

【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23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。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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23年10月22日から平成24年10月22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

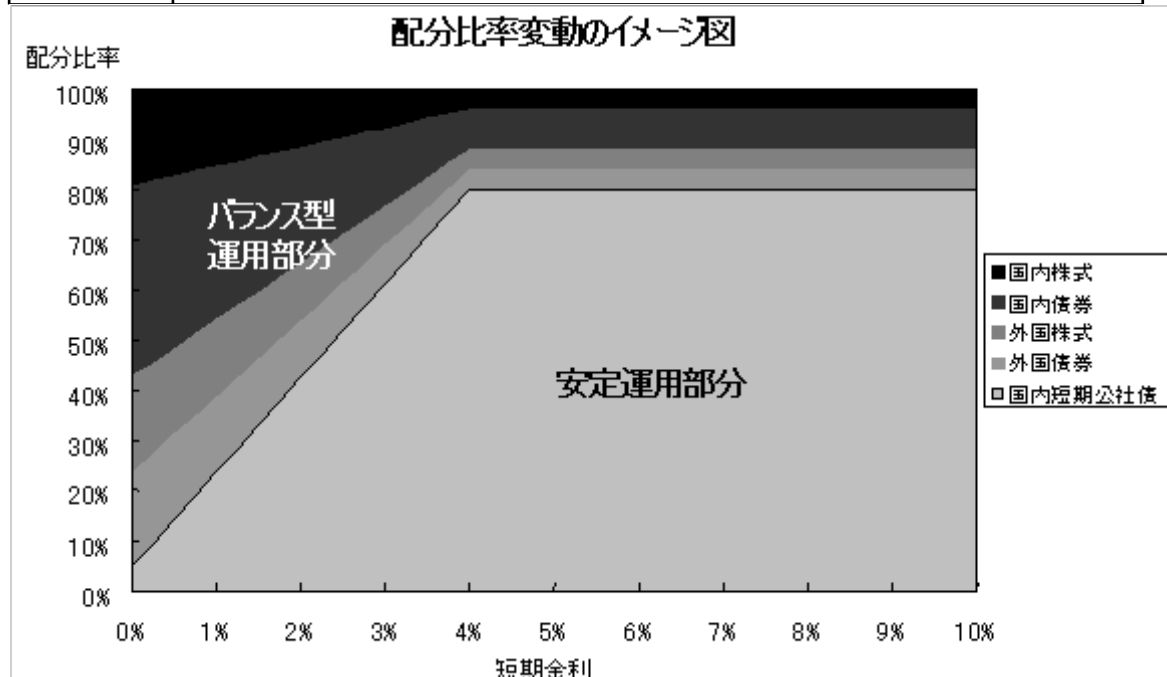
バランス型運用部分における各資産への配分比率は、以下の比率とすることを基本とします。

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。

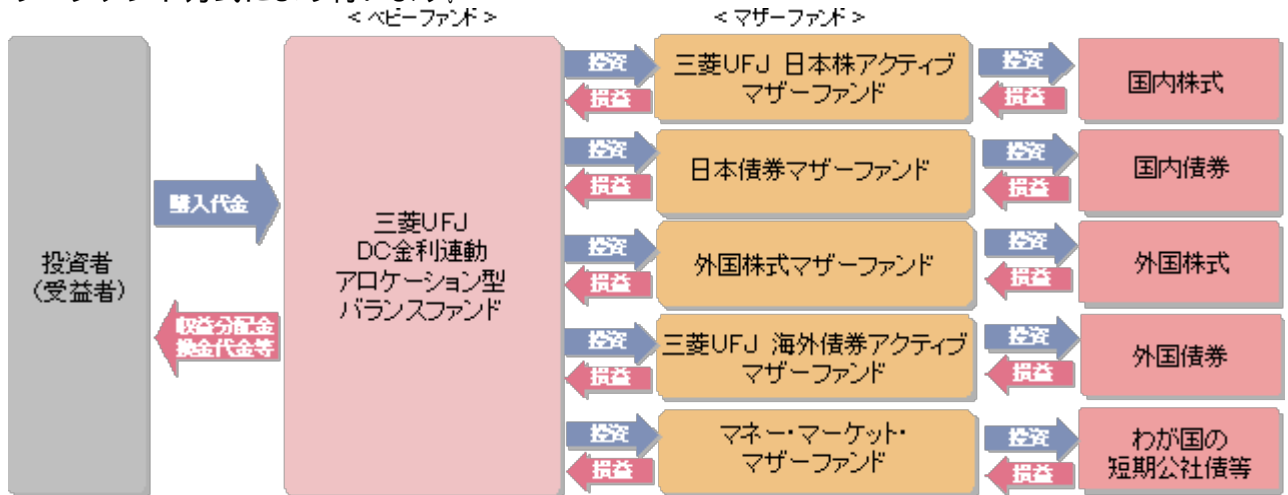
4

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。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

指数について

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。

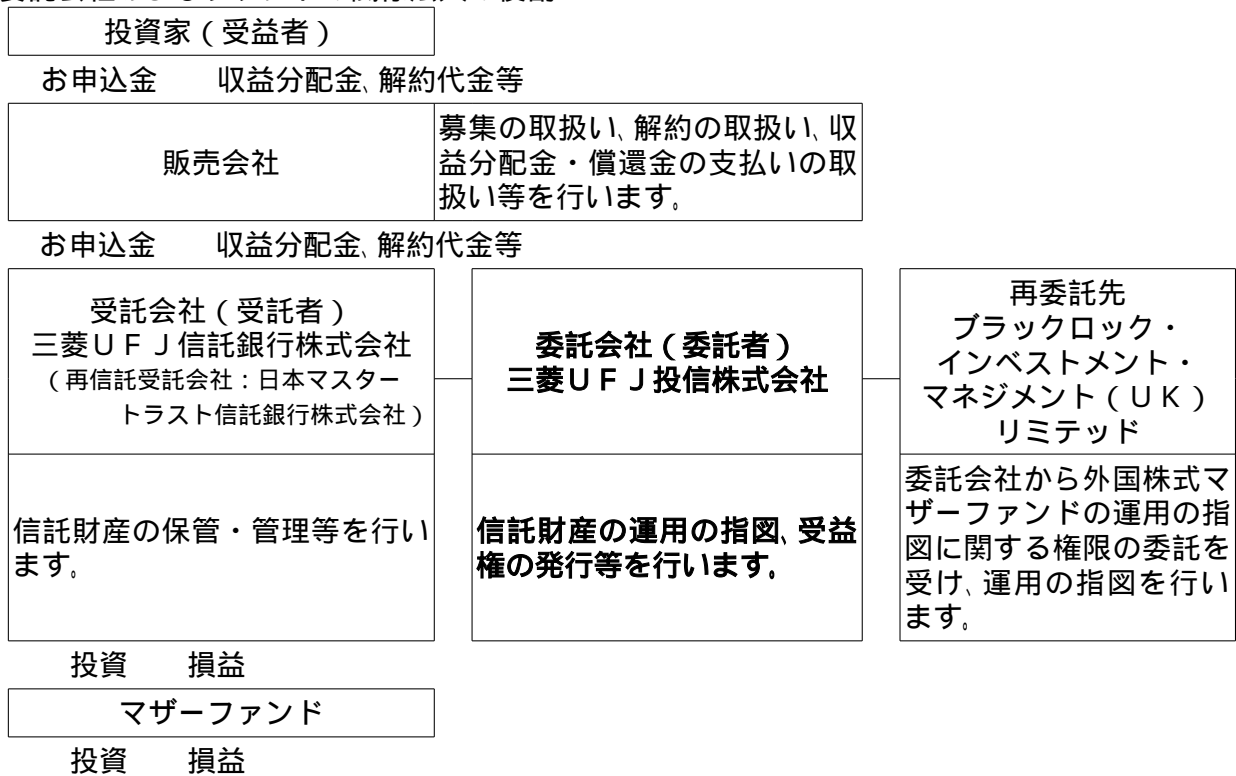
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(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23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23年7月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
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	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

