

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年11月13日提出
【計算期間】	第16期(自 平成28年8月16日至 平成29年8月14日)
【ファンド名】	三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
信託金の限度額は、5,000億円です。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型	内外	不動産投信	ETF	特殊型 ()
		その他資産 ()		
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	年4回	北米				
一般	年6回	欧州			その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
公債	(隔月)	アジア				
社債	年12回	オセアニア			その他 ()	その他 ()
その他債券	(毎月)	中南米				
クレジット	日々	アフリカ				
属性 ()	その他 ()	中近東 (中東)				
不動産投信		エマージング				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)))						
資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源

泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われたいファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

内外の株式・債券を実質的な主要投資対象とし、各資産の指数を合成した指数をベンチマークとして、超過収益を積み上げることをめざします。

ファンドの特色

特色

1

主として、国内債券マザーファンド、国内株式マザーファンド、世界債券マザーファンドおよび世界株式マザーファンドへの投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ長期的に安定した収益の積上げをめざします。

特色

2

委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマーク^(注1)として、超過収益を積み上げることを図ります。

委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス^(注2)42%、東証株価指数(TOPIX)^(注3)30%、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)^(注4)10%、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)^(注5)15%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

(注1)ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

(注2)NOMURA-BPI総合インデックスとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

(注3)東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

(注4)シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、シティ世界国債インデックス(除く日本)をもとに、委託会社が計算したものです。

(注5)MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

また、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

特色3

国内債券、国内株式、外国債券、および外国株式に投資するそれぞれのマザーファンドを設定し、その運用にはベンチマークを定め、アクティブ運用により、これを上回る収益を追求します。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

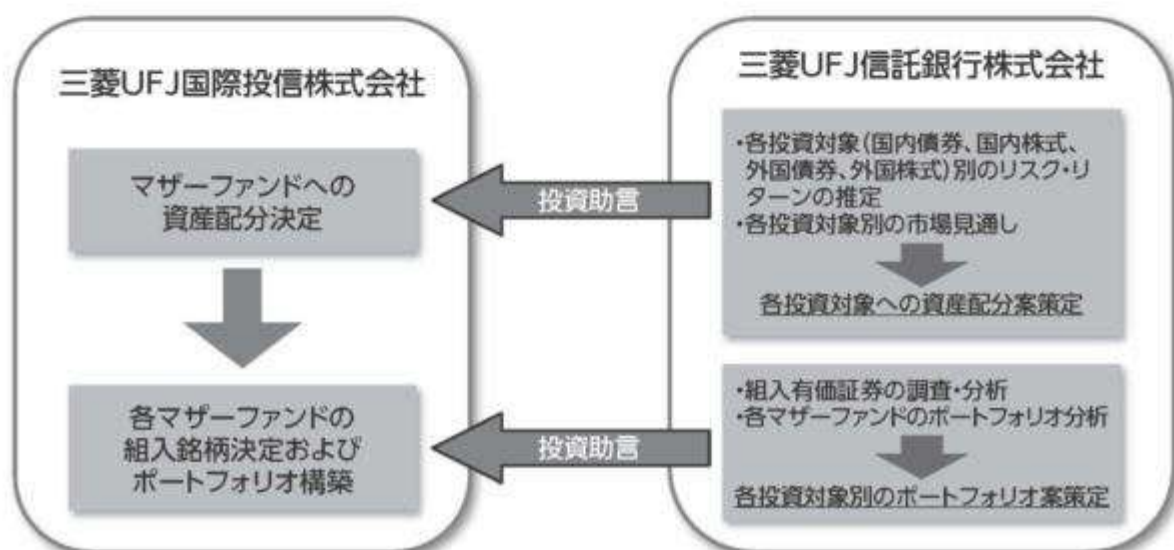
ファンド名	基本方針
国内債券マザーファンド	国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合インデックスを上回る投資成果をめざします。
国内株式マザーファンド	国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数(TOPIX)を上回る投資成果をめざします。
世界債券マザーファンド	外国の債券を主要投資対象とし、シティ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を上回る投資成果をめざします。
世界株式マザーファンド	外国の株式を主要投資対象とし、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイインデックス)(円換算ベース)を上回る投資成果をめざします。

実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。そのため、為替相場の変動による影響を受けます。

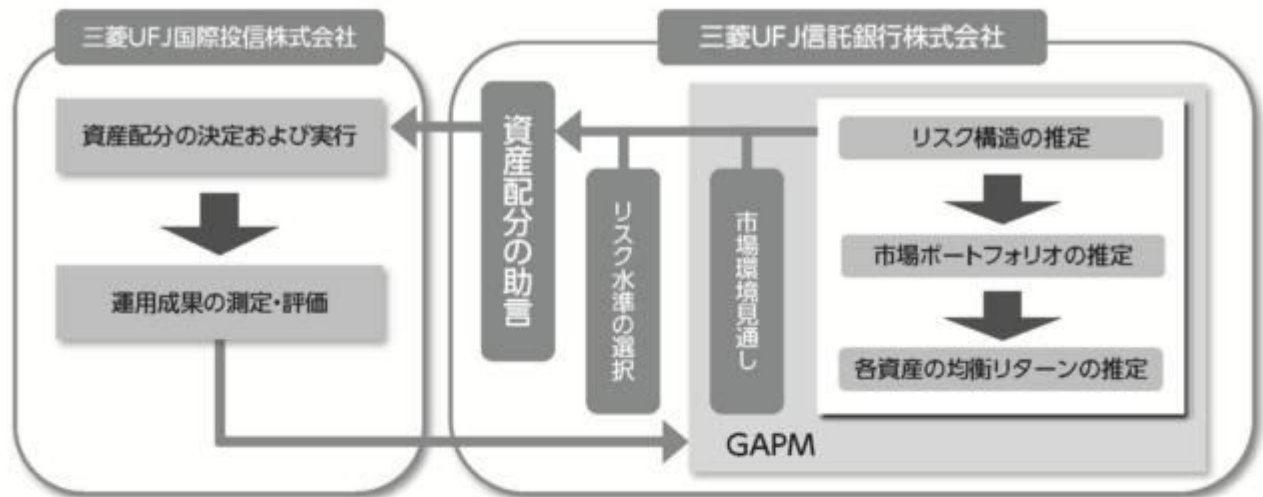
特色4

資産配分および各マザーファンドのポートフォリオ構築にあたりましては、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言を受けます。

※ 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。



ベビーファンドの資産配分助言のプロセス



GAPM

GAPM(Global Asset Pricing Model)とは、市場均衡理論にその基礎を置く資本資産評価モデル(CAPM=Capital Asset Pricing Model)をグローバルに展開した、リスク・リターンの推計モデルです。

☞ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

■ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、内外の株式・債券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%未満とします。
- ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%未満とします。
- ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- ・年1回の決算時(8月14日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- ・分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

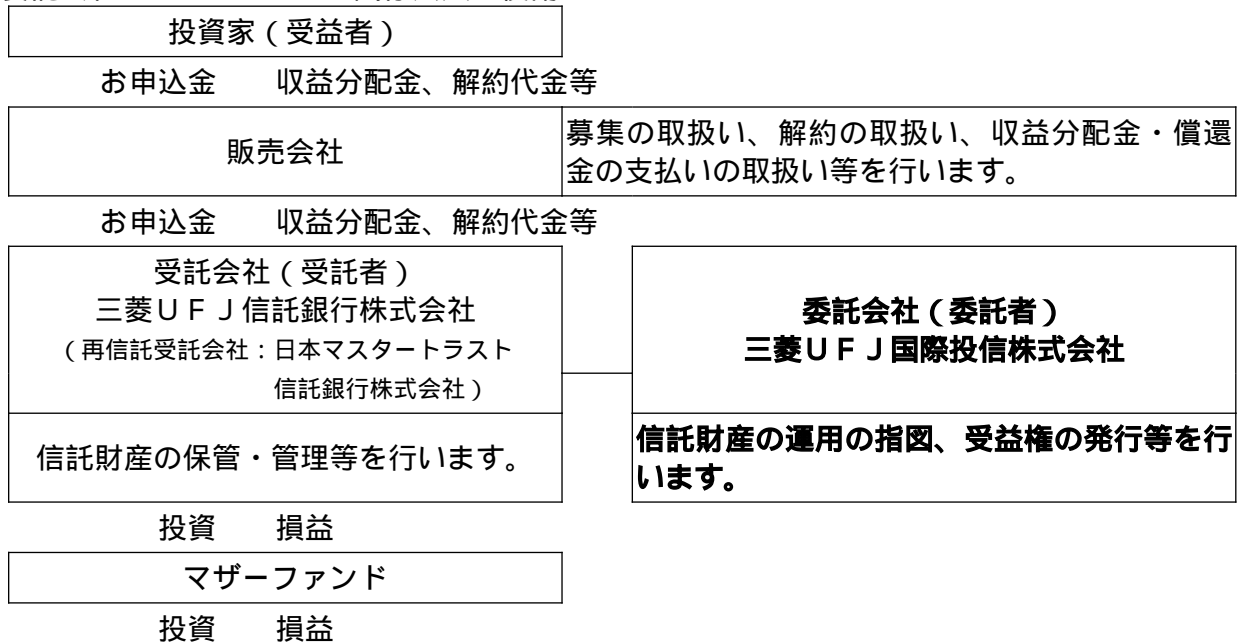
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成13年10月18日	設定日、信託契約締結、運用開始
平成17年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をユーエフジェイパートナーズ投信株式会社から三菱UFJ投信株式会社に承継 名称を「UFJパートナーズ<DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)」から「三菱UFJ<DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況（平成29年8月末現在）

- ・ 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・ 設立年月日
昭和60年8月1日
- ・ 資本金
2,000百万円
- ・ 沿革
平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・ 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

国内債券マザーファンド受益証券、国内株式マザーファンド受益証券、世界債券マザーファンド受益証券および世界株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか内外の株式・公社債に直接投資することがあります。

主として、国内債券マザーファンド受益証券、国内株式マザーファンド受益証券、世界債券マザーファンド受益証券および世界株式マザーファンド受益証券への投資を通して、国内債券・国内株式・外国債券・外国株式への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ長期的に安定した収益の積上げをめざします。

国内債券42%、国内株式30%、外国債券10%、外国株式15%および短期金融商品3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるアクティブ運用を行い、委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマークとして超過収益を積み上げることを図ります。

（注）委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA - BPI総合インデックス42%、東証株価指数（TOPIX）30%、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）10%、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイインデックス）（円換算

ベース)15%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

各資産につき、基本ポートフォリオにおける各資産毎の比率から±5%以内の範囲に配分比率の変動を抑えます。ただし、市況動向等に応じて、基本ポートフォリオは適宜見直しを行います。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただ

し、運用効率の向上を図るため、エクスポージャー^(注)のコントロールを行う場合があります。株式以外の資産への実質投資割合(信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合)は、原則として信託財産の総額の75%以下とします。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注)エクスポージャーとは、金融資産のうち市場の価格変動リスク・為替変動リスクにさらしている資産の度合いのことをいいます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。)

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする国内債券マザーファンド、国内株式マザーファンド、世界債券マザーファンド、世界株式マザーファンドおよび短期資産マザーファンド(「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

6. 資産の流動化に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)

および新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23. の有価証券の性質を有するもの

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

< マザーファンドの概要 >

国内債券マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の公社債を主要投資対象とします。

金利予測に基づき、デュレーション^(注)のリスクをベンチマーク（NOMURA - BPI総合インデックス）に対して限定的に取りつつ、残存期間構成・種別構成の変更を行うことにより、長期・安定的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. マクロ経済・市場環境等の分析に基づき、デュレーション・残存期間構成・種別構成等を決定します。

2. デュレーションについては、ベンチマーク比 $\pm 25\%$ 程度の範囲内で、コントロールします。
3. 残存期間構成については、ヒストリカルデータ分析とマクロ経済・市場環境等の分析における見通しから、割高割安を判定し決定します。
4. セクター配分は、ヒストリカルデータ分析に、信用リスク・流動性・投資家動向等の分析を加味して決定します。

