

## 【表紙】

|  |                             |
|--|-----------------------------|
| 【提出書類】                                   | 訂正有価証券届出書                   |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                     |
| 【提出日】                                    | 平成30年5月11日提出                |
| 【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                        |
| 【電話番号】                                   | 03-6250-4740                |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | 1兆円を上限とします。                 |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。                 |

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成29年11月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について半期報告書の提出に伴う関係情報の更新等および投資信託約款の重大な内容の変更（投資の対象とするマザーファンドの入替え）を予定しており、所要の変更を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

なお、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」において、「1 財務諸表」につきましては「中間財務諸表」が追加され、「2 ファンドの現況」につきましては原届出書の更新後の内容を記載します。

## 第一部【証券情報】

## (4)【発行(売出)価格】

## &lt;訂正前&gt;

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

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。

## &lt;訂正後&gt;

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

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。

## (12)【その他】

## &lt;訂正前&gt;

該当事項はありません。

## &lt;訂正後&gt;

[三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）の投資の対象とするマザーファンドの入替えに関するお知らせ]

三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）が投資の対象とする「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」は、残高些少により運用が困難な状況になりつつあり、投資の対象とするマザーファンドを「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド」に入替えることが受益者の皆さまにとって有利であると認められるため、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき2018年5月15日現在の受益者の皆さま（2018年5月11日までに、購入のお申込みをされた方が対象となります。）に、2018年7月18日付けで投資の対象とするマザーファンドを入替えることについての異議申立の手続きを2018年5月15日から2018年6月18日まで行います。

当該期間中に投資の対象とするマザーファンドの入替えに異議を述べた受益者の皆さまの受益権

の合計口数が2018年5月15日現在のファンドの受益権総口数の半数を超えない場合、ファンドは投資の対象とするマザーファンドを入替えいたします。また、否決された場合、投資の対象とするマザーファンドを入替えない旨を公告するとともに、2018年5月15日現在の受益者の皆さまにその旨を記載した書面を交付いたします。投資の対象とするマザーファンドの入替え可否につきましては、2018年6月19日に委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/>)にてお知らせいたします。

「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドに追加される予定です。

「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」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

## 第二部【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】

&lt;更新後&gt;

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

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

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、対円での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<sup>※1</sup>、三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド<sup>※2</sup>、国内株式マザーファンド<sup>※1</sup>、三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド<sup>※2</sup>、世界債券マザーファンド<sup>※1</sup>、三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド<sup>※2</sup>、世界株式マザーファンド<sup>※1</sup>および三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド<sup>※2</sup>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<sup>※</sup>として、超過収益を積み上げることを図ります。

以下の比率で合成したインデックスをベンチマークとします。

| マザーファンド名称                           | インデックス名称   | 比率  |
|-------------------------------------|--|-----|
| 国内債券マザーファンド <sup>※1</sup>           | NOMURA-BPI総合インデックス                               | 32% |
| 三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> |  |     |
| 国内株式マザーファンド <sup>※1</sup>           | 東証株価指数(TOPIX)                                    | 35% |
| 三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> |  |     |
| 世界債券マザーファンド <sup>※1</sup>           | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円換算ベース)                  | 10% |
| 三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本・円ベース)                    |     |
| 世界株式マザーファンド <sup>※1</sup>           | MSCI Kokusai Index<br>(MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース) | 20% |
| 三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> |  |     |
| —                                   | 無担保コール翌日物レート<br>(短資協会発表)の平均値                     | 3%  |

※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。

※1 「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」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

※2 「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。


 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。

| マザーファンド名称                            | 基本方針  |
|--------------------------------------|---|
| 国内債券マザーファンド <sup>※1</sup>            | 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。                          |
| 三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> | わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI<総合>(国内債券投資収益指数)を中長期的に上回ることを目標に運用を行います。        |
| 国内株式マザーファンド <sup>※1</sup>            | 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。                               |
| 三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> | わが国の株式を主要投資対象とし、TOPIX(東証株価指数)を中長期的に上回る投資成果をめざします。                         |
| 世界債券マザーファンド <sup>※1</sup>            | 外国の債券を主要投資対象とし、FTSE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。                 |
| 三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> | わが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)を中長期的に上回る投資成果をめざします。    |
| 世界株式マザーファンド <sup>※1</sup>            | 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。 |
| 三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド <sup>※2</sup> | わが国を除く世界主要国の株式を主要投資対象とし、MSCI KOKUSAIインデックス(円換算ベース)を中長期的に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。

※ 「国内債券マザーファンド」と「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」、「国内株式マザーファンド」と「三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド」、「世界株式マザーファンド」と「三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド」の各インデックスは表記の違いはありますが、同一のインデックスです。

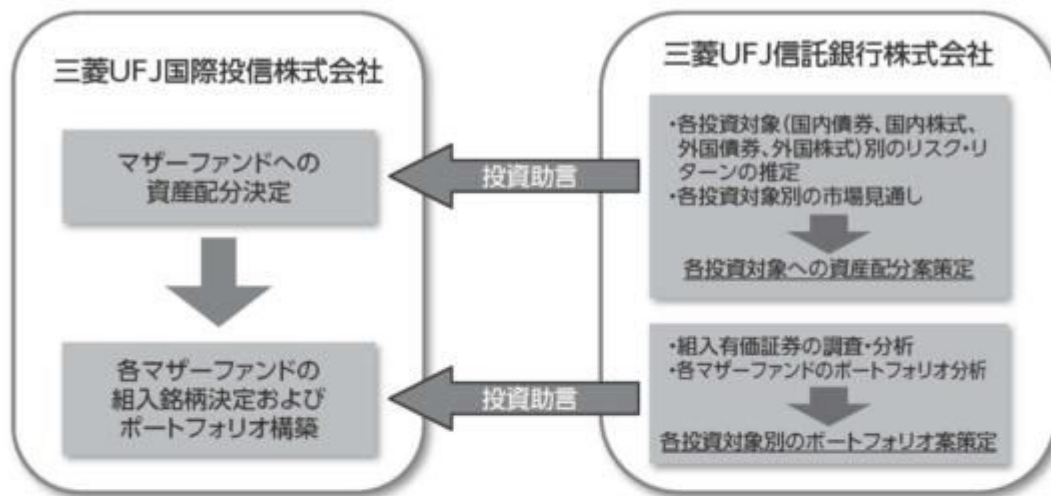
※1 「国内債券マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「世界債券マザーファンド」、「世界株式マザーファンド」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

※2 「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。

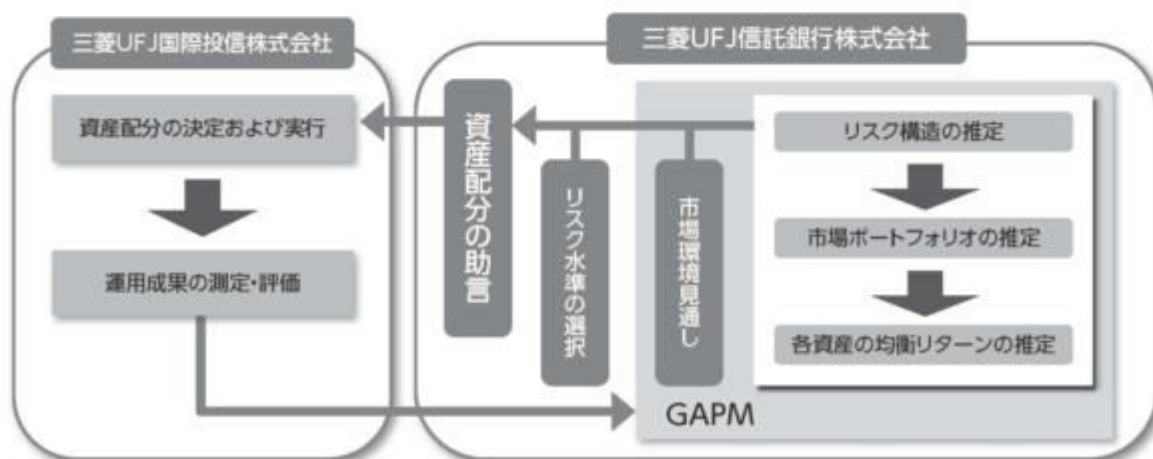


資産配分および各マザーファンドのポートフォリオ構築<sup>※1</sup>にあたりましては、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言<sup>※2</sup>を受けます。

※1 2018年7月18日に追加される予定の「三菱UFJ」国内債券アクティブマザーファンド、「三菱UFJ」国内株式アクティブマザーファンド、「三菱UFJ」海外債券アクティブマザーファンド、「三菱UFJ」海外株式アクティブマザーファンドは、投資助言は受けません。  
 ※2 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(<https://www.am.mufg.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。



※1 「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」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

※2 「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。

## ■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70%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45%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。

※2018年7月18日削除予定です。

## ■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。

## 指数について

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。

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。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき当社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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。

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。

### (3)【ファンドの仕組み】

#### <訂正前>

#### 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<br>「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。<br>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<br>「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% |

<訂正後>

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<br>「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。<br>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<br>「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30年2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(平成30年4月2日現在)

| 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 | 211,581株 | 100.0% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<更新後>

「国内債券マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「国内株式マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「世界債券マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「世界株式マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」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<sup>1</sup>」、「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「国内株式マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「世界債券マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」、「世界株式マザーファンド<sup>1</sup>」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>」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。

1 「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」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

2 「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。

国内債券32%、国内株式35%、外国債券10%、外国株式20%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。

以下の比率で合成したインデックスをベンチマークとします。

| マザーファンド名称                           | インデックス名称  | 比率  |
|-------------------------------------|---|-----|
| 国内債券マザーファンド <sup>*1</sup>           | NOMURA-BPI総合インデックス                              | 32% |
| 三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド <sup>*2</sup> |   |     |
| 国内株式マザーファンド <sup>*1</sup>           | 東証株価指数(TOPIX)                                   | 35% |
| 三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド <sup>*2</sup> |   |     |
| 世界債券マザーファンド <sup>*1</sup>           | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円換算ベース)                 | 10% |
| 三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド <sup>*2</sup> |   |     |
| 世界株式マザーファンド <sup>*1</sup>           | MSCI Kokusai Index<br>(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース) | 20% |
| 三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド <sup>*2</sup> |   |     |
| —                                   | 無担保コール翌日物レート<br>(短資協会発表)の平均値                    | 3%  |

※ 「国内債券マザーファンド」と「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「国内株式マザーファンド」と「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「世界株式マザーファンド」と「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」の各インデックスは表記の違いはありますが、同一のインデックスです。

※1 「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」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

※2 「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。

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<sup>(注)</sup>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50%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】

### <訂正前>

#### 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せん。）
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せん。）
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<sup>（注）</sup>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 $\pm 50\%$ 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

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。

#### < 訂正後 >

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<sup>1</sup>、三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>、国内株式マザーファンド<sup>1</sup>、三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>、世界債券マザーファンド<sup>1</sup>、三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド<sup>2</sup>、世界株式マザーファンド<sup>1</sup>、三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド<sup>2</sup>、短期資産マザーファンド<sup>1</sup>およびマネー・マーケット・マザーファンド<sup>2</sup>（「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。

<sup>1</sup> 「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」、「短期資産マザーファンド」は、2018年11月14日に投資の対象とするマザーファンドから削除される予定です。

<sup>2</sup> 「三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド」、「三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド」、「マネー・マーケット・マザーファンド」は、2018年7月18日に投資の対象とするマザーファンドの入替えのため、追加される予定です。

- 1．株券または新株引受権証書
- 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<sup>(注)</sup>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±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。

金利先渡し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（FTSE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 $\pm 50\%$ 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。

### 三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

#### （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。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格（S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの）相当以上の格付を有する債券を対象とします。

NOMURA - BPI <総合>（国内債券投資収益指数）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。

経済や金利の分析をベースに、デュレーション・残存構成・債券種別等をコントロールするアクティブ運用を行います。具体的には、次のプロセスによります。

1）経済分析や市場分析等を踏まえて金利の方向性等を予測し、デュレーションに関する戦略

を策定します。

- 2) また、同様の分析を行い金利の期間構造等を予測し、上記のデュレーション戦略を加味して、残存構成に関する戦略を策定します。
  - 3) さらに、各債券種別間の利回り較差動向等を予測し、債券種別構成に関する戦略を策定します。
  - 4) 以上の戦略を総合して、ポートフォリオを構築します。
- 市況動向、資金動向等によっては、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は信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引は信託約款の範囲で行います。