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（「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。

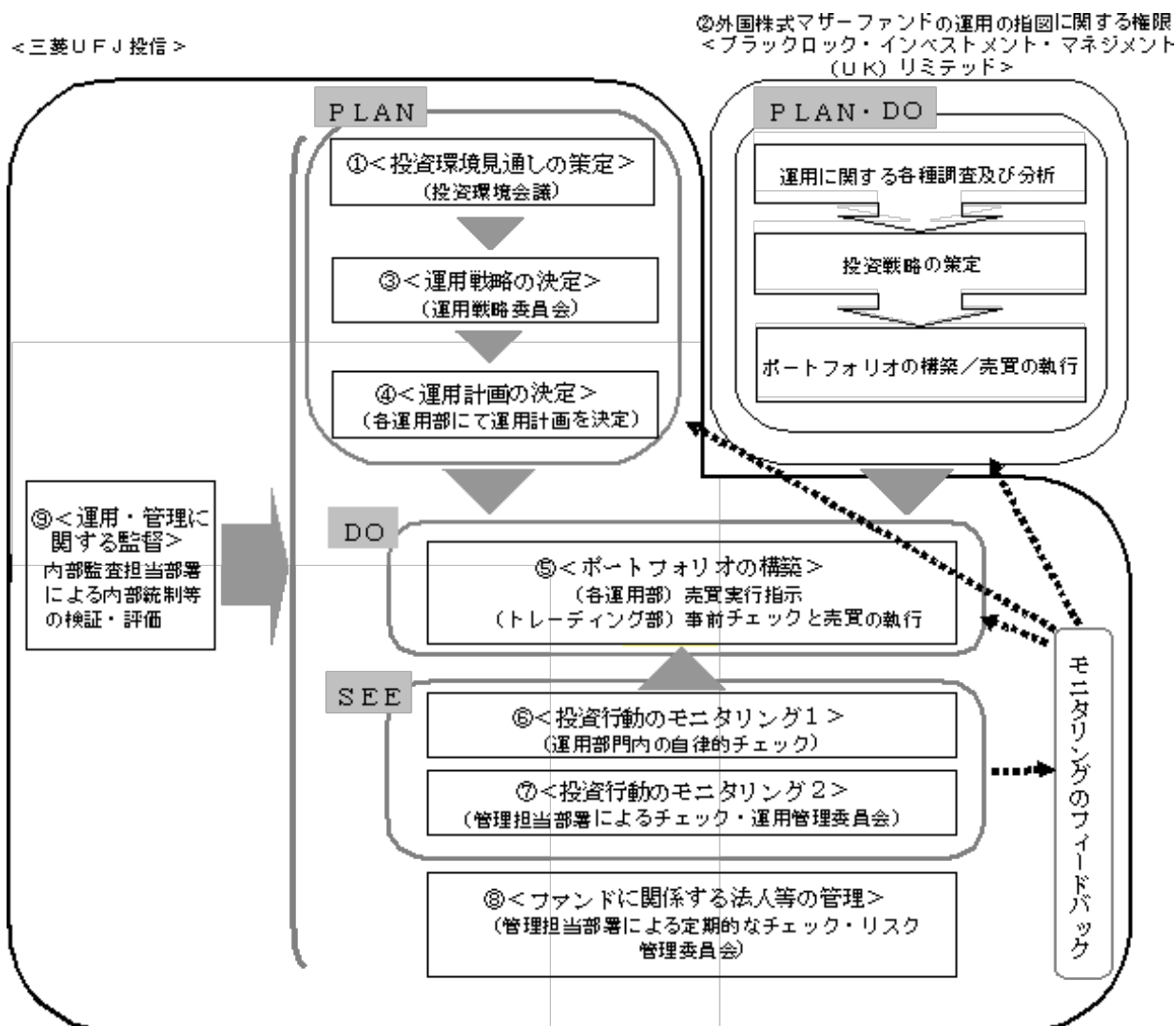
外貨建資産への投資は行いません。

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立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23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。

投資信託は預貯金と異なります。

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、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元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。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

「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います。

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。

〔再委託先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、同一マンド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、同一マンドート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・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】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。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（配当控除は適用されません。）・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25年12月31日まで適用される税率です。平成26年1月1日以降は、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25年12月31日まで適用される税率です。平成26年1月1日以降は、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。

上記は平成23年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成23年7月29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	1,598,085,824	99.80
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,182,928	0.20
純資産総額		1,601,268,752	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23年7月29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		486,554,710	1.2473 1.2488	606,896,717 607,609,521		37.95
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		172,437,440	1.7630 1.7505	304,012,798 301,851,738		18.85
日本	外国株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		274,432,819	1.1175 1.0862	306,688,766 298,088,927		18.62
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		339,075,395	0.9057 0.8786	307,131,618 297,911,642		18.60
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		91,192,278	1.0156 1.0157	92,623,995 92,623,996		5.78

(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23年7月29日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.80
合計	99.80

(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23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)
第4計算期間末日 (平成23年7月22日)	1,590,825,123 (分配付) 1,590,825,123 (分配落)	8,780 (分配付) 8,780 (分配落)
平成22年7月末日	1,027,231,337	8,522
8月末日	1,037,544,142	8,336
9月末日	1,119,212,927	8,636
10月末日	1,122,766,797	8,531
11月末日	1,148,352,053	8,638

12月末日	1,327,147,796	8,730
平成23年 1月末日	1,354,408,269	8,776
2月末日	1,345,353,545	8,874
3月末日	1,363,343,134	8,840
4月末日	1,450,123,587	8,890
5月末日	1,475,247,164	8,802
6月末日	1,584,345,623	8,780
7月末日	1,601,268,752	8,674

【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
第4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
第4計算期間	4.73

(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
第4計算期間	748,266,508	125,984,182	1,811,933,427