金融債、事業債、円建外債への投資は、原則としてA格以上(S&P、ムーディーズ、格付投資情報センター、日本格付研究所の内の最高格付を採用)に限定しており、またセクター内においては一つの銘柄・業種に過度のウェイトをかけず、分散を図ります。

特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。

公社債組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(注)デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

(投資制限)

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

国内株式マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の金融商品取引所に上場されている株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。

企業のファンダメンタルズ分析を重視したボトムアップによる銘柄選択を主軸としつつ、トップダウンによるリスク・コントロール(業種配分・ファクター戦略)を付加することにより、長期・安定的にベンチマーク(東証株価指数(TOPIX))を上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. わが国の金融商品取引所上場銘柄および店頭登録銘柄を対象に成長性・安全性・流動性等を勘案した組入候補銘柄群を選定したうえで、利益成長性(業績モメンタム、中期成長性)、企業の定性評価(事業資質、経営資源、業界環境、企業戦略)、株価評価等を基準に組入銘柄・組入比率を決定し、ポートフォリオを構築します。
2. 構築されたポートフォリオについては、マクロ経済・金利・株式市場等の分析に基づくセクター配分、ファクター戦略を加味して、リスク・コントロールを図ります。

特定の銘柄や業種に対し、過度の集中がないように配慮します。

株式組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。
スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

世界債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

金利・為替予測に基づき、通貨別投資配分、デュレーション、残存期間構成のリスクをベンチマーク（シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））に対して限定的に取ることにより、長期・安定的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. 各国のマクロ環境分析、市場動向分析に基づき、通貨別国別投資配分・デュレーション・残存期間構成等を決定します。
2. 国別通貨別投資配分、デュレーションについては通貨ブロック（ドル圏、欧州圏）別のデュレーション調整後ウェイトをベンチマーク比±50%程度の範囲内とします。
3. 残存期間構成については、ヒストリカルデータ分析とマクロ経済・市況環境等の分析における見通しから、割高割安を判定し決定します。

原則としてA格以上（S&P、ムーディーズの内の最高格付を採用）の公社債等に限定しており、特定の銘柄に対し、過度の集中がないように配慮します。

公社債組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

外貨建資産については、原則としてヘッジは行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

世界株式マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

世界各国の経済動向、株式市場動向の分析を踏まえ北米・欧州・アジアの3地域の投資配分を決定し、その上でボトムアップによる銘柄選択を行います。リスク・コントロール（国別配分・ファクター分析・信用リスク）を付加することにより長期・安定的にベンチマーク（MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース））を上回る投資成果をめざします。

ポートフォリオ構築は以下のプロセスで行います。

1. MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）採用銘柄およびインデックス採用国の中で成長性に魅力があり信用リスク上問題の無い銘柄から約1,000銘柄を投資対象銘柄として選定します。
2. 政治・経済・金利・通貨動向等マクロの環境分析、株式市場分析に基づき北米・欧州・アジアの3地域の投資配分を決定します。
3. 投資対象銘柄群の中から、利益成長性（業績モメンタム、中期成長性）、企業の定性評価

(事業資質、経営資源、業界環境、企業戦略)、株価評価等を基準に組入銘柄・組入比率を決定します。

4. 上記により構築されたポートフォリオについては、国別ウエイト、ファクター分析、トラッキングエラー、投資対象国・投資対象銘柄制度による信用リスク等のチェックによりリスク・コントロールを図ります。

特定の銘柄や業種、国に対し、過度の集中がないように配慮します。

株式組入比率は原則として100%に近い水準を維持します。ただし、市場動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、エクスポージャーのコントロールを行う場合があります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。ただし、外国または外国の者の発行する株券等に限りません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

短期資産マザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、安定的な収益の確保を目標として運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の短期公社債および短期金融商品に投資し、利子等収益の確保を図ります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

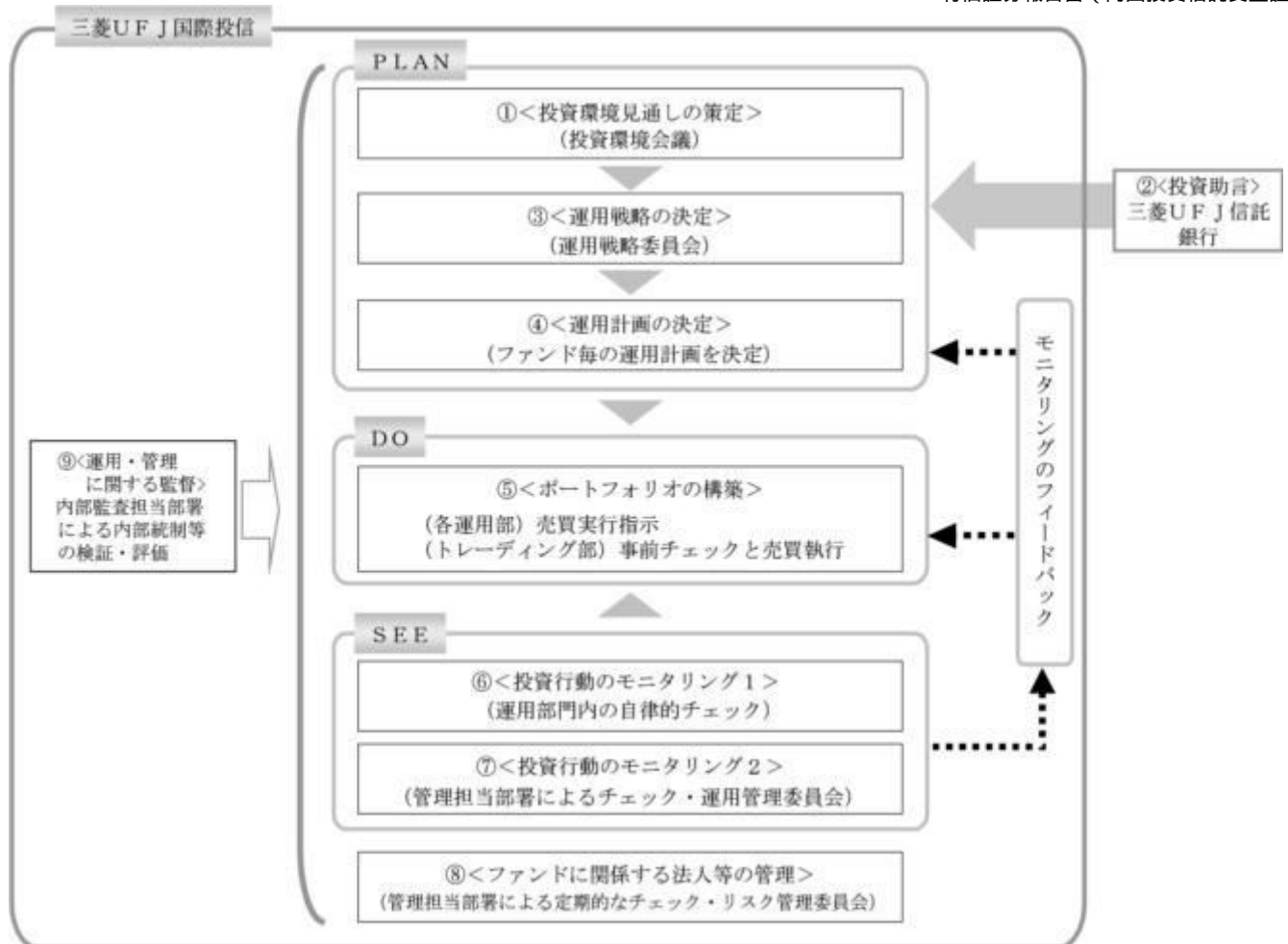
外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

(3)【運用体制】



投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通し、およびの投資助言に沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関係する法人等の管理

助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示

されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a．委託会社は、信託財産に属する株式（株式を組入可能な投資信託証券、新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。以下において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の60以上となる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

外貨建資産

a．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（外貨建資産を組入可能な投資信託証券を含みます。以下において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の40以上となる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の40以上となった場合には、速やかにこれを調整します。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

新株引受権証券および新株予約権証券

a．委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。以下

同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

- a. 委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. c. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を

次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

< その他法令等に定められた投資制限 >

- ・ 同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けませんが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や

公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署であるトレーディング担当部署およびリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

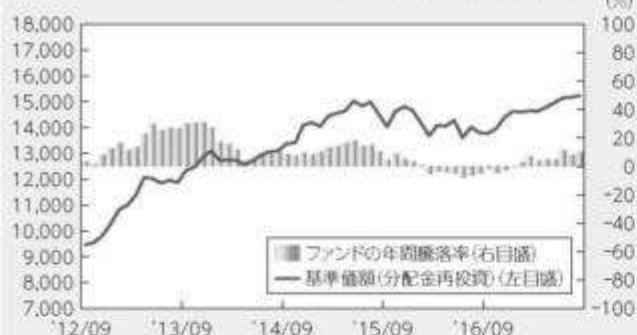
* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

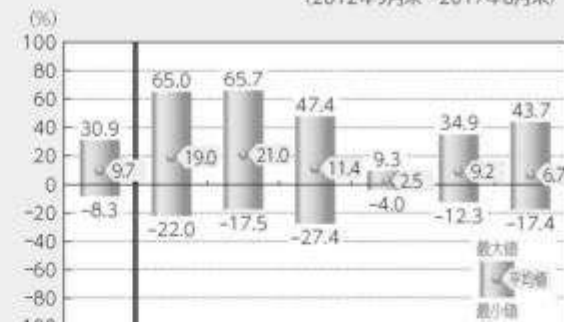
● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

(2012年9月末～2017年8月末)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2012年9月末～2017年8月末)



注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.512%（税抜1.4%）の率を乗じて得た額とします。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × （保有日数 / 365）
 上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.71%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.61%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.08%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成29年8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)】

(1)【投資状況】

平成29年8月31日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	335,025,436	98.93
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,625,623	1.07
純資産総額		338,651,059	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成29年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	国内債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		100,901,192	1.4036	141,625,722		41.95
					1.4079	142,058,788		
日本	国内株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		107,602,475	0.9606	103,365,121		31.05
					0.9771	105,138,378		
日本	世界株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		22,927,075	2.2471	51,520,139		15.54
					2.2958	52,635,978		
日本	世界債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		13,914,397	2.4966	34,739,929		10.39
					2.5292	35,192,292		

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成29年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.93
合計	98.93

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成29年8月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第7計算期間末日 (平成20年 8月14日)	129,954,491 (分配付) 129,954,491 (分配落)	11,630 (分配付) 11,630 (分配落)
第8計算期間末日 (平成21年 8月14日)	134,709,029 (分配付) 134,709,029 (分配落)	10,208 (分配付) 10,208 (分配落)
第9計算期間末日 (平成22年 8月16日)	145,501,615 (分配付) 145,501,615 (分配落)	9,627 (分配付) 9,627 (分配落)
第10計算期間末日 (平成23年 8月15日)	153,825,202 (分配付) 153,825,202 (分配落)	9,382 (分配付) 9,382 (分配落)
第11計算期間末日 (平成24年 8月14日)	168,533,594 (分配付) 168,533,594 (分配落)	9,442 (分配付) 9,442 (分配落)
第12計算期間末日 (平成25年 8月14日)	226,940,159 (分配付) 226,940,159 (分配落)	12,129 (分配付) 12,129 (分配落)
第13計算期間末日 (平成26年 8月14日)	269,690,903 (分配付) 269,690,903 (分配落)	12,991 (分配付) 12,991 (分配落)
第14計算期間末日 (平成27年 8月14日)	320,138,312 (分配付) 320,138,312 (分配落)	15,065 (分配付) 15,065 (分配落)
第15計算期間末日 (平成28年 8月15日)	290,927,508 (分配付) 290,927,508 (分配落)	13,809 (分配付) 13,809 (分配落)
第16計算期間末日 (平成29年 8月14日)	335,494,876 (分配付) 335,494,876 (分配落)	15,083 (分配付) 15,083 (分配落)
平成28年 8月末日	291,649,299	13,803
9月末日	292,315,161	13,772
10月末日	297,372,408	13,958
11月末日	311,047,840	14,395
12月末日	313,377,693	14,627
平成29年 1月末日	314,483,477	14,605
2月末日	315,872,710	14,646
3月末日	317,366,639	14,635
4月末日	321,051,885	14,797
5月末日	328,795,983	14,973
6月末日	330,195,453	15,150
7月末日	336,346,423	15,179
8月末日	338,651,059	15,242