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。

### 三菱UFJ 国内株式アクティブマザーファンド

#### (基本方針)

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

#### (運用方法)

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

銘柄選択にあたっては、以下の2つの観点から行います。

1) 中長期的な成長力の高い銘柄や業績改善度の大きい銘柄を選択

2) 企業価値に対して株価が割安と判断され、かつ株価上昇が期待できる銘柄を選択

具体的には、1) 経営者のリーダーシップ、2) 企業戦略の適切さ、3) マーケット支配力・競争力、4) 産業の循環、産業構造の変化等の定性的な要素を踏まえ、中長期的にみて高い利益成長が期待できる銘柄や業績の大幅な改善が見込める銘柄を選択し、株価の妥当性をチェックしたうえで、組み入れを図ります。なお、株価評価は、企業の利益成長率に見合った適正価値が存在するというGAR P（Growth at Reasonable Price）の考え方をベースに行います。また、各種評価尺度（株価収益率、株価キャッシュフロー倍率、株価売上高倍率、株価純資産倍率、配当利回り等）を用いて行う定量的な分析に、定性的な分析を加えた結果、「現在の株価が妥当株価に比して割安に放置されており、かつ今後株価上昇が期待できる」と判断される銘柄についても、適宜組み入れを図ります。

株式の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。

市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

#### (投資制限)

株式への投資に制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%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は信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引は信託約款の範囲で行います。

### 三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド

#### (基本方針)

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

#### (運用方法)

投資対象

わが国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

FTSE世界国債インデックス（除く日本・円ベース）をベンチマークとし、これを中長期的

に上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、各国のマクロ分析や金利予測に基づいて、カントリーアロケーション、デュレーションおよび残存構成のコントロール、利回り較差に着目した銘柄選択でアクティブに超過収益の獲得を目指します。さらに、ポートフォリオとベンチマークを比較分析することにより、リスクのチェックとコントロールを行います。

組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。ただし、エクスポージャーのコントロール等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

公社債の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。

市況動向、資金動向等によっては、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に制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は信託約款の範囲で行います。

外国為替予約取引は信託約款の範囲で行います。

### 三菱UFJ 海外株式アクティブマザーファンド

#### （基本方針）

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

#### （運用方法）

##### 投資対象

わが国を除く世界主要国の株式を主要投資対象とします。

##### 投資態度

MSCI KOKUSAIインデックス（円換算ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

運用にあたっては、カントリーアロケーションと銘柄選択の双方におけるアクティブ戦略により、超過収益の獲得を目指します。カントリーアロケーションについてはマクロシナリオからのトップダウンアプローチにより決定します。また組入銘柄選択については、企業の成長力と株価を評価することにより決定します。さらに、ポートフォリオとベンチマークを比較分析することにより、リスクのチェックとコントロールを行います。

組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。ただし、エクスポージャーのコントロール等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

株式の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。

市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

#### （投資制限）

株式への投資に制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資に制限を設けません。

有価証券先物取引等は信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引および為替先渡取引は信託約款の範囲で行います。

外国為替予約取引は信託約款の範囲で行います。

### マネー・マーケット・マザーファンド

#### （基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保をめざして安定運用を行います。

#### （運用方法）

##### 投資対象

わが国の公社債等を主要投資対象とします。

##### 投資態度

わが国の短期公社債等を中心に投資し、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）

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

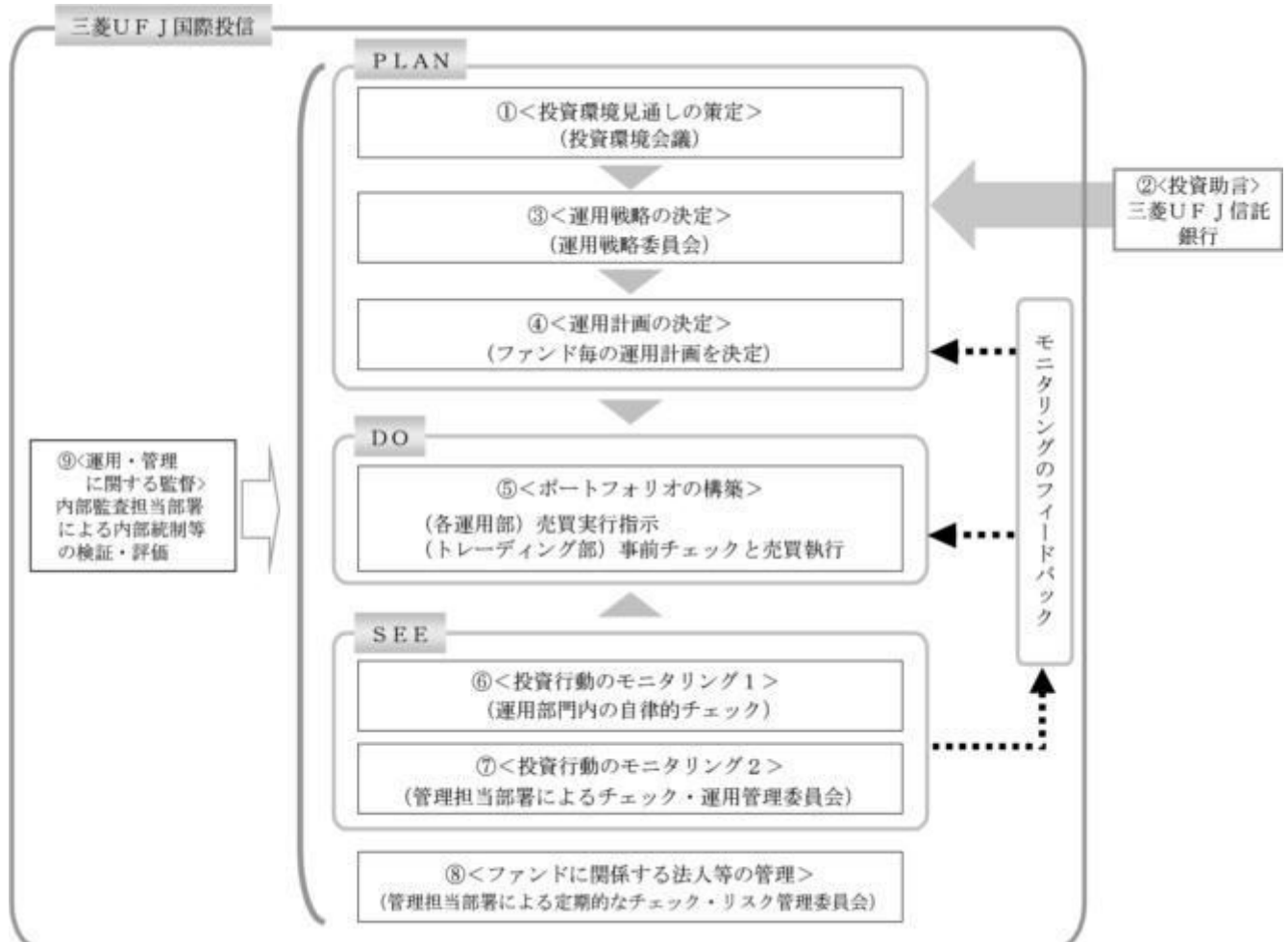
有価証券先物取引等を行うことができます。

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】

<訂正前>



#### 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。

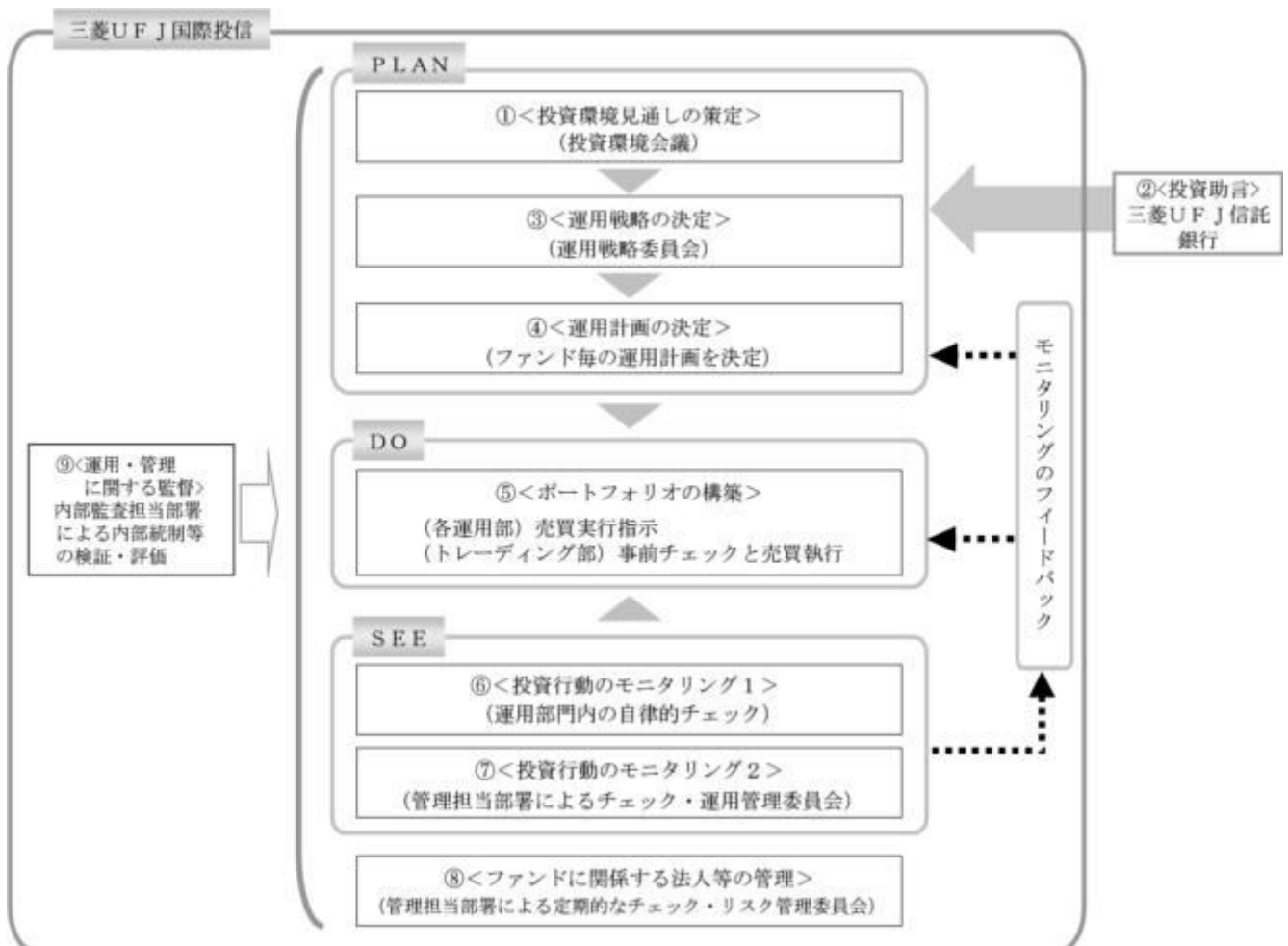
さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

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>

<訂正後>



**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。

**ファンドに關係する法人等の管理**

助言元、受託会社等、ファンドの運営に關係する法人については、その業務に關係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・管理に關係する監督**

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に關係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。

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、委託会社に關係する「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」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

**（5）【投資制限】**

<更新後>

（略）

<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。

（平成30年7月18日以降信託約款に定められた内容は、以下のとおり変更する予定です。）

| 変更後（新） | 変更前（旧） |
|--------|--------|
|--------|--------|

|  |   |
|--|---|
| <p>(投資の対象とする資産の種類等)<br/>第17条(略)</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>   | <p>(投資の対象とする資産の種類等)<br/>第17条(略)</p> <p>&lt;追加&gt;</p>   |
| <p>(投資の対象とする有価証券等)<br/>第18条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とする国内債券マザーファンド、<u>三菱UFJ国内債券アクティブマザーファンド、国内株式マザーファンド、三菱UFJ国内株式アクティブマザーファンド、世界債券マザーファンド、三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンド、世界株式マザーファンド、三菱UFJ海外株式アクティブマザーファンド、短期資産マザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド</u>(以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。<br/>(略)</p> <p>1. ~ 4. (略)</p> <p>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。新株予約権付社債については、<u>転換社債型新株予約権付社債(この信託約款において、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。)</u>に限ります。)</p> | <p>(投資の対象とする有価証券等)<br/>第18条 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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者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(以下これらを総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、次に掲げるものとします。<br/>(略)</p> <p>1. ~ 4. (略)</p> <p>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。)</p> |