<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23年7月29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	40,011,267,500	98.86
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		460,987,213	1.14
純資産総額		40,472,254,713	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23年7月29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	住友商事	株式	卸売業
日本	日立製作所	株式	電気機器	3,750,000	447.00 479.00	1,676,250,000 1,796,250,000		4.44
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	535,000	3,175.00 3,155.00	1,698,625,000 1,687,925,000		4.17
日本	キャノン	株式	電気機器	400,000	3,713.92 3,750.00	1,485,569,434 1,500,000,000		3.71
日本	三井物産	株式	卸売業	1,000,000	1,277.00 1,455.00	1,277,000,000 1,455,000,000		3.60
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	2,900,000	361.00 392.00	1,046,900,000 1,136,800,000		2.81
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	265,000	3,750.00 3,800.00	993,750,000 1,007,000,000		2.49
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	407,000	2,311.00 2,434.00	940,577,000 990,638,000		2.45
日本	豊田通商	株式	卸売業	700,000	1,309.00 1,352.00	916,300,000 946,400,000		2.34
日本	三菱商事	株式	卸売業	435,000	1,915.00 2,063.00	833,025,000 897,405,000		2.22
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	280,000	2,897.00 3,080.00	811,160,000 862,400,000		2.13
日本	日本電産	株式	電気機器	110,000	7,226.40 7,660.00	794,904,000 842,600,000		2.08
日本	TDK	株式	電気機器	208,000	4,330.27 3,990.00	900,697,207 829,920,000		2.05
日本	富士通	株式	電気機器	1,743,000	437.59 454.00	762,732,401 791,322,000		1.96
日本	リコー	株式	電気機器	945,000	852.51 832.00	805,621,952 786,240,000		1.94
日本	京セラ	株式	電気機器	95,000	8,050.00 8,250.00	764,750,000 783,750,000		1.94
日本	日本電気	株式	電気機器	4,400,000	169.04 176.00	743,784,915 774,400,000		1.91
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	6,000,000	120.00 127.00	720,000,000 762,000,000		1.88
日本	東芝	株式	電気機器	1,860,000	392.43 400.00	729,932,093 744,000,000		1.84
日本	オリックス	株式	その他金融業	89,200	7,290.00 8,340.00	650,268,000 743,928,000		1.84
日本	村田製作所	株式	電気機器	130,000	5,100.00 5,010.00	663,000,000 651,300,000		1.61
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	784,000	795.00 822.00	623,280,000 644,448,000		1.59
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	275,000	2,109.37 2,275.00	580,076,750 625,625,000		1.55
日本	ソニー	株式	電気機器	296,500	1,966.35 1,947.00	583,023,231 577,285,500		1.43
日本	花王	株式	化学	264,000	2,068.00 2,181.00	545,952,000 575,784,000		1.42
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	250,000	2,161.80 2,195.00	540,451,859 548,750,000		1.36
日本	小松製作所	株式	機械	220,000	2,330.45 2,407.00	512,699,624 529,540,000		1.31
日本	ローム	株式	電気機器	108,000	4,396.84 4,500.00	474,858,720 486,000,000		1.20
日本	HOYA	株式	精密機器	247,000	1,765.14 1,873.00	435,989,878 462,631,000		1.14
日本	KDDI	株式	情報・通信業	800	569,374.99 572,000.00	455,499,998 457,600,000		1.13

(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23年7月29日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
建設業	1.29
食料品	0.79
繊維製品	0.59
化学	5.56
医薬品	1.53
ガラス・土石製品	0.48
鉄鋼	1.88
非鉄金属	1.48
機械	2.19
電気機器	34.57
輸送用機器	9.31
精密機器	1.96
その他製品	1.10
海運業	0.17
情報・通信業	4.21
卸売業	13.43
小売業	2.70
銀行業	7.87
証券、商品先物取引業	1.17
保険業	2.02
その他金融業	1.84
不動産業	2.48
サービス業	0.22
合計	98.86

（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23年7月29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	7,279,458,500	58.39
特殊債券	日本	409,960,000	3.29
社債券	日本	4,625,975,000	37.11
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		151,656,838	1.21
純資産総額		12,467,050,338	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23年7月29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312回利付国債(10年)	国債証券		500,000	101.50 101.7150	507,500,000 508,575,000	1.200000 2020/12/20	4.08
日本	第294回利付国債(10年)	国債証券		300,000	107.10 107.3730	321,327,000 322,119,000	1.700000 2018/06/20	2.58
日本	第289回利付国債(10年)	国債証券		300,000	105.80 105.9860	317,421,000 317,958,000	1.500000 2017/12/20	2.55
日本	第306回利付国債(10年)	国債証券		300,000	104.01 104.2950	312,033,000 312,885,000	1.400000 2020/03/20	2.51
日本	第229回信金中金債	特殊債券		300,000	102.65 102.6350	307,968,000 307,905,000	1.400000 2013/12/27	2.47

日本	第1回オーストラリア・ニュージーランド銀行	社債券	300,000	102.53 102.3520	307,602,000 307,056,000	2.070000 2013/03/14	2.46
日本	第1回住友信託銀行(劣後特約付)	社債券	300,000	101.41 101.4070	304,242,000 304,221,000	1.370000 2013/05/22	2.44
日本	第14回メリルリンチ	社債券	300,000	100.59 100.6070	301,791,000 301,821,000	1.580000 2012/02/23	2.42
日本	第286回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.54 107.6700	215,080,000 215,340,000	1.800000 2017/06/20	1.73
日本	第280回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.30 107.3840	214,618,000 214,768,000	1.900000 2016/06/20	1.72
日本	第288回利付国債(10年)	国債証券	200,000	107.00 107.1700	214,000,000 214,340,000	1.700000 2017/09/20	1.72
日本	第282回利付国債(10年)	国債証券	200,000	106.53 106.6170	213,066,000 213,234,000	1.700000 2016/09/20	1.71
日本	第111回利付国債(20年)	国債証券	200,000	106.13 106.1280	212,266,000 212,256,000	2.200000 2029/06/20	1.70
日本	第296回利付国債(10年)	国債証券	200,000	105.69 105.9730	211,398,000 211,946,000	1.500000 2018/09/20	1.70
日本	第96回利付国債(20年)	国債証券	200,000	105.86 105.9280	211,734,000 211,856,000	2.100000 2027/06/20	1.70
日本	第301回利付国債(10年)	国債証券	200,000	105.35 105.6580	210,712,000 211,316,000	1.500000 2019/06/20	1.69
日本	第291回利付国債(10年)	国債証券	200,000	104.50 104.7280	209,014,000 209,456,000	1.300000 2018/03/20	1.68
日本	第303回利付国債(10年)	国債証券	200,000	104.43 104.7000	208,862,000 209,400,000	1.400000 2019/09/20	1.68
日本	第299回利付国債(10年)	国債証券	200,000	103.97 104.3060	207,954,000 208,612,000	1.300000 2019/03/20	1.67
日本	第70回住友不動産	社債券	200,000	102.64 102.7500	205,290,000 205,500,000	1.480000 2014/12/19	1.65
日本	第118回利付国債(20年)	国債証券	200,000	102.53 102.5290	205,062,000 205,058,000	2.000000 2030/06/20	1.64
日本	第309回利付国債(10年)	国債証券	200,000	101.23 101.4770	202,460,000 202,954,000	1.100000 2020/06/20	1.63
日本	第13回野村ホールディングス	社債券	200,000	101.25 101.2260	202,506,000 202,452,000	1.720000 2012/06/15	1.62
日本	第11回ラボバンク・ネダーランド	社債券	200,000	99.88 99.9200	199,776,000 199,840,000	0.620000 2014/06/09	1.60
日本	第123回利付国債(20年)	国債証券	150,000	104.01 104.0110	156,021,000 156,016,500	2.100000 2030/12/20	1.25
日本	第28回利付国債(30年)	国債証券	100,000	110.12 110.1220	110,127,000 110,122,000	2.500000 2038/03/20	0.88
日本	第20回利付国債(30年)	国債証券	100,000	110.11 110.1090	110,114,000 110,109,000	2.500000 2035/09/20	0.88
日本	第27回利付国債(30年)	国債証券	100,000	110.09 110.0920	110,097,000 110,092,000	2.500000 2037/09/20	0.88
日本	第23回利付国債(30年)	国債証券	100,000	109.95 109.9500	109,955,000 109,950,000	2.500000 2036/06/20	0.88
日本	第88回利付国債(20年)	国債証券	100,000	109.20 109.3980	109,209,000 109,398,000	2.300000 2026/06/20	0.88

