

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成22年10月21日

【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 後藤 俊夫

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【事務連絡者氏名】 井上 靖
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資信託 三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランス
受益証券に係るファンドの名称】 ファンド

【届出の対象とした募集内国投資信託 継続募集額 上限1兆円
受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当ありません

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド(「ファンド」といいます。)
ファンドの愛称を「DCオートマくん」とします。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1円です。

格付は取得していません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

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。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

(略称：Dオート)

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の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、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

毎営業日とは、土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。以下、同じ。

(5)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

再投資される収益分配金については1口単位とします。

(7)【申込期間】

平成22年10月22日から平成23年10月21日までです。

(注)上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間：毎営業日の9:00～17:00)

(9)【払込期日】

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。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。
振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

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】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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。

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な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)	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)	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	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

内外の株式や債券を実質的な主要投資対象とし、わが国の短期金利水準の変動に応じて投資配分

比率を変動させることにより、安定した収益の確保と着実な値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

1

主として、三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンドへの投資を通じて国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に分散投資を行うバランス型運用部分と、マネー・マーケット・マザーファンドへの投資を通じてわが国の短期公社債に投資を行う安定運用部分に、それぞれ投資を行います。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

ファンド名	基本方針
三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド	ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にわが国の株式市場全体(TOPIX)の動きを上回る運用成果をめざします。
日本債券マザーファンド	NOMURA - BPI総合インデックスをベンチマーク(注1)とし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
外国株式マザーファンド	MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。 運用の指図に関する権限は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(注2)に委託します。(注3)
三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	シティグループ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めざします。
マネー・マーケット・マザーファンド	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。

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

(注2)ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドは、ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)の英国現地法人であり、高い専門性に基いた資産運用サービスを提供しています。

(注3)運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

2

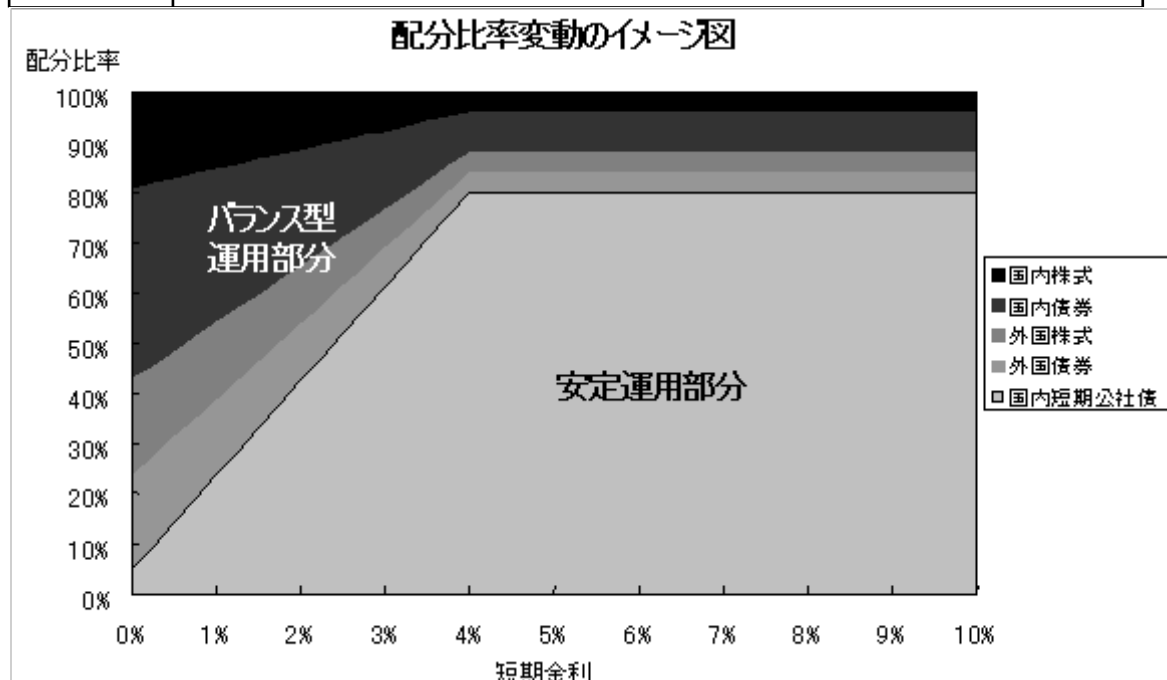
バランス型運用部分における各資産への配分比率は、以下の比率とすることを基本とします。

国内株式：三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド・・・20%程度
 国内債券：日本債券マザーファンド・・・・・・・・・・・・・・40%程度
 外国株式：外国株式マザーファンド・・・・・・・・・・・・・・20%程度
 外国債券：三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド・・・20%程度

3

わが国の短期金利水準の変動に応じて、バランス型運用部分と安定運用部分への配分比率を変動させるものとし、当該短期金利水準の上昇に伴い安定運用部分への配分比率を引き上げ、当該短期金利水準の低下に伴い安定運用部分への配分比率を引き下げます。なお、安定運用部分への配分比率は以下の範囲内とします。

安定運用部分への配分比率	
下限	短期金利水準が0%のとき、純資産総額に対して5%程度
上限	短期金利水準が4%以上のとき、純資産総額に対して80%程度



上図は配分比率変動のイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を保証するものではありません。

わが国の短期金利水準は、日銀がホームページ上で公表する「無担保コール0/N物レート（平均）」の月中平均とします。なお、当該指標については今後見直す場合があります。

（注）ファンドは、予め定めた一定のルールに基づき、わが国の短期金利水準の変動に伴いバランス型運用部分と安定運用部分の配分比率が自動的に変動するものであり、期待リターンおよびリスクの予測に基づき資産配分比率の調整を行うものではありません。

また、ファンドのパフォーマンス（運用成果）は、当該配分比率の変動のみによって左右されるものではなく、ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドがそれぞれベンチマークを上回る（あるいは中長期的に上回る）ことをめざした運用を行うことによるアクティブ運用成果によっても左右されます。

将来の運用成果等を保証するものではありません。

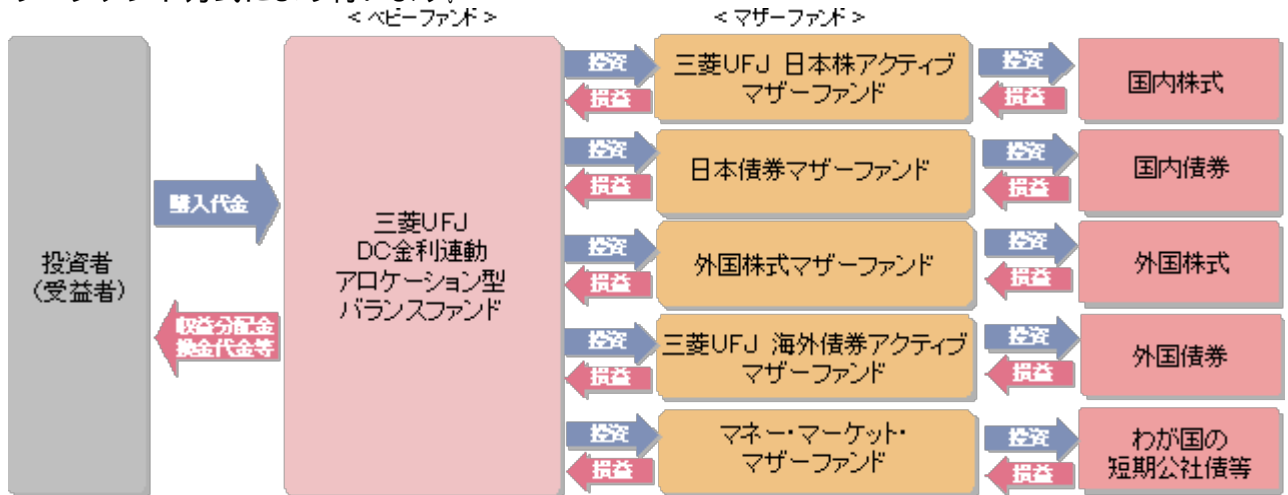
4

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

< 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、内外の株式や債券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



< 主な投資制限 >

- ・ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ・ 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50%以下とします。
- ・ デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

< 分配方針 >

- ・ 年1回の決算時（7月22日（休業日の場合は翌営業日））に分配を行います。
- ・ 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。
- ・ 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。

指数について

TOPIXとは、東京証券取引所第一部に上場する内国株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。

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。

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、日本を除く世界の主要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)はMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本・円ベース）とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。

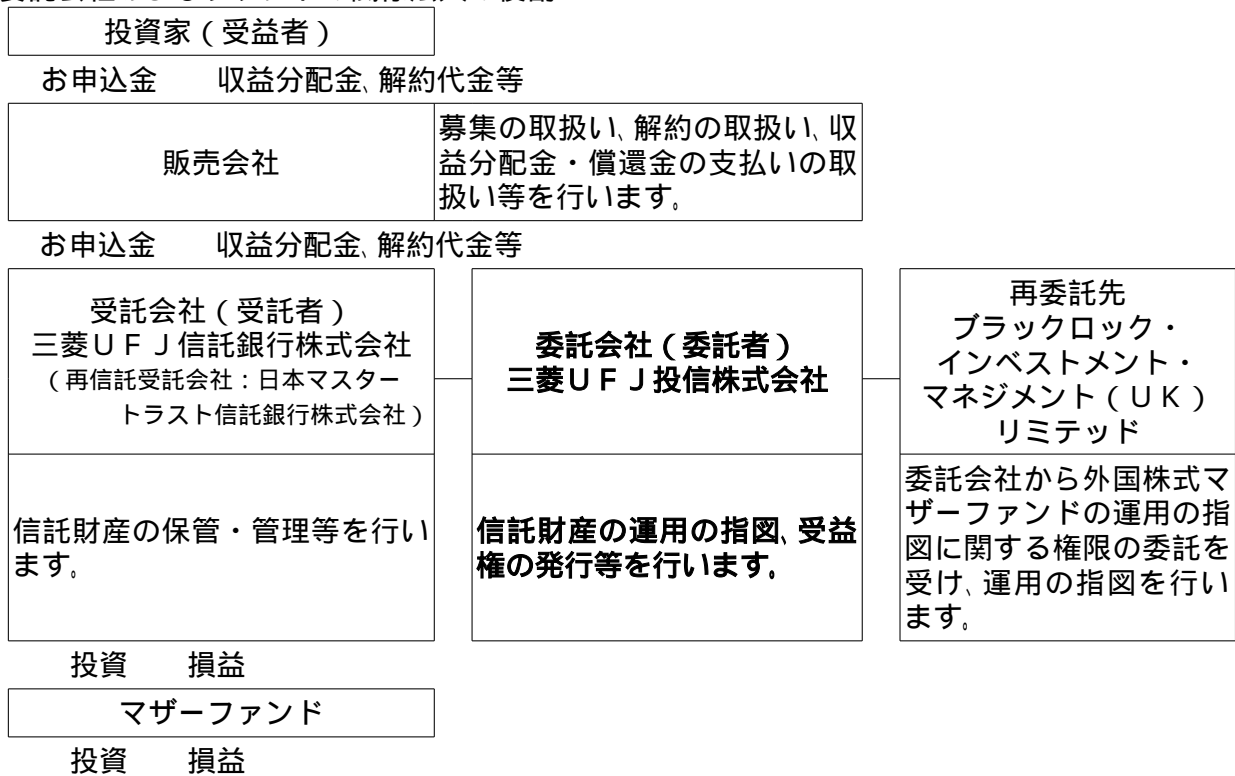
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成19年8月10日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	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。
委託会社と再委託先との契約 「信託財産の運用指図権限委託契約」	運用指図権限委託の内容およびこれに係る事務の内容、再委託先が受ける報酬等が定められています。

委託会社の概況

・資本金

2,000百万円（平成22年7月末現在）

・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

・大株主の状況（平成22年7月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	68,253株	55.0%
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	37,230株	30.0%
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	18,615株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券およびマネー・マーケット・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、内外の株式・公社債等に直接投資することがあります。

主として、三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド受益証券、日本債券マザーファンド受益証券、外国株式マザーファンド受益証券、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド受益証券への投資を通じて国内株式、国内債券、外国株式、外国債券に分散投資を行うバランス型運用部分と、マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じてわが国の短期公社債に投資を行う安定運用部分に、それぞれ投資を行います。

バランス型運用部分における各資産への配分比率は、国内株式20%程度、国内債券40%程度、外国株式20%程度、外国債券20%程度とすることを基本とします。

わが国の短期金利水準の変動に応じて、バランス型運用部分と安定運用部分への配分比率を変動させるものとし、当該短期金利水準の上昇に伴い安定運用部分への配分比率を引き上げ、当該短期金利水準の低下に伴い安定運用部分への配分比率を引き下げます。なお、安定運用部分への配分比率は以下の範囲内とします。

安定運用部分への配分比率	
下限	短期金利水準が0%のとき、純資産総額に対して5%程度
上限	短期金利水準が4%以上のとき、純資産総額に対して80%程度

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

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三菱UFJ日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株マザーファンド、三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンドおよびマネー・マーケット・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 >

三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、長期的に安定した信託財産の成長をはかることを目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

ボトムアップ・アプローチを基本としたアクティブ運用により長期的にわが国の株式市場全体（TOPIX）の動きを上回る運用成果をめざします。

株式への投資にあたっては、運用チームによる会社訪問も含め、自ら徹底的に企業分析を行います。

銘柄選定は、主に以下の観点で行います。

1. オーナーの持ち分としての株主価値の見極め。
2. 株主価値を分析する尺度としては、主に企業が事業から継続してキャッシュを生み出す能力を評価。
3. 株主価値と株価との関係がバーゲン（株主価値 > 株価）と判断される銘柄に投資。

また、株式の組入比率は高位を保つこととし、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

なお、株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

なお、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

また、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引を行うことができます。

（投資制限）

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

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。

同一銘柄の株式への投資は、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。

日本債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中長期的に信託財産の成長をめざ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

ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。NOMURA - BPI総合インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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）

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。

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。

外国株式マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中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

外国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界主要国の株式に投資します。運用にあたってはMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイインデックス）（円換算ベース）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。

企業訪問を含めた独自の調査に基づくアクティブ運用を行います。

超過収益の源泉は、地域配分・銘柄選択の双方におきます。

地域配分は、マクロ経済、市場・業種・個別銘柄の動向等の調査・分析を総合的に勘案し決定します。

銘柄選択の基準としては、経営資源の効率的活用の視点を重視します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