6. ~24. (略)

~ (略)

&lt;削除&gt;

&lt;削除&gt;

委託者は、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。

前項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。

6. ~24. (略)

~ (略)

委託者は、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。

前項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。

委託者は、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。

前項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。



|   |   |
|---|---|
| <p>第21条 &lt;削除&gt;</p>  | <p>(同一銘柄の株式等への投資制限)</p> <p>第21条 委託者は、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。</p> <p>前項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。</p> <p>委託者は、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。</p> <p>前項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。</p> |
| <p>(信用取引の指図範囲)</p> <p>第22条 委託者は、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。</p> | <p>(信用取引の指図範囲)</p> <p>第22条 委託者は、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。</p>   |

前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内である場合においてできます。

前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、かつ

- 1．信託財産に属する株券および新株引受権証券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（第26条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す。）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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

<追加>

信託財産の一部解約等の事由により前項の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとし、かつ

第26条 <削除>

（同一銘柄の転換社債等への投資制限）  
第26条 委託者は、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（この信託約款において、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。

前項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。

|  |                   |
|--|-------------------|
| <p><u>（公社債の空売りの指図範囲）</u></p> <p><u>第26条の2 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債または第26条の3の規定により借り入れた公社債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、売り付けた公社債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ものとしします。</u></p> <p><u>前項の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。</u></p> <p><u>信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとしします。</u></p> | <p>&lt;追加&gt;</p> |
| <p><u>（公社債の借入れ）</u></p> <p><u>第26条の3 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとしします。</u></p> <p><u>前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。</u></p> <p><u>信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとしします。</u></p> <p><u>第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。</u></p>          | <p>&lt;追加&gt;</p> |

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### （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すが、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率が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、定期的に関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。

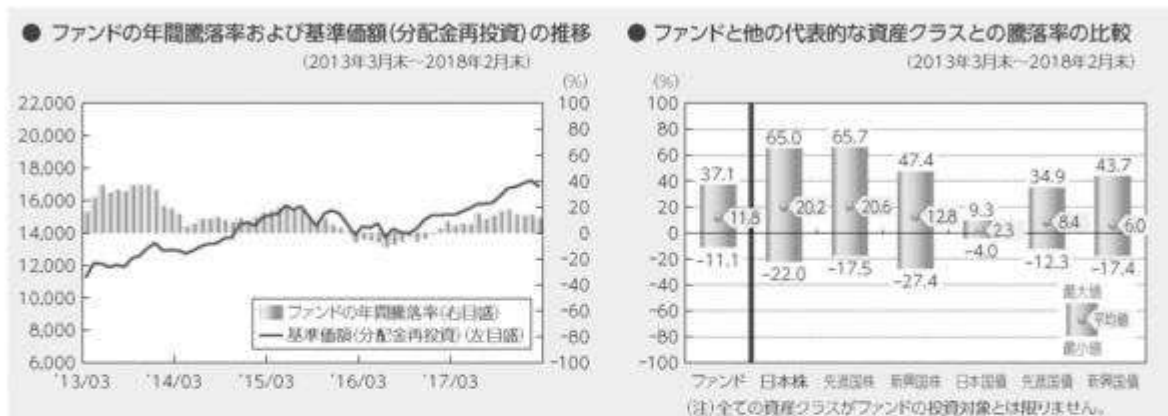
## <流動性リスクに対する管理体制>

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。



- 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、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)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。  |
| 先進国債  | FTSE世界国債インデックス(除く日本)          | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 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。当該指数の著作権は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】

##### (5)【課税上の取扱い】

###### <訂正前>

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、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。

#### <訂正後>

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30年2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（成長型）】

#### （1）【投資状況】

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計        | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券                | 日本   | 213,814,440 | 98.93   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 2,310,239   | 1.07    |
| 純資産総額                    |      | 216,124,679 | 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30年 2月28日現在

| 国/地域 | 種類        | 銘柄名         | 数量         | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（%） |
|------|-----------|-------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内株式マザーファンド | 72,097,027 | 0.9725          | 70,114,359      | 1.0971          | 79,097,648      | 36.60           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券マザーファンド | 47,572,677 | 1.4033          | 66,759,461      | 1.4100          | 67,077,474      | 31.04           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 世界株式マザーファンド | 17,698,671 | 2.2714          | 40,202,059      | 2.6356          | 46,646,617      | 21.58           |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 世界債券マザーファンド | 8,562,159  | 2.5014          | 21,417,976      | 2.4518          | 20,992,701      | 9.71            |



（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30年 2月28日現在

| 種類        | 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30年2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<br>(1万口当たりの純資産価額) |        |
|-------------------------|-------------|-------------|------------------------|--------|
|                         | (分配落)       | (分配付)       | (分配落)                  | (分配付)  |
| 第7計算期間末日 (平成20年 8月14日)  | 98,881,658  | 98,881,658  | 11,784                 | 11,784 |
| 第8計算期間末日 (平成21年 8月14日)  | 86,379,568  | 86,379,568  | 10,008                 | 10,008 |
| 第9計算期間末日 (平成22年 8月16日)  | 99,480,790  | 99,480,790  | 9,297                  | 9,297  |
| 第10計算期間末日 (平成23年 8月15日) | 99,431,096  | 99,431,096  | 9,040                  | 9,040  |
| 第11計算期間末日 (平成24年 8月14日) | 106,267,093 | 106,267,093 | 9,100                  | 9,100  |
| 第12計算期間末日 (平成25年 8月14日) | 145,024,652 | 145,024,652 | 12,227                 | 12,227 |
| 第13計算期間末日 (平成26年 8月14日) | 170,532,423 | 170,532,423 | 13,221                 | 13,221 |
| 第14計算期間末日 (平成27年 8月14日) | 186,278,239 | 186,278,239 | 15,713                 | 15,713 |
| 第15計算期間末日 (平成28年 8月15日) | 173,353,047 | 173,353,047 | 14,026                 | 14,026 |
| 第16計算期間末日 (平成29年 8月14日) | 198,130,035 | 198,130,035 | 15,679                 | 15,679 |
| 平成29年 2月末日              | 185,513,046 |             | 15,133                 |        |
| 3月末日                    | 185,579,835 |             | 15,127                 |        |
| 4月末日                    | 188,427,214 |             | 15,317                 |        |
| 5月末日                    | 192,085,559 |             | 15,541                 |        |
| 6月末日                    | 197,371,197 |             | 15,770                 |        |
| 7月末日                    | 199,188,372 |             | 15,810                 |        |

|            |             |  |        |
|------------|-------------|--|--------|
| 8月末日       | 201,315,897 |  | 15,870 |
| 9月末日       | 206,332,070 |  | 16,311 |
| 10月末日      | 212,904,078 |  | 16,768 |
| 11月末日      | 215,555,665 |  | 16,850 |
| 12月末日      | 217,178,340 |  | 17,062 |
| 平成30年 1月末日 | 219,907,687 |  | 17,230 |
| 2月末日       | 216,124,679 |  | 16,868 |

## 【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    | 12.98  |
| 第8計算期間    | 15.07  |
| 第9計算期間    | 7.10   |
| 第10計算期間   | 2.76   |
| 第11計算期間   | 0.66   |
| 第12計算期間   | 34.36  |
| 第13計算期間   | 8.12   |
| 第14計算期間   | 18.84  |
| 第15計算期間   | 10.73  |
| 第16計算期間   | 11.78  |
| 第17中間計算期間 | 5.26   |

（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    | 12,933,506 | 5,028,832  | 83,913,008  |
| 第8計算期間    | 18,528,760 | 16,130,040 | 86,311,728  |
| 第9計算期間    | 24,778,100 | 4,081,712  | 107,008,116 |
| 第10計算期間   | 12,990,676 | 10,002,731 | 109,996,061 |
| 第11計算期間   | 11,335,821 | 4,561,078  | 116,770,804 |
| 第12計算期間   | 11,339,218 | 9,500,382  | 118,609,640 |
| 第13計算期間   | 19,222,956 | 8,846,722  | 128,985,874 |
| 第14計算期間   | 19,776,567 | 30,211,961 | 118,550,480 |
| 第15計算期間   | 12,378,348 | 7,337,203  | 123,591,625 |
| 第16計算期間   | 18,890,789 | 16,114,136 | 126,368,278 |
| 第17中間計算期間 | 5,069,632  | 3,444,808  | 127,993,102 |

（参考）

## 国内債券マザーファンド

### 投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券                     | 日本   | 2,329,022,589 | 83.23   |
| 特殊債券                     | 日本   | 403,901,000   | 14.43   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 65,322,811    | 2.34    |
| 純資産総額                    |      | 2,798,246,400 | 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。

### 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30年 2月28日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名            | 数量          | 簿価単価<br>(円) | 簿価金額<br>(円) | 評価単価<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資比率<br>(%) |
|------|------|----------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|-----------------|-------------|
| 日本   | 国債証券 | 第129回利付国債（5年）  | 274,400,000 | 100.70      | 276,337,264 | 100.82      | 276,652,824 | 0.100000  | 2021/9/20       | 9.89        |
| 日本   | 国債証券 | 第150回利付国債（20年） | 203,000,000 | 115.84      | 235,167,380 | 116.42      | 236,350,870 | 1.400000  | 2034/9/20       | 8.45        |
| 日本   | 国債証券 | 第132回利付国債（5年）  | 213,000,000 | 100.83      | 214,770,030 | 100.95      | 215,025,630 | 0.100000  | 2022/6/20       | 7.68        |
| 日本   | 国債証券 | 第126回利付国債（5年）  | 198,500,000 | 100.57      | 199,637,405 | 100.67      | 199,839,875 | 0.100000  | 2020/12/20      | 7.14        |

|    |      |                              |             |        |             |        |             |          |            |      |
|----|------|------------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|----------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第124回利付国債(5年)                | 152,500,000 | 100.48 | 153,238,100 | 100.56 | 153,361,625 | 0.100000 | 2020/6/20  | 5.48 |
| 日本 | 国債証券 | 第153回利付国債(20年)               | 124,000,000 | 114.05 | 141,425,720 | 114.74 | 142,288,760 | 1.300000 | 2035/6/20  | 5.08 |
| 日本 | 国債証券 | 第128回利付国債(5年)                | 132,500,000 | 100.67 | 133,393,050 | 100.77 | 133,532,175 | 0.100000 | 2021/6/20  | 4.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第161回利付国債(20年)               | 105,000,000 | 100.69 | 105,732,900 | 101.40 | 106,473,150 | 0.600000 | 2037/6/20  | 3.80 |
| 日本 | 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 | 103.48 | 103,481,000 | 103.67 | 103,678,000 | 0.690000 | 2024/6/28  | 3.71 |
| 日本 | 特殊債券 | 第85回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 100,000,000 | 100.15 | 100,155,000 | 100.16 | 100,167,000 | 0.080000 | 2021/3/19  | 3.58 |
| 日本 | 特殊債券 | 第28回中日本高速道路                  | 100,000,000 | 100.08 | 100,087,000 | 100.04 | 100,042,000 | 0.782000 | 2018/3/20  | 3.58 |
| 日本 | 特殊債券 | 第73回都市再生債券(財投機関債)            | 100,000,000 | 100.02 | 100,026,000 | 100.01 | 100,014,000 | 0.239000 | 2018/3/20  | 3.57 |
| 日本 | 国債証券 | 第341回利付国債(10年)               | 82,500,000  | 102.31 | 84,411,525  | 102.58 | 84,628,500  | 0.300000 | 2025/12/20 | 3.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第159回利付国債(20年)               | 75,000,000  | 101.20 | 75,900,000  | 101.89 | 76,419,750  | 0.600000 | 2036/12/20 | 2.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第119回利付国債(20年)               | 58,000,000  | 119.73 | 69,443,400  | 119.92 | 69,558,820  | 1.800000 | 2030/6/20  | 2.49 |
| 日本 | 国債証券 | 第157回利付国債(20年)               | 64,500,000  | 94.63  | 61,040,865  | 95.28  | 61,461,405  | 0.200000 | 2036/6/20  | 2.20 |
| 日本 | 国債証券 | 第28回利付国債(30年)                | 40,000,000  | 136.04 | 54,417,200  | 136.94 | 54,777,600  | 2.500000 | 2038/3/20  | 1.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第110回利付国債(20年)               | 44,000,000  | 121.76 | 53,578,360  | 121.92 | 53,646,120  | 2.100000 | 2029/3/20  | 1.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第50回利付国債(30年)                | 48,000,000  | 100.57 | 48,276,480  | 101.74 | 48,839,040  | 0.800000 | 2046/3/20  | 1.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第162回利付国債(20年)               | 45,000,000  | 100.52 | 45,238,050  | 101.24 | 45,558,000  | 0.600000 | 2037/9/20  | 1.63 |
| 日本 | 国債証券 | 第35回利付国債(30年)                | 35,000,000  | 128.68 | 45,040,450  | 129.69 | 45,392,900  | 2.000000 | 2041/9/20  | 1.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第127回利付国債(5年)                | 45,000,000  | 100.62 | 45,280,350  | 100.71 | 45,323,550  | 0.100000 | 2021/3/20  | 1.62 |
| 日本 | 国債証券 | 第129回利付国債(20年)               | 35,000,000  | 120.58 | 42,203,700  | 120.88 | 42,310,450  | 1.800000 | 2031/6/20  | 1.51 |
| 日本 | 国債証券 | 第124回利付国債(20年)               | 31,000,000  | 122.64 | 38,019,640  | 122.92 | 38,107,990  | 2.000000 | 2030/12/20 | 1.36 |
| 日本 | 国債証券 | 第46回利付国債(30年)                | 24,000,000  | 118.22 | 28,374,240  | 119.41 | 28,659,840  | 1.500000 | 2045/3/20  | 1.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第88回利付国債(20年)                | 23,500,000  | 118.97 | 27,959,360  | 119.19 | 28,010,120  | 2.300000 | 2026/6/20  | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第158回利付国債(20年)               | 24,000,000  | 99.66  | 23,918,400  | 100.34 | 24,081,600  | 0.500000 | 2036/9/20  | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第8回利付国債(40年)                 | 20,000,000  | 115.35 | 23,070,400  | 117.31 | 23,462,800  | 1.400000 | 2055/3/20  | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第131回利付国債(5年)                | 17,000,000  | 100.78 | 17,133,110  | 100.89 | 17,152,150  | 0.100000 | 2022/3/20  | 0.61 |
| 日本 | 国債証券 | 第343回利付国債(10年)               | 16,000,000  | 100.62 | 16,100,000  | 100.91 | 16,146,080  | 0.100000 | 2026/6/20  | 0.58 |