(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23年7月29日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	58.39
特殊債券	3.29
社債券	37.11
合計	98.78

(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 >

「外国株式マザーファンド」

(1) 投資状況

平成23年7月29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	5,347,439,586	48.85
	イギリス	1,911,693,029	17.47
	香港	705,667,326	6.45
	スイス	688,778,104	6.29
	フランス	674,599,432	6.16
	オランダ	426,907,077	3.90
	カナダ	418,236,702	3.82
	スペイン	280,556,717	2.56
	ドイツ	178,528,073	1.63
	シンガポール	111,049,015	1.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		202,224,318	1.86
純資産総額		10,945,679,379	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23年7月29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	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	90,832	4,960.22 4,798.15	450,604,911 435,825,742		3.98
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	13,611	30,150.52 30,503.18	410,378,816 415,178,878		3.79
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	49,762	8,514.45 8,176.58	423,705,881 406,883,247		3.72
フランス	SANOFI	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	57,696	6,109.74 6,093.03	352,507,645 351,543,631		3.21
イギリス	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	株式	家庭用品・ パーソナル用品	75,805	4,336.51 4,496.94	328,729,837 340,890,718		3.11
イギリス	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	株式	食品・飲料・ タバコ	107,616	2,715.73 2,738.65	292,256,602 294,722,902		2.69
カナダ	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	株式	電気通信サービス	94,203	3,086.81 3,020.47	290,862,285 284,537,523		2.60
スペイン	TELEFONICA SA	株式	電気通信サービス	160,990	1,807.85 1,742.69	291,167,125 280,556,717		2.56
オランダ	HEINEKEN NV	株式	食品・飲料・ タバコ	58,379	4,578.12 4,629.92	267,299,106 270,290,411		2.47
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	株式	エネルギー	92,619	2,905.44 2,896.53	269,158,130 268,273,712		2.45
スイス	SWATCH GROUP AG/THE-BR	株式	耐久消費財・ アパレル	5,989	40,867.75 42,236.16	244,756,984 252,952,362		2.31
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	105,261	2,524.67 2,387.27	265,758,449 251,286,453		2.30
アメリカ	DIRECTV-CLASS A	株式	メディア	60,359	4,048.20 3,992.14	244,345,303 240,962,061		2.20
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	127,380	1,957.14 1,881.63	249,353,328 239,682,602		2.19
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・ タバコ	42,482	5,565.49 5,632.44	236,433,422 239,277,634		2.19
イギリス	RIO TINTO PLC	株式	素材	42,460	5,570.25 5,542.87	236,560,947 235,350,523		2.15
アメリカ	PRAXAIR INC	株式	素材	28,989	8,344.74 7,953.93	241,905,711 230,576,607		2.11
アメリカ	NII HOLDINGS INC	株式	電気通信サービス	70,148	3,286.82 3,278.26	230,564,340 229,963,627		2.10
イギリス	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	食品・飲料・ タバコ	61,396	3,561.14 3,637.53	218,639,775 223,329,939		2.04
フランス	SCHNEIDER ELECTRIC SA	株式	資本財	18,685	11,790.63 11,439.75	220,327,746 213,751,784		1.95

アメリカ	SPX CORP	株式	資本財	34,203	6,414.06 5,866.77	219,398,240 200,661,339		1.83
アメリカ	ANADARKO PETROLEUM CORP	株式	エネルギー	29,170	6,476.34 6,501.25	188,922,343 189,641,564		1.73
アメリカ	ACTIVISION BLIZZARD INC	株式	ソフトウェア・サービス	202,776	927.97 924.07	188,170,450 187,381,144		1.71
アメリカ	SCHLUMBERGER LTD	株式	エネルギー	25,526	7,081.23 7,115.49	180,755,630 181,629,997		1.66
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	64,503	2,924.82 2,776.13	188,659,954 179,068,777		1.64
ドイツ	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	株式	自動車・自動車部品	31,383	5,820.12 5,688.68	182,653,061 178,528,073		1.63
アメリカ	DOVER CORP	株式	資本財	37,589	5,166.12 4,702.91	194,189,510 176,778,003		1.62
オランダ	ING GROEP NV-CVA	株式	各種金融	182,529	901.14 858.03	164,668,100 156,616,665		1.43
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	50,446	3,138.91 2,972.31	158,345,554 149,941,301		1.37
アメリカ	FOSTER WHEELER AG	株式	資本財	69,800	2,202.37 2,105.84	153,725,879 146,987,806		1.34

(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23年7月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	13.42
	素材	6.49
	資本財	8.01
	自動車・自動車部品	1.63
	耐久消費財・アパレル	3.45
	消費者サービス	3.14
	メディア	4.39
	小売	1.75
	食品・飲料・タバコ	10.41
	家庭用品・パーソナル用品	4.04
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.52
	銀行	4.18
	各種金融	4.65
	保険	1.00
	ソフトウェア・サービス	6.08
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.30
	電気通信サービス	8.90
公益事業	0.70	
半導体・半導体製造装置	1.09	
合計	98.15	

(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23年7月29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	43,823,869,421	37.48
	ドイツ	17,439,641,682	14.91
	オランダ	11,431,120,275	9.78
	イギリス	9,323,212,621	7.97
	イタリア	7,671,913,846	6.56
	カナダ	6,078,583,602	5.20
	フランス	4,706,951,535	4.03
	オーストラリア	2,866,165,134	2.45
	スペイン	2,588,202,345	2.21
	ベルギー	2,189,816,010	1.87
	スウェーデン	1,586,281,923	1.36
	シンガポール	1,266,278,321	1.08
	マレーシア	1,134,025,266	0.97
	ポーランド	1,061,549,996	0.91
ノルウェー	314,834,493	0.27	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,456,156,794	2.95
純資産総額		116,938,603,264	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23年7月29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 (%)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
					償還期限 (年/月/日)			
オランダ	4.5 NETH GOVT 170715	国債証券		55,000,000.00	12,241.57 12,396.5931	6,732,868,299 6,818,126,205	4.500000 2017/07/15	5.83
アメリカ	2.5 T-NOTE 150430	国債証券		70,000,000.00	8,134.43 8,229.5965	5,694,101,051 5,760,717,566	2.500000 2015/04/30	4.93
アメリカ	4.25 T-NOTE 150815	国債証券		50,000,000.00	8,667.38 8,760.5578	4,333,690,546 4,380,278,906	4.250000 2015/08/15	3.75
アメリカ	3.875 T-NOTE 180515	国債証券		50,000,000.00	8,450.37 8,648.6484	4,225,187,110 4,324,324,218	3.875000 2018/05/15	3.70
ドイツ	2.5 BUND 210104	国債証券		37,000,000.00	10,847.90 11,059.9131	4,013,723,667 4,092,167,847	2.500000 2021/01/04	3.50
ドイツ	3.75 BUND 190104	国債証券		30,000,000.00	11,975.18 12,212.7996	3,592,555,849 3,663,839,880	3.750000 2019/01/04	3.13
アメリカ	4.75 T-NOTE 170815	国債証券		40,000,000.00	9,055.20 9,071.9578	3,622,080,726 3,628,783,125	4.750000 2017/08/15	3.10
ドイツ	3.75 BUND 150104	国債証券		30,000,000.00	11,804.18 11,954.9317	3,541,255,185 3,586,479,525	3.750000 2015/01/04	3.07
オランダ	3.25 NETH GOVT 210715	国債証券		30,000,000.00	11,152.36 11,346.1854	3,345,710,040 3,403,855,620	3.250000 2021/07/15	2.91
ドイツ	2 OBL 160226	国債証券		30,000,000.00	11,025.95 11,243.7066	3,307,787,314 3,373,111,980	2.000000 2016/02/26	2.88
イギリス	4.75 GILT 200307	国債証券		19,900,000.00	13,891.80 14,607.4236	2,764,469,112 2,906,877,296	4.750000 2020/03/07	2.49
ドイツ	3.25 BUND 420704	国債証券		25,000,000.00	10,479.79 10,896.1698	2,619,948,495 2,724,042,450	3.250000 2042/07/04	2.33
イタリア	5 ITALY GOVT 120201	国債証券		23,000,000.00	11,320.47 11,260.9720	2,603,708,946 2,590,023,571	5.000000 2012/02/01	2.21
アメリカ	4.25 T-NOTE 131115	国債証券		30,000,000.00	8,514.45 8,454.0234	2,554,336,350 2,536,207,031	4.250000 2013/11/15	2.17
アメリカ	3.375 T-NOTE 130731	国債証券		30,000,000.00	8,238.68 8,246.0179	2,471,605,520 2,473,805,390	3.375000 2013/07/31	2.12
アメリカ	2.625 T-NOTE 140630	国債証券		30,000,000.00	8,119.47 8,228.9882	2,435,843,297 2,468,696,484	2.625000 2014/06/30	2.11
アメリカ	3.875 T-NOTE 130215	国債証券		30,000,000.00	8,249.76 8,208.3093	2,474,929,350 2,462,492,812	3.875000 2013/02/15	2.11
アメリカ	1.25 T-NOTE 140415	国債証券		30,000,000.00	7,864.16 7,923.0621	2,359,250,332 2,376,918,644	1.250000 2014/04/15	2.03