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。

運用の指図に関する権限は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッドに委託します。

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。

運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

（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。

外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。

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

シティグループ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。

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。

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。

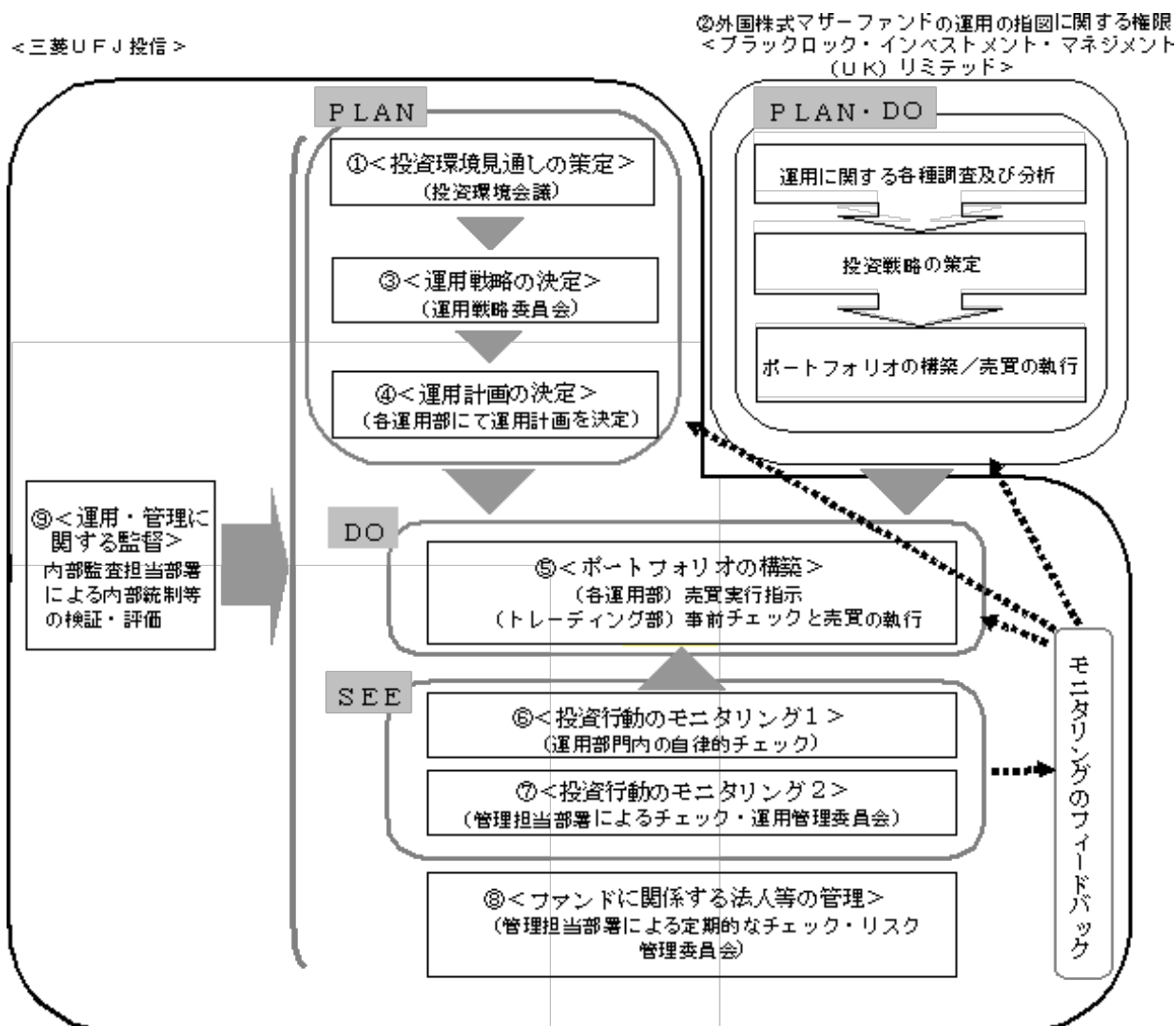
外貨建資産への投資は行いません。

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】



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。

運用の指図に関する権限の委託

当ファンドは、三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンドを主要投資対象としています。このうち外国株式マザーファンドについては、運用の指図に関する権限を、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド（「再委託先」といいます。）に委託しています。

再委託先は与えられた運用の指図に関する権限の範囲内で投資戦略を策定し、ポートフォリオの構築を行います。

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に沿ってファンド毎の運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定されたファンド毎の運用戦略に基づいて、各運用部は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

委託会社の運用部門は、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戦略に

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。再委託先の投資行動については、各運用部の担当ファンドマネージャーが日々再委託先の運用の適切性を確認しています。

投資行動のモニタリング2

委託会社では、運用部門から独立した管理担当部署が、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委託会社の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。その内容は更に運用部門から再委託先に還元されます。

ファンドに係る法人等の管理

再委託先、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(5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平成22年10月22日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

(5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

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

外貨建資産

a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の50を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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

新株引受権証券および新株予約権証券

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

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証

券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

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

同一銘柄の転換社債等

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

有価証券先物取引等

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、および組入抵当証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに（2）投資対象 金融商品の指図範囲の1. から4. に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、で規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所

における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(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ヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。)との合計額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに(2)投資対象 金融商品の指図範囲の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに(2)投資対象 金融商品の指図範囲の1.から4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(信託約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額、以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下c.において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- d. c.においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額とします。

- e. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- f. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証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(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、)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の新株予約権(5. に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

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

投資する株式等の範囲

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

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

<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。

- ・デリバティブ取引の投資制限

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを内容とした運用を行うことをしないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当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金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、投資元金を割り込むことがあります。

当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。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

市場リスク

(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、投資元金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、投資元金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、投資元金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、投資元金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。
- ・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

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しております。

また、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行うことにより、当ファンドの投資リスクを適切に管理するよう努めています。具体的な委託会社および再委託先における投資リスクに対する管理体制および委託会社での再委託先の確認体制は、以下の通りです。

[委託会社の投資リスクに対する管理体制]

市場リスク

(価格変動リスク・為替変動リスク)

市場リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、市場リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、市場リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署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、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

[ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドの投資リスクに対する管理体制]

チーム内のリスク管理と運用評価

当該運用チームでは、日次で全てのポートフォリオについて計量的なリスク管理ツールを用いてリスク管理を行っています。

更に、当該運用チームではリスク・クオンツ分析部とリスクの観点からポートフォリオ・レビューを目的としたミーティングを月次で開催しています。パフォーマンスおよびリスク・エクスポージャーについてのレビューを行います。更に様々なストレス・テストの結果についても議論を行い、頑健なポートフォリオの構築に努めます。また、同一マナデート間の共通度チェックについても確認しています。

チーム外のリスク管理と運用評価

a. リスク・クオンツ分析部(ロンドン)

専任のリスク・クオンツ分析部が運用商品のリスク分析および運用分析を行っています。さらに、分析結果についてレビューを行い、運用チームへ報告・助言をしています。

b. 運用評価を行う委員会によるレビュー(四半期毎)

株式パフォーマンス・レビュー委員会(ロンドン)が四半期毎に開催され、パフォーマンス、リスク、同一マナド間のパフォーマンスの共通度などのレビューを行います。この委員会は、ブラックロックの株式グローバルCIOおよびリスク・クオンツ分析部EMEA*パシフィック地域ヘッドが主催、EMEAパシフィック地域CIO、株式グローバルCOO、株式運用商品の各運用チームヘッドなどで構成されています。

*EMEA・・・欧州、中東、アフリカの略

[委託会社における運用の指図に関する権限の再委託先に対する確認体制]

委託会社と再委託先の間で、再委託先がファンド運用コンセプトを維持し、適切に投資リスク管理が図られるよう運用指図権限委託契約として委託内容を定めています。また、委託会社は再委託先に対し定期的に書面による調査等を実施し、投資リスクに対する管理体制の確認を行っています。

また、再委託先からの定期的なデータ還元を受け、市場、信用、流動性の各リスクの運営状況の確認を行っているほか、委託会社自身でもモニタリングし、投資リスクを管理しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はかかりません。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年0.63% (税抜 年0.6%)

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.28875% (税抜 年0.275%)	年0.28875% (税抜 年0.275%)	年0.0525% (税抜 年0.05%)

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税および地方消費税に相当する金額(「消費税等相当額」といいます。)を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

外国株式マザーファンドの再委託先が受ける報酬は、当該マザーファンドを投資対象とするファンドの委託会社が、当該ファンドに係る信託報酬のうち委託会社が受ける報酬から、毎年1月22日および7月22日から15営業日以内ならびに信託終了のときに支払われ、その報酬額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、当該マザーファンドの信託財産の純資産総額にマザーファンドの受益権総口数に占める当該ファンドに属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額に年0.45%を乗じて得た金額とします。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

(*) 「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

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。特別分配金(受益者の元本の一部払戻しに相当する部分)は課税されません。

原則として、10%(所得税7%および地方税3%)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・申告分離課税を選択することもできます。申告分離課税を選択した場合、10%(所得税7%および地方税3%)の税率となります。

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。

10%(所得税7%および地方税3%)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、10%(所得税7%および地方税3%)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。

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、20%(所得税15%および地方税5%)の税率となる予定です。

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7%(所得税7%)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、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

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。

平成23年12月31日まで適用される税率です。平成24年以降は、15%(所得税15%)の税率となる予定です。

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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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。

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、税務署等にご確認ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成22年7月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,025,115,964	99.79
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,115,373	0.21
純資産総額		1,027,231,337	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22年7月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	日本債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		307,447,728	1.2326 1.2343	378,989,633 379,482,730		36.94
日本	外国株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		201,321,834	0.9411 0.9802	189,463,978 197,335,661		19.21
日本	三菱UFJ 日本株アクティ ブマザーファンド	親投資信託 受益証券		222,291,330	0.8299 0.8583	184,500,016 190,792,648		18.57
日本	三菱UFJ 海外債券アク ティブマザーファンド	親投資信託 受益証券		104,216,356	1.8019 1.8210	187,793,349 189,777,984		18.47
日本	マネー・マーケット・マザー ファンド	親投資信託 受益証券		66,752,357	1.0145 1.0146	67,726,940 67,726,941		6.59

(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22年7月30日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.79
合計	99.79

(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22年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成20年7月22日)	130,638,772 (分配付) 130,638,772 (分配落)	9,512 (分配付) 9,512 (分配落)
第2計算期間末日 (平成21年7月22日)	685,233,194 (分配付) 685,233,194 (分配落)	8,399 (分配付) 8,399 (分配落)
第3計算期間末日 (平成22年7月22日)	997,323,434 (分配付) 997,323,434 (分配落)	8,383 (分配付) 8,383 (分配落)
平成21年7月末日	711,613,974	8,608
8月末日	722,109,793	8,667
9月末日	731,340,029	8,605
10月末日	742,220,137	8,619
11月末日	735,210,924	8,451
12月末日	837,977,765	8,761
平成22年1月末日	836,621,955	8,578

2月末日	828,545,271	8,549
3月末日	918,805,192	8,958
4月末日	989,133,943	9,060
5月末日	938,266,164	8,539
6月末日	959,309,778	8,358
7月末日	1,027,231,337	8,522

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.88
第2計算期間	11.70
第3計算期間	0.19

(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(分配落ちの額、以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	138,128,696	790,140	137,338,556
第2計算期間	732,066,660	53,547,246	815,857,970
第3計算期間	451,527,825	77,734,694	1,189,651,101

<参考>

「三菱UFJ日本株アクティブマザーファンド」

(1) 投資状況

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	50,610,141,600	97.43
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,333,945,427	2.57
純資産総額		51,944,087,027	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22年7月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	645,000	3,295.00 3,050.00	2,125,275,000 1,967,250,000		3.79
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	585,000	2,682.00 2,676.00	1,568,970,000 1,565,460,000		3.01
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	3,580,000	428.00 429.00	1,532,240,000 1,535,820,000		2.96
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	478,000	2,790.00 2,709.00	1,333,620,000 1,294,902,000		2.49
日本	住友商事	株式	卸売業	1,260,000	1,016.00 918.00	1,280,160,000 1,156,680,000		2.23
日本	日本電産	株式	電気機器	125,000	8,280.78 8,110.00	1,035,097,500 1,013,750,000		1.95
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	428,000	2,462.00 2,366.00	1,053,736,000 1,012,648,000		1.95
日本	日立金属	株式	鉄鋼	1,028,000	972.00 982.00	999,223,336 1,009,496,000		1.94
日本	三菱商事	株式	卸売業	488,000	2,014.29 1,869.00	982,975,915 912,072,000		1.76

日本	キヤノン	株式	電気機器	221,000	3,885.00 3,765.00	858,585,000 832,065,000		1.60
日本	ソニー	株式	電気機器	305,000	2,593.51 2,705.00	791,020,550 825,025,000		1.59
日本	日立製作所	株式	電気機器	2,225,000	349.13 352.00	776,814,250 783,200,000		1.51
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	5,350,000	139.62 141.00	747,014,233 754,350,000		1.45
日本	三井物産	株式	卸売業	610,000	1,203.26 1,108.00	733,990,886 675,880,000		1.30
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	187,000	3,675.00 3,590.00	687,225,000 671,330,000		1.29
日本	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	情報・通信業	4,380	136,892.62 137,500.00	599,589,685 602,250,000		1.16
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	2,010	298,800.00 278,000.00	600,588,000 558,780,000		1.08
日本	富士通	株式	電気機器	900,000	619.00 615.00	557,100,000 553,500,000		1.07
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	820,000	690.00 664.00	565,800,000 544,480,000		1.05
日本	オリックス	株式	その他金融業	80,000	6,930.00 6,800.00	554,400,000 544,000,000		1.05
日本	SUMCO	株式	金属製品	319,000	1,659.53 1,640.00	529,390,070 523,160,000		1.01
日本	商船三井	株式	海運業	890,000	665.29 585.00	592,115,646 520,650,000		1.00
日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	201,000	2,476.00 2,585.00	497,676,000 519,585,000		1.00
日本	住友信託銀行	株式	銀行業	1,080,000	475.00 481.00	513,000,000 519,480,000		1.00
日本	HOYA	株式	精密機器	252,000	2,051.96 2,056.00	517,093,920 518,112,000		1.00
日本	三井化学	株式	化学	2,020,000	264.35 256.00	533,996,900 517,120,000		1.00
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	176,000	3,002.75 2,931.00	528,485,200 515,856,000		0.99
日本	野村ホールディングス	株式	証券・商品 先物取引業	1,070,000	531.20 481.00	568,391,184 514,670,000		0.99
日本	ツムラ	株式	医薬品	197,900	2,665.61 2,599.00	527,524,348 514,342,100		0.99
日本	ジェイエフイーホールディングス	株式	鉄鋼	192,000	2,878.41 2,675.00	552,655,400 513,600,000		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22年7月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
建設業	2.36
食料品	2.53
繊維製品	0.44
パルプ・紙	0.34
化学	6.64
医薬品	3.73
石油・石炭製品	0.69
ゴム製品	0.35
ガラス・土石製品	1.48
鉄鋼	4.64
非鉄金属	2.45
金属製品	1.48
機械	2.95
電気機器	16.46
輸送用機器	10.91
精密機器	1.47
その他製品	0.95
電気・ガス業	0.49
陸運業	0.30
海運業	1.00
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.29
情報・通信業	5.89
卸売業	6.26
小売業	4.37
銀行業	9.88
証券・商品先物取引業	0.99
保険業	3.21