(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30年 2月28日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|----|---------|
|----|---------|

|      |       |
|------|-------|
| 国債証券 | 83.23 |
| 特殊債券 | 14.43 |
| 合計   | 97.67 |

（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。

#### 国内株式マザーファンド

#### 投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

| 資産の種類                    | 国/地域 | 時価合計          | 投資比率（%） |
|--------------------------|------|---------------|---------|
| 株式                       | 日本   | 1,968,788,760 | 97.47   |
| コール・ローン、その他資産<br>（負債控除後） |      | 51,148,854    | 2.53    |
| 純資産総額                    |      | 2,019,937,614 | 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。

#### 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30年 2月28日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-------------------|--------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 70,500 | 792.00          | 55,836,000      | 762.30          | 53,742,150      | 2.66            |
| 日本   | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 6,000  | 8,688.00        | 52,128,000      | 8,895.00        | 53,370,000      | 2.64            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 10,000 | 4,802.00        | 48,020,000      | 4,686.00        | 46,860,000      | 2.32            |
| 日本   | 株式 | ソニー               | 電気機器   | 8,500  | 5,362.08        | 45,577,743      | 5,442.00        | 46,257,000      | 2.29            |
| 日本   | 株式 | S M C             | 機械     | 1,000  | 49,650.00       | 49,650,000      | 45,030.00       | 45,030,000      | 2.23            |
| 日本   | 株式 | ディスコ              | 機械     | 1,700  | 23,120.25       | 39,304,436      | 25,210.00       | 42,857,000      | 2.12            |
| 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 8,300  | 4,966.00        | 41,217,800      | 4,966.00        | 41,217,800      | 2.04            |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 8,100  | 4,991.00        | 40,427,100      | 4,982.00        | 40,354,200      | 2.00            |

|    |    |                 |          |        |           |            |           |            |      |
|----|----|-----------------|----------|--------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン        | 電気機器     | 1,900  | 18,671.02 | 35,474,940 | 21,060.00 | 40,014,000 | 1.98 |
| 日本 | 株式 | 日本電産            | 電気機器     | 2,300  | 16,215.00 | 37,294,500 | 17,260.00 | 39,698,000 | 1.97 |
| 日本 | 株式 | ヤマハ発動機          | 輸送用機器    | 11,500 | 3,455.00  | 39,732,500 | 3,405.00  | 39,157,500 | 1.94 |
| 日本 | 株式 | デンソー            | 輸送用機器    | 6,200  | 6,461.00  | 40,058,200 | 6,285.00  | 38,967,000 | 1.93 |
| 日本 | 株式 | オリックス           | その他金融業   | 20,300 | 1,899.06  | 38,550,932 | 1,910.00  | 38,773,000 | 1.92 |
| 日本 | 株式 | 小松製作所           | 機械       | 9,900  | 4,035.10  | 39,947,529 | 3,916.00  | 38,768,400 | 1.92 |
| 日本 | 株式 | スズキ             | 輸送用機器    | 6,300  | 6,024.00  | 37,951,200 | 6,146.00  | 38,719,800 | 1.92 |
| 日本 | 株式 | 住友ベークライト        | 化学       | 41,000 | 862.00    | 35,342,000 | 941.00    | 38,581,000 | 1.91 |
| 日本 | 株式 | T D K           | 電気機器     | 3,900  | 9,260.00  | 36,114,000 | 9,770.00  | 38,103,000 | 1.89 |
| 日本 | 株式 | アサヒグループホールディングス | 食料品      | 6,700  | 5,300.00  | 35,510,000 | 5,491.00  | 36,789,700 | 1.82 |
| 日本 | 株式 | 三菱ケミカルホールディングス  | 化学       | 33,000 | 1,088.00  | 35,904,000 | 1,094.00  | 36,102,000 | 1.79 |
| 日本 | 株式 | ヤマハ             | その他製品    | 7,200  | 4,280.00  | 30,816,000 | 4,730.00  | 34,056,000 | 1.69 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業          | 輸送用機器    | 8,700  | 3,840.00  | 33,408,000 | 3,885.00  | 33,799,500 | 1.67 |
| 日本 | 株式 | ダイフク            | 機械       | 4,700  | 6,650.00  | 31,255,000 | 7,060.00  | 33,182,000 | 1.64 |
| 日本 | 株式 | マキタ             | 機械       | 6,500  | 4,979.13  | 32,364,384 | 5,070.00  | 32,955,000 | 1.63 |
| 日本 | 株式 | 第一生命ホールディングス    | 保険業      | 15,400 | 2,224.50  | 34,257,300 | 2,132.00  | 32,832,800 | 1.63 |
| 日本 | 株式 | ニチアス            | ガラス・土石製品 | 22,000 | 1,293.00  | 28,446,000 | 1,427.00  | 31,394,000 | 1.55 |
| 日本 | 株式 | ケーズホールディングス     | 小売業      | 10,100 | 2,994.73  | 30,246,811 | 2,982.00  | 30,118,200 | 1.49 |
| 日本 | 株式 | 三井物産            | 卸売業      | 15,400 | 1,902.24  | 29,294,621 | 1,951.50  | 30,053,100 | 1.49 |
| 日本 | 株式 | J X T Gホールディングス | 石油・石炭製品  | 45,500 | 686.90    | 31,253,950 | 656.00    | 29,848,000 | 1.48 |
| 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・データ    | 情報・通信業   | 26,800 | 1,164.00  | 31,195,200 | 1,112.00  | 29,801,600 | 1.48 |
| 日本 | 株式 | 大成建設            | 建設業      | 5,400  | 5,080.00  | 27,432,000 | 5,450.00  | 29,430,000 | 1.46 |

(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30年 2月28日現在

| 種類 | 業種       | 投資比率(%) |
|----|----------|---------|
| 株式 | 鉱業       | 0.49    |
|    | 建設業      | 2.91    |
|    | 食料品      | 1.82    |
|    | 繊維製品     | 0.68    |
|    | 化学       | 8.97    |
|    | 医薬品      | 1.75    |
|    | 石油・石炭製品  | 1.48    |
|    | ゴム製品     | 0.85    |
|    | ガラス・土石製品 | 2.12    |
|    | 鉄鋼       | 0.86    |
|    | 非鉄金属     | 3.64    |
|    | 金属製品     | 0.90    |
|    | 機械       | 12.50   |

|            |       |
|------------|-------|
| 電気機器       | 12.81 |
| 輸送用機器      | 8.81  |
| 精密機器       | 0.88  |
| その他製品      | 2.71  |
| 陸運業        | 0.49  |
| 情報・通信業     | 6.76  |
| 卸売業        | 3.50  |
| 小売業        | 4.41  |
| 銀行業        | 6.26  |
| 証券、商品先物取引業 | 0.57  |
| 保険業        | 3.67  |
| その他金融業     | 1.92  |
| 不動産業       | 3.18  |
| サービス業      | 2.52  |
| 小計         | 97.47 |
| 合計         | 97.47 |

（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。

#### 世界債券マザーファンド

#### 投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国/地域    | 時価合計        | 投資比率（%） |
|-------|---------|-------------|---------|
| 国債証券  | アメリカ    | 234,059,506 | 40.11   |
|       | フランス    | 99,444,777  | 17.04   |
|       | イギリス    | 40,387,787  | 6.92    |
|       | ドイツ     | 39,906,130  | 6.84    |
|       | アイルランド  | 38,615,317  | 6.62    |
|       | ベルギー    | 30,518,160  | 5.23    |
|       | オーストラリア | 12,643,692  | 2.17    |
|       | オランダ    | 12,442,086  | 2.13    |
|       | カナダ     | 12,003,665  | 2.06    |
|       | オーストリア  | 11,040,522  | 1.89    |

|  |                          |             |        |
|--|--------------------------|-------------|--------|
|  | フィンランド                   | 7,754,685   | 1.33   |
|  | メキシコ                     | 4,574,149   | 0.78   |
|  | ポーランド                    | 4,211,274   | 0.72   |
|  | デンマーク                    | 3,613,402   | 0.62   |
|  | スウェーデン                   | 2,730,150   | 0.47   |
|  | シンガポール                   | 2,386,727   | 0.41   |
|  | マレーシア                    | 2,329,983   | 0.40   |
|  | ノルウェー                    | 1,729,124   | 0.30   |
|  | スイス                      | 1,114,916   | 0.19   |
|  | 小計                       | 561,506,052 | 96.22  |
|  | コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | 22,044,325  | 3.78   |
|  | 純資産総額                    | 583,550,377 | 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。