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第7計算期間	10.52
第8計算期間	12.22
第9計算期間	5.69
第10計算期間	2.54
第11計算期間	0.63
第12計算期間	28.45

第13計算期間	7.10
第14計算期間	15.96
第15計算期間	8.33
第16計算期間	9.22

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第7計算期間	22,812,870	16,943,300	111,738,146
第8計算期間	30,380,456	10,158,258	131,960,344
第9計算期間	25,789,677	6,616,231	151,133,790
第10計算期間	24,056,196	11,229,991	163,959,995
第11計算期間	22,310,000	7,779,322	178,490,673
第12計算期間	23,378,535	14,756,391	187,112,817
第13計算期間	38,252,620	17,762,426	207,603,011
第14計算期間	52,174,909	47,268,060	212,509,860
第15計算期間	23,663,739	25,489,255	210,684,344
第16計算期間	29,115,961	17,371,979	222,428,326

< 参考 >

「国内債券マザーファンド」

（１）投資状況

平成29年8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	2,324,591,996	83.40
特殊債券	日本	405,004,000	14.53
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		57,819,474	2.07
純資産総額		2,787,415,470	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第129回利付国債(5年)	国債証券		274,400	100.70	276,323,544	0.100000	9.94
					101.0170	277,190,648	2021/09/20	
日本	第150回利付国債(20年)	国債証券		203,000	116.11	235,705,330	1.400000	8.51
					116.7940	237,091,820	2034/09/20	
日本	第132回利付国債(5年)	国債証券		213,000	100.78	214,661,400	0.100000	7.73
					101.1820	215,517,660	2022/06/20	
日本	第126回利付国債(5年)	国債証券		198,500	100.65	199,797,295	0.100000	7.18
					100.8440	200,175,340	2020/12/20	
日本	第124回利付国債(5年)	国債証券		143,200	100.54	143,973,280	0.100000	5.17
					100.7290	144,243,928	2020/06/20	
日本	第153回利付国債(20年)	国債証券		124,000	114.24	141,660,080	1.300000	5.11
					114.9480	142,535,520	2035/06/20	
日本	第128回利付国債(5年)	国債証券		132,500	100.65	133,371,850	0.100000	4.80
					100.9530	133,762,725	2021/06/20	
日本	第140回利付国債(20年)	国債証券		88,500	120.41	106,569,045	1.700000	3.85
					121.1980	107,260,230	2032/09/20	
日本	第61回地方公共団体金融機構 債券(財投機関債)	特殊債券		100,000	103.68	103,686,000	0.690000	3.74
					104.2110	104,211,000	2024/06/28	
日本	第28回中日本高速道路	特殊債券		100,000	100.47	100,479,000	0.782000	3.60
					100.4080	100,408,000	2018/03/20	
日本	第85回鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券(財投機関債)	特殊債券		100,000	100.24	100,248,000	0.080000	3.60
					100.2670	100,267,000	2021/03/19	
日本	第73回都市再生債券(財投機 関債)	特殊債券		100,000	100.14	100,144,000	0.239000	3.59
					100.1180	100,118,000	2018/03/20	

日本	第341回利付国債（10年）	国債証券	82,500	102.33 102.9140	84,422,250 84,904,050	0.300000 2025/12/20	3.05
日本	第119回利付国債（20年）	国債証券	68,000	120.36 120.9360	81,848,880 82,236,480	1.800000 2030/06/20	2.95
日本	第110回利付国債（20年）	国債証券	64,000	122.53 123.1670	78,421,120 78,826,880	2.100000 2029/03/20	2.83
日本	第159回利付国債（20年）	国債証券	75,000	100.87 101.5800	75,656,250 76,185,000	0.600000 2036/12/20	2.73
日本	第157回利付国債（20年）	国債証券	64,500	94.17 94.8460	60,745,455 61,175,670	0.200000 2036/06/20	2.19
日本	第28回利付国債（30年）	国債証券	40,000	136.47 137.2530	54,591,200 54,901,200	2.500000 2038/03/20	1.97
日本	第127回利付国債（5年）	国債証券	45,000	100.63 100.9070	45,284,850 45,408,150	0.100000 2021/03/20	1.63
日本	第50回利付国債（30年）	国債証券	43,000	98.96 100.2320	42,554,090 43,099,760	0.800000 2046/03/20	1.55
日本	第129回利付国債（20年）	国債証券	35,000	121.17 121.8010	42,410,550 42,630,350	1.800000 2031/06/20	1.53
日本	第35回利付国債（30年）	国債証券	30,000	128.27 129.1460	38,483,100 38,743,800	2.000000 2041/09/20	1.39
日本	第124回利付国債（20年）	国債証券	31,000	123.42 124.0300	38,262,990 38,449,300	2.000000 2030/12/20	1.38
日本	第343回利付国債（10年）	国債証券	32,000	100.57 101.1450	32,183,680 32,366,400	0.100000 2026/06/20	1.16
日本	第46回利付国債（30年）	国債証券	24,000	116.88 118.1980	28,053,120 28,367,520	1.500000 2045/03/20	1.02
日本	第88回利付国債（20年）	国債証券	23,500	120.01 120.5390	28,202,820 28,326,665	2.300000 2026/06/20	1.02
日本	第161回利付国債（20年）	国債証券	25,000	100.44 101.1630	25,111,250 25,290,750	0.600000 2037/06/20	0.91
日本	第158回利付国債（20年）	国債証券	24,000	99.30 100.0000	23,833,440 24,000,000	0.500000 2036/09/20	0.86
日本	第131回利付国債（5年）	国債証券	17,000	100.73 101.1880	17,125,630 17,201,960	0.100000 2022/03/20	0.62
日本	第8回利付国債（40年）	国債証券	15,000	111.69 113.2350	16,754,250 16,985,250	1.400000 2055/03/20	0.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	83.40
特殊債券	14.53
合計	97.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「国内株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成29年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,904,526,290	97.93
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		40,342,425	2.07
純資産総額		1,944,868,715	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年8月31日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額		利率 (%)	投資比率 (%)
					下段：評価額	償還期限 (年/月/日)		
					単価 (円)	金額 (円)		

日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	105,000	713.40 674.10	74,907,000 70,780,500	3.64
日本	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	7,000	9,023.00 8,922.00	63,161,000 62,454,000	3.21
日本	ダイフク	株式	機械	10,100	3,990.00 4,785.00	40,299,000 48,328,500	2.48
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	8,100	5,450.00 5,468.00	44,145,000 44,290,800	2.28
日本	大成建設	株式	建設業	40,000	1,102.00 1,103.00	44,080,000 44,120,000	2.27
日本	住友ベークライト	株式	化学	54,000	862.00 809.00	46,548,000 43,686,000	2.25
日本	塩野義製薬	株式	医薬品	7,400	5,865.00 5,795.00	43,401,000 42,883,000	2.20
日本	花王	株式	化学	6,200	6,722.00 6,862.00	41,676,400 42,544,400	2.19
日本	三菱ケミカルホールディングス	株式	化学	40,400	953.70 1,023.00	38,529,480 41,329,200	2.13
日本	ソニー	株式	電気機器	9,300	4,410.00 4,337.00	41,013,000 40,334,100	2.07
日本	S M C	株式	機械	1,000	36,000.00 37,710.00	36,000,000 37,710,000	1.94
日本	東ソー	株式	化学	29,000	1,184.00 1,290.00	34,336,000 37,410,000	1.92
日本	三菱電機	株式	電気機器	22,700	1,740.50 1,627.00	39,509,350 36,932,900	1.90
日本	ヤマハ発動機	株式	輸送用機器	11,500	2,956.94 3,110.00	34,004,891 35,765,000	1.84
日本	積水化学工業	株式	化学	17,300	2,117.00 2,050.00	36,624,100 35,465,000	1.82
日本	アサヒグループホールディングス	株式	食料品	6,700	4,653.00 4,789.00	31,175,100 32,086,300	1.65
日本	エヌ・ティ・ティ・データ	株式	情報・通信業	26,800	1,210.00 1,188.00	32,428,000 31,838,400	1.64
日本	日本M & Aセンター	株式	サービス業	5,900	4,692.68 5,090.00	27,686,814 30,031,000	1.54
日本	積水ハウス	株式	建設業	15,600	1,915.50 1,904.00	29,881,800 29,702,400	1.53
日本	ディスコ	株式	機械	1,500	19,170.00 19,710.00	28,755,000 29,565,000	1.52
日本	オリックス	株式	その他金融業	16,400	1,841.50 1,759.50	30,200,600 28,855,800	1.48
日本	日本電産	株式	電気機器	2,300	12,780.00 12,460.00	29,394,000 28,658,000	1.47
日本	アルバック	株式	電気機器	4,700	5,822.98 6,050.00	27,368,008 28,435,000	1.46
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	6,900	4,265.00 4,114.00	29,428,500 28,386,600	1.46
日本	ニチアス	株式	ガラス・土石製品	22,000	1,372.00 1,288.00	30,184,000 28,336,000	1.46
日本	富士通	株式	電気機器	34,000	832.80 815.10	28,315,200 27,713,400	1.42
日本	ヤマハ	株式	その他製品	7,200	3,875.57 3,830.00	27,904,124 27,576,000	1.42
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	6,200	4,712.00 4,390.00	29,214,400 27,218,000	1.40
日本	住友電気工業	株式	非鉄金属	15,700	1,754.00 1,722.00	27,537,800 27,035,400	1.39
日本	朝日インテック	株式	精密機器	4,600	5,070.00 5,760.00	23,322,000 26,496,000	1.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
鉱業	0.41
建設業	3.80
食料品	2.81
繊維製品	1.02
化学	11.59
医薬品	3.35
石油・石炭製品	1.08
ゴム製品	0.87
ガラス・土石製品	2.85
鉄鋼	0.92
非鉄金属	2.62
金属製品	0.76
機械	9.14
電気機器	13.03
輸送用機器	7.14

精密機器	1.36
その他製品	3.31
電気・ガス業	0.85
陸運業	0.95
情報・通信業	7.91
卸売業	2.60
小売業	3.85
銀行業	6.31
証券、商品先物取引業	0.55
保険業	2.62
その他金融業	1.48
不動産業	2.65
サービス業	2.10
合計	97.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「世界債券マザーファンド」

（１）投資状況

平成29年8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	261,204,362	42.10
	フランス	98,142,856	15.82
	アイルランド	45,505,685	7.33
	イギリス	41,243,262	6.65
	ドイツ	40,288,636	6.49
	ベルギー	31,344,576	5.05
	オーストラリア	13,328,732	2.15
	オランダ	12,715,909	2.05
	カナダ	12,712,759	2.05
	オーストリア	11,316,170	1.82
	フィンランド	7,826,337	1.26
	メキシコ	5,212,450	0.84
	ポーランド	4,095,214	0.66
	デンマーク	3,723,267	0.60
	スウェーデン	2,917,563	0.47
	シンガポール	2,440,962	0.39
	マレーシア	2,207,477	0.36
ノルウェー	1,838,520	0.30	
スイス	1,154,498	0.19	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		21,284,050	3.42
純資産総額		620,503,285	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	3.75 T-NOTE 181115	国債証券		471,000.00	11,380.59 11,368.5153	53,602,590 53,545,706	3.750000 2018/11/15	8.63
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券		389,000.00	11,806.31 11,818.3906	45,926,558 45,973,539	3.625000 2021/02/15	7.41