	その他金融業	1.05
	不動産業	2.24
	サービス業	1.20
合計		97.43

（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>

「日本債券マザーファンド」

（１）投資状況

平成22年7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	8,037,491,000	60.90
特殊債券	日本	413,466,000	3.13
社債券	日本	4,477,260,000	33.92
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		270,132,776	2.05
純資産総額		13,198,349,776	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。

その他の資産の投資状況

平成22年7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引（売建）	141,840,000	1.07

（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22年7月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第280回利付国債(10年)	国債証券		400,000	108.48 108.4250	433,948,000 433,700,000	1.900000 2016/06/20	3.29
日本	第275回利付国債(10年)	国債証券		400,000	105.42 105.3480	421,700,000 421,392,000	1.400000 2015/12/20	3.19
日本	第303回利付国債(10年)	国債証券		400,000	104.00 103.9540	416,028,000 415,816,000	1.400000 2019/09/20	3.15
日本	第282回利付国債(10年)	国債証券		300,000	107.48 107.3910	322,443,000 322,173,000	1.700000 2016/09/20	2.44
日本	第289回利付国債(10年)	国債証券		300,000	106.15 106.1330	318,453,000 318,399,000	1.500000 2017/12/20	2.41
日本	第296回利付国債(10年)	国債証券		300,000	105.76 105.7050	317,280,000 317,115,000	1.500000 2018/09/20	2.40
日本	第301回利付国債(10年)	国債証券		300,000	105.15 105.0610	315,477,000 315,183,000	1.500000 2019/06/20	2.39
日本	第298回利付国債(10年)	国債証券		300,000	103.93 103.8850	311,805,000 311,655,000	1.300000 2018/12/20	2.36
日本	第299回利付国債(10年)	国債証券		300,000	103.66 103.6160	310,998,000 310,848,000	1.300000 2019/03/20	2.36
日本	第229回信金中金債	特殊債券		300,000	103.56 103.4860	310,683,000 310,458,000	1.400000 2013/12/27	2.35
日本	第90回利付国債(20年)	国債証券		200,000	108.25 108.6670	216,512,000 217,334,000	2.200000 2026/09/20	1.65
日本	第286回利付国債(10年)	国債証券		200,000	108.38 108.3180	216,760,000 216,636,000	1.800000 2017/06/20	1.64
日本	第111回利付国債(20年)	国債証券		200,000	106.99 107.6060	213,996,000 215,212,000	2.200000 2029/06/20	1.63
日本	第288回利付国債(10年)	国債証券		200,000	107.65 107.5930	215,304,000 215,186,000	1.700000 2017/09/20	1.63

日本	第285回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.65 107.5910	215,300,000 215,182,000	1.700000 2017/03/20	1.63
日本	第284回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.57 107.5160	215,150,000 215,032,000	1.700000 2016/12/20	1.63
日本	第294回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.48 107.4250	214,968,000 214,850,000	1.700000 2018/06/20	1.63
日本	第96回利付国債(20年)	国債証券	200,000	106.29 106.7150	212,594,000 213,430,000	2.100000 2027/06/20	1.62
日本	第273回利付国債(10年)	国債証券	200,000	105.81 105.7140	211,636,000 211,428,000	1.500000 2015/09/20	1.60
日本	第291回利付国債(10年)	国債証券	200,000	104.58 104.5700	209,164,000 209,140,000	1.300000 2018/03/20	1.58
日本	第118回利付国債(20年)	国債証券	200,000	103.38 104.1470	206,768,000 208,294,000	2.000000 2030/06/20	1.58
日本	第306回利付国債(10年)	国債証券	200,000	103.42 103.3750	206,856,000 206,750,000	1.400000 2020/03/20	1.57
日本	第13回野村ホールディングス	社債券	200,000	102.26 102.2450	204,534,000 204,490,000	1.720000 2012/06/15	1.55
日本	第1回住友信託銀行(劣後特約付)	社債券	200,000	102.27 102.2400	204,552,000 204,480,000	1.370000 2013/05/22	1.55
日本	第12回日産フィナンシャルサービス	社債券	200,000	101.55 101.5390	203,116,000 203,078,000	1.117000 2012/12/20	1.54
日本	第19回GEキャピタルコーポレーション	社債券	200,000	101.00 100.9770	202,006,000 201,954,000	1.950000 2011/05/27	1.53
日本	第14回メリルリンチ	社債券	200,000	100.44 100.5180	200,890,000 201,036,000	1.580000 2012/02/23	1.52
日本	第11回メリルリンチ	社債券	200,000	100.47 100.2150	200,944,000 200,430,000	1.300000 2011/12/09	1.52
日本	第88回利付国債(20年)	国債証券	150,000	109.77 110.1870	164,664,000 165,280,500	2.300000 2026/06/20	1.25
日本	第55回利付国債(20年)	国債証券	150,000	108.28 108.3280	162,430,500 162,492,000	2.000000 2022/03/21	1.23

(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22年7月30日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	60.90
特殊債券	3.13
社債券	33.92
合計	97.95

(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

平成22年7月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
債券先物取引						
長期国債先物10年09月限	東京証券取引所	売建	1	141,870,000	141,840,000	1.07

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

< 参考 >

「外国株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成22年7月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	5,221,679,701	55.43
	イギリス	1,137,550,314	12.07
	スイス	706,910,435	7.50
	フランス	602,167,150	6.39
	オランダ	419,290,033	4.45
	香港	349,891,623	3.71
	ドイツ	201,201,200	2.14
	シンガポール	180,467,000	1.92
	スウェーデン	156,950,643	1.67
	スペイン	154,286,002	1.64
	カナダ	122,304,502	1.30
	ルクセンブルグ	74,194,205	0.79
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		94,079,910	0.99
純資産総額		9,420,972,718	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22年7月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・ タバコ	83,605	4,445.22 4,307.61	371,642,618 360,137,734		3.82
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	52,014	6,257.13 6,590.93	325,458,827 342,820,841		3.64
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・ タバコ	53,195	5,544.46 5,625.96	294,937,815 299,273,101		3.18
イギリス	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	食品・飲料・ タバコ	99,770	3,022.14 2,973.41	301,586,641 296,658,093		3.15
フランス	SANOFI-AVENTIS	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	57,047	5,305.68 5,073.62	302,705,643 289,435,028		3.07
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	12,917	22,042.60 22,378.13	284,724,367 289,058,395		3.07
アメリカ	AMGEN INC	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	54,444	4,530.07 4,627.17	246,635,403 251,922,133		2.67
アメリカ	PRAXAIR INC	株式	素材	32,388	7,140.61 7,439.72	231,270,141 240,957,878		2.56
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・ 半導体製造装置	124,365	1,843.24 1,823.30	229,234,791 226,754,828		2.41
オランダ	HEINEKEN NV	株式	食品・飲料・ タバコ	56,252	4,062.74 3,959.73	228,569,539 222,743,069		2.36
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	86,790	2,259.40 2,400.72	196,093,499 208,358,749		2.21
アメリカ	SPX CORP	株式	資本財	40,179	4,807.51 5,145.64	193,161,145 206,746,870		2.19
アメリカ	HEWLETT-PACKARD CO	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	50,468	3,943.11 4,023.74	199,001,178 203,070,463		2.16
ドイツ	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	株式	自動車・ 自動車部品	42,896	4,635.54 4,690.44	198,846,123 201,201,200		2.14
アメリカ	DIRECTV-CLASS A	株式	メディア	63,014	3,096.92 3,182.75	195,149,568 200,558,249		2.13
アメリカ	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	株式	ソフトウェア・ サービス	40,928	4,601.16 4,676.59	188,316,644 191,403,802		2.03
スイス	ABB LTD-REG	株式	資本財	109,569	1,638.81 1,746.39	179,562,772 191,350,863		2.03
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・ タバコ	41,551	4,325.46 4,437.30	179,727,313 184,374,501		1.96

シンガポール	DBS GROUP HOLDINGS LTD	株式	銀行	196,000	910.59 920.75	178,475,640 180,467,000	1.92
フランス	SOCIETE GENERALE	株式	銀行	34,885	4,089.91 5,061.17	142,696,464 176,558,985	1.87
イギリス	RIO TINTO PLC	株式	素材	37,835	4,394.48 4,540.65	166,291,123 171,795,757	1.82
アメリカ	LORILLARD INC	株式	食品・飲料・ タバコ	25,569	6,454.81 6,571.86	165,043,164 168,035,888	1.78
アメリカ	TIFFANY & CO	株式	小売	46,137	3,399.50 3,598.91	156,843,054 166,043,233	1.76
スイス	SWATCH GROUP AG/THE-BR	株式	耐久消費財・ アパレル	5,766	26,854.80 26,954.88	154,844,776 155,421,838	1.65
スペイン	TELEFONICA SA	株式	電気通信サービス	77,661	1,837.23 1,986.66	142,681,584 154,286,002	1.64
香港	SANDS CHINA LTD	株式	消費者サービス	1,150,800	130.34 133.02	150,005,399 153,087,701	1.62
アメリカ	TIMKEN CO	株式	資本財	51,438	2,545.51 2,926.99	130,936,046 150,558,614	1.60
イギリス	TULLOW OIL PLC	株式	エネルギー	88,645	1,529.34 1,694.45	135,568,521 150,205,123	1.59
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	64,112	2,177.90 2,256.80	139,629,781 144,688,025	1.54
アメリカ	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	株式	各種金融	108,069	1,237.20 1,309.17	133,703,939 141,480,692	1.50

（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22年7月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	9.56
	素材	8.65
	資本財	7.49
	自動車・自動車部品	2.14
	耐久消費財・アパレル	2.06
	消費者サービス	2.60
	メディア	2.13
	小売	2.44
	食品・飲料・タバコ	16.86
	ヘルスケア機器・サービス	0.46
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	8.88
	銀行	10.04
	各種金融	3.74
	保険	1.45
	ソフトウェア・サービス	5.27
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.46
電気通信サービス	2.91	
半導体・半導体製造装置	4.87	
合計	99.00	

（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 >

「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」

(1) 投資状況

平成22年7月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	60,025,038,115	39.55
	ドイツ	33,058,364,264	21.78
	イタリア	11,672,833,080	7.69
	フランス	10,897,424,400	7.18
	イギリス	10,848,582,366	7.15
	オランダ	6,977,874,400	4.60
	カナダ	4,295,388,707	2.83
	オーストラリア	1,305,912,116	0.86
	ポーランド	1,269,605,448	0.84
	スペイン	1,149,432,800	0.76
	スウェーデン	1,022,569,073	0.67
	マレーシア	1,000,415,934	0.66
	シンガポール	846,931,383	0.56
	ベルギー	651,522,600	0.43
ノルウェー	498,194,074	0.33	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		6,268,681,096	4.11
純資産総額		151,788,769,856	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22年7月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					ドイツ	3.75 BUND 190104	国債証券	
アメリカ	3.875 T-NOTE 130215	国債証券		80,000,000.00	9,312.84 9,370.3734	7,450,273,242 7,496,298,750	3.875000 2013/02/15	4.94
ドイツ	4 BUND 160704	国債証券		50,000,000.00	12,472.37 12,547.2012	6,236,188,000 6,273,600,600	4.000000 2016/07/04	4.13
ドイツ	3.25 BUND 200104	国債証券		48,000,000.00	11,929.32 11,867.2088	5,726,078,236 5,696,260,224	3.250000 2020/01/04	3.75
アメリカ	3 T-NOTE 170228	国債証券		60,000,000.00	8,844.58 9,026.2828	5,306,751,211 5,415,769,687	3.000000 2017/02/28	3.57
アメリカ	4.25 T-NOTE 150815	国債証券		55,000,000.00	9,508.11 9,737.4937	5,229,464,934 5,355,621,562	4.250000 2015/08/15	3.53
アメリカ	3.875 T-NOTE 180515	国債証券		55,000,000.00	9,060.37 9,507.1968	4,983,204,693 5,228,958,281	3.875000 2018/05/15	3.44
ドイツ	2.5 OBL 150227	国債証券		40,000,000.00	11,759.21 11,727.0672	4,703,686,400 4,690,826,880	2.500000 2015/02/27	3.09
アメリカ	2.5 T-NOTE 150430	国債証券		50,000,000.00	8,788.19 9,029.6695	4,394,098,242 4,514,834,787	2.500000 2015/04/30	2.97
オランダ	4.5 NETH GOVT 170715	国債証券		35,000,000.00	12,690.98 12,809.7120	4,441,843,480 4,483,399,200	4.500000 2017/07/15	2.95
アメリカ	3.625 T-NOTE 190815	国債証券		40,000,000.00	8,839.60 9,175.2984	3,535,840,040 3,670,119,375	3.625000 2019/08/15	2.42
フランス	3.25 O.A.T 160425	国債証券		30,000,000.00	11,593.94 11,943.7320	3,478,183,200 3,583,119,600	3.250000 2016/04/25	2.36
ドイツ	4.75 BUND 400704	国債証券		25,000,000.00	13,878.54 14,080.7216	3,469,636,600 3,520,180,400	4.750000 2040/07/04	2.32
アメリカ	2.625 T-NOTE 140630	国債証券		35,000,000.00	8,822.93 9,123.8203	3,088,027,089 3,193,337,109	2.625000 2014/06/30	2.10
アメリカ	5.375 T-BOND 310215	国債証券		30,000,000.00	10,011.14 10,496.1187	3,003,342,187 3,148,835,625	5.375000 2031/02/15	2.07
フランス	3.5 O.A.T 150425	国債証券		25,000,000.00	11,785.93 12,120.3240	2,946,482,800 3,030,081,000	3.500000 2015/04/25	2.00
アメリカ	4.75 T-NOTE 170815	国債証券		30,000,000.00	9,678.73 10,038.2343	2,903,620,931 3,011,470,312	4.750000 2017/08/15	1.98
イタリア	4.5 ITALY GOVT 200201	国債証券		25,000,000.00	11,736.57 11,883.7360	2,934,144,000 2,970,934,000	4.500000 2020/02/01	1.96