フランス	4.5 BTAN 120712	国債証券		20,000,000.00	11,528.30 11,476.5117	2,305,661,610 2,295,302,340	4.500000 2012/07/12	1.96
イタリア	4.75 ITALY GOVT 130201	国債証券		20,000,000.00	11,604.61 11,248.7191	2,320,922,040 2,249,743,830	4.750000 2013/02/01	1.92
カナダ	3.5 CAN GOVT 130601	国債証券		26,000,000.00	8,481.56 8,491.8015	2,205,206,640 2,207,868,390	3.500000 2013/06/01	1.89
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券		25,000,000.00	8,031.91 8,166.9515	2,007,979,576 2,041,737,890	3.125000 2019/05/15	1.75
イギリス	4.25 GILT 551207	国債証券		14,000,000.00	12,611.88 13,261.6512	1,765,663,574 1,856,631,168	4.250000 2055/12/07	1.59
イギリス	4.75 GILT 150907	国債証券		12,000,000.00	14,074.90 14,382.7038	1,688,988,924 1,725,924,456	4.750000 2015/09/07	1.48
アメリカ	3.625 T-NOTE 190815	国債証券		20,000,000.00	8,427.79 8,427.2625	1,685,559,787 1,685,452,500	3.625000 2019/08/15	1.44
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券		20,000,000.00	8,275.45 8,258.1820	1,655,091,000 1,651,636,406	3.625000 2021/02/15	1.41
スペイン	2.3 SPAIN GOVT 130430	国債証券		15,000,000.00	10,903.96 10,787.0076	1,635,595,065 1,618,051,140	2.300000 2013/04/30	1.38
ベルギー	3.75 BEL GOVT 200928	国債証券		15,000,000.00	10,894.98 10,722.4014	1,634,247,246 1,608,360,210	3.750000 2020/09/28	1.38
アメリカ	4.5 T-BOND 360215	国債証券		18,000,000.00	7,817.84 8,207.0929	1,407,211,734 1,477,276,734	4.500000 2036/02/15	1.26
カナダ	2 CAN GOVT 160601	国債証券		18,000,000.00	8,063.05 8,161.1712	1,451,349,900 1,469,010,816	2.000000 2016/06/01	1.26

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成23年7月29日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	97.04
合計	97.04

(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23年7月29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	1,249,838,050	82.81
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		259,381,063	17.19
純資産総額		1,509,219,113	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23年7月29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206回国庫短期証券	国債証券		150,000	99.97 99.9810	149,964,750 149,971,500	2011/10/11	9.94
日本	第207回国庫短期証券	国債証券		150,000	99.97 99.9794	149,965,650 149,969,100	2011/10/17	9.94
日本	第194回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9947	99,982,200 99,994,700	2011/08/22	6.63
日本	第196回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9928	99,975,200 99,992,800	2011/08/29	6.63
日本	第197回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9909	99,975,100 99,990,900	2011/09/05	6.63
日本	第199回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9890	99,977,990 99,989,000	2011/09/12	6.63
日本	第202回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9868	99,977,460 99,986,800	2011/09/20	6.63
日本	第203回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9859	99,978,940 99,985,900	2011/09/26	6.63
日本	第204回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9832	99,975,800 99,983,200	2011/10/03	6.62
日本	第209回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9775	99,975,800 99,977,500	2011/10/24	6.62
日本	第189回国庫短期証券	国債証券		50,000	99.98 99.9983	49,990,200 49,999,150	2011/08/01	3.31
日本	第190回国庫短期証券	国債証券		50,000	99.97 99.9983	49,989,200 49,999,150	2011/08/08	3.31
日本	第192回国庫短期証券	国債証券		50,000	99.97 99.9967	49,988,200 49,998,350	2011/08/15	3.31

(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23年7月29日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	82.81
合計	82.81

(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～2011年07月29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)を再投資したものとして計算

2 分配の推移

2011年 7月	0円
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

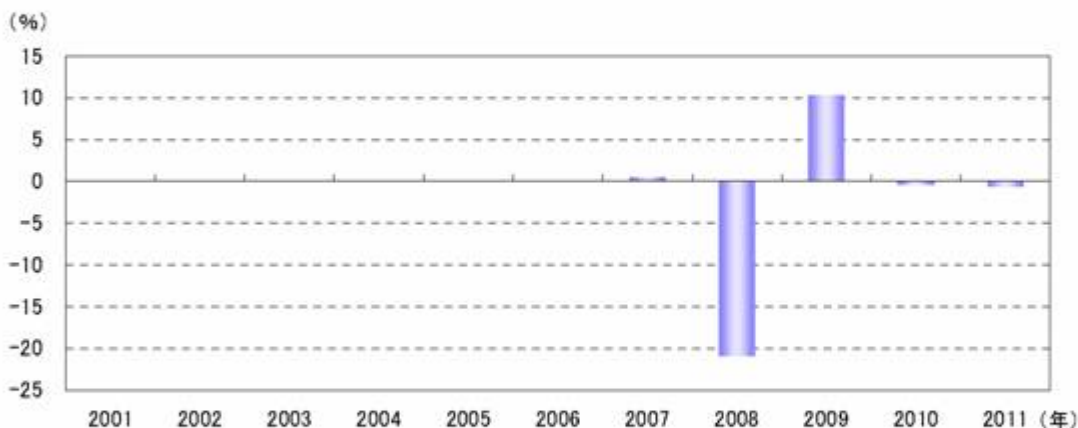
・分配金は1万円当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2011年07月29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	18.4%	円	63.1%	住友商事	株式	卸売業	日本	0.9%
国内債券	42.3%	アメリカドル	16.0%	日立製作所	株式	電気機器	日本	0.8%
外国株式	18.3%	ユーロ	10.3%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.8%
外国債券	18.3%	イギリスポンド	4.8%	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	スイス	0.7%
		カナダドル	1.7%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.7%
		香港ドル	1.2%	第312回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.5%
		スイスフラン	1.2%	4.5 NETH GOVT 170715	債券	国債	オランダ	1.1%
コールローン他 (負債控除後)	2.7%	オーストラリアドル	0.5%	第294回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.0%
合計	100.0%	その他	1.2%	第289回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.0%
		合計	100.0%	第306回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.0%