アメリカ	1.75 T-NOTE 230131	国債証券	336,000.00	10,948.83 11,013.5323	36,788,079 37,005,468	1.750000 2023/01/31	5.96
アメリカ	4.375 T-BOND 380215	国債証券	235,000.00	14,073.37 14,322.6817	33,072,427 33,658,301	4.375000 2038/02/15	5.42
フランス	0.5 O.A.T 250525	国債証券	211,000.00	13,223.13 13,314.0408	27,900,825 28,092,625	0.500000 2025/05/25	4.53
アメリカ	2.75 T-BOND 420815	国債証券	245,000.00	10,934.16 11,147.2440	26,788,710 27,310,747	2.750000 2042/08/15	4.40
フランス	5.5 O.A.T 290425	国債証券	105,000.00	19,887.40 19,981.3714	20,881,779 20,980,439	5.500000 2029/04/25	3.38
アイルランド	4.5 IRISH GOVT 181018	国債証券	140,000.00	13,923.61 13,875.6507	19,493,062 19,425,910	4.500000 2018/10/18	3.13
ベルギー	4.25 BEL GOVT 220928	国債証券	114,000.00	16,107.18 16,144.8906	18,362,188 18,405,174	4.250000 2022/09/28	2.97
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券	160,000.00	11,018.81 11,114.4631	17,630,098 17,783,141	2.125000 2025/05/15	2.87
フランス	4 O.A.T 550425	国債証券	84,000.00	20,937.76 21,070.9287	17,587,721 17,699,579	4.000000 2055/04/25	2.85
アイルランド	2 IRISH GOVT 450218	国債証券	104,000.00	13,622.84 13,763.2499	14,167,761 14,313,779	2.000000 2045/02/18	2.31
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券	126,000.00	11,249.89 11,340.4790	14,174,872 14,289,002	2.375000 2024/08/15	2.30
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券	93,000.00	15,159.91 15,157.9494	14,098,725 14,096,892	3.750000 2021/04/25	2.27
アメリカ	1.875 T-NOTE 200630	国債証券	122,000.00	11,162.33 11,182.6129	13,618,054 13,642,787	1.875000 2020/06/30	2.20
フランス	1 O.A.T 181125	国債証券	100,000.00	13,404.35 13,393.2914	13,404,350 13,393,291	1.000000 2018/11/25	2.16
ベルギー	3.75 BEL GOVT 200928	国債証券	87,000.00	14,883.99 14,872.8759	12,949,078 12,939,401	3.750000 2020/09/28	2.09
イギリス	4.25 GILT 360307	国債証券	63,000.00	20,046.25 20,328.2331	12,629,140 12,806,785	4.250000 2036/03/07	2.06
オランダ	2.25 NETH GOVT 220715	国債証券	86,000.00	14,744.81 14,785.9419	12,680,544 12,715,909	2.250000 2022/07/15	2.05
カナダ	2.5 CAN GOVT 240601	国債証券	138,000.00	9,177.96 9,212.1447	12,665,589 12,712,759	2.500000 2024/06/01	2.05
ドイツ	1.5 BUND 240515	国債証券	83,000.00	14,484.06 14,588.5773	12,021,777 12,108,518	1.500000 2024/05/15	1.95
アイルランド	2.4 IRISH GOVT 300515	国債証券	78,000.00	15,000.81 15,084.6091	11,700,634 11,765,994	2.400000 2030/05/15	1.90
ドイツ	4.25 BUND 390704	国債証券	53,000.00	21,447.82 21,807.3258	11,367,345 11,557,881	4.250000 2039/07/04	1.86
オーストリア	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	国債証券	80,000.00	14,178.79 14,145.2129	11,343,037 11,316,170	4.350000 2019/03/15	1.82
オーストラリア	3.25 AUST GOVT 250421	国債証券	122,000.00	9,234.66 9,189.0011	11,266,293 11,210,580	3.250000 2025/04/21	1.81
イギリス	4.25 GILT 551207	国債証券	43,000.00	24,502.24 25,105.5875	10,535,966 10,795,401	4.250000 2055/12/07	1.74
アメリカ	1.25 T-NOTE 191031	国債証券	97,000.00	11,009.21 11,020.0022	10,678,942 10,689,401	1.250000 2019/10/31	1.72
イギリス	3.75 GILT 200907	国債証券	57,000.00	15,799.09 15,803.1226	9,005,486 9,007,779	3.750000 2020/09/07	1.45
ドイツ	2.25 BUND 210904	国債証券	61,000.00	14,589.37 14,623.8684	8,899,520 8,920,558	2.250000 2021/09/04	1.44
フィンランド	0.375 FINNISH GOV 200915	国債証券	58,000.00	13,471.54 13,493.6877	7,813,495 7,826,337	0.375000 2020/09/15	1.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	96.57
合計	96.57

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「世界株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成29年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	737,629,761	70.28
	イギリス	72,764,528	6.93
	スウェーデン	68,104,145	6.49
	オーストラリア	31,612,190	3.01
	デンマーク	20,880,768	1.99
	香港	18,960,397	1.81
	スイス	17,792,128	1.70
	ドイツ	16,855,488	1.61
	オランダ	13,039,573	1.24
	フランス	11,598,380	1.11
	ベルギー	7,339,027	0.70
	フィンランド	7,014,449	0.67
	スペイン	4,568,652	0.44
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		21,349,298	2.02
純資産総額		1,049,508,784	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	386	109,048.58 106,841.28	42,092,753 41,240,737		3.93
アメリカ	FIRST REPUBLIC BANK/CA	株式	銀行	3,062	11,215.35 10,717.36	34,341,430 32,816,572		3.13
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	1,570	18,729.44 18,762.56	29,405,221 29,457,229		2.81
アメリカ	ILLUMINA INC	株式	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	1,045	21,473.37 22,055.29	22,439,679 23,047,778		2.20
アメリカ	MASTERCARD INC - A	株式	ソフトウェア・ サービス	1,496	14,379.99 14,774.19	21,513,380 22,102,197		2.11
アメリカ	GRUBHUB INC	株式	ソフトウェア・ サービス	3,253	5,810.30 6,215.54	18,900,907 20,219,157		1.93
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・ サービス	191	102,465.34 102,643.11	19,570,880 19,604,835		1.87
アメリカ	TD AMERITRADE HOLDING CORP	株式	各種金融	3,959	5,000.92 4,751.37	19,798,649 18,810,684		1.79
アメリカ	MARKETAXESS HOLDINGS INC	株式	各種金融	834	22,747.62 21,134.38	18,971,518 17,626,079		1.68
アメリカ	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	株式	家庭用品・パーソ ナル用品	1,509	11,212.04 11,666.97	16,919,723 17,605,468		1.68
アメリカ	TESLA INC	株式	自動車・自動車部 品	443	39,410.00 38,998.13	17,458,630 17,276,174		1.65
アメリカ	ABIOMED INC	株式	ヘルスケア機器・ サービス	970	16,674.52 16,284.74	16,174,288 15,796,199		1.51
アメリカ	EOG RESOURCES INC	株式	エネルギー	1,664	9,680.52 9,238.84	16,109,286 15,373,432		1.46
アメリカ	MARKEL CORP	株式	保険	131	116,848.65 115,073.09	15,307,173 15,074,575		1.44
アメリカ	MARTIN MARIETTA MATERIALS	株式	素材	626	23,676.25 23,607.79	14,821,336 14,778,480		1.41
アメリカ	GOLDMAN SACHS GROUP INC	株式	各種金融	593	25,373.41 24,559.61	15,046,433 14,563,852		1.39
アメリカ	WATERS CORP	株式	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	707	19,638.19 19,992.64	13,884,205 14,134,800		1.35
アメリカ	CELGENE CORP	株式	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	930	14,695.79 14,833.82	13,668,006 13,795,455		1.31
アメリカ	AMERICAN EXPRESS CO	株式	各種金融	1,418	9,492.80 9,461.88	13,460,800 13,416,959		1.28
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・ サービス	127	104,434.13 104,195.62	13,263,134 13,232,844		1.26
アメリカ	NETFLIX INC	株式	小売	683	19,905.41 19,289.26	13,595,397 13,174,571		1.26
アメリカ	TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	株式	ソフトウェア・ サービス	1,630	7,874.05 7,950.24	12,834,701 12,958,891		1.23

スウェーデン	ATLAS COPCO AB-A SHS	株式	資本財	3,032	4,125.91 4,225.63	12,509,774 12,812,125		1.22
アメリカ	WATSCO INC	株式	資本財	796	16,783.84 16,083.77	13,359,936 12,802,686		1.22
アメリカ	WAYFAIR INC- CLASS A	株式	小売	1,647	8,873.35 7,705.10	14,614,409 12,690,312		1.21
スウェーデン	INVESTOR AB-B SHS	株式	各種金融	2,460	5,398.73 5,078.79	13,280,875 12,493,835		1.19
スウェーデン	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	株式	銀行	7,622	1,682.77 1,630.14	12,826,111 12,424,965		1.18
アメリカ	M & T BANK CORP	株式	銀行	723	18,062.50 16,484.60	13,059,190 11,918,367		1.14
アメリカ	INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	株式	各種金融	2,516	4,476.42 4,603.40	11,262,689 11,582,179		1.10
アメリカ	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	651	17,064.30 17,257.54	11,108,863 11,234,659		1.07

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年8月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
エネルギー	2.10
素材	4.82
資本財	12.06
商業・専門サービス	2.97
運輸	1.72
自動車・自動車部品	1.85
耐久消費財・アパレル	2.25
消費者サービス	0.68
小売	10.25
食品・生活必需品小売り	0.65
食品・飲料・タバコ	2.92
家庭用品・パーソナル用品	2.28
ヘルスケア機器・サービス	3.18
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.27
銀行	6.49
各種金融	12.34
保険	3.23
ソフトウェア・サービス	16.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.09
半導体・半導体製造装置	1.66
合計	97.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

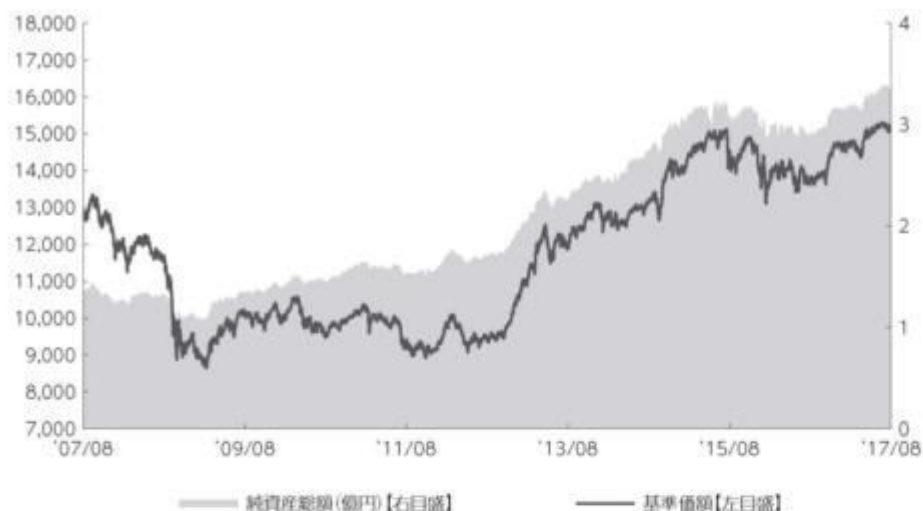
参考情報



運用実績

2017年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2007年8月31日～2017年8月31日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	15,242円
純資産総額	3.3億円