アメリカ	4.5 T-BOND 360215	国債証券		28,000,000.00	8,908.31 9,341.9250	2,494,328,519 2,615,739,000	4.500000 2036/02/15	1.72
オランダ	4 NETH GOVT 160715	国債証券		20,000,000.00	12,138.43 12,472.3760	2,427,687,200 2,494,475,200	4.000000 2016/07/15	1.64
ドイツ	3.75 BUND 150104	国債証券		20,000,000.00	12,308.23 12,338.2340	2,461,647,200 2,467,646,800	3.750000 2015/01/04	1.63
フランス	4 O.A.T 550425	国債証券		20,000,000.00	11,119.63 12,146.3600	2,223,927,200 2,429,272,000	4.000000 2055/04/25	1.60
ドイツ	6.25 BUND 300104	国債証券		15,000,000.00	14,718.26 15,951.4648	2,207,739,600 2,392,719,720	6.250000 2030/01/04	1.58
アメリカ	3.5 T-NOTE 200515	国債証券		25,000,000.00	8,919.69 9,033.0562	2,229,924,000 2,258,264,062	3.500000 2020/05/15	1.49
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券		25,000,000.00	8,394.29 8,871.8484	2,098,573,500 2,217,962,109	3.125000 2019/05/15	1.46
アメリカ	3.375 T-NOTE 130731	国債証券		23,000,000.00	9,132.97 9,310.7671	2,100,584,940 2,141,476,453	3.375000 2013/07/31	1.41
イギリス	4.75 GILT 150907	国債証券		14,000,000.00	15,183.73 15,126.9518	2,125,723,123 2,117,773,252	4.750000 2015/09/07	1.40
アメリカ	7.5 T-BOND 161115	国債証券		17,000,000.00	11,127.94 11,364.4734	1,891,750,650 1,931,960,484	7.500000 2016/11/15	1.27
アメリカ	6.25 T-BOND 230815	国債証券		17,000,000.00	10,684.85 11,178.8812	1,816,425,961 1,900,409,812	6.250000 2023/08/15	1.25
イタリア	4 ITALY GOVT 170201	国債証券		15,000,000.00	11,752.65 11,886.0000	1,762,897,560 1,782,900,000	4.000000 2017/02/01	1.17

（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22年7月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	95.87
合計	95.87

（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 >

「マネー・マーケット・マザーファンド」

(1) 投資状況

平成22年7月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	日本	589,929,620	81.92
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		130,191,119	18.08
純資産総額		720,120,739	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22年7月30日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
日本	第 1 0 4 回国庫短期証券	国債証券		60,000	99.97 99.9981	59,987,660 59,998,860	2010/08/02	8.33
日本	第 1 0 7 回国庫短期証券	国債証券		60,000	99.97 99.9963	59,985,340 59,997,780	2010/08/16	8.33
日本	第 1 1 1 回国庫短期証券	国債証券		60,000	99.97 99.9918	59,986,200 59,995,080	2010/08/30	8.33
日本	第 1 0 9 回国庫短期証券	国債証券		50,000	99.97 99.9942	49,986,720 49,997,100	2010/08/23	6.94
日本	第 1 0 5 回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9981	39,990,840 39,999,240	2010/08/09	5.55
日本	第 1 1 2 回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9896	39,988,880 39,995,840	2010/09/06	5.55

日本	第114回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9873	39,988,880 39,994,920	2010/09/13	5.55
日本	第116回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9848	39,990,680 39,993,920	2010/09/21	5.55
日本	第117回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9829	39,989,200 39,993,160	2010/09/27	5.55
日本	第118回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9807	39,988,880 39,992,280	2010/10/04	5.55
日本	第120回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9782	39,988,880 39,991,280	2010/10/12	5.55
日本	第122回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9763	39,989,480 39,990,520	2010/10/18	5.55
日本	第124回国庫短期証券	国債証券		40,000	99.97 99.9741	39,989,120 39,989,640	2010/10/25	5.55

(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22年7月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	81.92
合計	81.92

(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

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2010年07月30日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算

2 分配の推移

2010年 7月	0円
2009年 7月	0円
2008年 7月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

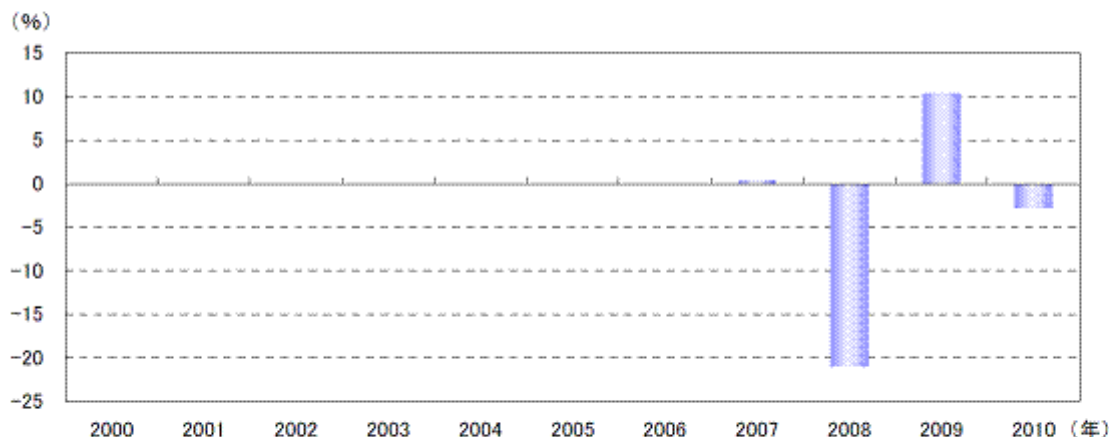
3 主要な資産の状況(2010年07月30日現在)

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	18.1%	円	62.4%	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	スイス	0.7%
国内債券	41.6%	アメリカドル	18.3%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.7%
外国株式	19.0%	ユーロ	11.1%	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	アメリカ	0.7%
外国債券	17.7%	イギリスポンド	3.7%	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	アメリカ	0.6%
		スイスフラン	1.4%	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	食品・飲料・タバコ	イギリス	0.6%
		カナダドル	0.8%	第280回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.2%
		香港ドル	0.7%	第275回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.2%
		シンガポールドル	0.5%	第303回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.2%
		その他	1.1%	3.75 BUND 190104	債券	国債	ドイツ	1.0%
コールローン他 (負債控除後)	3.6%	合計	100.0%	3.875 T-NOTE 130215	債券	国債	アメリカ	0.9%
合計	100.0%							

その他資産の状況	比率
債券先物取引(売建)	-0.4%

- ・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(REITを含む)の組み入れがある場合、株式に含めて表示

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2007年は設定日から年末までの、2010年は7月30日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。
申込単位	1円以上1円単位
申込価額	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、委託会社の毎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投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の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。 なお、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。 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。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	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を取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。
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、委託会社の毎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投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	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	原則、午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

その他	<p>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します。</p> <p>委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。</p> <p>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。</p>
-----	--

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「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を除きます。)を法令および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。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式：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、外国金融商品市場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。</p> <p>公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、第一種金融商品取引業者・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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>

(2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3) 【信託期間】

信託期間	平成19年8月10日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

(4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎年7月23日から翌年7月22日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。 委託会社と再委託先との間で締結された契約は、契約締結の日から1年間とし、期間満了の2ヵ月前までに相手方に対し書面による契約終了の申し出がない限り、1年間自動的に延長されるものとし、その後もまた同様とします。
運用報告書の作成	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、運用経過、信託財産の内容および有価証券の売買状況などを記載した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等があった場合は、その内容を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。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、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、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。 ・収益分配金は、原則として毎計算期間の終了日(決算日)の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。 ・償還金は、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金(解約)請求権	受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。 ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 (「2 換金(解約)手続等」をご参照ください。)

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。ただし、前計算期間については「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則等の一部を改正する内閣府令」(平成21年内閣府令第35号)の附則第16条第2項本文を適用しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成20年7月23日から平成21年7月22日まで)および第3期計算期間(平成21年7月23日から平成22年7月22日まで)の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

三菱UFJDC金利連動アロケーション型バランスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 [平成21年7月22日現在]	第3期 [平成22年7月22日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,775,985	4,806,471
親投資信託受益証券	683,936,298	995,357,889
未収入金	23,925	61,558
未収利息	8	13
流動資産合計	686,736,216	1,000,225,931
資産合計	686,736,216	1,000,225,931
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	120,482	238,111
未払委託者報酬	1,325,234	2,619,095
その他未払費用	57,306	45,291
流動負債合計	1,503,022	2,902,497
負債合計	1,503,022	2,902,497
純資産の部		
元本等		
元本	1 815,857,970	1 1,189,651,101
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 130,624,776	2 192,327,667
(分配準備積立金)	6,604,200	16,511,683
元本等合計	685,233,194	997,323,434
純資産合計	685,233,194	997,323,434
負債純資産合計	686,736,216	1,000,225,931

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第 2 期 自 平成20年 7月23日 至 平成21年 7月22日	第 3 期 自 平成21年 7月23日 至 平成22年 7月22日
営業収益		
受取利息	2,268	3,017
有価証券売買等損益	16,017,089	7,588,761
営業収益合計	16,014,821	7,585,744
営業費用		
受託者報酬	183,534	434,724
委託者報酬	1 2,018,808	1 4,781,749
その他費用	87,272	82,678
営業費用合計	2,289,614	5,299,151
営業利益	18,304,435	12,884,895
経常利益	18,304,435	12,884,895
当期純利益	18,304,435	12,884,895
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	4,034,613	1,866,853
期首剰余金又は期首欠損金 ()	6,699,784	130,624,776
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,518,488	11,932,213
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,518,488	11,932,213
剰余金減少額又は欠損金増加額	114,173,658	58,883,356
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	114,173,658	58,883,356
分配金	2 -	2 -
期末剰余金又は期末欠損金 ()	130,624,776	192,327,667

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第2期 (自平成20年7月23日 至平成21年7月22日)	第3期 (自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>(1) 親投資信託受益証券 同左</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第2期 [平成21年7月22日現在]	第3期 [平成22年7月22日現在]
1 期首元本額	137,338,556円	815,857,970円
期中追加設定元本額	732,066,660円	451,527,825円
期中一部解約元本額	53,547,246円	77,734,694円
2 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	130,624,776円	192,327,667円
3 計算期間末日における受益権の総数	815,857,970口	1,189,651,101口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8399円 (8,399円)	0.8383円 (8,383円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期(自平成20年7月23日 至 平成21年7月22日)

1 運用に係る権限を委託するための費用

「外国株式マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、親投資信託の純資産総額に親投資信託の受益権総口数に占める当投資信託に属する受益権口数の割合に乗じて得た額に対し年0.45%の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

2 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	6,305,074円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	3,729,504円
分配準備積立金額	D	299,126円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,333,704円
当ファンドの期末残存口数	F	815,857,970口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	126円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第3期（自平成21年7月23日 至平成22年7月22日）

1 運用に係る権限を委託するための費用

「外国株式マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、親投資信託の純資産総額に親投資信託の受益権総口数に占める当投資信託に属する受益権口数の割合に乗じて得た額に対し年0.45%の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

2 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	10,417,107円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	9,370,165円
分配準備積立金額	D	6,094,576円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,881,848円
当ファンドの期末残存口数	F	1,189,651,101口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	217円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第3期 (自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 (1)親投資信託受益証券は、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、債券価格の変動による価格変動リスクを有しております。 (2)親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 実質的な主要投資対象である親投資信託受益証券は、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第3期 [平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の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 売買目的有価証券 (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。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 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。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 [平成21年7月22日現在]		第3期 [平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	683,936,298	11,887,738	9,589,611
合計	683,936,298	11,887,738	9,589,611

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第2期（自平成20年7月23日至平成21年7月22日）

- 1 取引の状況に関する事項
該当事項はありません。
- 2 取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

第3期〔平成22年7月22日現在〕

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

- （1）株式
該当事項はありません。
- （2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数（口）	評価額	備考
親投資信託 受益証券	三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド	219,367,146	181,943,110	
	三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	102,536,082	184,718,751	
	日本債券マザーファンド	302,518,507	372,914,563	
	外国株式マザーファンド	201,506,743	189,637,995	
	マネー・マーケット・マザーファンド	65,191,672	66,143,470	
	親投資信託受益証券 小計	891,120,150	995,357,889	
	合計	891,120,150	995,357,889	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

<参考>

当ファンドは「三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」および「マネー・マーケット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これら親投資信託の受益証券です。

なお、これら親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

「三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,029,970,350	1,064,141,241
株式	68,674,360,500	49,505,530,000
未収入金	1,439,021,618	258,303,063
未収配当金	37,807,000	29,745,500
未収利息	3,063	3,029
流動資産合計	71,181,162,531	50,857,722,833
資産合計	71,181,162,531	50,857,722,833
負債の部		
流動負債		
未払金	1,469,417,885	498,444,456
未払解約金	6,339,079	13,571,396
流動負債合計	1,475,756,964	512,015,852
負債合計	1,475,756,964	512,015,852
純資産の部		
元本等		
元本	1 78,540,935,373	60,700,350,547
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2 8,835,529,806	10,354,643,566
元本等合計	69,705,405,567	50,345,706,981
純資産合計	69,705,405,567	50,345,706,981
負債純資産合計	71,181,162,531	50,857,722,833

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年6月21日から翌年6月20日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自 平成20年 7月23日 至 平成21年 7月22日)	(自 平成21年 7月23日 至 平成22年 7月22日)
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成20年7月23日 73,031,007,687円	平成21年7月23日 78,540,935,373円
期首からの追加設定元本額	23,994,737,203円	2,369,004,492円
期首からの一部解約元本額	18,484,809,517円	20,209,589,318円
元本の内訳*		
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブオープン	15,601,145,644円	14,243,272,279円
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブオープン（確定拠出年金）	7,010,970,254円	8,212,429,916円
三菱ＵＦＪ バランスインカムオープン（毎月決算型）	53,606,705,273円	36,151,524,215円
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	143,116,505円	219,367,146円
三菱ＵＦＪ 日本株アクティブファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	1,491,990,475円	1,375,628,116円
三菱ＵＦＪ 日本株式ファンドＦ（適格機関投資家限定）	687,007,222円	498,128,875円
（合計）	78,540,935,373円	60,700,350,547円
2 元本の欠損		
貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	8,835,529,806円	10,354,643,566円
3 計算期間末日における受益権の総数	78,540,935,373口	60,700,350,547口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8875円 (8,875円)	0.8294円 (8,294円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式を実質的な主要投資対象としております。株式の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の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 売買目的有価証券 （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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成21年7月22日現在]		[平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	68,674,360,500	917,712,278	4,595,115,560
合計	68,674,360,500	917,712,278	4,595,115,560

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

(自平成20年7月23日 至 平成21年7月22日)