## 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30年 2月28日現在

| 国/<br>地域   | 種類   | 銘柄名                      | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------------|------|--------------------------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------------|-----------------|
| アメリカ       | 国債証券 | 1.25 T-NOTE 191031       | 495,000 | 10,589.78       | 52,419,437      | 10,567.13       | 52,307,328      | 1.250000  | 2019/10/31      | 8.96            |
| アメリカ       | 国債証券 | 3.625 T-NOTE<br>210215   | 389,000 | 11,157.25       | 43,401,714      | 11,098.11       | 43,171,669      | 3.625000  | 2021/2/15       | 7.40            |
| フランス       | 国債証券 | 0.5 O.A.T 250525         | 291,000 | 13,132.20       | 38,214,705      | 13,122.09       | 38,185,289      | 0.500000  | 2025/5/25       | 6.54            |
| アメリカ       | 国債証券 | 2.125 T-NOTE<br>250515   | 345,000 | 10,332.68       | 35,647,763      | 10,227.83       | 35,286,017      | 2.125000  | 2025/5/15       | 6.05            |
| アメリカ       | 国債証券 | 4.375 T-BOND<br>380215   | 210,000 | 13,088.23       | 27,485,293      | 12,834.90       | 26,953,309      | 4.375000  | 2038/2/15       | 4.62            |
| アメリカ       | 国債証券 | 1.75 T-NOTE 230131       | 230,000 | 10,352.81       | 23,811,478      | 10,284.03       | 23,653,275      | 1.750000  | 2023/1/31       | 4.05            |
| フランス       | 国債証券 | 5.5 O.A.T 290425         | 105,000 | 19,450.56       | 20,423,088      | 19,416.41       | 20,387,236      | 5.500000  | 2029/4/25       | 3.49            |
| アメリカ       | 国債証券 | 1.875 T-NOTE<br>200630   | 179,000 | 10,658.56       | 19,078,838      | 10,622.91       | 19,015,025      | 1.875000  | 2020/6/30       | 3.26            |
| アメリカ       | 国債証券 | 2.75 T-BOND 420815       | 185,000 | 10,243.76       | 18,950,972      | 10,004.70       | 18,508,700      | 2.750000  | 2042/8/15       | 3.17            |
| ベルギー       | 国債証券 | 4.25 BEL GOVT<br>220928  | 114,000 | 15,710.47       | 17,909,941      | 15,683.73       | 17,879,455      | 4.250000  | 2022/9/28       | 3.06            |
| フランス       | 国債証券 | 4 O.A.T 550425           | 74,000  | 20,901.57       | 15,467,164      | 20,863.84       | 15,439,245      | 4.000000  | 2055/4/25       | 2.65            |
| アイルラ<br>ンド | 国債証券 | 2.4 IRISH GOVT<br>300515 | 103,000 | 14,881.84       | 15,328,301      | 14,816.77       | 15,261,274      | 2.400000  | 2030/5/15       | 2.62            |
| アイルラ<br>ンド | 国債証券 | 2 IRISH GOVT<br>450218   | 104,000 | 13,757.57       | 14,307,882      | 13,661.98       | 14,208,461      | 2.000000  | 2045/2/18       | 2.43            |
| フランス       | 国債証券 | 3.75 O.A.T 210425        | 93,000  | 14,820.33       | 13,782,907      | 14,793.24       | 13,757,720      | 3.750000  | 2021/4/25       | 2.36            |
| アメリカ       | 国債証券 | 2.375 T-NOTE<br>240815   | 126,000 | 10,555.81       | 13,300,325      | 10,461.86       | 13,181,949      | 2.375000  | 2024/8/15       | 2.26            |
| イギリス       | 国債証券 | 4.25 GILT 360307         | 63,000  | 20,345.15       | 12,817,446      | 20,270.10       | 12,770,166      | 4.250000  | 2036/3/7        | 2.19            |
| ドイツ        | 国債証券 | 1.5 BUND 240515          | 90,000  | 14,174.36       | 12,756,929      | 14,166.22       | 12,749,603      | 1.500000  | 2024/5/15       | 2.18            |
| ベルギー       | 国債証券 | 3.75 BEL GOVT<br>200928  | 87,000  | 14,562.18       | 12,669,098      | 14,527.24       | 12,638,705      | 3.750000  | 2020/9/28       | 2.17            |



|         |      |                             |         |           |            |           |            |          |            |      |
|---------|------|-----------------------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|----------|------------|------|
| オランダ    | 国債証券 | 2.25 NETH GOVT<br>220715    | 86,000  | 14,475.64 | 12,449,052 | 14,467.54 | 12,442,086 | 2.250000 | 2022/7/15  | 2.13 |
| カナダ     | 国債証券 | 2.5 CAN GOVT<br>240601      | 140,000 | 8,542.26  | 11,959,175 | 8,574.04  | 12,003,665 | 2.500000 | 2024/6/1   | 2.06 |
| フランス    | 国債証券 | 3.75 O.A.T 191025           | 83,000  | 14,096.97 | 11,700,492 | 14,066.61 | 11,675,287 | 3.750000 | 2019/10/25 | 2.00 |
| ドイツ     | 国債証券 | 4.25 BUND 390704            | 53,000  | 20,869.80 | 11,060,996 | 20,846.83 | 11,048,820 | 4.250000 | 2039/7/4   | 1.89 |
| オーストリア  | 国債証券 | 4.35 AUSTRIA GOVT<br>190315 | 80,000  | 13,838.61 | 11,070,895 | 13,800.65 | 11,040,522 | 4.350000 | 2019/3/15  | 1.89 |
| イギリス    | 国債証券 | 4.25 GILT 551207            | 43,000  | 24,957.31 | 10,731,646 | 24,890.56 | 10,702,943 | 4.250000 | 2055/12/7  | 1.83 |
| オーストラリア | 国債証券 | 3.25 AUST GOVT<br>250421    | 122,000 | 8,688.60  | 10,600,093 | 8,730.71  | 10,651,473 | 3.250000 | 2025/4/21  | 1.83 |
| アイルランド  | 国債証券 | 5.9 IRISH GOVT<br>191018    | 63,000  | 14,546.66 | 9,164,398  | 14,516.79 | 9,145,582  | 5.900000 | 2019/10/18 | 1.57 |
| イギリス    | 国債証券 | 3.75 GILT 200907            | 57,000  | 16,076.01 | 9,163,330  | 16,015.30 | 9,128,721  | 3.750000 | 2020/9/7   | 1.56 |
| ドイツ     | 国債証券 | 2.25 BUND 210904            | 61,000  | 14,309.05 | 8,728,526  | 14,298.25 | 8,721,936  | 2.250000 | 2021/9/4   | 1.49 |
| フィンランド  | 国債証券 | 0.375 FINNISH GOV<br>200915 | 58,000  | 13,379.20 | 7,759,939  | 13,370.14 | 7,754,685  | 0.375000 | 2020/9/15  | 1.33 |
| ドイツ     | 国債証券 | 4.75 BUND 280704            | 40,000  | 18,454.17 | 7,381,670  | 18,464.42 | 7,385,771  | 4.750000 | 2028/7/4   | 1.27 |

（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30年 2月28日現在

| 種類   | 投資比率（%） |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.22   |
| 合計   | 96.22   |

（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。

#### 世界株式マザーファンド

#### 投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

| 資産の種類 | 国 / 地域  | 時価合計        | 投資比率（%） |
|-------|---------|-------------|---------|
| 株式    | アメリカ    | 829,031,682 | 72.76   |
|       | イギリス    | 76,279,434  | 6.70    |
|       | スウェーデン  | 63,776,773  | 5.60    |
|       | オーストラリア | 27,222,857  | 2.39    |

|  |                          |               |        |
|--|--------------------------|---------------|--------|
|  | オランダ                     | 22,448,118    | 1.97   |
|  | ドイツ                      | 21,966,705    | 1.93   |
|  | スイス                      | 16,966,717    | 1.49   |
|  | 香港                       | 15,701,871    | 1.38   |
|  | デンマーク                    | 13,113,588    | 1.15   |
|  | フランス                     | 11,393,227    | 1.00   |
|  | スペイン                     | 7,718,809     | 0.68   |
|  | フィンランド                   | 6,577,837     | 0.58   |
|  | 小計                       | 1,112,197,618 | 97.62  |
|  | コール・ローン、その他資産<br>(負債控除後) | 27,130,615    | 2.38   |
|  | 純資産総額                    | 1,139,328,233 | 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。

## 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30年 2月28日現在

| 国/<br>地域 | 種類 | 銘柄名                          | 業種                     | 数量    | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|------------------------------|------------------------|-------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| アメリカ     | 株式 | AMAZON.COM INC               | 小売                     | 362   | 154,917.73      | 56,080,219      | 162,341.29      | 58,767,548      | 5.16            |
| アメリカ     | 株式 | GRUBHUB INC                  | ソフトウェア・サービス            | 3,056 | 7,397.79        | 22,607,655      | 10,621.04       | 32,457,899      | 2.85            |
| アメリカ     | 株式 | FIRST REPUBLIC BANK/CA       | 銀行                     | 2,862 | 9,620.35        | 27,533,447      | 10,153.98       | 29,060,693      | 2.55            |
| アメリカ     | 株式 | ABIOMED INC                  | ヘルスケア<br>機器・サービス       | 912   | 24,921.65       | 22,728,546      | 29,124.11       | 26,561,191      | 2.33            |
| アメリカ     | 株式 | MASTERCARD INC - A           | ソフトウェア・サービス            | 1,403 | 18,175.59       | 25,500,358      | 18,889.60       | 26,502,115      | 2.33            |
| アメリカ     | 株式 | NETFLIX INC                  | 小売                     | 845   | 28,865.09       | 24,391,004      | 31,202.79       | 26,366,362      | 2.31            |
| アメリカ     | 株式 | ILLUMINA INC                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 980   | 23,707.29       | 23,233,150      | 24,666.11       | 24,172,788      | 2.12            |
| アメリカ     | 株式 | FACEBOOK INC-A               | ソフトウェア・サービス            | 1,197 | 19,896.73       | 23,816,391      | 19,483.36       | 23,321,582      | 2.05            |
| アメリカ     | 株式 | TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 各種金融                   | 3,714 | 6,197.39        | 23,017,130      | 6,253.22        | 23,224,492      | 2.04            |
| アメリカ     | 株式 | ALPHABET INC-CL C            | ソフトウェア・サービス            | 178   | 116,024.02      | 20,652,276      | 120,070.79      | 21,372,602      | 1.88            |
| アメリカ     | 株式 | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 家庭用品・パーソナル用品           | 1,413 | 14,733.31       | 20,818,169      | 15,008.17       | 21,206,556      | 1.86            |
| アメリカ     | 株式 | EOG RESOURCES INC            | エネルギー                  | 1,564 | 11,624.95       | 18,181,422      | 11,482.14       | 17,958,079      | 1.58            |
| アメリカ     | 株式 | INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A | 各種金融                   | 2,357 | 6,806.18        | 16,042,176      | 7,537.37        | 17,765,590      | 1.56            |
| アメリカ     | 株式 | MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 各種金融                   | 783   | 20,965.06       | 16,415,646      | 21,582.44       | 16,899,053      | 1.48            |

|        |    |                             |                        |       |            |            |            |            |      |
|--------|----|-----------------------------|------------------------|-------|------------|------------|------------|------------|------|
| アメリカ   | 株式 | TESLA INC                   | 自動車・自動車部品              | 418   | 35,858.35  | 14,988,794 | 37,685.79  | 15,752,663 | 1.38 |
| アメリカ   | 株式 | WATERS CORP                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 665   | 21,766.04  | 14,474,420 | 22,130.03  | 14,716,470 | 1.29 |
| アメリカ   | 株式 | MARKEL CORP                 | 保険                     | 122   | 117,570.14 | 14,343,558 | 120,586.17 | 14,711,513 | 1.29 |
| アメリカ   | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 1,454 | 9,806.10   | 14,258,072 | 10,114.25  | 14,706,125 | 1.29 |
| アメリカ   | 株式 | AMERICAN EXPRESS CO         | 各種金融                   | 1,329 | 10,112.10  | 13,438,989 | 10,691.90  | 14,209,541 | 1.25 |
| アメリカ   | 株式 | M & T BANK CORP             | 銀行                     | 678   | 19,869.89  | 13,471,787 | 20,635.44  | 13,990,829 | 1.23 |
| アメリカ   | 株式 | NVIDIA CORP                 | 半導体・半導体製造装置            | 527   | 24,220.52  | 12,764,217 | 26,419.46  | 13,923,057 | 1.22 |
| アメリカ   | 株式 | WATSCO INC                  | 資本財                    | 746   | 18,220.68  | 13,592,634 | 17,938.30  | 13,381,976 | 1.17 |
| アメリカ   | 株式 | TABLEAU SOFTWARE INC-CL A   | ソフトウェア・サービス            | 1,519 | 8,514.44   | 12,933,436 | 8,778.57   | 13,334,650 | 1.17 |
| アメリカ   | 株式 | MARTIN MARIETTA MATERIALS   | 素材                     | 587   | 22,597.09  | 13,264,492 | 22,139.69  | 12,996,000 | 1.14 |
| アメリカ   | 株式 | WAYFAIR INC- CLASS A        | 小売                     | 1,533 | 9,876.96   | 15,141,389 | 8,189.10   | 12,553,905 | 1.10 |
| アメリカ   | 株式 | MOODY'S CORP                | 各種金融                   | 692   | 16,958.01  | 11,734,949 | 18,077.88  | 12,509,898 | 1.10 |
| アメリカ   | 株式 | VERISK ANALYTICS INC        | 商業・専門サービス              | 1,072 | 10,201.22  | 10,935,712 | 11,066.62  | 11,863,423 | 1.04 |
| アメリカ   | 株式 | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 877   | 13,139.32  | 11,523,191 | 13,237.64  | 11,609,417 | 1.02 |
| スウェーデン | 株式 | INVESTOR AB-B SHS           | 各種金融                   | 2,333 | 4,663.10   | 10,879,022 | 4,876.96   | 11,377,948 | 1.00 |
| スウェーデン | 株式 | ATLAS COPCO AB-A SHS        | 資本財                    | 2,439 | 4,432.29   | 10,810,370 | 4,631.80   | 11,296,980 | 0.99 |