■分配の推移

2017年 8月	0円
2016年 8月	0円
2015年 8月	0円
2014年 8月	0円
2013年 8月	0円
2012年 8月	0円
設定来累計	0円

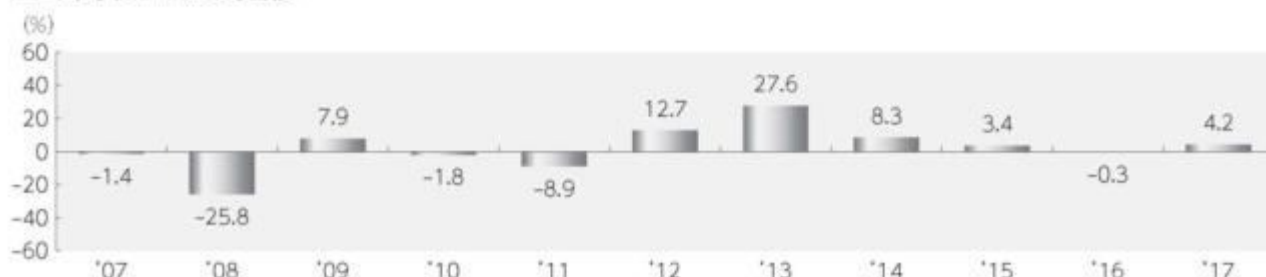
●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	30.4%	円	74.4%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	1.1%
国内債券	41.1%	アメリカドル	15.4%	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	日本	1.0%
外国株式	15.2%	ユーロ	5.1%	ダイフク	株式	機械	日本	0.8%
外国債券	10.0%	イギリスポンド	1.8%	日本電信電話	株式	情報・通信業	日本	0.7%
		スウェーデンクローネ	1.1%	大成建設	株式	建設業	日本	0.7%
		オーストラリアドル	0.7%	第129回利付国債(5年)	債券	国債	日本	4.2%
		デンマーククローネ	0.4%	第150回利付国債(20年)	債券	国債	日本	3.6%
		スイスフラン	0.3%	第132回利付国債(5年)	債券	国債	日本	3.2%
コールローン他 (負債控除後)	3.3%	その他	0.8%	第126回利付国債(5年)	債券	国債	日本	3.0%
合計	100.0%	合計	100.0%	第124回利付国債(5年)	債券	国債	日本	2.2%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は年初から8月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

1円以上1円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込価額の照会方法

申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

解約単位

1口単位

解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額
ありません。

解約価額の算出頻度
原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法
解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。
なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社
お客様専用フリーダイヤル 0120-151034
（受付時間：営業日の9:00～17:00）
ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

支払開始日
解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間
解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し
委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとし、また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・ 転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・ 公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・ マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・ 投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・ 外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・ 外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・ 市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限（平成13年10月18日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（4）【計算期間】

毎年8月15日から翌年8月14日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承

継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

収益分配金は、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日以内)から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成28年8月16日から平成29年8月14日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 [平成28年 8月15日現在]	第16期 [平成29年 8月14日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,284,969	6,471,949
親投資信託受益証券	287,677,571	331,454,074
流動資産合計	293,962,540	337,926,023
資産合計	293,962,540	337,926,023
負債の部		
流動負債		
未払解約金	809,834	-
未払受託者報酬	126,828	138,575
未払委託者報酬	2,092,727	2,286,401
未払利息	7	7
その他未払費用	5,636	6,164
流動負債合計	3,035,032	2,431,147
負債合計	3,035,032	2,431,147
純資産の部		
元本等		
元本	210,684,344	222,428,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	80,243,164	113,066,550
（分配準備積立金）	61,203,189	60,220,234
元本等合計	290,927,508	335,494,876
純資産合計	290,927,508	335,494,876
負債純資産合計	293,962,540	337,926,023

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成27年 8月15日 至 平成28年 8月15日	自	平成28年 8月16日 至 平成29年 8月14日
営業収益				
受取利息		1,483		47
有価証券売買等損益		21,948,088		32,176,503
営業収益合計		21,946,605		32,176,550
営業費用				
支払利息		863		2,249
受託者報酬		260,603		270,662
委託者報酬		4,299,868		4,465,671
その他費用		11,596		12,046
営業費用合計		4,572,930		4,750,628
営業利益又は営業損失（ ）		26,519,535		27,425,922
経常利益又は経常損失（ ）		26,519,535		27,425,922
当期純利益又は当期純損失（ ）		26,519,535		27,425,922
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,018,379		1,536,763
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		107,628,452		80,243,164
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,916,784		13,611,823
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,916,784		13,611,823
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,800,916		6,677,596
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,800,916		6,677,596
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		80,243,164		113,066,550

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年8月14日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成28年8月16日から平成29年8月14日までとなっております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	

（貸借対照表に関する注記）

	第 15 期 [平成28年8月15日現在]	第 16 期 [平成29年8月14日現在]
1 期首元本額	212,509,860円	210,684,344円
期中追加設定元本額	23,663,739円	29,115,961円
期中一部解約元本額	25,489,255円	17,371,979円
2 受益権の総数	210,684,344口	222,428,326口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3809円 (13,809円)	1.5083円 (15,083円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 15 期（自平成27年8月15日 至 平成28年8月15日）

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	66,564,962円
分配準備積立金額	D	61,203,189円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	127,768,151円
当ファンドの期末残存口数	F	210,684,344口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,064円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第 16 期（自平成28年8月16日 至 平成29年8月14日）

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	3,741,348円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	78,461,501円
分配準備積立金額	D	56,478,886円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	138,681,735円
当ファンドの期末残存口数	F	222,428,326口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,234円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期 (自平成27年 8月15日 至 平成28年 8月15日)	第 16 期 (自平成28年 8月16日 至 平成29年 8月14日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同 左 同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左
	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 15 期 [平成28年8月15日現在]	第 16 期 [平成29年8月14日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 15 期 [平成28年8月15日現在]	第 16 期 [平成29年8月14日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	17,802,471	26,575,994
合計	17,802,471	26,575,994

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	100,616,098	141,234,816	
	国内株式マザーファンド	107,189,176	102,965,922	
	世界債券マザーファンド	14,195,592	35,440,714	
	世界株式マザーファンド	23,058,577	51,812,622	
	親投資信託受益証券 小計	245,059,443	331,454,074	
	合計	245,059,443	331,454,074	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

「国内債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	167,804,475	53,324,168
国債証券	2,246,995,851	2,316,216,655
特殊債券	306,304,000	304,381,000
社債券	103,292,000	100,108,000
未収利息	6,544,839	6,777,695
前払費用	113,692	61,521
流動資産合計	2,831,054,857	2,780,869,039
資産合計	2,831,054,857	2,780,869,039
負債の部		
流動負債		
未払金	149,749,975	
未払利息	207	62
流動負債合計	149,750,182	62
負債合計	149,750,182	62
純資産の部		
元本等		
元本	1,877,928,294	1,981,153,090
剰余金		
剰余金又は欠損金()	803,376,381	799,715,887
元本等合計	2,681,304,675	2,780,868,977
純資産合計	2,681,304,675	2,780,868,977
負債純資産合計	2,831,054,857	2,780,869,039

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 期首	平成27年8月15日	平成28年8月16日
期首元本額	2,014,823,370円	1,877,928,294円
期首からの追加設定元本額	554,845,030円	709,796,365円
期首からの一部解約元本額	691,740,106円	606,571,569円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	395,381,257円	390,731,642円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	220,346,758円	227,829,315円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	145,721,320円	156,359,411円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	143,251,418円	149,047,595円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	129,472,136円	117,572,402円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	218,668,562円	244,915,355円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	154,086,388円	174,966,297円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	71,983,421円	80,277,455円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	86,357,755円	100,616,098円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	38,864,238円	45,006,784円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	33,152,694円	40,220,485円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2020	74,189,557円	63,239,553円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2030	96,846,876円	109,522,210円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーファンド 2040	69,605,914円	80,848,488円
(合計)	1,877,928,294円	1,981,153,090円

2 受益権の総数	1,877,928,294口	1,981,153,090口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4278円 (14,278円)	1.4037円 (14,037円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	(自平成27年8月15日 至平成28年8月15日)	(自平成28年8月16日 至平成29年8月14日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	10,190,028	4,219,766
特殊債券	157,000	72,000
社債券	68,000	58,000
合計	10,279,028	4,233,766

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種 類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備 考
国債証券	第124回利付国債(5年)	143,200,000	144,016,240	
	第126回利付国債(5年)	156,500,000	157,523,510	
	第127回利付国債(5年)	45,000,000	45,307,800	
	第128回利付国債(5年)	132,500,000	133,444,725	
	第129回利付国債(5年)	274,400,000	276,485,440	
	第131回利付国債(5年)	17,000,000	17,140,930	
	第132回利付国債(5年)	213,000,000	214,810,500	
	第8回利付国債(40年)	15,000,000	16,916,550	
	第335回利付国債(10年)	12,000,000	12,456,600	

	第341回利付国債(10年)	122,500,000	125,513,500
	第343回利付国債(10年)	32,000,000	32,225,920
	第345回利付国債(10年)	12,000,000	12,072,600
	第28回利付国債(30年)	40,000,000	54,782,000
	第31回利付国債(30年)	10,000,000	13,211,700
	第35回利付国債(30年)	30,000,000	38,638,500
	第41回利付国債(30年)	8,000,000	9,801,200
	第46回利付国債(30年)	24,000,000	28,243,920
	第50回利付国債(30年)	43,000,000	42,850,360
	第88回利付国債(20年)	23,500,000	28,242,535
	第110回利付国債(20年)	64,000,000	78,531,840
	第119回利付国債(20年)	68,000,000	81,982,840
	第124回利付国債(20年)	31,000,000	38,327,470
	第129回利付国債(20年)	35,000,000	42,486,150
	第140回利付国債(20年)	88,500,000	106,855,785
	第150回利付国債(20年)	203,000,000	236,239,220
	第153回利付国債(20年)	124,000,000	142,112,680
	第157回利付国債(20年)	64,500,000	60,957,660
	第158回利付国債(20年)	24,000,000	23,916,480
	第159回利付国債(20年)	75,000,000	75,921,000
	第161回利付国債(20年)	25,000,000	25,201,000
	国債証券 小計	2,155,600,000	2,316,216,655
特殊債券	第61回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	103,778,000
	第73回都市再生債券(財投機関債)	100,000,000	100,139,000
	第28回中日本高速道路	100,000,000	100,464,000
	特殊債券 小計	300,000,000	304,381,000
社債券	第7回東日本旅客鉄道	100,000,000	100,108,000
	社債券 小計	100,000,000	100,108,000
	合計	2,555,600,000	2,720,705,655

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「国内株式マザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,606,932	30,870,203
株式	1,807,374,770	1,871,725,770
未収入金		65,844,389
未収配当金	2,159,100	2,630,840
流動資産合計	1,820,140,802	1,971,071,202
資産合計	1,820,140,802	1,971,071,202
負債の部		
流動負債		
未払金		65,669,499
未払利息	13	36
流動負債合計	13	65,669,535
負債合計	13	65,669,535
純資産の部		
元本等		
元本	2,289,449,543	1,983,655,647
剰余金		
剰余金又は欠損金()	469,308,754	78,253,980
元本等合計	1,820,140,789	1,905,401,667
純資産合計	1,820,140,789	1,905,401,667
負債純資産合計	1,820,140,802	1,971,071,202

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 期首	平成27年8月15日	平成28年8月16日
期首元本額	2,170,898,953円	2,289,449,543円
期首からの追加設定元本額	710,200,608円	493,250,066円
期首からの一部解約元本額	591,650,018円	799,043,962円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定型）	251,824,690円	205,874,502円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定成長型）	285,623,175円	242,872,087円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド（成長型）	291,410,971円	256,333,190円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド（積極型）	389,230,394円	332,089,104円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	85,453,748円	59,917,454円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	186,774,570円	158,398,729円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	235,659,568円	210,655,788円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定型）	45,931,050円	42,338,485円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）	111,832,098円	107,189,176円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）	77,729,629円	73,708,390円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（積極型）	90,120,469円	89,666,922円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020	48,724,390円	35,497,190円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	82,716,603円	71,443,985円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040	106,418,188円	97,670,645円
（合計）	2,289,449,543円	1,983,655,647円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	469,308,754円	78,253,980円
3 受益権の総数	2,289,449,543口	1,983,655,647口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7950円 （7,950円）	0.9606円 （9,606円）

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成27年8月15日 至平成28年8月15日）	（自平成28年8月16日 至平成29年8月14日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	18,484,140	39,810,219
合計	18,484,140	39,810,219