1 取引の状況に関する事項

該当事項はありません。

2 取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

[平成22年7月22日現在]
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1802	大林組	700,000	366	256,200,000	
1808	長谷工コーポレーション	3,340,000	66	220,440,000	
1878	大東建託	50,000	4,595	229,750,000	
1928	積水ハウス	330,000	772	254,760,000	
2212	山崎製パン	221,000	1,151	254,371,000	
2802	味の素	610,000	816	497,760,000	
2914	日本たばこ産業	2,670	270,600	722,502,000	
3402	東レ	560,000	433	242,480,000	
3593	ホギメディカル	55,700	4,100	228,370,000	
3941	レンゴー	490,000	552	270,480,000	
4005	住友化学	1,030,000	336	346,080,000	
4044	セントラル硝子	650,000	327	212,550,000	
4091	大陽日酸	366,000	745	272,670,000	
4114	日本触媒	140,000	884	123,760,000	
4182	三菱瓦斯化学	520,000	439	228,280,000	
4183	三井化学	2,020,000	247	498,940,000	
4185	J S R	326,000	1,531	499,106,000	
4186	東京応化工業	175,000	1,445	252,875,000	
4452	花王	134,000	2,033	272,422,000	
4901	富士フイルムホールディングス	104,000	2,585	268,840,000	
6988	日東電工	87,000	2,891	251,517,000	
4503	アステラス製薬	91,000	2,885	262,535,000	
4507	塩野義製薬	273,000	1,790	488,670,000	
4508	田辺三菱製薬	336,000	1,285	431,760,000	
4540	ツムラ	161,900	2,630	425,797,000	
5019	出光興産	56,000	6,350	355,600,000	
5110	住友ゴム工業	300,000	831	249,300,000	
5214	日本電気硝子	314,000	1,022	320,908,000	
5233	太平洋セメント	2,140,000	109	233,260,000	
5310	東洋炭素	39,000	4,225	164,775,000	
5401	新日本製鐵	2,190,000	287	628,530,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	102,000	2,570	262,140,000	
5423	東京製鐵	510,000	1,011	515,610,000	
5486	日立金属	978,000	983	961,374,000	
5706	三井金属鉱業	1,020,000	224	228,480,000	
5714	D O W Aホールディングス	600,000	418	250,800,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	69,000	3,565	245,985,000	
5801	古河電気工業	660,000	371	244,860,000	
5802	住友電気工業	249,000	1,010	251,490,000	
3436	S U M C O	338,000	1,491	503,958,000	
5938	住生活グループ	159,000	1,754	278,886,000	
6268	ナブテスコ	190,000	1,253	238,070,000	
6273	S M C	22,600	11,430	258,318,000	
6301	小松製作所	305,000	1,722	525,210,000	
6367	ダイキン工業	170,000	2,933	498,610,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	279,000	872	243,288,000	
6448	ブラザー工業	269,000	890	239,410,000	
6501	日立製作所	2,225,000	327	727,575,000	
6502	東芝	570,000	440	250,800,000	
6503	三菱電機	400,000	693	277,200,000	
6594	日本電産	125,000	7,630	953,750,000	
6665	エルピーダメモリ	165,000	1,245	205,425,000	
6702	富士通	900,000	575	517,500,000	

6752	パナソニック	219,000	1,094	239,586,000	
6758	ソニー	305,000	2,398	731,390,000	
6762	T D K	52,000	4,905	255,060,000	
6770	アルプス電気	328,000	711	233,208,000	
6773	パイオニア	790,000	288	227,520,000	
6807	日本航空電子工業	278,000	545	151,510,000	
6841	横河電機	250,000	517	129,250,000	
6954	ファナック	73,900	9,770	722,003,000	
6963	ローム	45,000	5,320	239,400,000	
6971	京セラ	38,000	7,170	272,460,000	
6981	村田製作所	117,000	4,265	499,005,000	
7751	キヤノン	221,000	3,330	735,930,000	
8035	東京エレクトロン	48,000	4,530	217,440,000	
6902	デンソー	200,000	2,516	503,200,000	
6995	東海理化電機製作所	297,000	1,498	444,906,000	
7012	川崎重工業	2,040,000	213	434,520,000	
7201	日産自動車	820,000	607	497,740,000	
7203	トヨタ自動車	645,000	3,035	1,957,575,000	
7205	日野自動車	590,000	389	229,510,000	
7259	アイシン精機	103,000	2,422	249,466,000	
7267	本田技研工業	532,000	2,586	1,375,752,000	
7741	H O Y A	252,000	1,890	476,280,000	
7762	シチズンホールディングス	470,000	506	237,820,000	
7911	凸版印刷	340,000	702	238,680,000	
7974	任天堂	20,300	24,180	490,854,000	
9513	電源開発	95,000	2,855	271,225,000	
9086	日立物流	126,000	1,262	159,012,000	
9104	商船三井	890,000	557	495,730,000	
9202	全日本空輸	680,000	295	200,600,000	
9375	近鉄エクスプレス	71,000	2,132	151,372,000	
3632	グリー	21,000	6,400	134,400,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	1,980	122,300	242,154,000	
4684	オービック	10,300	16,480	169,744,000	
4689	ヤフー	7,600	33,150	251,940,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	50,000	3,195	159,750,000	
8056	日本ユニシス	420,000	601	252,420,000	
9432	日本電信電話	187,000	3,655	683,485,000	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	4,070	135,300	550,671,000	
9697	カブコン	171,000	1,304	222,984,000	
9984	ソフトバンク	244,000	2,472	603,168,000	
8001	伊藤忠商事	350,000	669	234,150,000	
8015	豊田通商	205,000	1,257	257,685,000	
8031	三井物産	610,000	1,113	678,930,000	
8053	住友商事	1,260,000	891	1,122,660,000	
8058	三菱商事	488,000	1,823	889,624,000	
2651	ローソン	68,000	4,020	273,360,000	
2670	エービーシー・マート	87,000	2,895	251,865,000	
2685	ポイント	35,000	4,430	155,050,000	
3086	J . フロント リテイリング	580,000	391	226,780,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	122,000	2,065	251,930,000	
7532	ドン・キホーテ	74,000	2,308	170,792,000	
8227	しまむら	32,000	7,980	255,360,000	
9831	ヤマダ電機	44,000	5,900	259,600,000	
9843	ニトリ	29,000	7,520	218,080,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,770,000	400	1,508,000,000	
8309	中央三井トラスト・ホールディングス	840,000	296	248,640,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	585,000	2,481	1,451,385,000	
8331	千葉銀行	950,000	517	491,150,000	
8403	住友信託銀行	1,080,000	449	484,920,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	3,970,000	134	531,980,000	
8604	野村ホールディングス	1,070,000	460	492,200,000	
8725	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	224,000	1,786	400,064,000	
8750	第一生命保険	1,820	110,400	200,928,000	
8766	東京海上ホールディングス	428,000	2,302	985,256,000	
8591	オリックス	80,000	6,200	496,000,000	
8801	三井不動産	362,000	1,221	442,002,000	
8802	三菱地所	377,000	1,164	438,828,000	
8804	東京建物	860,000	267	229,620,000	
2432	ディー・エヌ・エー	94,000	2,123	199,562,000	

4751	サイバーエージェント	1,170	124,600	145,782,000	
4755	楽天	4,000	69,600	278,400,000	
9783	ベネッセホールディングス	65,000	3,880	252,200,000	
	合 計	58,917,010		49,505,530,000	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「日本債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	235,549,574	103,971,583
国債証券	8,990,938,100	8,024,277,500
特殊債券	1,327,443,000	413,729,000
社債券	3,343,852,000	4,479,220,000
未収入金		210,270,000
未収利息	35,047,097	33,153,920
前払金		1,350,000
前払費用	7,367,575	4,321,771
差入委託証拠金		390,000
流動資産合計	13,940,197,346	13,270,683,774
資産合計	13,940,197,346	13,270,683,774
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,521,050
未払金	99,910,000	
未払解約金	4,927,063	51,556,971
流動負債合計	104,837,063	53,078,021
負債合計	104,837,063	53,078,021
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,716,588,958
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,118,771,325	2,495,554,156
元本等合計	13,835,360,283	13,217,605,753
純資産合計	13,835,360,283	13,217,605,753
負債純資産合計	13,940,197,346	13,270,683,774

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年7月23日から翌年7月22日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自 平成20年 7月23日 至 平成21年 7月22日)	(自 平成21年 7月23日 至 平成22年 7月22日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法		<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成20年7月23日 12,562,981,826円	平成21年7月23日 11,716,588,958円
期首からの追加設定元本額	2,680,364,391円	1,682,631,061円
期首からの一部解約元本額	3,526,757,259円	2,677,168,422円
元本の内訳*		
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	213,408,235円	302,518,507円
三菱UFJ 日本債券ファンドF（適格機関投資家限定）	54,329,145円	230,130,414円
三菱UFJ グローバルバランス（積極型）	372,608,883円	335,280,239円
三菱UFJ グローバルバランス（安定型）	1,154,117,484円	991,728,414円
三菱UFJ グローバルバランスVA	4,130,102,776円	3,331,755,375円
三菱UFJ 日本バランス20	367,909,345円	320,442,080円
三菱UFJ 日本バランス50	218,109,036円	183,455,667円
三菱UFJ 国内バランス20	3,865,714,442円	3,643,765,840円
三菱UFJ 国内バランス50	495,445,016円	459,390,171円
三菱UFJ <DC>日本債券ファンド	607,839,786円	664,360,622円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	66,055,424円	81,998,916円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	99,540,638円	109,774,574円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	71,408,748円	67,450,778円
（合計）	11,716,588,958円	10,722,051,597円
2 計算期間末日における受益権の総数	11,716,588,958口	10,722,051,597口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1808円 （11,808円）	1.2327円 （12,327円）

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成21年7月23日 至平成22年7月22日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の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 売買目的有価証券 （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。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 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。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成21年7月22日現在]		[平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,990,938,100	95,606,100	254,513,900
特殊債券	1,327,443,000	22,601,000	5,457,000
社債券	3,343,852,000	32,545,000	44,957,000
合計	13,662,233,100	150,752,100	304,927,900

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

（自 平成20年7月23日 至 平成21年7月22日）

- 1 取引の状況に関する事項
該当事項はありません。
- 2 取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

[平成22年7月22日現在]

取引の時価等に関する事項
債券関連

区分	種類	[平成22年7月22日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 売建	140,350,000		141,870,000	1,520,000
	合計	140,350,000		141,870,000	1,520,000

（注）時価の算定方法

- 1 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第270回利付国債（10年）	100,000,000	104,701,000	
	第273回利付国債（10年）	200,000,000	211,636,000	
	第275回利付国債（10年）	400,000,000	421,700,000	
	第280回利付国債（10年）	400,000,000	433,948,000	
	第282回利付国債（10年）	300,000,000	322,443,000	
	第284回利付国債（10年）	200,000,000	215,150,000	
	第285回利付国債（10年）	200,000,000	215,300,000	
	第286回利付国債（10年）	200,000,000	216,760,000	
	第288回利付国債（10年）	200,000,000	215,304,000	
	第289回利付国債（10年）	300,000,000	318,453,000	
	第291回利付国債（10年）	200,000,000	209,164,000	
	第294回利付国債（10年）	200,000,000	214,968,000	
	第296回利付国債（10年）	300,000,000	317,280,000	
	第298回利付国債（10年）	300,000,000	311,805,000	
	第299回利付国債（10年）	300,000,000	310,998,000	
	第301回利付国債（10年）	300,000,000	315,477,000	
	第303回利付国債（10年）	400,000,000	416,028,000	
	第306回利付国債（10年）	200,000,000	206,856,000	
	第11回利付国債（30年）	100,000,000	96,963,000	
	第20回利付国債（30年）	100,000,000	112,508,000	
	第23回利付国債（30年）	100,000,000	112,464,000	
	第26回利付国債（30年）	100,000,000	110,506,000	
	第27回利付国債（30年）	100,000,000	112,766,000	
	第28回利付国債（30年）	100,000,000	112,922,000	
	第50回利付国債（20年）	150,000,000	161,364,000	
	第55回利付国債（20年）	150,000,000	162,430,500	
	第59回利付国債（20年）	100,000,000	104,494,000	
	第62回利付国債（20年）	100,000,000	93,240,000	
	第66回利付国債（20年）	100,000,000	104,927,000	
	第70回利付国債（20年）	100,000,000	112,091,000	
	第74回利付国債（20年）	100,000,000	107,936,000	
	第80回利付国債（20年）	100,000,000	107,634,000	
	第88回利付国債（20年）	150,000,000	164,664,000	
	第90回利付国債（20年）	200,000,000	216,512,000	

	第96回利付国債(20年)	200,000,000	212,594,000	
	第99回利付国債(20年)	100,000,000	106,083,000	
	第104回利付国債(20年)	100,000,000	105,779,000	
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	102,444,000	
	第111回利付国債(20年)	200,000,000	213,996,000	
	第114回利付国債(20年)	100,000,000	105,221,000	
	第118回利付国債(20年)	200,000,000	206,768,000	
	国債証券 小計	7,550,000,000	8,024,277,500	
特殊債券	第222回信金中金債	100,000,000	103,046,000	
	第229回信金中金債	300,000,000	310,683,000	
	特殊債券 小計	400,000,000	413,729,000	
社債券	第14回メリルリンチ	200,000,000	200,890,000	
	第19回GEキャピタルコーポレーション	200,000,000	202,006,000	
	第12回積水ハウス	100,000,000	102,456,000	
	第1回キリンホールディングス	100,000,000	102,018,000	
	第2回サントリーホールディングス	100,000,000	102,936,000	
	第3回クラレ	200,000,000	201,860,000	
	第16回電気化学工業	100,000,000	100,743,000	
	第8回ジェイエフイーホールディングス	100,000,000	101,759,000	
	第13回日立建機	100,000,000	100,360,000	
	第15回三菱重工業	100,000,000	101,653,000	
	第21回三菱重工業	100,000,000	104,958,000	
	第51回日産自動車	100,000,000	100,756,000	
	第16回ニコン	100,000,000	102,929,000	
	第53回丸紅	100,000,000	101,159,000	
	第75回丸紅	100,000,000	101,702,000	
	第14回みずほコーポレート銀行	100,000,000	103,817,000	
	第16回みずほコーポレート銀行	100,000,000	103,131,000	
	第6回りそな銀行(劣後特約付)	100,000,000	104,034,000	
	第1回住友信託銀行(劣後特約付)	200,000,000	204,552,000	
	第12回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	203,116,000	
	第38回日立キャピタル	100,000,000	102,130,000	
	第40回日立キャピタル	100,000,000	100,966,000	
	第127回オリックス	100,000,000	103,920,000	
	第128回オリックス	100,000,000	101,787,000	
	第136回オリックス	100,000,000	99,096,000	
	第6回三菱UFJリース	100,000,000	101,460,000	
	第8回三菱UFJリース	100,000,000	100,716,000	
	第9回三菱UFJリース	100,000,000	100,542,000	
	第9回野村ホールディングス	100,000,000	101,916,000	
	第13回野村ホールディングス	200,000,000	204,534,000	
	第17回野村ホールディングス	100,000,000	102,143,000	
	第20回野村ホールディングス	100,000,000	100,740,000	
	第63回住友不動産	100,000,000	101,962,000	
	第70回住友不動産	100,000,000	101,596,000	
	第66回東京急行電鉄	100,000,000	101,269,000	
	第68回東京急行電鉄	100,000,000	100,911,000	
	第30回京浜急行電鉄	100,000,000	103,571,000	
	第14回KDDI	100,000,000	103,126,000	
	社債券 小計	4,400,000,000	4,479,220,000	
	合計	12,350,000,000	12,917,226,500	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	59,333,318	221,949,782
コール・ローン	268,948,012	76,224,860
株式	10,334,380,115	9,003,208,771
未収配当金	12,181,406	788,619
未収利息	800	217
流動資産合計	10,674,843,651	9,302,172,249
資産合計	10,674,843,651	9,302,172,249
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	611,829	
未払金	191,431,472	221,949,782
未払解約金	283,997	17,011,136
流動負債合計	192,327,298	238,960,918
負債合計	192,327,298	238,960,918
純資産の部		
元本等		
元本	1 11,449,883,084	9,630,320,233
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2 967,366,731	567,108,902
元本等合計	10,482,516,353	9,063,211,331
純資産合計	10,482,516,353	9,063,211,331
負債純資産合計	10,674,843,651	9,302,172,249