(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30年 2月28日現在

| 種類 | 業種                     | 投資比率 (%) |
|----|------------------------|----------|
| 株式 | エネルギー                  | 2.14     |
|    | 素材                     | 4.10     |
|    | 資本財                    | 10.90    |
|    | 商業・専門サービス              | 2.55     |
|    | 運輸                     | 2.33     |
|    | 自動車・自動車部品              | 1.38     |
|    | 耐久消費財・アパレル             | 1.90     |
|    | 消費者サービス                | 0.32     |
|    | 小売                     | 12.44    |
|    | 食品・生活必需品小売り            | 0.28     |
|    | 食品・飲料・タバコ              | 1.35     |
|    | 家庭用品・パーソナル用品           | 2.38     |
|    | ヘルスケア機器・サービス           | 5.81     |
|    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.19     |

|                    |       |
|--------------------|-------|
| 銀行                 | 5.05  |
| 各種金融               | 11.65 |
| 保険                 | 2.32  |
| 不動産                | 0.44  |
| ソフトウェア・サービス        | 17.30 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 0.90  |
| 半導体・半導体製造装置        | 2.87  |
| 小計                 | 97.62 |
| 合計                 | 97.62 |

（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。

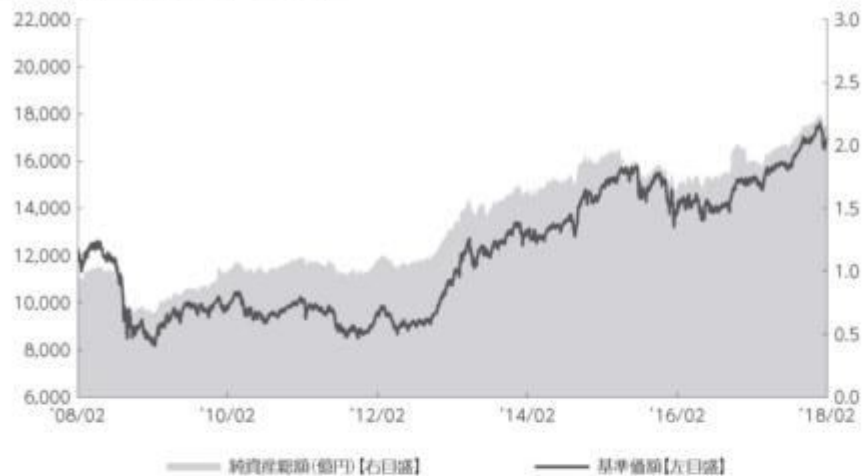
#### 参考情報



## 運用実績

2018年2月28日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2008年2月29日～2018年2月28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  | 16,868円 |
| 純資産総額 | 2.1億円   |

### ■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               | 35.7%  | 円          | 69.5%  | AMAZON.COM INC    | 株式 | 小売     | アメリカ | 1.1% |
| 国内債券               | 30.3%  | アメリカドル     | 19.7%  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 銀行業    | 日本   | 1.0% |
| 外国株式               | 21.1%  | ユーロ        | 5.4%   | ソフトバンクグループ        | 株式 | 情報・通信業 | 日本   | 1.0% |
| 外国債券               | 9.3%   | イギリスポンド    | 2.1%   | 三井住友フィナンシャルグループ   | 株式 | 銀行業    | 日本   | 0.8% |
|                    |        | スウェーデンクローネ | 1.3%   | ソニー               | 株式 | 電気機器   | 日本   | 0.8% |
|                    |        | 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   | 3.1% |
|                    |        | スイスフラン     | 0.3%   | 第150回利付国債(20年)    | 債券 | 国債     | 日本   | 2.6% |
|                    |        | デンマーククローネ  | 0.3%   | 第132回利付国債(5年)     | 債券 | 国債     | 日本   | 2.4% |
|                    |        | その他        | 0.7%   | 第126回利付国債(5年)     | 債券 | 国債     | 日本   | 2.2% |
| コールローン他<br>(負債控除後) | 3.6%   |            |        | 第124回利付国債(5年)     | 債券 | 国債     | 日本   | 1.7% |
| 合計                 | 100.0% | 合計         | 100.0% |                   |    |        |      |      |

●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)

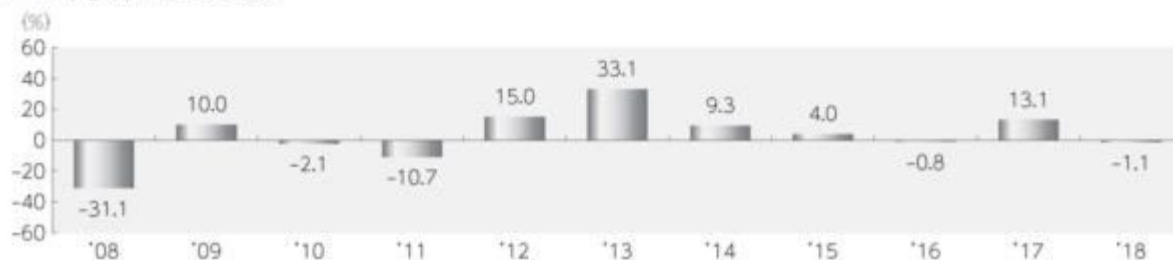
●投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示

●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

●外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

### ■年間収益率の推移



●収益率は基準価額で計算

●2018年は年初から2月28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。

## 1【申込（販売）手続等】

## &lt;訂正前&gt;

## 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。

## &lt;訂正後&gt;

## 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 <https://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】****<訂正前>****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、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す。

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。

### <訂正後>

#### 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 <https://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、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す。

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】

##### <訂正前>

##### 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/>

#### <訂正後>

#### 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 <https://www.am.mufg.jp/>

### （５）【その他】

#### <訂正前>

##### 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10億口を下回るようになった場合
- ・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いに関する契約」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。

#### <訂正後>

##### 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。

<https://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。

## 第3【ファンドの経理状況】

1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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、当中間計算期間（平成29年8月15日から平成30年2月14日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【三菱UFJ &lt;DC&gt;ライフ・バランスファンド（成長型）】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第16期<br>[平成29年8月14日現在] | 第17期中間計算期間末<br>[平成30年2月14日現在] |
|-----------------|------------------------|-------------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                        |                               |
| 流動資産            |                        |                               |
| コール・ローン         | 4,241,949              | 4,056,015                     |
| 親投資信託受益証券       | 195,675,976            | 208,924,984                   |
| 流動資産合計          | 199,917,925            | 212,980,999                   |
| 資産合計            | 199,917,925            | 212,980,999                   |
| <b>負債の部</b>     |                        |                               |
| 流動負債            |                        |                               |
| 未払解約金           | 251,471                | -                             |
| 未払受託者報酬         | 81,750                 | 92,417                        |
| 未払委託者報酬         | 1,451,051              | 1,640,359                     |
| 未払利息            | 4                      | 4                             |
| その他未払費用         | 3,614                  | 4,095                         |
| 流動負債合計          | 1,787,890              | 1,736,875                     |
| 負債合計            | 1,787,890              | 1,736,875                     |
| <b>純資産の部</b>    |                        |                               |
| 元本等             |                        |                               |
| 元本              | 126,368,278            | 127,993,102                   |
| 剰余金             |                        |                               |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 71,761,757             | 83,251,022                    |
| （分配準備積立金）       | 43,102,838             | 41,951,288                    |
| 元本等合計           | 198,130,035            | 211,244,124                   |
| 純資産合計           | 198,130,035            | 211,244,124                   |
| 負債純資産合計         | 199,917,925            | 212,980,999                   |

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|             | 第16期中間計算期間<br>自平成28年8月16日<br>至平成29年2月15日 | 第17期中間計算期間<br>自平成29年8月15日<br>至平成30年2月14日 |
|-------------|--|--|
| <b>営業収益</b> |  |  |
| 受取利息        | 17                                       | 11                                       |
| 有価証券売買等損益   | 17,726,505                               | 12,149,008                               |

|   | 第16期中間計算期間<br>自 平成28年 8月16日<br>至 平成29年 2月15日 | 第17期中間計算期間<br>自 平成29年 8月15日<br>至 平成30年 2月14日 |
|---|--|--|
| 営業収益合計                                    | 17,726,522                                   | 12,149,019                                   |
| 営業費用                                      |  |  |
| 支払利息                                      | 696  | 792  |
| 受託者報酬                                     | 80,586                                       | 92,417                                       |
| 委託者報酬                                     | 1,430,341                                    | 1,640,359                                    |
| その他費用                                     | 3,558  | 4,095  |
| 営業費用合計                                    | 1,515,181                                    | 1,737,663                                    |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 16,211,341                                   | 10,411,356                                   |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 16,211,341                                   | 10,411,356                                   |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           | 16,211,341                                   | 10,411,356                                   |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） | 1,401,736                                    | 356,270                                      |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 49,761,422                                   | 71,761,757                                   |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 5,649,764                                    | 3,395,256                                    |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 5,649,764                                    | 3,395,256                                    |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 5,492,347                                    | 1,961,077                                    |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 5,492,347                                    | 1,961,077                                    |
| 分配金                                       | -  | -  |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 64,728,444                                   | 83,251,022                                   |

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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。 |
|--------------------|---|

( 中間貸借対照表に関する注記 )

|           | 第16期<br>[平成29年 8月14日現在] | 第17期中間計算期間末<br>[平成30年 2月14日現在] |
|-----------|-------------------------|--------------------------------|
| 1. 期首元本額  | 123,591,625円            | 126,368,278円                   |
| 期中追加設定元本額 | 18,890,789円             | 5,069,632円                     |
| 期中一部解約元本額 | 16,114,136円             | 3,444,808円                     |
| 2. 受益権の総数 | 126,368,278口            | 127,993,102口                   |

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

| 第16期中間計算期間<br>自 平成28年 8月16日<br>至 平成29年 2月15日 | 第17期中間計算期間<br>自 平成29年 8月15日<br>至 平成30年 2月14日 |
|--|--|
| 該当事項はありません。                                  | 該当事項はありません。                                  |



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 第16期<br>[平成29年 8月14日現在]   | 第17期中間計算期間末<br>[平成30年 2月14日現在]   |
|----------------------------|---|--|
| 1. 中間貸借対照表計上額、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                 | <p>(1) 有価証券<br/>           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>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           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>(1) 有価証券<br/>           同左</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>           同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           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 | 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つた場合、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）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報）

|              | 第16期<br>[平成29年 8月14日現在] | 第17期中間計算期間末<br>[平成30年 2月14日現在] |
|--------------|-------------------------|--------------------------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.5679円                 | 1.6504円                        |
| (1万口当たり純資産額) | (15,679円)               | (16,504円)                      |

（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。  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## 国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月14日現在]

|             |               |
|-------------|---------------|
| 資産の部        |               |
| 流動資産        |               |
| コール・ローン     | 101,223,527   |
| 国債証券        | 2,324,474,856 |
| 特殊債券        | 403,797,000   |
| 未収利息        | 4,801,733     |
| 前払費用        | 79,981        |
| 流動資産合計      | 2,834,377,097 |
| 資産合計        | 2,834,377,097 |
| 負債の部        |               |
| 流動負債        |               |
| 未払利息        | 108           |
| 流動負債合計      | 108           |
| 負債合計        | 108           |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 2,013,966,507 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 820,410,482   |
| 元本等合計       | 2,834,376,989 |
| 純資産合計       | 2,834,376,989 |
| 負債純資産合計     | 2,834,377,097 |

### 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30年 2月14日現在] |
|-----------|-----------------|
| 1. 期首     | 平成29年 8月15日     |
| 期首元本額     | 1,981,153,090円  |
| 期中追加設定元本額 | 345,759,568円    |
| 期中一部解約元本額 | 312,946,151円    |

|                               | [平成30年 2月14日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 元本の内訳                         |                 |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定型）       | 391,252,653円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定成長型）     | 232,316,389円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（成長型）       | 159,496,708円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（積極型）       | 155,533,725円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020      | 94,006,486円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030      | 257,810,335円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040      | 187,643,531円    |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定型）   | 80,133,579円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型） | 105,955,635円    |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）   | 48,354,245円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（積極型）   | 44,069,053円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020 | 57,542,095円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030 | 114,153,799円    |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040 | 85,698,274円     |
| 合計                            | 2,013,966,507円  |
| 2. 受益権の総数                     | 2,013,966,507口  |

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）

金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | [平成30年 2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                 | <p>(1) 有価証券<br/>           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>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           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> |
| 3. 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。   |

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報）

|              | [平成30年 2月14日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.4074円         |
| (1万口当たり純資産額) | (14,074円)       |