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

コード	銘 柄 銘 柄 名	株式数	評 価 額		備考
			単 価	金 額	
1605	国際石油開発帝石	7,500	1,057.50	7,931,250	
1801	大成建設	40,000	1,087.00	43,480,000	
1928	積水ハウス	15,600	1,884.50	29,398,200	
2282	日本ハム	7,000	3,275.00	22,925,000	
2502	アサヒグループホールディングス	6,700	4,681.00	31,362,700	
3402	東レ	19,000	990.30	18,815,700	
4042	東ソー	29,000	1,159.00	33,611,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	40,400	937.60	37,879,040	
4203	住友ベークライト	54,000	791.00	42,714,000	
4204	積水化学工業	17,300	2,037.00	35,240,100	
4217	日立化成	8,400	3,050.00	25,620,000	
4452	花王	6,200	6,685.00	41,447,000	
4507	塩野義製薬	7,400	5,664.00	41,913,600	
4516	日本新薬	2,900	7,080.00	20,532,000	
5020	J X T Gホールディングス	39,400	517.80	20,401,320	
5108	ブリヂストン	3,600	4,789.00	17,240,400	
5333	日本碍子	8,900	2,049.00	18,236,100	
5334	日本特殊陶業	4,200	2,069.00	8,689,800	
5393	ニチアス	22,000	1,277.00	28,094,000	
5401	新日鐵住金	6,800	2,667.00	18,135,600	
5706	三井金属鉱業	41,000	548.00	22,468,000	
5802	住友電気工業	15,700	1,718.50	26,980,450	
5929	三和ホールディングス	12,100	1,231.00	14,895,100	
6113	アマダホールディングス	12,500	1,179.00	14,737,500	
6146	ディスコ	1,500	19,060.00	28,590,000	
6273	S M C	1,000	34,190.00	34,190,000	
6301	小松製作所	8,300	2,852.50	23,675,750	
6367	ダイキン工業	1,200	11,145.00	13,374,000	
6383	ダイフク	10,100	4,405.00	44,490,500	
6471	日本精工	7,000	1,314.00	9,198,000	
6503	三菱電機	22,700	1,671.00	37,931,700	
6592	マブチモーター	3,600	5,060.00	18,216,000	
6594	日本電産	2,300	12,375.00	28,462,500	
6702	富士通	34,000	826.50	28,101,000	
6728	アルバック	4,700	6,100.00	28,670,000	
6758	ソニー	9,300	4,257.00	39,590,100	
6762	T D K	2,400	7,780.00	18,672,000	
6981	村田製作所	1,200	17,060.00	20,472,000	
7276	小糸製作所	1,700	6,730.00	11,441,000	
8035	東京エレクトロン	1,500	14,895.00	22,342,500	
6902	デンソー	4,000	5,290.00	21,160,000	
7202	いすゞ自動車	16,200	1,426.50	23,109,300	
7259	アイシン精機	3,200	5,530.00	17,696,000	
7267	本田技研工業	7,700	3,031.00	23,338,700	
7269	スズキ	3,100	5,600.00	17,360,000	
7272	ヤマハ発動機	11,500	3,165.00	36,397,500	
7747	朝日インテック	4,600	4,880.00	22,448,000	
7832	パンダイナムコホールディングス	3,100	3,565.00	11,051,500	
7864	フジシールインターナショナル	7,600	3,325.00	25,270,000	
7951	ヤマハ	7,200	3,770.00	27,144,000	
9503	関西電力	10,700	1,514.50	16,205,150	
9022	東海旅客鉄道	500	18,155.00	9,077,500	
9064	ヤマトホールディングス	3,900	2,158.00	8,416,200	

3626	T I S	1,800	3,235.00	5,823,000	
4768	大塚商会	1,300	6,950.00	9,035,000	
9432	日本電信電話	8,100	5,250.00	42,525,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	26,800	1,188.00	31,838,400	
9984	ソフトバンクグループ	7,000	8,662.00	60,634,000	
3076	あい ホールディングス	2,000	3,055.00	6,110,000	
7613	シークス	3,700	4,355.00	16,113,500	
8031	三井物産	10,400	1,600.50	16,645,200	
8058	三菱商事	4,300	2,523.00	10,848,900	
3197	すかいらく	5,800	1,611.00	9,343,800	
3391	ツルハホールディングス	800	12,880.00	10,304,000	
7453	良品計画	400	30,900.00	12,360,000	
8282	ケーズホールディングス	4,500	2,419.00	10,885,500	
9843	ニトリホールディングス	1,500	16,220.00	24,330,000	
9983	ファーストリテイリング	200	32,150.00	6,430,000	
8303	新生銀行	53,000	182.00	9,646,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	105,000	688.50	72,292,500	
8308	りそなホールディングス	25,800	553.70	14,285,460	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	6,900	4,101.00	28,296,900	
8604	野村ホールディングス	17,600	634.00	11,158,400	
8750	第一生命ホールディングス	13,400	1,866.00	25,004,400	
8766	東京海上ホールディングス	6,200	4,449.00	27,583,800	
8591	オリックス	16,400	1,792.00	29,388,800	
4666	パーク24	3,400	2,750.00	9,350,000	
8801	三井不動産	3,700	2,414.50	8,933,650	
8802	三菱地所	8,000	1,946.00	15,568,000	
8804	東京建物	13,700	1,431.00	19,604,700	
2127	日本M&Aセンター	5,900	4,745.00	27,995,500	
2413	エムスリー	3,800	2,777.00	10,552,600	
	合 計	984,800		1,871,725,770	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「世界債券マザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,044,731	
コール・ローン	9,160,894	25,333,649
国債証券	562,725,546	592,093,961
未収入金		1,388,248
未収利息	3,689,410	5,712,466
前払費用	263,613	878,823
流動資産合計	578,884,194	625,407,147
資産合計	578,884,194	625,407,147
負債の部		
流動負債		
未払利息	11	29
流動負債合計	11	29
負債合計	11	29
純資産の部		
元本等		
元本	248,673,026	250,502,601
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	330,211,157	374,904,517
元本等合計	578,884,183	625,407,118
純資産合計	578,884,183	625,407,118
負債純資産合計	578,884,194	625,407,147

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 期首	平成27年8月15日	平成28年8月16日
期首元本額	289,508,656円	248,673,026円
期首からの追加設定元本額	57,970,900円	91,787,630円
期首からの一部解約元本額	98,806,530円	89,958,055円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	42,637,241円	40,332,358円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	32,457,861円	32,117,356円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	28,397,049円	29,151,701円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	16,417,410円	16,594,680円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	14,137,290円	11,464,293円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	26,483,847円	27,304,617円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	25,102,906円	26,834,070円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	7,788,229円	8,296,774円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	12,712,218円	14,195,592円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	7,580,332円	8,411,951円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	3,805,622円	4,477,319円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020	8,102,775円	6,820,557円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	11,720,650円	12,192,530円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040	11,329,596円	12,308,803円
(合計)	248,673,026円	250,502,601円
2 受益権の総数	248,673,026口	250,502,601口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3279円 (23,279円)	2.4966円 (24,966円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年8月15日 至平成28年8月15日)	(自平成28年8月16日 至平成29年8月14日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	同 左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,568,108	3,096,117
合計	2,568,108	3,096,117

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨種類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備考
アメリカドル				
国債証券	1.25 T-NOTE 191031	97,000.00	96,852.22	
	1.75 T-NOTE 230131	336,000.00	334,792.50	
	1.875 T-NOTE 200630	122,000.00	123,591.71	
	2.125 T-NOTE 250515	160,000.00	160,637.50	
	2.375 T-NOTE 240815	126,000.00	129,120.46	
	2.75 T-BOND 420815	245,000.00	245,306.25	
	3.625 T-NOTE 210215	389,000.00	416,837.81	
	3.75 T-NOTE 181115	471,000.00	485,571.56	
	4.375 T-BOND 380215	235,000.00	302,342.18	
	5.5 T-BOND 280815	50,000.00	65,937.50	
国債証券 小 計		2,231,000.00	2,360,989.69 (258,339,491)	
アメリカドル 小 計		2,231,000.00	2,360,989.69 (258,339,491)	
カナダドル				
国債証券	2.5 CAN GOVT 240601	138,000.00	145,541.70	
	国債証券 小 計	138,000.00	145,541.70 (12,558,793)	
カナダドル 小 計		138,000.00	145,541.70 (12,558,793)	
オーストラリアドル				
国債証券	3.25 AUST GOVT 250421	122,000.00	129,065.50	
	5.25 AUST GOVT 190315	23,000.00	24,289.79	
	国債証券 小 計	145,000.00	153,355.29 (13,277,501)	
オーストラリアドル 小 計		145,000.00	153,355.29 (13,277,501)	
イギリスポンド				
国債証券	2.75 GILT 240907	30,000.00	34,219.20	
	3.75 GILT 200907	57,000.00	63,179.94	
	4.25 GILT 271207	20,000.00	26,224.80	
	4.25 GILT 360307	63,000.00	89,822.25	
	4.25 GILT 551207	43,000.00	75,440.92	
国債証券 小 計		213,000.00	288,887.11 (41,094,191)	
イギリスポンド 小 計		213,000.00	288,887.11 (41,094,191)	
スイスフラン				

国債証券	4 SWISS GOVT 280408	7,000.00	10,119.90	
	国債証券 小計	7,000.00	10,119.90 (1,148,811)	
スイスフラン 小計		7,000.00	10,119.90 (1,148,811)	
シンガポールドル				
国債証券	3.125SINGAPORGVOT 220901	28,000.00	30,080.40	
	国債証券 小計	28,000.00	30,080.40 (2,420,569)	
シンガポールドル 小計		28,000.00	30,080.40 (2,420,569)	
マレーシアリングギット				
国債証券	4.048 MALAYSIA 210930	84,000.00	85,449.42	
	国債証券 小計	84,000.00	85,449.42 (2,178,960)	
マレーシアリングギット 小計		84,000.00	85,449.42 (2,178,960)	
スウェーデンクローネ				
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	195,000.00	210,970.11	
	国債証券 小計	195,000.00	210,970.11 (2,841,767)	
スウェーデンクローネ 小計		195,000.00	210,970.11 (2,841,767)	
ノルウェークローネ				
国債証券	1.5 NORWE GOVT 260219	51,000.00	51,378.42	
	3.75 NORWE GOVT 210525	71,000.00	78,635.76	
	国債証券 小計	122,000.00	130,014.18 (1,794,195)	
ノルウェークローネ 小計		122,000.00	130,014.18 (1,794,195)	
デンマーククローネ				
国債証券	1.75 DMK GOVT 251115	187,000.00	210,231.57	
	国債証券 小計	187,000.00	210,231.57 (3,655,927)	
デンマーククローネ 小計		187,000.00	210,231.57 (3,655,927)	
メキシコペソ				
国債証券	8 MEXICAN BONOS 231207	786,000.00	837,160.74	
	国債証券 小計	786,000.00	837,160.74 (5,148,538)	
メキシコペソ 小計		786,000.00	837,160.74 (5,148,538)	
ポーランドズロチ				
国債証券	2 POLAND 210425	134,000.00	132,191.00	
	国債証券 小計	134,000.00	132,191.00 (3,988,202)	
ポーランドズロチ 小計		134,000.00	132,191.00 (3,988,202)	
ユーロ				
国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	58,000.00	59,568.66	
	0.5 O.A.T 250525	211,000.00	213,458.15	
	1 O.A.T 181125	100,000.00	102,078.70	
	1.5 BUND 240515	83,000.00	92,023.42	
	2 IRISH GOVT 450218	104,000.00	109,721.24	
	2.25 BUND 210904	61,000.00	67,907.64	
	2.25 NETH GOVT 220715	86,000.00	96,782.16	
	2.4 IRISH GOVT 300515	78,000.00	89,768.64	
	3.75 BEL GOVT 200928	87,000.00	98,654.33	
	3.75 O.A.T 191025	27,000.00	29,591.81	
	3.75 O.A.T 210425	93,000.00	107,442.90	
	4 O.A.T 550425	84,000.00	136,188.69	
	4.25 BEL GOVT 220928	114,000.00	140,185.11	
	4.25 BUND 390704	53,000.00	87,929.12	
	4.35 AUSTRIA GOVT 190315	80,000.00	86,319.36	
	4.5 IRISH GOVT 181018	140,000.00	148,288.98	
	4.75 BUND 280704	40,000.00	58,539.36	
	5.5 O.A.T 290425	105,000.00	159,906.07	
	国債証券 小計	1,604,000.00	1,884,354.34 (243,647,016)	
ユーロ 小計		1,604,000.00	1,884,354.34 (243,647,016)	
合 計			592,093,961 (592,093,961)	