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年7月23日から翌年7月22日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自平成20年 7月23日 至平成21年 7月22日)	(自平成21年 7月23日 至平成22年 7月22日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建資産等の会計処理 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成20年7月23日 2,797,676,279円	平成21年7月23日 11,449,883,084円
期首からの追加設定元本額	9,578,057,080円	2,974,640,414円
期首からの一部解約元本額	925,850,275円	4,794,203,265円
元本の内訳*		
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	145,760,292円	201,506,743円
三菱UFJ /ブラックロック 海外株式オープン（FOF用） （適格機関投資家限定）	7,623,248,471円	5,779,897,774円
三菱UFJ グローバルバランス（積極型）	362,142,510円	345,731,160円
三菱UFJ グローバルバランス（安定型）	448,679,080円	404,084,463円
三菱UFJ グローバルバランスVA	1,605,636,958円	1,357,687,610円
三菱UFJ <DC>海外株式オープン	1,147,326,659円	1,414,810,986円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	8,988,003円	12,316,118円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	38,698,127円	44,728,057円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	69,402,984円	69,557,322円
（合計）	11,449,883,084円	9,630,320,233円
2 元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額 であります。	967,366,731円	567,108,902円
3 計算期間末日における受益権の総数	11,449,883,084口	9,630,320,233口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9155円 (9,155円)	0.9411円 (9,411円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式を実質的な主要投資対象としております。株式の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の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 売買目的有価証券 （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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成21年7月22日現在]		[平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,334,380,115	864,947,912	328,977,430
合計	10,334,380,115	864,947,912	328,977,430

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

1 取引の状況に関する事項

区分	(自平成20年7月23日 至平成21年7月22日)
1 取引の内容、取引の利用目的及び取引に対する取組方針	当ファンドは、外貨の決済のために、その受渡までの期間がごく短い為替予約取引を利用しております。
2 取引に係るリスクの内容	外貨の決済のために行う為替予約取引は、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。
3 取引に係るリスクの管理体制	運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他ファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。 また、運用部門から独立した管理部門によってリスク運営状況等をモニタリングする体制をとっており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。
4 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2 取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成21年7月22日現在]		
		契約額等(円) うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	100,941,107	100,329,278	611,829
	合計	100,941,107	100,329,278	611,829

(注) 時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
(イ) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
(ロ) 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

[平成22年7月22日現在]

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,096	70.050000	1,057,474.80	
	ALTERA CORPORATION	34,374	27.540000	946,659.96	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	59,043	12.040000	710,877.72	
	AMGEN INC	54,444	52.250000	2,844,699.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	24,021	45.980000	1,104,485.58	
	APPLE INC	12,917	254.240000	3,284,018.08	
	BECTON DICKINSON AND CO	7,396	66.920000	494,940.32	
	CELANESE CORP-SERIES A	18,615	27.150000	505,397.25	
	CHEVRON CORP	52,014	72.170000	3,753,850.38	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,928	53.070000	2,172,048.96	
	DELL INC	113,608	13.070000	1,484,856.56	
	DIRECTV-CLASS A	63,014	35.720000	2,250,860.08	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	108,069	14.270000	1,542,144.63	
	GILEAD SCIENCES INC	38,998	32.910000	1,283,424.18	
	HEWLETT-PACKARD CO	50,468	45.480000	2,295,284.64	
	INTEL CORP	124,365	21.260000	2,643,999.90	
	LORILLARD INC	25,569	74.450000	1,903,612.05	
MCDONALD'S CORP	15,207	70.110000	1,066,162.77		

MERCADOLIBRE INC	16,182	58.920000	953,443.44	
MICROSOFT CORP	85,099	25.120000	2,137,686.88	
NII HOLDINGS INC	36,572	37.730000	1,379,861.56	
PEPSICO INC	53,195	63.950000	3,401,820.25	
PFIZER INC	77,618	14.500000	1,125,461.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	41,551	49.890000	2,072,979.39	
PRAXAIR INC	32,388	82.360000	2,667,475.68	
SCHLUMBERGER LTD	17,313	59.590000	1,031,681.67	
SMART TECHNOLOGIES INC - A	59,187	16.400000	970,666.80	
SPX CORP	40,179	55.450000	2,227,925.55	
SUNTRUST BANKS INC	37,459	22.420000	839,830.78	
TIFFANY & CO	46,137	39.210000	1,809,031.77	
TIMKEN CO	51,438	29.360000	1,510,219.68	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,684	32.150000	922,190.60	
WEATHERFORD INTL LTD	82,100	15.190000	1,247,099.00	
WELLS FARGO & CO	86,790	26.060000	2,261,747.40	
XILINX INC	21,613	27.800000	600,841.40	
アメリカドル 小計	1,671,651		58,504,759.71 (5,068,852,381)	
カナダドル				
TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,588	35.140000	1,426,262.32	
カナダドル 小計	40,588		1,426,262.32 (117,695,166)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	285,016	2.741000	781,228.85	
BARCLAYS PLC	275,084	2.902500	798,431.31	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	99,770	22.335000	2,228,362.95	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,308,126	0.610100	798,087.67	
RIO TINTO PLC	37,835	32.475000	1,228,691.62	
STANDARD CHARTERED PLC	19,690	17.690000	348,316.10	
TULLOW OIL PLC	88,645	11.300000	1,001,688.50	
XSTRATA PLC	79,425	9.907000	786,863.47	
イギリスポンド 小計	2,193,591		7,971,670.47 (1,048,115,233)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	109,569	19.650000	2,153,030.85	
NESTLE SA-REG	83,605	53.300000	4,456,146.50	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5,766	322.000000	1,856,652.00	
スイスフラン 小計	198,940		8,465,829.35 (698,854,212)	
香港ドル				
CHINA DONGXIANG GROUP CO	784,000	4.810000	3,771,040.00	
CNOOC LTD	691,000	12.840000	8,872,440.00	
SANDS CHINA LTD	1,150,800	11.680000	13,441,344.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	830,000	6.260000	5,195,800.00	
香港ドル 小計	3,455,800		31,280,624.00 (348,466,151)	
シンガポールドル				
DBS GROUP HOLDINGS LTD	196,000	14.340000	2,810,640.00	
シンガポールドル 小計	196,000		2,810,640.00 (176,873,575)	
スウェーデンクローネ				
HEXAGON AB-B SHS	41,162	121.900000	5,017,647.80	
VOLVO AB-B SHS	90,676	89.850000	8,147,238.60	
スウェーデンクローネ 小計	131,838		13,164,886.40 (153,634,224)	
ユーロ				
ARCELORMITTAL	27,696	23.820000	659,718.72	
ASML HOLDING NV	35,169	23.990000	843,704.31	
AXA SA	84,506	12.735000	1,076,183.91	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	49,893	40.955000	2,043,367.81	
HEINEKEN NV	56,252	35.895000	2,019,165.54	
ING GROEP NV-CVA	114,178	6.685000	763,279.93	
SANOFI-AVENTIS	57,047	46.875000	2,674,078.12	
SOCIETE GENERALE	34,885	36.135000	1,260,569.47	
TELEFONICA SA	77,661	16.230000	1,260,438.03	
ユーロ 小計	537,287		12,600,505.84 (1,390,717,829)	
合計	8,425,695		9,003,208,771 (9,003,208,771)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 35銘柄	100.00%	56.30%
カナダドル	株式 1銘柄	100.00%	1.31%
イギリスポンド	株式 8銘柄	100.00%	11.64%
スイスフラン	株式 3銘柄	100.00%	7.76%
香港ドル	株式 4銘柄	100.00%	3.87%
シンガポールドル	株式 1銘柄	100.00%	1.96%
スウェーデンクローネ	株式 2銘柄	100.00%	1.71%
ユーロ	株式 9銘柄	100.00%	15.45%

- 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

- 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」の状況
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	9,601,086,618	3,815,357,362
コール・ローン	638,772,796	796,245,148
国債証券	193,170,704,058	144,945,818,970
未収入金	1,023,891,741	172,171,378
未収利息	1,817,048,646	1,073,877,042
前払費用	946,284,140	702,084,622
流動資産合計	207,197,787,999	151,505,554,522
資産合計	207,197,787,999	151,505,554,522
負債の部		
流動負債		
未払金	2,374,099,875	
未払解約金	458,460,283	330,411,446
流動負債合計	2,832,560,158	330,411,446
負債合計	2,832,560,158	330,411,446
純資産の部		
元本等		
元本	1 107,076,493,349	83,915,119,515
剰余金		
剰余金又は欠損金()	97,288,734,492	67,260,023,561
元本等合計	204,365,227,841	151,175,143,076
純資産合計	204,365,227,841	151,175,143,076
負債純資産合計	207,197,787,999	151,505,554,522

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年12月16日から翌年12月15日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自平成20年7月23日 至平成21年7月22日)	(自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>	<p>為替予約取引 同左</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>	<p>外貨建資産等の会計処理 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成20年7月23日 133,442,024,555円	平成21年7月23日 107,076,493,349円
期首からの追加設定元本額	6,403,954,578円	1,833,966,359円
期首からの一部解約元本額	32,769,485,784円	24,995,340,193円
元本の内訳*		
三菱UFJ バランスインカムオープン（毎月決算型）	57,866,914,194円	40,166,778,856円
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド	65,972,760円	102,536,082円
三菱UFJ ライフプラン 25	18,177,351円	17,190,605円
三菱UFJ ライフプラン 50	30,879,320円	29,540,998円
三菱UFJ ライフプラン 75	8,806,170円	5,758,513円
三菱UFJ 海外債券オープン	2,410,299,683円	2,610,141,156円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式20型	202,271,192円	171,398,134円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式40型	64,160,206円	51,652,138円
三菱UFJ 海外債券オープン（3ヵ月決算型）	18,430,920,030円	13,759,064,646円
三菱UFJ ライフプラン 50VA（適格機関投資家限定）	369,113,510円	303,859,433円
三菱UFJ 海外債券オープンVA（適格機関投資家限定）	677,298,627円	633,076,961円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA（適格機関投資家限定）	24,302,953,485円	23,415,793,068円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限定）	2,628,726,821円	2,648,328,925円
（合計）	107,076,493,349円	83,915,119,515円
2 計算期間末日における受益権の総数	107,076,493,349口	83,915,119,515口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9086円 （19,086円）	1.8015円 （18,015円）

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成21年7月23日 至平成22年7月22日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成21年7月22日現在]		[平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	193,170,704,058	1,554,384,898	3,527,198,687
合計	193,170,704,058	1,554,384,898	3,527,198,687

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

1 取引の状況に関する事項

区分	(自平成20年7月23日 至平成21年7月22日)
1 取引の内容、取引の利用目的及び取引に対する取組方針	当ファンドは、外貨の決済のために、その受渡までの期間がごく短い為替予約取引を利用しておりません。
2 取引に係るリスクの内容	外貨の決済のために行う為替予約取引は、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。
3 取引に係るリスクの管理体制	運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他ファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。 また、運用部門から独立した管理部門によってリスク運営状況等をモニタリングする体制をとっており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。
4 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

2 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

[平成22年7月22日現在]

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル				
国債証券	2.5 T-NOTE 150430	50,000,000.00	52,089,844.00	
	2.625 T-NOTE 140630	35,000,000.00	36,837,500.00	
	3 T-NOTE 170228	60,000,000.00	62,634,375.00	
	3.125 T-NOTE 190515	25,000,000.00	25,757,812.50	
	3.375 T-NOTE 130731	23,000,000.00	24,714,218.75	
	3.5 T-NOTE 200515	25,000,000.00	26,281,250.00	
	3.625 T-NOTE 190815	40,000,000.00	42,618,750.00	
	3.875 T-NOTE 130215	90,000,000.00	97,354,687.50	
	3.875 T-NOTE 180515	55,000,000.00	60,585,937.50	
	4 T-NOTE 121115	15,000,000.00	16,167,187.50	
	4.25 T-NOTE 131115	10,000,000.00	11,062,500.00	
	4.25 T-NOTE 150815	55,000,000.00	61,840,625.00	
	4.5 T-BOND 360215	28,000,000.00	31,053,750.00	
	4.625 T-BOND 400215	15,000,000.00	16,884,375.00	
	4.75 T-NOTE 170815	30,000,000.00	34,893,750.00	
	5.375 T-BOND 310215	30,000,000.00	37,092,187.50	
	6 T-BOND 260215	10,000,000.00	12,985,937.50	
6.25 T-BOND 230815	17,000,000.00	22,203,593.75		
7.5 T-BOND 161115	17,000,000.00	22,352,343.75		
8.75 T-BOND 200515	8,000,000.00	12,017,500.00		
国債証券 小計		638,000,000.00	707,428,125.25 (61,291,572,771)	
アメリカドル 小計		638,000,000.00	707,428,125.25 (61,291,572,771)	
カナダドル				
国債証券	3.5 CAN GOVT 130601	9,000,000.00	9,415,530.00	
	3.75 CAN GOVT 120601	9,000,000.00	9,385,470.00	
	4.25 CAN GOVT 180601	5,800,000.00	6,330,816.00	
	4.5 CAN GOVT 150601	8,000,000.00	8,783,040.00	
	5 CAN GOVT 370601	4,500,000.00	5,463,000.00	
	5.75 CAN GOVT 290601	4,500,000.00	5,751,585.00	
	8 CAN GOVT 230601	4,300,000.00	6,336,136.00	
国債証券 小計		45,100,000.00	51,465,577.00 (4,246,939,414)	