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・投資信託証券(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、2011年は7月29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ください。</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。）。
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6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。
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)および第4期計算期間(平成22年7月23日から平成23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3期 [平成22年7月22日現在]	第4期 [平成23年7月22日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,806,471	7,612,430
親投資信託受益証券	995,357,889	1,587,686,792
未収入金	61,558	45,536
未収利息	13	16
流動資産合計	1,000,225,931	1,595,344,774
資産合計	1,000,225,931	1,595,344,774
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	54,891
未払受託者報酬	238,111	369,854
未払委託者報酬	2,619,095	4,068,336
その他未払費用	45,291	26,570
流動負債合計	2,902,497	4,519,651
負債合計	2,902,497	4,519,651
純資産の部		
元本等		
元本	1,189,651,101	1,811,933,427
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	192,327,667	221,108,304
(分配準備積立金)	16,511,683	37,692,265
元本等合計	997,323,434	1,590,825,123
純資産合計	997,323,434	1,590,825,123
負債純資産合計	1,000,225,931	1,595,344,774

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 自平成21年7月23日 至平成22年7月22日	第4期 自平成22年7月23日 至平成23年7月22日
営業収益		
受取利息	3,017	3,978
有価証券売買等損益	7,588,761	59,010,489
営業収益合計	7,585,744	59,014,467
営業費用		
受託者報酬	434,724	667,807
委託者報酬	4,781,749 ₁	7,345,718 ₁
その他費用	82,678	47,963
営業費用合計	5,299,151	8,061,488
営業利益	12,884,895	50,952,979
経常利益	12,884,895	50,952,979
当期純利益	12,884,895	50,952,979
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,866,853	3,516,720
期首剰余金又は期首欠損金()	130,624,776	192,327,667
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,932,213	19,561,149
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,932,213	19,561,149
剰余金減少額又は欠損金増加額	58,883,356	95,778,045
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	58,883,356	95,778,045
分配金	2 -	2 -
期末剰余金又は期末欠損金()	192,327,667	221,108,304

(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3期 (自平成21年7月23日 至平成22年7月22日)	第4期 (自平成22年7月23日 至平成23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3期 [平成22年7月22日現在]	第4期 [平成23年7月22日現在]
1 期首元本額	815,857,970円	1,189,651,101円
期中追加設定元本額	451,527,825円	748,266,508円
期中一部解約元本額	77,734,694円	125,984,182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。	192,327,667円	221,108,304円
3 計算期間末日における受益権の総数	1,189,651,101口	1,811,933,427口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8383円 (8,383円)	0.8780円 (8,780円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	

第4期（自平成22年7月23日 至 平成23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10,000分の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	22,545,124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	24,998,415円
分配準備積立金額	D	15,147,141円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,690,680円
当ファンドの期末残存口数	F	1,811,933,427口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	345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)	第4期 (自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券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。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左
	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。	同左

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]	第4期 [平成23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。	同左
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。	同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。	同 左
	(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。	同 左
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

（有価証券関係に関する注記）
売買目的有価証券

種 類	第 3 期 [平成22年7月22日現在]	第 4 期 [平成23年7月22日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	9,589,611	55,390,254
合計	9,589,611	55,390,254

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式
該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数（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	339,003,064	307,068,975	
	三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	166,466,853	293,531,001	
	日本債券マザーファンド	476,476,667	594,309,346	
	外国株式マザーファンド	270,310,646	302,207,302	
	マネー・マーケット・マザーファンド	89,170,196	90,570,168	
	親投資信託受益証券 小計	1,341,427,426	1,587,686,792	
	合計	1,341,427,426	1,587,686,792	

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22年7月22日現在]	[平成23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	1,064,141,241	450,910,835
株式	49,505,530,000	41,415,793,000
未収入金	258,303,063	598,660,843
未収配当金	29,745,500	50,385,000
未収利息	3,029	977
流動資産合計	50,857,722,833	42,515,750,655
資産合計	50,857,722,833	42,515,750,655
負債の部		
流動負債		
未払金	498,444,456	489,735,831
未払解約金	13,571,396	17,714,540
流動負債合計	512,015,852	507,450,371
負債合計	512,015,852	507,450,371
純資産の部		
元本等		
元本	1 60,700,350,547	46,375,554,902
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2 10,354,643,566	4,367,254,618
元本等合計	50,345,706,981	42,008,300,284
純資産合計	50,345,706,981	42,008,300,284
負債純資産合計	50,857,722,833	42,515,750,655

(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21年 7月23日 至 平成22年 7月22日)	(自 平成22年 7月23日 至 平成23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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成21年7月23日 78,540,935,373円	平成22年7月23日 60,700,350,547円
期首からの追加設定元本額	2,369,004,492円	2,754,339,825円
期首からの一部解約元本額	20,209,589,318円	17,079,135,470円
元本の内訳*		
三菱UFJ 日本株アクティブオープン	14,243,272,279円	12,703,817,202円
三菱UFJ 日本株アクティブオープン（確定拠出年金）	8,212,429,916円	8,883,933,705円
三菱UFJ バランスインカムオープン（毎月決算型）	36,151,524,215円	23,147,916,459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	219,367,146円	339,003,064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）	1,375,628,116円	1,300,884,472円
三菱UFJ 日本株式ファンドF（適格機関投資家限定） （合計）	498,128,875円 60,700,350,547円	46,375,554,902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。	10,354,643,566円	4,367,254,618円
3 計算期間末日における受益権の総数	60,700,350,547口	46,375,554,902口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8294円 （8,294円）	0.9058円 （9,058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）	（自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式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。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]	[平成23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。	同左
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。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,595,115,560	2,783,320,107
合計	4,595,115,560	2,783,320,107

(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)