（注1）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

（注2）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 10銘柄	100.00%	43.63%
カナダドル	国債証券 1銘柄	100.00%	2.12%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	100.00%	2.24%
イギリスポンド	国債証券 5銘柄	100.00%	6.94%
スイスフラン	国債証券 1銘柄	100.00%	0.19%
シンガポールドル	国債証券 1銘柄	100.00%	0.41%
マレーシアリングット	国債証券 1銘柄	100.00%	0.37%
スウェーデンクローネ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.48%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.30%
デンマーククローネ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.62%
メキシコペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.87%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.67%
ユーロ	国債証券 18銘柄	100.00%	41.15%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「世界株式マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	303,287	137,042
コール・ローン	11,724,338	24,189,921
株式	966,465,406	1,006,078,303
未収入金	46,645,188	
未収配当金	392,595	248,045
流動資産合計	1,025,530,814	1,030,653,311
資産合計	1,025,530,814	1,030,653,311
負債の部		
流動負債		
未払金	7,032,125	
未払利息	14	28
流動負債合計	7,032,139	28
負債合計	7,032,139	28
純資産の部		
元本等		
元本	586,757,797	458,687,367
剰余金		
剰余金又は欠損金()	431,740,878	571,965,916
元本等合計	1,018,498,675	1,030,653,283
純資産合計	1,018,498,675	1,030,653,283
負債純資産合計	1,025,530,814	1,030,653,311

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月8日から8月7日まで、および8月8日から翌年2月7日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 期首 期首元本額	平成27年8月15日 575,770,925円	平成28年8月16日 586,757,797円

期首からの追加設定元本額	237,251,469円	173,787,044円
期首からの一部解約元本額	226,264,597円	301,857,474円
元本の内訳*		
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	59,265,325円	44,137,696円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	67,486,763円	52,216,487円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	78,853,835円	62,798,621円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	115,271,180円	88,830,936円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020	19,868,410円	12,904,588円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	44,138,224円	32,479,457円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	59,281,360円	46,910,932円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	10,769,892円	9,075,529円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	26,429,704円	23,058,577円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	21,029,054円	18,110,547円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	26,690,886円	23,973,514円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020	11,359,701円	7,626,598円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	19,535,748円	14,637,984円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040	26,777,715円	21,925,901円
(合計)	586,757,797円	458,687,367円
2 受益権の総数	586,757,797口	458,687,367口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7358円 (17,358円)	2.2470円 (22,470円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年8月15日 至平成28年8月15日)	(自平成28年8月16日 至平成29年8月14日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成28年8月15日現在]	[平成29年8月14日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,779,835	23,716,067
合計	5,779,835	23,716,067

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	ABIOMED INC	970	151.370000	146,828.90	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	1,071	60.740000	65,052.54	
	ALBEMARLE CORP	556	109.360000	60,804.16	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	737	78.220000	57,648.14	
	ALPHABET INC-CL A	127	930.090000	118,121.43	
	ALPHABET INC-CL C	191	914.390000	174,648.49	
	AMAZON.COM INC	451	967.990000	436,563.49	
	AMERICAN EXPRESS CO	1,418	84.290000	119,523.22	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,060	48.440000	51,346.40	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,170	65.630000	76,787.10	
	CARMAX INC	1,212	64.420000	78,077.04	
	CELGENE CORP	534	130.610000	69,745.74	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	141	326.410000	46,023.81	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	1,152	71.260000	82,091.52	
	COSTAR GROUP INC	255	279.880000	71,369.40	
	ELLIE MAE INC	884	83.980000	74,238.32	
	EOG RESOURCES INC	942	88.530000	83,395.26	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	865	99.650000	86,197.25	
	FACEBOOK INC-A	1,570	168.080000	263,885.60	
	FASTENAL CO	1,809	42.610000	77,081.49	
	FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,310	97.370000	322,294.70	
	FORTIVE CORP	1,277	65.600000	83,771.20	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	593	224.150000	132,920.95	
	GRUBHUB INC	3,253	54.460000	177,158.38	
	HARLEY-DAVIDSON INC	899	47.540000	42,738.46	
	HEICO CORP-CLASS A	988	74.600000	73,704.80	
	ILLUMINA INC	1,045	194.250000	202,991.25	
	INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	2,516	40.680000	102,350.88	
	JUNO THERAPEUTICS INC	1,981	28.490000	56,438.69	
	LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS	1,066	86.070000	91,750.62	
	M & T BANK CORP	723	156.600000	113,221.80	
	MARKEL CORP	161	1,044.710000	168,198.31	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,000	192.460000	192,460.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	626	204.770000	128,186.02	
	MASTERCARD INC - A	1,094	128.550000	140,633.70	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	134	577.580000	77,395.72	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	685	82.210000	56,313.85	
	MOODY'S CORP	734	127.760000	93,775.84	
	NETFLIX INC	683	171.400000	117,066.20	
	NOW INC	3,163	12.170000	38,493.71	
	NVIDIA CORP	1,176	155.960000	183,408.96	
	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	698	114.670000	80,039.66	
	SCHLUMBERGER LTD	946	63.830000	60,383.18	
	SEATTLE GENETICS INC	680	46.320000	31,497.60	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	167	331.880000	55,423.96	
	TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	1,630	68.670000	111,932.10	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,959	43.820000	173,483.38	
	TESLA INC	619	357.870000	221,521.53	
	TIFFANY & CO	1,059	90.290000	95,617.11	
	TJX COMPANIES INC	745	71.070000	52,947.15	
	TRIPADVISOR INC	1,038	42.180000	43,782.84	
	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	3,283	16.800000	55,154.40	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	811	97.740000	79,267.14	
	VERISK ANALYTICS INC	1,134	80.620000	91,423.08	

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	651	153.780000	100,110.78
WABTEC CORP	983	72.810000	71,572.23
WATERS CORP	707	177.030000	125,160.21
WATSCO INC	796	147.330000	117,274.68
WAYFAIR INC- CLASS A	2,552	69.690000	177,848.88
アメリカドル 小計	66,680		6,579,143.25 (719,889,854)
オーストラリアドル			
BRAMBLES LTD	3,135	9.570000	30,001.95
CHALLENGER LTD	7,079	12.860000	91,035.94
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	598	51.420000	30,749.16
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	1,929	17.280000	33,333.12
MESOBLAST LTD	9,235	1.770000	16,345.95
NEWCREST MINING LTD	2,591	21.850000	56,613.35
QBE INSURANCE GROUP LTD	5,374	11.740000	63,090.76
SEEK LTD	1,882	17.690000	33,292.58
WOOLWORTHS LTD	1,005	26.870000	27,004.35
オーストラリアドル 小計	32,828		381,467.16 (33,027,426)
イギリスポンド			
ABCAM PLC	3,807	10.350000	39,402.45
BOOHOO.COM PLC	6,652	2.325000	15,465.90
BURBERRY GROUP PLC	1,759	17.370000	30,553.83
COCA-COLA HBC AG-DI	1,922	25.920000	49,818.24
EXPERIAN PLC	1,172	15.170000	17,779.24
FDM GROUP HOLDINGS PLC	1,833	8.890000	16,295.37
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,858	13.410000	24,915.78
IMAGINATION TECH GROUP PLC	3,060	1.372500	4,199.85
IWG PLC	3,819	2.955000	11,285.14
JUST EAT PLC	3,025	6.015000	18,195.37
OCADO GROUP PLC	4,261	2.928000	12,476.20
OXFORD INSTRUMENTS PLC	1,330	10.370000	13,792.10
PAGEGROUP PLC	2,508	4.847000	12,156.27
PRUDENTIAL PLC	1,461	17.825000	26,042.32
RENISHAW PLC	1,315	43.360000	57,018.40
RIGHTMOVE PLC	468	40.450000	18,930.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,349	9.100000	21,375.90
ROTORK PLC	7,998	2.326000	18,603.34
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	412	56.950000	23,463.40
ST JAMES'S PLACE PLC	3,855	11.660000	44,949.30
TED BAKER PLC	749	23.830000	17,848.67
XAAR PLC	1,474	4.347500	6,408.21
イギリスポンド 小計	57,087		500,975.88 (71,263,818)
スイスフラン			
NESTLE SA-REG	1,052	80.850000	85,054.20
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	343	206.200000	70,726.60
スイスフラン 小計	1,395		155,780.80 (17,684,236)
香港ドル			
AIA GROUP LTD	4,400	58.850000	258,940.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	7,500	37.800000	283,500.00
GLOBAL BRANDS GROUP HOLDING	94,800	0.710000	67,308.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	8,500	33.600000	285,600.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	11,000	32.250000	354,750.00
香港ドル 小計	126,200		1,250,098.00 (17,488,871)
スウェーデンクローネ			
ALFA LAVAL AB	2,512	183.400000	460,700.80
ATLAS COPCO AB-A SHS	3,032	293.300000	889,285.60
HEXPOL AB	6,943	80.800000	560,994.40
INVESTOR AB-B SHS	2,460	379.400000	933,324.00
KINNEVIK AB - B	1,241	243.500000	302,183.50
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	7,149	77.650000	555,119.85
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	7,622	118.000000	899,396.00
VOLVO AB-B SHS	2,824	138.000000	389,712.00
スウェーデンクローネ 小計	33,783		4,990,716.15 (67,224,946)
デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	591	689.500000	407,494.50
JYSKE BANK-REG	1,008	380.500000	383,544.00

	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,223	286.600000	350,511.80	
	デンマーククローネ 小計	2,822		1,141,550.30 (19,851,559)	
ユーロ					
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,494	41.940000	62,658.36	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	6,497	5.426000	35,252.72	
	ELRINGKLINGER AG	1,088	15.145000	16,477.76	
	EXOR NV	978	50.000000	48,900.00	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	656	86.910000	57,012.96	
	IMCD GROUP NV	985	50.190000	49,437.15	
	KONECRANES OYJ	1,460	37.460000	54,691.60	
	LEGRAND SA	681	58.780000	40,029.18	
	L'OREAL	274	173.600000	47,566.40	
	ZALANDO SE	1,236	39.875000	49,285.50	
	ユーロ 小計	15,349		461,311.63 (59,647,593)	
	合計	336,144		1,006,078,303 (1,006,078,303)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 59銘柄	100.00%	71.55%
オーストラリアドル	株式 9銘柄	100.00%	3.28%
イギリスポンド	株式 22銘柄	100.00%	7.08%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.00%	1.76%
香港ドル	株式 5銘柄	100.00%	1.74%
スウェーデンクローネ	株式 8銘柄	100.00%	6.68%
デンマーククローネ	株式 3銘柄	100.00%	1.97%
ユーロ	株式 10銘柄	100.00%	5.93%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型）】

【純資産額計算書】

平成29年8月31日現在
（単位：円）

資産総額	338,907,205
負債総額	256,146
純資産総額（ - ）	338,651,059
発行済口数	222,178,000 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.5242 （ 1万口当たり 15,242 ）

（参考）

国内債券マザーファンド

純資産額計算書

平成29年8月31日現在
（単位：円）

資産総額	2,787,415,586
負債総額	116
純資産総額（ - ）	2,787,415,470
発行済口数	1,979,876,192 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.4079 （ 1万口当たり 14,079 ）

国内株式マザーファンド

純資産額計算書

平成29年8月31日現在
（単位：円）

資産総額	1,944,868,799
負債総額	84
純資産総額（ - ）	1,944,868,715
発行済口数	1,990,388,315 口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9771 （ 1万口当たり 9,771 ）

世界債券マザーファンド

純資産額計算書

平成29年8月31日現在
（単位：円）

資産総額	620,503,312
負債総額	27
純資産総額（ - ）	620,503,285
発行済口数	245,332,130 口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.5292 （ 1万口当たり 25,292 ）

世界株式マザーファンド

純資産額計算書

平成29年8月31日現在
(単位：円)

資産総額	1,049,508,830
負債総額	46
純資産総額(-)	1,049,508,784
発行済口数	457,143,245 口
1口当たり純資産価額(/)	2.2958 (1万口当たり 22,958)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

平成29年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。平成29年8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	832	11,020,040
追加型公社債投資信託	16	1,379,844
単位型株式投資信託	52	358,881
単位型公社債投資信託	1	6,409
合計	901	12,765,173