カナダドル 小計		45,100,000.00	51,465,577.00 (4,246,939,414)
オーストラリアドル			
国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	2,000,000.00	2,017,850.00
	5.75 AUST GOVT 120415	5,700,000.00	5,805,769.20
	5.75 AUST GOVT 210515	3,000,000.00	3,127,377.00
	6 AUST GOVT 170215	1,800,000.00	1,898,623.80
	6.25 AUST GOVT 150415	3,700,000.00	3,922,085.10
国債証券 小計		16,200,000.00	16,771,705.10 (1,273,643,285)
オーストラリアドル 小計		16,200,000.00	16,771,705.10 (1,273,643,285)
イギリスポンド			
国債証券	4.25 GILT 320607	11,000,000.00	11,062,040.00
	4.25 GILT 551207	11,000,000.00	11,120,670.00
	4.5 GILT 130307	11,000,000.00	11,942,700.00
	4.75 GILT 150907	14,000,000.00	15,719,200.00
	4.75 GILT 200307	6,000,000.00	6,681,000.00
	5 GILT 120307	3,000,000.00	3,203,610.00
	5 GILT 180307	7,000,000.00	7,975,100.00
	5 GILT 250307	6,000,000.00	6,715,200.00
	6 GILT 281207	6,000,000.00	7,476,060.00
	8 GILT 151207	1,000,000.00	1,290,700.00
国債証券 小計		76,000,000.00	83,186,280.00 (10,937,332,094)
イギリスポンド 小計		76,000,000.00	83,186,280.00 (10,937,332,094)
シンガポールドル			
国債証券	2.5 SINGAPOGOVT 190601	1,700,000.00	1,795,878.30
	2.625SINGAPOGOVT 120401	4,000,000.00	4,146,816.00
	3.25 SINGAPOGOVT 200901	2,000,000.00	2,182,726.00
	3.5 SINGAPOGOVT 270301	900,000.00	975,330.00
	3.625SINGAPOGOVT 140701	1,700,000.00	1,889,310.30
	3.75 SINGAPOGOVT 160901	2,000,000.00	2,286,396.00
国債証券 小計		12,300,000.00	13,276,456.60 (835,487,413)
シンガポールドル 小計		12,300,000.00	13,276,456.60 (835,487,413)
マレーシアリングギット			
国債証券	3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,699,196.00
	3.718MALAYSIAGOVT 120615	13,000,000.00	13,152,607.00
	3.814MALAYSIAGOVT 170215	13,000,000.00	13,110,331.00
	4.378MALAYSIAGOVT 191129	3,500,000.00	3,629,703.00
	5.094MALAYSIAGOVT 140430	4,000,000.00	4,250,044.00
国債証券 小計		36,500,000.00	36,841,881.00 (990,678,180)
マレーシアリングギット 小計		36,500,000.00	36,841,881.00 (990,678,180)
スウェーデンクローネ			
国債証券	3 SWD GOVT 160712	20,000,000.00	20,768,000.00
	3.5 SWD GOVT 390330	7,000,000.00	7,128,660.00
	3.75 SWD GOVT 170812	24,000,000.00	25,992,720.00
	5 SWD GOVT 201201	12,000,000.00	14,427,480.00
	6.75 SWD GOVT 140505	15,000,000.00	17,642,550.00
国債証券 小計		78,000,000.00	85,959,410.00 (1,003,146,314)
スウェーデンクローネ 小計		78,000,000.00	85,959,410.00 (1,003,146,314)
ノルウェークローネ			
国債証券	4.25 NORWE GOVT 170519	13,000,000.00	14,105,000.00
	5 NORWE GOVT 150515	10,000,000.00	11,093,000.00
	6.5 NORWE GOVT 130515	9,000,000.00	10,011,600.00
国債証券 小計		32,000,000.00	35,209,600.00 (484,132,000)
ノルウェークローネ 小計		32,000,000.00	35,209,600.00 (484,132,000)
ポーランドズロチ			
国債証券	4.75 POLAND 120425	12,000,000.00	12,031,200.00
	5 POLAND 131024	13,000,000.00	12,971,400.00
	5.25 POLAND 171025	10,000,000.00	9,733,000.00
	5.75 POLAND 220923	5,000,000.00	4,907,500.00

	6.25 POLAND 151024	5,000,000.00	5,175,000.00	
	国債証券 小計	45,000,000.00	44,818,100.00 (1,210,088,700)	
	ポーランドズロチ 小計	45,000,000.00	44,818,100.00 (1,210,088,700)	
	ユーロ			
国債証券	2.5 OBL 150227	40,000,000.00	41,640,800.00	
	2.75 SPAIN GOVT 120430	10,000,000.00	10,121,000.00	
	3.25 BUND 200104	25,000,000.00	26,390,750.00	
	3.25 O.A.T 160425	30,000,000.00	31,743,000.00	
	3.5 O.A.T 150425	25,000,000.00	26,847,500.00	
	3.75 BUND 150104	20,000,000.00	21,896,600.00	
	3.75 BUND 190104	65,000,000.00	71,241,300.00	
	3.75 ITALY GOVT 150801	10,000,000.00	10,452,000.00	
	4 BUND 160704	50,000,000.00	55,729,000.00	
	4 ITALY GOVT 170201	15,000,000.00	15,675,000.00	
	4 NETH GOVT 160715	20,000,000.00	22,102,000.00	
	4 O.A.T 140425	10,000,000.00	10,919,000.00	
	4 O.A.T 550425	20,000,000.00	21,734,000.00	
	4.25 ITALY GOVT 140801	10,000,000.00	10,656,000.00	
	4.25 O.A.T 231025	5,000,000.00	5,507,500.00	
	4.5 ITALY GOVT 200201	25,000,000.00	26,107,500.00	
	4.5 NETH GOVT 170715	35,000,000.00	39,781,000.00	
	4.75 BUND 400704	25,000,000.00	31,662,250.00	
	4.75 ITALY GOVT 130201	5,000,000.00	5,346,000.00	
	4.75 ITALY GOVT 230801	33,000,000.00	34,336,500.00	
	5 BEL GOVT 350328	5,000,000.00	5,795,500.00	
	5 ITALY GOVT 400901	15,000,000.00	15,078,000.00	
	6 ITALY GOVT 310501	5,000,000.00	5,662,000.00	
	6.25 BUND 300104	15,000,000.00	21,418,500.00	
	国債証券 小計	518,000,000.00	567,842,700.00 (62,672,798,799)	
	ユーロ 小計	518,000,000.00	567,842,700.00 (62,672,798,799)	
	合計		144,945,818,970 (144,945,818,970)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 20銘柄	100.00%	42.29%
カナダドル	国債証券 7銘柄	100.00%	2.93%
オーストラリアドル	国債証券 5銘柄	100.00%	0.88%
イギリスポンド	国債証券 10銘柄	100.00%	7.55%
シンガポールドル	国債証券 6銘柄	100.00%	0.58%
マレーシアリングギット	国債証券 5銘柄	100.00%	0.68%
スウェーデンクローネ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.69%
ノルウェークローネ	国債証券 3銘柄	100.00%	0.33%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.83%
ユーロ	国債証券 24銘柄	100.00%	43.24%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[前へ](#) [次へ](#)

「マネー・マーケット・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,748,001	154,557,543
国債証券	349,945,710	589,927,140
未収利息	192	440
流動資産合計	414,693,903	744,485,123
資産合計	414,693,903	744,485,123
負債の部		
流動負債		
未払金		39,989,480
未払解約金	10,264,255	461,791
流動負債合計	10,264,255	40,451,271
負債合計	10,264,255	40,451,271
純資産の部		
元本等		
元本	1 399,143,491	693,929,785
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,286,157	10,104,067
元本等合計	404,429,648	704,033,852
純資産合計	404,429,648	704,033,852
負債純資産合計	414,693,903	744,485,123

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月21日から11月20日まで、および11月21日から翌年5月20日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自 平成20年 7月23日 至 平成21年 7月22日)	(自 平成21年 7月23日 至 平成22年 7月22日)
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成21年7月22日現在]	[平成22年7月22日現在]
1 期首	平成20年7月23日	平成21年7月23日
期首元本額	79,494,326円	399,143,491円
期首からの追加設定元本額	606,431,847円	2,382,169,309円
期首からの一部解約元本額	286,782,682円	2,087,383,015円
元本の内訳*		
三菱ＵＦＪ ＤＣ金利連動アロケーション型バランスファンド	44,975,130円	65,191,672円
三菱ＵＦＪ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)ファンド・マネジャー(新興国株式)	24,866,713円	24,866,713円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	32,418円	32,418円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	308,759円	308,759円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	5,845,182円	38,654,392円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	266,588円	1,795,545円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	157,978円	878,253円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>(毎月分配型)	1,777,252円	25,382,478円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	41,893,760円	366,963,045円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マナーブルファンド>	1,145,340円	1,393,530円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中国元コース>(毎月分配型)	375,198円	1,046,465円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<インドネシアルピアコース>(毎月分配型)	245,262,641円	132,846,445円
マナーブル・ファンド		433,750円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)		2,691,177円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	31,227,549円	3,584,179円
(合計)	1,008,983円	26,407,926円
2 計算期間末日における受益権の総数	399,143,491口	693,929,785口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0132円 (10,132円)	1.0146円 (10,146円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の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 売買目的有価証券 (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。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成21年7月22日現在]		[平成22年7月22日現在]
	貸借対照表計上額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	349,945,710	6,876	3,602
合計	349,945,710	6,876	3,602

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、当該親投資信託の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

(自 平成20年7月23日 至 平成21年7月22日)

1 取引の状況に関する事項

該当事項はありません。

2 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

[平成22年7月22日現在]

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備 考
国債証券	第103回国庫短期証券	40,000,000	39,999,240	
	第104回国庫短期証券	60,000,000	59,998,860	
	第105回国庫短期証券	40,000,000	39,998,400	
	第107回国庫短期証券	60,000,000	59,996,340	
	第109回国庫短期証券	50,000,000	49,995,900	
	第111回国庫短期証券	60,000,000	59,993,520	
	第112回国庫短期証券	40,000,000	39,994,800	
	第114回国庫短期証券	40,000,000	39,993,920	
	第116回国庫短期証券	40,000,000	39,992,920	
	第117回国庫短期証券	40,000,000	39,992,160	
	第118回国庫短期証券	40,000,000	39,991,280	
	第120回国庫短期証券	40,000,000	39,990,280	
	第122回国庫短期証券	40,000,000	39,989,520	
	国債証券 小計	590,000,000	589,927,140	
	合計	590,000,000	589,927,140	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	1,027,372,312
負債総額	140,975
純資産総額(-)	1,027,231,337
発行済口数	1,205,370,287 口
1口当たり純資産価額(/)	0.8522 (1万口当たり 8,522)

<参考>

「三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	53,384,741,124
負債総額	1,440,654,097
純資産総額(-)	51,944,087,027
発行済口数	60,518,021,200 口
1口当たり純資産価額(/)	0.8583 (1万口当たり 8,583)

<参考>

「日本債券マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	13,504,799,311
負債総額	306,449,535
純資産総額(-)	13,198,349,776
発行済口数	10,692,987,554 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2343 (1万口当たり 12,343)

<参考>

「外国株式マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	9,421,144,459
負債総額	171,741
純資産総額(-)	9,420,972,718
発行済口数	9,611,271,998 口
1口当たり純資産価額(/)	0.9802 (1万口当たり 9,802)

<参考>

「三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	152,211,138,277
負債総額	422,368,421
純資産総額(-)	151,788,769,856
発行済口数	83,354,961,532 口
1口当たり純資産価額(/)	1.8210 (1万口当たり 18,210)

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成22年7月30日現在

(単位:円)

資産総額	720,120,864
負債総額	125
純資産総額(-)	720,120,739
発行済口数	709,769,082 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0146 (1万口当たり 10,146)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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】

(1) 資本金の額等

平成22年7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、124,098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ファンド毎の運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定されたファンド毎の運用戦略に基づいて、各運用部は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戦略に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに関係する法人等の管理

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（5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平成22年7月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）

等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。
平成22年7月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	330	5,806,070
追加型公社債投資信託	18	403,232
単位型株式投資信託	9	80,412
単位型公社債投資信託	7	116,206
合計	364	6,405,919

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ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。

第24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）は、改正前の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、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正後の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」に基づいて作成しております。

なお、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24期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受けており、第25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表については、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。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により、平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなりました。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)		第25期 (平成22年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	8,398,952	2	8,675,536
有価証券	2	11,498,934	2	14,000,000
前払費用		130,052		136,193
未収入金		133,300	2	45,397
未収委託者報酬		3,496,056		4,345,110
未収収益	2	77,468	2	43,835
繰延税金資産		289,685		407,456
金銭の信託	2	1,000,000	2	500,000
その他		13,229		8,190
流動資産合計		25,037,680		28,161,721
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	368,327	1	333,687
器具備品	1	168,906	1	158,971
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,742,265		1,697,691
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		809,683		787,767
ソフトウェア仮勘定		7,316		72,475
その他		156		112
無形固定資産合計		832,978		876,178
投資その他の資産				
投資有価証券		11,906,934		11,797,311
関係会社株式		431,812		431,812
長期性預金	2	2,000,000	2	5,000,000
長期差入保証金	2	844,978	2	1,030,783
長期前払費用		4,371		142
繰延税金資産		473,766		474,632
その他		20,485		16,075
投資その他の資産合計		15,682,348		18,750,756
固定資産合計		18,257,593		21,324,626
資産合計		43,295,274		49,486,347

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,038,438	51,838
未払金		
未払収益分配金	272,705	274,776
未払償還金	2,047,207	1,607,485
未払手数料	2 1,440,183	2 1,748,905
その他未払金	110,716	52,889
未払費用	2 781,556	2 1,034,566
未払消費税等		104,853
未払法人税等	595,981	1,727,215
仮受金	43	
賞与引当金	478,200	580,826
デリバティブ債務		7,536
流動負債合計	6,765,032	7,190,892
固定負債		
退職給付引当金	13,304	68,206
役員退職慰労引当金	54,658	66,197
固定負債合計	67,962	134,404
負債合計	6,832,995	7,325,296
(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	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
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	27,520,492	31,383,254
利益剰余金合計	34,861,082	38,723,843
株主資本合計	37,083,309	40,946,071
評価・換算差額等		
その他有価証券	621,031	1,277,237
評価差額金		
繰延ヘッジ損益		62,258
評価・換算差額等合計	621,031	1,214,979
純資産合計	36,462,278	42,161,050
負債純資産合計	43,295,274	49,486,347