## 国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月14日現在]

|             |               |
|-------------|---------------|
| 資産の部        |               |
| 流動資産        |               |
| コール・ローン     | 122,583,941   |
| 株式          | 1,885,011,620 |
| 未収配当金       | 2,630,900     |
| 流動資産合計      | 2,010,226,461 |
| 資産合計        | 2,010,226,461 |
| 負債の部        |               |
| 流動負債        |               |
| 未払金         | 96,295,482    |
| 未払利息        | 131           |
| 流動負債合計      | 96,295,613    |
| 負債合計        | 96,295,613    |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 1,820,843,694 |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 93,087,154    |
| 元本等合計       | 1,913,930,848 |
| 純資産合計       | 1,913,930,848 |
| 負債純資産合計     | 2,010,226,461 |

## 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30年 2月14日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                         | 平成29年 8月15日     |
| 期首元本額                         | 1,983,655,647円  |
| 期中追加設定元本額                     | 224,119,739円    |
| 期中一部解約元本額                     | 386,931,692円    |
| 元本の内訳                         |                 |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定型）       | 184,100,928円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（安定成長型）     | 221,648,483円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（成長型）       | 234,519,648円    |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド（積極型）       | 309,532,158円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020      | 49,497,814円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030      | 140,878,076円    |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040      | 194,514,060円    |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定型）   | 37,743,282円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（安定成長型） | 101,101,635円    |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）   | 71,071,573円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（積極型）   | 87,671,358円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020 | 29,602,896円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030 | 66,431,347円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040 | 92,530,436円     |
| 合計                            | 1,820,843,694円  |
| 2. 受益権の総数                     | 1,820,843,694口  |

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）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | [平成30年 2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           | <p>(1) 有価証券<br/>           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>(2) デリバティブ取引<br/>           デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品<br/>           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> |

| 区分                        | [平成30年 2月14日現在]   |
|---------------------------|---|
| 3.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。 |

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報）

|              | [平成30年 2月14日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0511円         |
| (1万口当たり純資産額) | (10,511円)       |

## 世界債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月14日現在]

|              |             |
|--------------|-------------|
| <b>資産の部</b>  |             |
| 流動資産         |             |
| 預金           | 176,844     |
| コール・ローン      | 17,160,853  |
| 国債証券         | 567,382,083 |
| 未収利息         | 6,596,526   |
| 前払費用         | 335,763     |
| 流動資産合計       | 591,652,069 |
| 資産合計         | 591,652,069 |
| <b>負債の部</b>  |             |
| 流動負債         |             |
| 未払利息         | 18          |
| 流動負債合計       | 18          |
| 負債合計         | 18          |
| <b>純資産の部</b> |             |
| 元本等          |             |
| 元本           | 239,108,866 |
| 剰余金          |             |
| 剰余金又は欠損金（ ）  | 352,543,185 |
| 元本等合計        | 591,652,051 |

[平成30年 2月14日現在]

|         |             |
|---------|-------------|
| 純資産合計   | 591,652,051 |
| 負債純資産合計 | 591,652,069 |

## 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<br>「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30年 2月14日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 1. 期首                         | 平成29年 8月15日     |
| 期首元本額                         | 250,502,601円    |
| 期中追加設定元本額                     | 26,152,746円     |
| 期中一部解約元本額                     | 37,546,481円     |
| 元本の内訳                         |                 |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)       | 38,163,335円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)     | 30,909,583円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)       | 28,099,272円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)       | 15,517,086円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020      | 9,006,047円      |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030      | 26,545,285円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040      | 26,222,313円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)   | 7,823,309円      |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型) | 14,102,271円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)   | 8,521,534円      |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)   | 4,392,732円      |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2020 | 5,517,041円      |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030 | 11,991,604円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040 | 12,297,454円     |
| 合計                            | 239,108,866円    |
| 2. 受益権の総数                     | 239,108,866口    |

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)

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | [平成30年 2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                 | (1) 有価証券<br>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。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>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。 |
| 3. 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。  |

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報）

|              | [平成30年 2月14日現在] |
|--------------|-----------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.4744円         |
| (1万口当たり純資産額) | (24,744円)       |

## 世界株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月14日現在]

|         |            |
|---------|------------|
| 資産の部    |            |
| 流動資産    |            |
| 預金      | 303,349    |
| コール・ローン | 30,093,641 |



[平成30年 2月14日現在]

|             |               |
|-------------|---------------|
| 株式          | 1,073,881,112 |
| 未収配当金       | 250,116       |
| 流動資産合計      | 1,104,528,218 |
| 資産合計        | 1,104,528,218 |
| 負債の部        |               |
| 流動負債        |               |
| 未払利息        | 32            |
| 流動負債合計      | 32            |
| 負債合計        | 32            |
| 純資産の部       |               |
| 元本等         |               |
| 元本          | 433,623,336   |
| 剰余金         |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 670,904,850   |
| 元本等合計       | 1,104,528,186 |
| 純資産合計       | 1,104,528,186 |
| 負債純資産合計     | 1,104,528,218 |

## 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<br>「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30年 2月14日現在] |
|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首                       | 平成29年 8月15日     |
| 期首元本額                       | 458,687,367円    |
| 期中追加設定元本額                   | 60,621,797円     |
| 期中一部解約元本額                   | 85,685,828円     |
| 元本の内訳                       |                 |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)     | 40,978,427円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)   | 48,781,595円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)     | 58,385,262円     |
| 三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)     | 83,956,581円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2020    | 11,619,571円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030    | 31,323,121円     |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040    | 44,120,063円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型) | 8,401,409円      |

|                               | [平成30年 2月14日現在] |
|-------------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型) | 22,251,806円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)   | 17,698,731円     |
| 三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)   | 23,811,944円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーフアンド 2020  | 6,883,606円      |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーフアンド 2030  | 14,127,515円     |
| 三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤーフアンド 2040  | 21,283,705円     |
| 合計                            | 433,623,336円    |
| 2. 受益権の総数                     | 433,623,336口    |

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)

金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | [平成30年 2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                 | (1) 有価証券<br>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。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引は、該当事項はありません。<br>(3) 上記以外の金融商品<br>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。 |
| 3. 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。  |

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(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。

(1口当たり情報)

| [平成30年 2月14日現在] |           |
|-----------------|-----------|
| 1口当たり純資産額       | 2.5472円   |
| (1万口当たり純資産額)    | (25,472円) |

## 2【ファンドの現況】

### 【三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)】

#### 【純資産額計算書】

平成30年 2月28日現在

(単位:円)

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 216,258,442  |
| 負債総額            | 133,763      |
| 純資産総額( - )      | 216,124,679  |
| 発行済口数           | 128,127,366口 |
| 1口当たり純資産価額( / ) | 1.6868       |
| (10,000口当たり)    | (16,868)     |

(参考)

### 国内債券マザーファンド

#### 純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

(単位:円)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 2,798,246,491  |
| 負債総額            | 91             |
| 純資産総額( - )      | 2,798,246,400  |
| 発行済口数           | 1,984,554,877口 |
| 1口当たり純資産価額( / ) | 1.4100         |
| (10,000口当たり)    | (14,100)       |

### 国内株式マザーファンド

#### 純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

(単位:円)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 2,019,937,687  |
| 負債総額            | 73             |
| 純資産総額（ - ）      | 2,019,937,614  |
| 発行済口数           | 1,841,241,304口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.0971         |
| （10,000口当たり）    | （10,971）       |

## 世界債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 資産総額            | 583,550,399  |
| 負債総額            | 22           |
| 純資産総額（ - ）      | 583,550,377  |
| 発行済口数           | 238,006,550口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.4518       |
| （10,000口当たり）    | （24,518）     |

## 世界株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| 資産総額            | 1,139,328,272 |
| 負債総額            | 39            |
| 純資産総額（ - ）      | 1,139,328,233 |
| 発行済口数           | 432,280,890口  |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 2.6356        |
| （10,000口当たり）    | （26,356）      |

## 第三部【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】

<更新後>

##### (1) 資本金の額等

平成30年2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。

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】

< 更新後 >

「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」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

平成30年2月28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<br>(本) | 純資産総額<br>(百万円) |
|------------|-----------|----------------|
| 追加型株式投資信託  | 844       | 11,748,864     |
| 追加型公社債投資信託 | 16        | 1,329,544      |
| 単位型株式投資信託  | 54        | 320,129        |
| 単位型公社債投資信託 | 1         | 6,116          |
| 合計         | 915       | 13,404,653     |

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】

< 更新後 >

### (1) 財務諸表及び中間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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間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」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|                 | 第31期<br>(平成28年3月31日現在) |             | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) |             |
|-----------------|------------------------|-------------|------------------------|-------------|
| <b>(資産の部)</b>   |                        |             |                        |             |
| <b>流動資産</b>     |                        |             |                        |             |
| 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  |
| <b>固定資産</b>     |                        |             |                        |             |
| <b>有形固定資産</b>   |                        |             |                        |             |
| 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   |
| <b>無形固定資産</b>   |                        |             |                        |             |
| 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   |
| <b>投資その他の資産</b> |                        |             |                        |             |
| 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<br>(平成28年3月31日現在) |         | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) |         |
|---------------|------------------------|---------|------------------------|---------|
| <b>(負債の部)</b> |                        |         |                        |         |
| <b>流動負債</b>   |                        |         |                        |         |
| 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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(平成29年3月31日現在) |
|------------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等         |                        |                        |
| その他有価証券<br>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<br>(自 平成27年4月1日<br>至 平成28年3月31日) |            | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>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<br>(自 平成27年4月1日<br>至 平成28年3月31日) |            | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益剰余金<br>合計 |             |
|                             |           | 資本<br>準備金 | その他<br>資本剰余金 | 資本<br>剰余金合計 |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>有価証券<br>評価差額金 | 繰延ヘッジ<br>損益 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動額<br>(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 |

|                             |           |       |           |             |
|-----------------------------|-----------|-------|-----------|-------------|
| 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<br>項目の当期変動額<br>(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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(自平成27年4月1日<br>至平成28年3月31日) | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>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<br>(自平成27年4月1日<br>至平成28年3月31日) | 第32期<br>(自平成28年4月1日<br>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<br>（遊休資産） | ソフトウェア<br>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つのグループとしております。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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>株式数（株） | 当事業年度増加<br>株式数（株） | 当事業年度減少<br>株式数（株） | 当事業年度末<br>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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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行っておりません。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<br>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<br>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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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、記載していません。

## (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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>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<br>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<br>(千円) | 取得原価<br>(千円) | 差額(千円)    |
|-------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が<br>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<br>取得原価を超えない<br>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<br>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<br>(自 平成27年4月1日<br>至 平成28年3月31日) | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>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<br>(自 平成27年4月1日<br>至 平成28年3月31日) | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(自 平成27年4月1日<br>至 平成28年3月31日) | 第32期<br>(自 平成28年4月1日<br>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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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<br>(平成28年3月31日現在) | 第32期<br>(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 | ㈱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<br>間接<br>100.0% | 連結納税<br>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㈱         | 東京都千代田区 | 324,279百万円   | 信託業、銀行業 | 被所有<br>直接<br>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<br>事務所の賃借 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払<br>事務所賃借料 | 5,895,622千円<br>223,695千円 | 未払手数料  | 805,721千円   |
|     |                    |         |              |         |                     | 投資の助言<br>役員兼任                           | 投資助言料                       | 885,549千円<br>515,287千円   | 未払費用   | 319,698千円   |

|      |              |         |                  |     |                    |                               |                   |                  |        |                  |
|------|--------------|---------|------------------|-----|--------------------|-------------------------------|-------------------|------------------|--------|------------------|
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業 | 被所有<br>直接<br>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 | 9,224,647<br>千円  | 未払手数料  | 1,806,446<br>千円  |
|      |              |         |                  |     |                    | 取引銀行                          | コーラブル預金の預入        | 35,000,000<br>千円 | 現金及び預金 | 35,000,000<br>千円 |
|      |              |         |                  |     |                    |                               | コーラブル預金に係る受取利息    | 9,263<br>千円      | 未収収益   | 2,372<br>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<br>百万円 | 銀行持株会社業     | 被所有<br>間接<br>100.0% | 連結納税<br>役員の兼任                 | 連結納税に伴う支払         | 4,204,969<br>千円 | その他未払金 | 2,071,256<br>千円 |
| 親会社  | 三菱UFJ信託銀行(株)         | 東京都千代田区 | 324,279<br>百万円   | 信託業、<br>銀行業 | 被所有<br>直接<br>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<br>千円 | 未払手数料  | 716,117<br>千円   |
|      |                      |         |                  |             |                     | 投資の助言                         | 投資助言料             | 662,992<br>千円   | 未払費用   | 352,297<br>千円   |
|      |                      |         |                  |             |                     | 役員の兼任                         |                   |                 |        |                 |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行         | 東京都千代田区 | 1,711,958<br>百万円 | 銀行業         | 被所有<br>直接<br>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<br>千円 | 未払手数料  | 1,276,937<br>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<br>モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円 | 証券業   | なし             | 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 | 6,398,782<br>千円 | 未払手数料 | 898,096<br>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<br>モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500<br>百万円 | 証券業   | なし             | 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 | 6,532,238<br>千円 | 未払手数料 | 933,908<br>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<br>（自平成27年4月1日<br>至平成28年3月31日） | 第32期<br>（自平成28年4月1日<br>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、記載しておりません。