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	
1911	住友林業	110,000	748	82,280,000	
1924	パナホーム	612,000	541	331,092,000	
1928	積水ハウス	200,000	765	153,000,000	
2871	ニチレイ	500,000	353	176,500,000	
2914	日本たばこ産業	850	310,000	263,500,000	
3401	帝人	615,000	362	222,630,000	
4044	セントラル硝子	340,000	387	131,580,000	
4061	電気化学工業	275,000	383	105,325,000	
4118	カネカ	840,000	540	453,600,000	
4202	ダイセル化学工業	340,000	560	190,400,000	
4206	アイカ工業	55,000	1,108	60,940,000	
4401	ADEKA	140,000	836	117,040,000	
4403	日油	570,000	362	206,340,000	
4452	花王	264,000	2,148	567,072,000	
4612	日本ペイント	30,000	641	19,230,000	
4631	DIC	500,000	183	91,500,000	
6988	日東電工	68,000	3,830	260,440,000	
4503	アステラス製薬	140,000	3,065	429,100,000	
4507	塩野義製薬	200,000	1,388	277,600,000	
5214	日本電気硝子	200,000	1,020	204,000,000	
5401	新日本製鐵	1,800,000	259	466,200,000	
5486	日立金属	250,000	1,078	269,500,000	
5713	住友金属鉱山	120,000	1,377	165,240,000	
5801	古河電気工業	300,000	334	100,200,000	
5802	住友電気工業	180,000	1,203	216,540,000	
6146	ディスコ	40,500	4,585	185,692,500	
6268	ナブテスコ	80,000	2,058	164,640,000	
6301	小松製作所	200,000	2,539	507,800,000	
4902	コニカミノルタホールディングス	350,000	672	235,200,000	
6448	ブラザー工業	440,000	1,248	549,120,000	
6501	日立製作所	3,750,000	478	1,792,500,000	
6502	東芝	1,860,000	419	779,340,000	
6594	日本電産	112,500	7,800	877,500,000	
6645	オムロン	120,000	2,242	269,040,000	
6701	日本電気	4,350,000	184	800,400,000	
6702	富士通	1,720,000	487	837,640,000	
6752	パナソニック	450,000	931	418,950,000	
6753	シャープ	630,000	744	468,720,000	
6758	ソニー	296,500	2,100	622,650,000	
6762	TDK	195,000	4,340	846,300,000	
6770	アルプス電気	200,000	894	178,800,000	
6816	アルパイン	70,000	1,189	83,230,000	
6841	横河電機	250,000	720	180,000,000	
6905	コーセル	153,000	1,412	216,036,000	
6954	ファナック	27,500	14,710	404,525,000	
6963	ローム	114,000	4,660	531,240,000	
6967	新光電気工業	410,500	710	291,455,000	
6971	京セラ	95,000	8,370	795,150,000	
6981	村田製作所	130,000	5,330	692,900,000	
6999	KOA	230,000	915	210,450,000	
7751	キヤノン	400,000	3,785	1,514,000,000	
7752	リコー	930,000	873	811,890,000	
8035	東京エレクトロン	83,500	4,305	359,467,500	
6584	三櫻工業	125,000	762	95,250,000	
6995	東海理化電機製作所	130,000	1,586	206,180,000	
7201	日産自動車	784,000	861	675,024,000	

7202	いすゞ自動車	550,000	392	215,600,000	
7203	トヨタ自動車	535,000	3,335	1,784,225,000	
7242	カヤバ工業	140,000	595	83,300,000	
7267	本田技研工業	280,000	3,235	905,800,000	
7731	ニコン	70,000	1,857	129,990,000	
7741	HOYA	242,000	1,873	453,266,000	
7762	シチズンホールディングス	440,000	478	210,320,000	
7911	凸版印刷	700,000	638	446,600,000	
9101	日本郵船	250,000	292	73,000,000	
9432	日本電信電話	265,000	3,895	1,032,175,000	
9433	KDDI	800	575,000	460,000,000	
9984	ソフトバンク	80,000	3,175	254,000,000	
8015	豊田通商	700,000	1,430	1,001,000,000	
8031	三井物産	1,000,000	1,480	1,480,000,000	
8053	住友商事	1,840,000	1,105	2,033,200,000	
8058	三菱商事	435,000	2,103	914,805,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	130,000	1,007	130,910,000	
2651	ローソン	50,000	4,280	214,000,000	
3086	J.フロントリテイリング	820,000	388	318,160,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	250,000	2,281	570,250,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,900,000	407	1,180,300,000	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	700,000	294	205,800,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	407,000	2,530	1,029,710,000	
8368	百五銀行	320,000	334	106,880,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	6,000,000	132	792,000,000	
8473	SBIホールディングス	9,000	7,830	70,470,000	
8604	野村ホールディングス	1,180,000	393	463,740,000	
8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	100,000	2,011	201,100,000	
8766	東京海上ホールディングス	281,000	2,356	662,036,000	
8591	オリックス	89,200	8,210	732,332,000	
8801	三井不動産	260,000	1,490	387,400,000	
8802	三菱地所	250,000	1,462	365,500,000	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	3,950	70,300	277,685,000	
9783	ベネッセホールディングス	20,000	3,415	68,300,000	
	合計	48,674,800		41,415,793,000	

(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22年7月22日現在]	[平成23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	103,971,583	240,019,775
国債証券	8,024,277,500	7,162,084,800
特殊債券	413,729,000	410,034,000
社債券	4,479,220,000	4,620,114,000
未収入金	210,270,000	
未収利息	33,153,920	29,605,649
前払金	1,350,000	
前払費用	4,321,771	1,236,221
差入委託証拠金	390,000	
流動資産合計	13,270,683,774	12,463,094,445
資産合計	13,270,683,774	12,463,094,445
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,521,050	
未払解約金	51,556,971	10,885,272
流動負債合計	53,078,021	10,885,272
負債合計	53,078,021	10,885,272
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,722,051,597	9,983,578,052
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,495,554,156	2,468,631,121
元本等合計	13,217,605,753	12,452,209,173
純資産合計	13,217,605,753	12,452,209,173
負債純資産合計	13,270,683,774	12,463,094,445

(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21年7月23日 至平成22年7月22日)	(自平成22年7月23日 至平成23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>	<p>先物取引 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
1 期首	平成21年7月23日	平成22年7月23日
期首元本額	11,716,588,958円	10,722,051,597円
期首からの追加設定元本額	1,682,631,061円	1,665,997,070円
期首からの一部解約元本額	2,677,168,422円	2,404,470,615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	302,518,507円	476,476,667円
三菱UFJ 日本債券ファンドF(適格機関投資家限定)	230,130,414円	151,532,247円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	335,280,239円	334,767,594円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	991,728,414円	917,128,869円
三菱UFJ グローバルバランスVA	3,331,755,375円	2,807,168,353円
三菱UFJ 日本バランス20	320,442,080円	281,274,655円
三菱UFJ 日本バランス50	183,455,667円	164,476,761円
三菱UFJ 国内バランス20	3,643,765,840円	3,281,233,331円
三菱UFJ 国内バランス50	459,390,171円	426,990,201円
三菱UFJ <DC>日本債券ファンド	664,360,622円	847,004,644円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス20型	81,998,916円	95,140,976円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス40型	109,774,574円	125,610,512円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス60型	67,450,778円	74,773,242円
(合計)	10,722,051,597円	9,983,578,052円
2 計算期間末日における受益権の総数	10,722,051,597口	9,983,578,052口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2327円 (12,327円)	1.2473円 (12,473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)	(自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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。	同左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]	[平成23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。	同左
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。	(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	254,513,900	4,710,500
特殊債券	5,457,000	3,695,000
社債券	44,957,000	7,614,800
合計	304,927,900	16,020,300

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 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