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		42,137,383		40,630,847
その他営業収益				
投資顧問料		7,887		7,619
その他		8,381		85,040
営業収益合計		42,153,652		40,723,506
営業費用				
支払手数料	2	18,452,482	2	17,208,659
広告宣伝費		911,798		579,833
公告費		4,088		7,195
調査費				
調査費		778,991		799,697
委託調査費		4,427,117		5,231,920
事務委託費		229,877		183,931
営業雑経費				
通信費		114,009		98,055
印刷費		640,249		607,867
協会費		42,295		35,983
諸会費		6,356		5,761
事務機器関連費		820,190		841,349
営業費用合計		26,427,456		25,600,255
一般管理費				
給料				
役員報酬		171,783		194,520
給料・手当		3,243,471		3,445,656
賞与引当金繰入		478,200		580,826
福利厚生費		427,372		458,092
交際費		20,785		21,080
旅費交通費		126,644		108,299
租税公課		112,608		102,967
不動産賃借料		658,309		654,768
退職給付費用		151,382		177,435
役員退職慰労引当金繰入		17,566		18,448
固定資産減価償却費		345,975		382,798
諸雑費		368,982		287,163
一般管理費合計		6,123,082		6,432,057
営業利益		9,603,113		8,691,194

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		185,609		30,250
有価証券利息	2	55,030	2	29,170
受取利息	2	21,926	2	19,853
投資有価証券償還益				73,517
収益分配金等時効完成分		111,003		421,674
その他		5,225		8,586
営業外収益合計		378,796		583,053
営業外費用				
投資有価証券償還損				181,632
収益分配金等時効完成分支払額		62,259		10,520
事務過誤費		13,871		7,510
その他		7,266		3,626
営業外費用合計		83,398		203,289
経常利益		9,898,511		9,070,957
特別利益				
投資有価証券売却益		15,399		231,903
ゴルフ会員権売却益				10,190
特別利益合計		15,399		242,093
特別損失				
投資有価証券売却損		228,868		129,159
投資有価証券評価損		2,124,730		
固定資産除却損	1	2,488	1	701
その他		5,965		
特別損失合計		2,362,053		129,860
税引前当期純利益		7,551,856		9,183,190
法人税、住民税及び事業税		3,801,688		3,627,233
法人税等調整額		144,759		118,635
法人税等合計		3,946,448		3,508,597
当期純利益		3,605,408		5,674,592

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
前期末残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	28,643,217	27,520,492
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	27,520,492	31,383,254
利益剰余金合計		
前期残高	35,983,807	34,861,082
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	34,861,082	38,723,843
株主資本合計		
前期末残高	38,206,035	37,083,309
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
当期変動額合計	1,122,725	3,862,761
当期末残高	37,083,309	40,946,071
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	119,404	621,031
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,898,269
当期変動額合計	501,627	1,898,269
当期末残高	621,031	1,277,237
繰延ヘッジ損益		
前期末残高		
当期変動額		

株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		62,258
当期変動額合計		62,258
当期末残高		62,258
評価・換算差額等合計		
前期末残高	119,404	621,031
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,836,011
当期変動額合計	501,627	1,836,011
当期末残高	621,031	1,214,979
純資産合計		
前期末残高	38,086,630	36,462,278
当期変動額		
剰余金の配当	4,728,133	1,811,830
当期純利益	3,605,408	5,674,592
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	501,627	1,836,011
当期変動額合計	1,624,352	5,698,772
当期末残高	36,462,278	42,161,050

重要な会計方針

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	子会社株式：移動平均法による原価法によっております。 その他有価証券： 時価のあるものは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)によっております。 時価のないものは移動平均法による原価法によっております。	同 左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	-	時価法によっております。
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。 なお、主な耐用年数は、建物38年であります。	同 左
(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェア	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。	同 左
それ以外の無形固定資産	定額法を採用しております。	同 左
4. 外貨建の資産又は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。	同 左
5. 引当金の計上基準		
(1) 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。	同 左
(2) 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。 数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。	同 左
(3) 役員退職慰労引当金	役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。	同 左
6. ヘッジ会計の手法		
(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	-	当事業年度にヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 a. ヘッジ手段... 株価指数先物 ヘッジ対象... 投資有価証券 b. ヘッジ手段... 株式関連オプション ヘッジ対象... 投資有価証券
(3) ヘッジ方針	-	当社の内規である「ヘッジ取引に関する内規」に基づき、ヘッジ対象に係る価格変動リスクを一定の範囲内でヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法	-	ヘッジ対象の騰落率とヘッジ手段の騰落率を比較し、両者の変動額を基礎にして、有効性を評価しております。
7.消費税等の会計処理	税抜方式によっております。	同 左

重要な会計方針の変更

第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
-	当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3) (企業会計基準第19号 平成20年7月31日)を適用しております。なお、これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。

注記事項

(貸借対照表関係)

項目	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 117,264千円 器具備品 130,206千円	建物 152,240千円 器具備品 167,633千円
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。 預金 5,493,354千円 有価証券 11,000,000千円 未収収益 5,233千円 金銭の信託 1,000,000千円 長期性預金 2,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 868,907千円 未払費用 198,857千円	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。 預金 5,272,377千円 有価証券 14,000,000千円 未収入金 2,072千円 未収収益 43,545千円 金銭の信託 500,000千円 長期性預金 5,000,000千円 長期差入保証金 837,940千円 未払手数料 1,005,639千円 未払費用 153,908千円

（損益計算書関係）

項目	第24期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）		第25期 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	
	1. 固定資産除却損の内 訳	器具備品 1,961千円	ソフトウェア 527千円	器具備品 701千円
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。 支払手数料 12,493,304千円 有価証券利息 44,704千円 受取利息 21,926千円		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。 支払手数料 11,148,518千円 有価証券利息 26,197千円 受取利息 19,853千円	

（株主資本等変動計算書関係）

第24期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成20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	4,728,133千円
1株当たり配当額	38,100円
基準日	平成20年3月31日
効力発生日	平成20年7月1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21年6月29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	1,811,830千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	14,600円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21年6月30日

第25期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成21年6月29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	1,811,830千円
1株当たり配当額	14,600円
基準日	平成21年3月31日
効力発生日	平成21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22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	2,841,844千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1日

(金融商品関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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。

(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。このうち一部の投資信託については価格変動リスクを回避するために、デリバティブ取引を行っております。

デリバティブ取引は、投資信託に係る価格変動リスクに対するヘッジを目的とした先物取引及びオプション取引であります。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「6.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

デリバティブ取引の利用にあたっては、カウンターパーティーリスクを軽減するために、格付の高い金融機関とのみ取引を行っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

投資信託については、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。

デリバティブ取引については、内部管理規程に従い、実需の範囲で行うこととしております。

(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

平成22年3月31日(当期の決算日)における貸借対照表計上額、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)。

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	8,675,536	8,675,536	-
(2) 有価証券	14,000,000	14,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,345,110	4,345,110	-
(4) 長期性預金	5,000,000	5,007,477	7,477
(5) 投資有価証券	11,533,054	11,533,054	-
(6) 未払手数料	(1,748,905)	(1,748,905)	-
(7) 未払法人税等	(1,727,215)	(1,727,215)	-
(8) デリバティブ取引(*2)	(7,536)	(7,536)	-

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)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ます。

(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

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券並びに(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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4) 長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

(6) 未払手数料、並びに(7) 未払法人税等

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。

(8) デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

(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

非上場株式(貸借対照表計上額264,257千円)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、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円)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

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	8,675,536	-	-	-
未収委託者報酬	4,345,110	-	-	-
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				
譲渡性預金	14,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,044,412	62,645	-
長期性預金	-	5,000,000	-	-
合計	27,020,647	8,044,412	62,645	-

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

(有価証券関係)

第24期（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価 (千円)	貸借対照表計上額 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	1,465,168	1,522,867	57,698
	小計	1,465,168	1,522,867	57,698
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,557,951	7,573,200	984,750
	小計	8,557,951	7,573,200	984,750
合計		10,023,119	9,096,067	927,052

(注) 当事業年度において、有価証券について2,124,730千円（その他有価証券で時価のある証券投資信託2,124,730千円）減損処理を行っております。なお、証券投資信託の減損処理は、期末における時価が簿価に比べ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。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）

売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
1,729,081	15,399	228,868

3. 時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
MMF	2,014,549千円
キャッシュファンド	1,008,475千円
譲渡性預金	11,000,000千円
非上場株式	286,777千円
子会社株式及び関連会社株式	
子会社株式	431,812千円

4. その他有価証券のうち満期があるものの今後の償還予定

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
投資信託	498,934	2,262,320	482,062	-
合計	498,934	2,262,320	482,062	-

第25期（平成22年3月31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（貸借対照表計上額 関係会社株式431,812千円）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	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,083,784	4,825,309	1,258,474
	小計	6,083,784	4,825,309	1,258,474
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,449,270	5,692,652	243,382
	小計	5,449,270	5,692,652	243,382
合計		11,533,054	10,517,961	1,015,092

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額264,257千円）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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自平成21年4月1日至平成22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	11,600	-	10,920
債券	-	-	-
その他	1,988,176	253,043	118,239
合計	1,999,776	253,043	129,159

（デリバティブ取引関係）

第24期（自平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第25期（自平成21年4月1日 至 平成22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

該当するものではありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ会計の手法	取引の種類	主なヘッジ対象	当事業年度（平成22年3月31日）		
			契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	先物取引（売建）	投資有価証券	373,043	-	7,536

（注）時価の算定方法 取引所の価格及び決算日の為替レートによっております。

（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、従業員に対して適格退職年金制度及び退職一時金制度を設けております。なお、平成18年6月に適格退職年金制度及び退職一時金制度の一部について確定拠出年金制度へ移行しました。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(1)退職給付債務	771,109	661,846
(2)年金資産	454,977	416,582
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	316,132	245,263
(4)未認識数理計算上の差異	306,966	177,056
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	9,164	68,206
(6)前払年金費用	4,139	
(7)退職給付引当金 (5) - (6)	13,304	68,206

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
(1)勤務費用	29,439	28,685
(2)利息費用	12,676	11,367
(3)期待運用収益	10,905	6,824
(4)数理計算上の差異の費用処理額	38,186	57,581
(5)退職給付費用	69,396	90,809
(6)その他	81,986	86,626
(7)合計	151,382	177,435

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付の計算基礎に関する事項

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
(1) 割引率	1.5%	同左
(2) 期待運用収益率	1.5%	同左
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	同左
(4) 数理計算上の差異の処理年数	各事業年度の発生時における従業員 の平均支払期間以内の一定 の年数（8年）による定額法に より、翌事業年度より費用処理 しております。	同左

(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

(単位：千円)

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	689,220	669,724
投資有価証券評価損	1,041,250	849,883
ゴルフ会員権評価損	30,885	9,710
未払事業税	49,084	136,281
賞与引当金	194,579	236,338
役員退職慰労引当金	22,240	26,935
退職給付引当金	5,413	27,753
退職一時金未払	14,992	-
減価償却超過額	63,725	54,520
委託者報酬	124,519	106,666
その他有価証券評価差額金	377,217	-
その他	32,298	62,287
繰延税金資産 小計	2,645,429	2,180,101
評価性引当額	1,880,292	1,298,012
繰延税金資産 合計	765,137	882,088
繰延税金負債		
前払年金費用	1,684	-
繰延税金負債 合計	1,684	-
繰延税金資産(負債)の純額	763,452	882,088

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原因

	第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
法定実効税率	(%) 40.7	法定実効税率 (%) 40.7
(調整)		(調整)
投資有価証券評価損に係る損金不算入	11.4	投資有価証券評価損認容
その他	0.2	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	52.3	税効果会計適用後の法人税等の負担率
		2.1
		0.4
		38.2

(関連当事者情報)

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

(追加情報)

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準第11号平成18年10月17日)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第13号平成18年10月17日)を適用しております。

この結果、従来の開示対象に加えて、親会社に関する注記が開示対象に追加されております。

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

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	直接 30.0%	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	4,440,945 千円	未払手数料	239,286 千円	
							事務所の賃借	631,409 千円	長期差入保証金	833,144 千円	
							投資の助言	264,141 千円	未払費用	146,190 千円	
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,196,295 百万円	銀行業	直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	8,052,358 千円	未払手数料	629,621 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	34,000,000 千円	有価証券	11,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	44,704 千円	未収利息	3,900 千円
								マルチコーラブル預金の預入	3,000,000 千円	長期性預金	2,000,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	4,423 千円	未収利息	35 千円

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。

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、市場実勢等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。

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

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	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証券(株)	東京都千代田区	65,518 百万円	証券業	-	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	2,400,621 千円	未払手数料	296,719 千円

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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 30.0%	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	4,064,069 千円	未払手数料	285,840 千円
						事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	833,144 千円
						投資の助言	投資助言料	186,556 千円	未払費用	99,917 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,084,449 千円	未払手数料	719,799 千円
						取引銀行	譲渡性預金の預入	49,000,000 千円	有価証券	14,000,000 千円
							譲渡性預金に係る受取利息	26,197 千円	未収利息	1,234 千円
							マルチコーラブル預金の預入	5,000,000 千円	長期性預金	5,000,000 千円
		マルチコーラブル預金に係る受取利息	16,869 千円	未収利息	1,597 千円					

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。

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、市場実勢等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3ヶ月～3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

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証券(株)	東京都千代田区	65,518百万円	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	2,822,731千円	未払手数料	397,272千円

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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額	293,818円41銭	339,739円97銭
1株当たり当期純利益	29,052円91銭	45,726円70銭

(注)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。

1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
当期純利益(千円)	3,605,408	5,674,592
普通株式に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	3,605,408	5,674,592
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下

において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成22年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成22年3月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958 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。

(3) 再委託先

名称：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド

資本金の額：94百万英ポンド（平成22年3月末現在）

事業の内容：投資運用業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

(3) 再委託先：委託会社から外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受け、運用の指図を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成22年7月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の30.0%（37,230株）、株式会社三菱東京UFJ銀行は15.0%（18,615株）を所有しています。

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式・公社債等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成22年9月1日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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金利連動アロケーション型バランスファンドの平成21年7月23日から平成22年7月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンドの平成22年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	村山 周平 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	後藤 徳彌 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	五十幡 理一郎 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投信株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成22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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成21年8月26日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員

公認会計士 荒川 進 印

指定社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田光夫 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金利連動アロケーション型バランスファンドの平成20年7月23日から平成21年7月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンドの平成21年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

(注) 上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月30日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	桃崎 有治 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	村山 周平 印
指定社員 業務執行社員	公認会計士	五十幡 理一郎 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投信株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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投信株式会社の平成21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。

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。