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	80,707,781	2	69,212,680
有価証券		2,728,127		36,210
前払費用		402,267		337,699
未収入金		14,286		35,896
未収委託者報酬		11,275,577		10,076,022
未収収益	2	564,923	2	659,405
繰延税金資産		491,700		446,374
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		438,012		113,754
流動資産合計		96,652,678		80,948,042

固定資産				
有形固定資産				
建物	1	846,844	1	806,798
器具備品	1	768,584	1	759,446
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,971,428		2,922,245
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,813,951		1,844,549
ソフトウェア仮勘定		341,815		608,066
その他		71		10
無形固定資産合計		2,171,661		2,468,448
投資その他の資産				
投資有価証券		24,223,272		24,327,081
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		686,446		654,402
前払年金費用		499,178		463,105
繰延税金資産		786,810		711,230
その他		51,090		50,235
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,543,335		26,502,592
固定資産合計		31,686,425		31,893,286
資産合計		128,339,103		112,841,328

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		199,091		166,493
未払金				
未払収益分配金		101,046		108,024
未払償還金		821,178		547,707
未払手数料	2	4,866,423	2	4,225,009
その他未払金	2	2,521,849	2	2,355,815
未払費用	2	3,419,978	2	3,061,479
未払消費税等		370,110		351,670
未払法人税等		947,540		756,668
賞与引当金		882,523		843,729
役員賞与引当金				100,680
その他		670,983		711,633
流動負債合計		14,800,725		13,228,909
固定負債				
退職給付引当金		508,142		590,154

役員退職慰労引当金	166,789	166,458
時効後支払損引当金	257,105	253,070
固定負債合計	932,038	1,009,684
負債合計	15,732,763	14,238,594
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	57,079,782	43,034,713
利益剰余金合計	64,420,372	50,375,303
株主資本合計	111,153,216	97,108,147

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,446,576	1,494,586
繰延ヘッジ損益	6,546	
評価・換算差額等合計	1,453,123	1,494,586
純資産合計	112,606,339	98,602,734
負債純資産合計	128,339,103	112,841,328

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,096,942	81,709,776
投資顧問料	2,226,322	2,396,020
その他営業収益	35,063	25,763
営業収益合計	84,358,328	84,131,560
営業費用		
支払手数料	2 34,821,751	2 33,975,255
広告宣伝費	742,632	731,771
公告費		482

調査費		
調査費	1,642,352	1,713,892
委託調査費	14,530,744	13,961,993
事務委託費	751,410	984,749
営業雑経費		
通信費	122,574	158,915
印刷費	704,639	699,940
協会費	51,201	51,995
諸会費	7,730	9,887
事務機器関連費	1,674,745	1,611,608
その他営業雑経費	30,382	11,925
営業費用合計	55,080,164	53,912,419
一般管理費		
給料		
役員報酬	280,681	331,997
給料・手当	5,948,603	6,496,165
賞与引当金繰入	882,523	843,729
役員賞与引当金繰入		100,680
福利厚生費	1,091,897	1,196,210
交際費	17,062	14,843
旅費交通費	212,578	233,159
租税公課	264,376	422,030
不動産賃借料	795,415	706,571
退職給付費用	341,073	441,736
役員退職慰労引当金繰入	34,369	48,393
固定資産減価償却費	1,068,796	1,030,040
諸経費	426,547	474,521
一般管理費合計	11,363,925	12,340,079
営業利益	17,914,238	17,879,061

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	235,697	243,048
有価証券利息	523	0
受取利息	2 15,142	2 4,601
投資有価証券償還益	9,315	260,190
収益分配金等時効完成分	71,619	278,148
その他	17,393	4,383
営業外収益合計	349,691	790,372
営業外費用		
投資有価証券償還損	152,298	11,552
時効後支払損引当金繰入	98,891	
事務過誤費	421	218
その他	5,862	4,357

営業外費用合計		257,473		16,128
経常利益		18,006,455		18,653,304
特別利益				
投資有価証券売却益		424,605		259,137
ゴルフ会員権売却益		1,300		
特別利益合計		425,905		259,137
特別損失				
投資有価証券売却損		52,623		42,248
デリバティブ解約損				126,228
有価証券評価損		67,284		
投資有価証券評価損		18,539		157,482
固定資産除却損	1	1,305	1	13,540
減損損失	3	42,073	3	48,575
合併関連費用		829,181		
特別損失合計		1,011,007		388,075
税引前当期純利益		17,421,353		18,524,367
法人税、住民税及び事業税	2	5,796,941	2	5,658,953
法人税等調整額		1,035,591		103,169
法人税等合計		4,761,350		5,762,122
当期純利益		12,660,003		12,762,244

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096		222,096	342,589	6,998,000	48,527,422	55,868,012	58,090,240
当期変動額									
剰余金の配当							4,107,643	4,107,643	4,107,643
当期純利益							12,660,003	12,660,003	12,660,003
合併による増加		3,350,000	41,160,616	44,510,616					44,510,616
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計		3,350,000	41,160,616	44,510,616			8,552,359	8,552,359	53,062,976
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,300,727		2,300,727	60,390,967

当期変動額				
剰余金の配当				4,107,643
当期純利益				12,660,003
合併による増加	903,495	148,745	754,749	45,265,365
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,757,645	155,292	1,602,353	1,602,353
当期変動額合計	854,150	6,546	847,604	52,215,371
当期末残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

- (2) その他有価証券
時価のあるもの
決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。
時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
- (1) 有形固定資産
定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
- | | |
|------|--------|
| 建物 | 5年～50年 |
| 器具備品 | 2年～20年 |
- (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準
- (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
- (2) 賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
- (3) 役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
- (4) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。
- 退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
- (追加情報)
当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行しております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準委員会平成14年1月31日企業会計基準適用指針第1号)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(企業会計基準委員会平成19年2月7日実務対応報告第2号)を適用しております。
なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であ

ります。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ開始から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして判断しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	467,206千円	539,649千円
器具備品	897,207千円	1,029,950千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
預金	43,128,360千円	47,798,472千円
未収収益	52,753千円	46,963千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	2,612,168千円	1,993,055千円
その他未払金	2,296,632千円	2,071,256千円

未払費用

442,340千円

456,748千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第31期	第32期
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
建物	254千円	2,392千円
器具備品	1,051千円	7,791千円
ソフトウェア	-	3,356千円
計	1,305千円	13,540千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期	第32期
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
支払手数料	15,120,269千円	13,862,465千円
受取利息	12,609千円	4,375千円
法人税、住民税及び事業税	3,980,844千円	4,204,969千円

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
静岡県裾野市	遊休資産（不動産）	土地	35,031千円
東京都千代田区（本社）	遊休資産（美術品）	器具備品	7,041千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア（遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

(株主資本等変動計算書関係)

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式(注)	124,098	87,483	-	211,581
合計	124,098	87,483	-	211,581

(注) 普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,107,643千円
1株当たり配当額	33,100円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,651,815千円	1,973,699千円
合計	3,329,932千円	2,651,815千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達はありません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	80,707,781	80,707,781	-
(2) 有価証券	2,728,127	2,728,127	-
(3) 未収委託者報酬	11,275,577	11,275,577	-
(4) 投資有価証券	24,054,542	24,054,542	-
資産計	118,766,029	118,766,029	-
(1) 未払手数料	4,866,423	4,866,423	-
負債計	4,866,423	4,866,423	-
デリバティブ取引()	(3,459)	(3,459)	-

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務

となる項目については()で表示しております。

第32期(平成29年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項
資 産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	168,730	137,160
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	80,707,781	-	-	-
未収委託者報酬	11,275,577	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,728,127	9,234,321	9,756,778	5,050

合計	94,711,487	9,234,321	9,756,778	5,050
----	------------	-----------	-----------	-------

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	113,875	30,541	83,333
	債券	-	-	-
	その他	19,085,937	16,697,402	2,388,535
	小計	19,199,812	16,727,944	2,471,868
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,582,857	7,969,134	386,277
	小計	7,582,857	7,969,134	386,277
合計		26,782,669	24,697,079	2,085,590

第32期(平成29年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

3. 売却したその他有価証券

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,649,814	424,605	52,623
合計	5,649,814	424,605	52,623

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	945,410	-	3,459
合計			945,410	-	3,459

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
退職給付債務の期首残高	263,476 千円	2,997,931 千円

勤務費用	135,457	199,166
利息費用	19,818	22,711
数理計算上の差異の発生額	113,714	40,934
退職給付の支払額	159,115	183,403
過去勤務費用の発生額	-	653,618
合併による増加	2,624,579	-
退職給付債務の期末残高	2,997,931	3,649,089

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	196,439 千円	2,678,827 千円
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の発生額	111,449	7,066
事業主からの拠出額	210,960	107,823
退職給付の支払額	139,379	142,532
合併による増加	2,486,329	-
年金資産の期末残高	2,678,827	2,698,738

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,422,447 千円	3,471,120 千円
年金資産	2,678,827	2,698,738
	256,380	772,381
非積立型制度の退職給付債務	575,484	177,969
未積立退職給付債務	319,103	950,350
未認識数理計算上の差異	310,139	207,810
未認識過去勤務費用	-	615,490
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049
退職給付引当金	508,142	590,154
前払年金費用	499,178	463,105
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	135,457 千円	199,166 千円
利息費用	19,818	22,711
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の費用処理額	13,847	54,327
過去勤務費用の費用処理額	-	38,127

その他	65,395	28,533
確定給付制度に係る退職給付費用	198,592	295,314

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
債券	58.1 %	62.9 %
株式	35.5	33.3
その他	6.3	3.7
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.077～0.71%	0.061～0.90%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円でありま

す。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	475,116 千円	455,165 千円
投資有価証券評価損	238,391	242,551
ゴルフ会員権評価損	295	295
未払事業税	185,473	124,367
賞与引当金	272,346	260,374
役員賞与引当金	-	11,509
役員退職慰労引当金	51,071	50,969
退職給付引当金	155,593	180,726
減価償却超過額	29,059	19,277
委託者報酬	204,395	217,902
長期差入保証金	6,344	14,803
時効後支払損引当金	78,725	77,490
連結納税適用による時価評価	309,675	236,450
その他	69,525	68,614

繰延税金資産 小計	2,076,013	1,960,499
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,076,013	1,960,499
繰延税金負債		
未収配当金	1,228	-
前払年金費用	152,848	141,802
連結納税適用による時価評価	1,516	1,447
その他有価証券評価差額金	639,013	659,638
繰延ヘッジ損益	2,889	-
その他	6	3
繰延税金負債 合計	797,502	802,893
繰延税金資産の純額	1,278,511	1,157,605

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
法定実効税率	33.06 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
(調整)		
評価性引当額の減少	6.34	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.59	
その他	0.02	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.33	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有間接100.0%	連結納税 役員兼任	連結納税に伴う支払	3,980,844千円	その他未払金	2,296,632千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有直接51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借	投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料	5,895,622千円 223,695千円	未払手数料	805,721千円
親会社							長期差入保証金の返還	885,549千円		
親会社							投資の助言	515,287千円	未払費用	319,698千円
親会社							役員兼任			
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	被所有直接15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入	9,224,647千円 35,000,000千円	未払手数料 現金及び預金	1,806,446千円 35,000,000千円
主要株主							コーラブル預金に係る受取利息	9,263千円	未収収益	2,372千円

--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969 千円	その他未払金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,398,782 千円	未払手数料	898,096 千円

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
1株当たり純資産額	532,213.85円	466,028.30円
1株当たり当期純利益金額	66,691.34円	60,318.47円

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額（千円）	12,660,003	12,762,244
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株式の期中平均株式数（株）	189,829	211,581

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成29年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容

株式会社鹿児島銀行	18,130 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- (2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成29年8月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%(107,855株)を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年11月14日	有価証券届出書
平成28年11月14日	有価証券報告書
平成29年 5月12日	有価証券届出書の訂正届出書
平成29年 5月12日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成29年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年9月27日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ＜DC＞ライフ・バランスファンド（安定成長型）の平成28年8月16日から平成29年8月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ＜DC＞ライフ・バランスファンド（安定成長型）の平成29年8月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。