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<br>（自平成27年4月1日<br>至平成28年3月31日） | 第32期<br>（自平成28年4月1日<br>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                             |

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## (資産の部)

## 流動資産

|         |            |
|---------|------------|
| 現金及び預金  | 46,287,102 |
| 有価証券    | 78,897     |
| 前払費用    | 496,625    |
| 未収入金    | 87,286     |
| 未収委託者報酬 | 9,160,402  |
| 未収収益    | 681,527    |
| 繰延税金資産  | 471,973    |
| 金銭の信託   | 30,000     |
| その他     | 95,228     |
| 流動資産合計  | 57,389,043 |

## 固定資産

## 有形固定資産

|          |   |           |
|----------|---|-----------|
| 建物       | 1 | 780,721   |
| 器具備品     | 1 | 764,182   |
| 土地       |   | 1,356,000 |
| 有形固定資産合計 |   | 2,900,904 |

## 無形固定資産

|           |  |           |
|-----------|--|-----------|
| 電話加入権     |  | 15,822    |
| ソフトウェア    |  | 1,938,735 |
| ソフトウェア仮勘定 |  | 1,212,251 |
| 無形固定資産合計  |  | 3,166,809 |

## 投資その他の資産

|        |  |            |
|--------|--|------------|
| 投資有価証券 |  | 28,266,735 |
|--------|--|------------|

|            |            |
|------------|------------|
| 関係会社株式     | 320,136    |
| 長期差入保証金    | 640,950    |
| 前払年金費用     | 448,902    |
| 繰延税金資産     | 451,891    |
| その他        | 45,230     |
| 貸倒引当金      | 23,600     |
| 投資その他の資産合計 | 30,150,247 |
| 固定資産合計     | 36,217,960 |
| 資産合計       | 93,607,004 |

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

|         |            |
|---------|------------|
| 預り金     | 196,841    |
| 未払金     |            |
| 未払収益分配金 | 174,797    |
| 未払償還金   | 514,622    |
| 未払手数料   | 3,754,874  |
| その他未払金  | 2,503,473  |
| 未払費用    | 4,229,858  |
| 未払消費税等  | 2 305,160  |
| 未払法人税等  | 792,896    |
| 賞与引当金   | 863,522    |
| 役員賞与引当金 | 66,649     |
| その他     | 776,417    |
| 流動負債合計  | 14,179,114 |

## 固定負債

|           |            |
|-----------|------------|
| 退職給付引当金   | 651,492    |
| 役員退職慰労引当金 | 163,557    |
| 時効後支払損引当金 | 252,546    |
| 固定負債合計    | 1,067,596  |
| 負債合計      | 15,246,710 |

## (純資産の部)

## 株主資本

|          |            |
|----------|------------|
| 資本金      | 2,000,131  |
| 資本剰余金    |            |
| 資本準備金    | 3,572,096  |
| その他資本剰余金 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計  | 44,732,712 |
| 利益剰余金    |            |
| 利益準備金    | 342,589    |
| その他利益剰余金 |            |
| 別途積立金    | 6,998,000  |
| 繰越利益剰余金  | 22,251,535 |
| 利益剰余金合計  | 29,592,124 |
| 株主資本合計   | 76,324,968 |

(単位：千円)

| 第33期中間会計期間<br>(平成29年9月30日現在) |            |
|------------------------------|------------|
| 評価・換算差額等                     |            |
| その他有価証券                      | 2,035,325  |
| 評価差額金                        |            |
| 評価・換算差額等合計                   | 2,035,325  |
| 純資産合計                        | 78,360,294 |
| 負債純資産合計                      | 93,607,004 |

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

| 第33期中間会計期間<br>(自平成29年4月1日<br>至平成29年9月30日) |            |
|---|------------|
| 営業収益                                      |            |
| 委託者報酬                                     | 38,184,632 |
| 投資顧問料                                     | 1,346,730  |
| その他営業収益                                   | 26,405     |
| 営業収益合計                                    | 39,557,767 |
| 営業費用                                      |            |
| 支払手数料                                     | 15,720,488 |
| 広告宣伝費                                     | 318,084    |
| 公告費                                       | 500        |
| 調査費                                       |            |
| 調査費                                       | 861,247    |
| 委託調査費                                     | 6,711,776  |
| 事務委託費                                     | 436,601    |
| 営業雑経費                                     |            |
| 通信費                                       | 85,593     |
| 印刷費                                       | 251,837    |
| 協会費                                       | 24,207     |
| 諸会費                                       | 7,746      |
| 事務機器関連費                                   | 821,139    |
| その他営業雑経費                                  | 13,599     |
| 営業費用合計                                    | 25,252,824 |
| 一般管理費                                     |            |
| 給料  |            |
| 役員報酬                                      | 178,839    |
| 給料・手当                                     | 2,821,754  |
| 賞与引当金繰入                                   | 863,522    |
| 役員賞与引当金繰入                                 | 66,649     |
| 福利厚生費                                     | 619,913    |
| 交際費                                       | 6,009      |
| 旅費交通費                                     | 93,328     |
| 租税公課                                      | 222,435    |
| 不動産賃借料                                    | 341,770    |
| 退職給付費用                                    | 210,625    |
| 役員退職慰労引当金繰入                               | 23,884     |
| 固定資産減価償却費                                 | 1 512,328  |
| 諸経費                                       | 199,624    |

|         |           |
|---------|-----------|
| 一般管理費合計 | 6,160,685 |
| 営業利益    | 8,144,257 |

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 平成29年4月1日

至 平成29年9月30日)

|              |           |
|--------------|-----------|
| 営業外収益        |           |
| 受取配当金        | 134,154   |
| 受取利息         | 277       |
| 投資有価証券償還益    | 29,656    |
| 収益分配金等時効完成分  | 34,222    |
| その他          | 9,043     |
| 営業外収益合計      | 207,354   |
| 営業外費用        |           |
| 投資有価証券償還損    | 20,261    |
| 時効後支払損引当金繰入  | 26,116    |
| その他          | 5,612     |
| 営業外費用合計      | 51,990    |
| 経常利益         | 8,299,622 |
| 特別利益         |           |
| 投資有価証券売却益    | 196,888   |
| ゴルフ会員権売却益    | 2,495     |
| 特別利益合計       | 199,383   |
| 特別損失         |           |
| 投資有価証券売却損    | 60,319    |
| 固定資産除却損      | 0         |
| 特別損失合計       | 60,319    |
| 税引前中間純利益     | 8,438,686 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,631,045 |
| 法人税等調整額      | 4,911     |
| 法人税等合計       | 2,626,133 |
| 中間純利益        | 5,812,552 |

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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   | その他利益剰余金  |            | 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    |         | 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 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |
| 当中間期変動額                       |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 剰余金の配当                        |           |           |            |            |         |           | 26,595,731 | 26,595,731 | 26,595,731 |
| 中間純利益                         |           |           |            |            |         |           | 5,812,552  | 5,812,552  | 5,812,552  |
| 株主資本以外の項目<br>の当中間期変動額<br>(純額) |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
| 当中間期変動額合計                     |           |           |            |            |         |           | 20,783,178 | 20,783,178 | 20,783,178 |

|         |           |           |            |            |         |           |            |            |            |
|---------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| 当中間期末残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 22,251,535 | 29,592,124 | 76,324,968 |
|---------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|

|                               | 評価・換算差額等             |                | 純資産合計      |
|-------------------------------|----------------------|----------------|------------|
|                               | その他<br>有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |            |
| 当期首残高                         | 1,494,586            | 1,494,586      | 98,602,734 |
| 当中間期変動額                       |                      |                |            |
| 剰余金の配当                        |                      |                | 26,595,731 |
| 中間純利益                         |                      |                | 5,812,552  |
| 株主資本以外の項目<br>の当中間期変動額<br>(純額) | 540,738              | 540,738        | 540,738    |
| 当中間期変動額合計                     | 540,738              | 540,738        | 20,242,440 |
| 当中間期末残高                       | 2,035,325            | 2,035,325      | 78,360,294 |

### [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

中間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. 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。

#### 3. 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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

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。

(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、内規に基づく中間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。

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、中間決算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. その他中間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

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、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。

**[注記事項]**

（中間貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

|      | 第33期中間会計期間<br>(平成29年9月30日現在) |
|------|------------------------------|
| 建物   | 571,713千円                    |
| 器具備品 | 1,115,446千円                  |

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

|        | 第33期中間会計期間<br>(自平成29年4月1日<br>至平成29年9月30日) |
|--------|---|
| 有形固定資産 | 114,767千円                                 |
| 無形固定資産 | 397,560千円                                 |

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30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<br>株式数 (株) | 当中間会計期間<br>増加株式数 (株) | 当中間会計期間<br>減少株式数 (株) | 当中間会計期間末<br>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

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）

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 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

|     |             |
|-----|-------------|
| 1年内 | 678,116千円   |
| 1年超 | 1,634,641千円 |
| 合 計 | 2,312,757千円 |

## （金融商品関係）

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）。

|             | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 時価（千円）     | 差額（千円） |
|-------------|--------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金  | 46,287,102         | 46,287,102 | -      |
| (2) 有価証券    | 78,897             | 78,897     | -      |
| (3) 未収委託者報酬 | 9,160,402          | 9,160,402  | -      |
| (4) 投資有価証券  | 28,129,575         | 28,129,575 | -      |
| 資産計         | 83,655,978         | 83,655,978 | -      |
| (1) 未払手数料   | 3,754,874          | 3,754,874  | -      |
| 負債計         | 3,754,874          | 3,754,874  | -      |

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 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、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。

## （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

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）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、「(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（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）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。



## （注3）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。

## （有価証券関係）

第33期中間会計期間（平成29年9月30日現在）

## 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（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）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

|                                | 種類  | 中間貸借対照表<br>計上額（千円） | 取得原価<br>（千円） | 差額（千円）    |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えるもの  | 株式  | -                  | -            | -         |
|                                | 債券  | -                  | -            | -         |
|                                | その他 | 21,493,708         | 18,316,441   | 3,177,266 |
|                                | 小計  | 21,493,708         | 18,316,441   | 3,177,266 |
| 中間貸借対照表計<br>上額が取得原価を<br>超えないもの | 株式  | -                  | -            | -         |
|                                | 債券  | -                  | -            | -         |
|                                | その他 | 6,714,765          | 6,958,415    | 243,650   |
|                                | 小計  | 6,714,765          | 6,958,415    | 243,650   |
| 合計                             |     | 28,208,473         | 25,274,857   | 2,933,616 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区別の外部顧客への営業収益が中間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]

該当事項はありません。

## [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]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                                      | 第33期中間会計期間<br>(平成29年9月30日現在) |
|--------------------------------------|------------------------------|
| 1株当たり純資産額                            | 370,356.00円                  |
| (算定上の基礎)                             |                              |
| 純資産の部の合計額(千円)                        | 78,360,294                   |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)                 | 78,360,294                   |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた<br>中間期末の普通株式の数(株) | 211,581                      |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 第33期中間会計期間<br>(自平成29年4月1日<br>至平成29年9月30日) |
|--------------------|---|
| 1株当たり中間純利益金額       | 27,471.99円                                |
| (算定上の基礎)           |   |
| 中間純利益金額(千円)        | 5,812,552                                 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円)   | -   |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 5,812,552                                 |
| 普通株式の期中平均株式数(株)    | 211,581                                   |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

## 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】

<更新後>

## (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9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<br>(平成29年9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。 |

## 3【資本関係】

## &lt;訂正前&gt;

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。

## &lt;訂正後&gt;

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30年4月2日現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年3月22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（成長型）の平成29年8月15日から平成30年2月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド（成長型）の平成30年2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中間計算期間（平成29年8月15日から平成30年2月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、独立監査人の中間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データは中間監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

# 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<br>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<br>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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1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<br>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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 青木 裕晃 | 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

## 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を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、独立監査人の中間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データは中間監査の対象に含まれていません。