[平成23年7月22日現在]
 該当事項はありません。

（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	103,853,000	
	第273回利付国債（10年）	100,000,000	104,833,000	
	第280回利付国債（10年）	200,000,000	214,618,000	
	第282回利付国債（10年）	200,000,000	213,066,000	
	第284回利付国債（10年）	100,000,000	106,702,000	
	第286回利付国債（10年）	200,000,000	215,080,000	
	第288回利付国債（10年）	200,000,000	214,000,000	
	第289回利付国債（10年）	300,000,000	317,421,000	
	第291回利付国債（10年）	200,000,000	209,014,000	
	第294回利付国債（10年）	300,000,000	321,327,000	
	第296回利付国債（10年）	200,000,000	211,398,000	
	第298回利付国債（10年）	100,000,000	104,148,000	
	第299回利付国債（10年）	200,000,000	207,954,000	
	第301回利付国債（10年）	200,000,000	210,712,000	
	第303回利付国債（10年）	200,000,000	208,862,000	
	第305回利付国債（10年）	100,000,000	103,406,000	
	第306回利付国債（10年）	300,000,000	312,033,000	
	第309回利付国債（10年）	200,000,000	202,460,000	
	第310回利付国債（10年）	100,000,000	100,041,000	
	第312回利付国債（10年）	500,000,000	507,500,000	
	第11回利付国債（30年）	100,000,000	95,942,000	
	第15回利付国債（30年）	50,000,000	55,050,000	
	第20回利付国債（30年）	100,000,000	110,114,000	
	第23回利付国債（30年）	100,000,000	109,955,000	
	第26回利付国債（30年）	100,000,000	108,062,000	
	第27回利付国債（30年）	100,000,000	110,097,000	
	第28回利付国債（30年）	100,000,000	110,127,000	
	第30回利付国債（30年）	40,000,000	42,324,400	
	第50回利付国債（20年）	100,000,000	107,685,000	

	第55回利付国債(20年)	100,000,000	108,166,000
	第59回利付国債(20年)	100,000,000	104,542,000
	第66回利付国債(20年)	100,000,000	105,002,000
	第70回利付国債(20年)	60,000,000	66,920,400
	第74回利付国債(20年)	100,000,000	107,655,000
	第80回利付国債(20年)	100,000,000	107,270,000
	第84回利付国債(20年)	100,000,000	105,670,000
	第88回利付国債(20年)	100,000,000	109,209,000
	第90回利付国債(20年)	100,000,000	107,776,000
	第96回利付国債(20年)	200,000,000	211,734,000
	第99回利付国債(20年)	100,000,000	105,535,000
	第104回利付国債(20年)	100,000,000	105,250,000
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	101,932,000
	第111回利付国債(20年)	200,000,000	212,266,000
	第114回利付国債(20年)	100,000,000	104,290,000
	第118回利付国債(20年)	200,000,000	205,062,000
	第123回利付国債(20年)	150,000,000	156,021,000
	国債証券 小計	6,800,000,000	7,162,084,800
特殊債券	第222回信金中金債	100,000,000	102,066,000
	第229回信金中金債	300,000,000	307,968,000
	特殊債券 小計	400,000,000	410,034,000
社債券	第14回メリルリンチ	300,000,000	301,791,000
	第11回GEキャピタルコーポレーション	100,000,000	100,496,000
	第12回GEキャピタルコーポレーション	100,000,000	102,672,000
	第6回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,208,000
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	100,000,000	100,579,000
	第11回ラボバンク・ネーデルランド	200,000,000	199,776,000
	第1回キリンホールディングス	100,000,000	101,294,000
	第2回サントリーホールディングス	100,000,000	102,193,000
	第16回電気化学工業	100,000,000	100,593,000
	第13回日立建機	100,000,000	100,334,000
	第10回パナソニック	100,000,000	100,856,000
	第15回三菱重工業	100,000,000	100,965,000
	第51回日産自動車	100,000,000	100,852,000
	第16回ニコン	100,000,000	102,477,000
	第71回丸紅	100,000,000	102,685,000
	第75回丸紅	100,000,000	101,878,000
	第14回みずほコーポレート銀行	100,000,000	102,743,000
	第16回みずほコーポレート銀行	100,000,000	102,377,000
	第1回住友信託銀行(劣後特約付)	300,000,000	304,242,000
	第12回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	201,902,000
	第38回日立キャピタル	100,000,000	101,929,000
	第40回日立キャピタル	100,000,000	100,955,000
	第127回オリックス	100,000,000	103,293,000
	第136回オリックス	100,000,000	101,046,000
	第140回オリックス	60,000,000	60,621,000
	第141回オリックス	100,000,000	101,027,000
	第143回オリックス	100,000,000	100,385,000
	第8回三菱UFJリース	100,000,000	100,517,000
	第9回三菱UFJリース	100,000,000	100,518,000
	第9回野村ホールディングス	100,000,000	101,357,000
	第13回野村ホールディングス	200,000,000	202,506,000
	第17回野村ホールディングス	100,000,000	102,330,000
	第20回野村ホールディングス	100,000,000	101,280,000
	第6回東京建物	100,000,000	100,690,000
	第63回住友不動産	100,000,000	101,129,000
	第70回住友不動産	200,000,000	205,290,000
	第72回住友不動産	100,000,000	101,630,000
	第30回京浜急行電鉄	100,000,000	102,698,000
	社債券 小計	4,560,000,000	4,620,114,000
	合計	11,760,000,000	12,192,232,800

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](#)

「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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	221,949,782	127,804,224
コール・ローン	76,224,860	372,171,502
株式	9,003,208,771	10,859,838,289
未収入金		37,477,617
未収配当金	788,619	8,356,540
未収利息	217	806
流動資産合計	9,302,172,249	11,405,648,978
資産合計	9,302,172,249	11,405,648,978
負債の部		
流動負債		
未払金	221,949,782	155,560,034
未払解約金	17,011,136	788,085
流動負債合計	238,960,918	156,348,119
負債合計	238,960,918	156,348,119
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,630,320,233	10,061,826,738
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2 567,108,902	1,187,474,121
元本等合計	9,063,211,331	11,249,300,859
純資産合計	9,063,211,331	11,249,300,859
負債純資産合計	9,302,172,249	11,405,648,978

(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21年 7月23日 至平成22年 7月22日)	(自平成22年 7月23日 至平成23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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
1 期首		
期首元本額	平成21年7月23日 11,449,883,084円	平成22年7月23日 9,630,320,233円
期首からの追加設定元本額	2,974,640,414円	2,414,905,349円
期首からの一部解約元本額	4,794,203,265円	1,983,398,844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	201,506,743円	270,310,646円
三菱UFJ /ブラックロック 海外株式オープン(FOF s用)(適格機関投資家限定)	5,779,897,774円	6,615,446,614円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	345,731,160円	274,998,488円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	404,084,463円	287,581,724円
三菱UFJ グローバルバランスVA	1,357,687,610円	880,232,784円
三菱UFJ <DC>海外株式オープン	1,414,810,986円	1,622,898,069円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	12,316,118円	9,547,893円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	44,728,057円	39,387,198円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	69,557,322円	61,423,322円
(合計)	9,630,320,233円	10,061,826,738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。	567,108,902円	
3 計算期間末日における受益権の総数	9,630,320,233口	10,061,826,738口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9411円 (9,411円)	1.1180円 (11,180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)	(自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当 該金融商品に係るリス ク	当ファンドは、株式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。	同左
3 金融商品に係るリスク 管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金 融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]	[平成23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。	同左
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。	同左
3 金融商品の時価等に関 する事項についての補 足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金 融商品に関する注記)に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	328,977,430	1,074,910,520
合計	328,977,430	1,074,910,520

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項
 該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	ACTIVISION BLIZZARD INC	202,776	11.920000	2,417,089.92	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	28,248	83.210000	2,350,516.08	
	APPLE INC	13,611	387.290000	5,271,404.19	
	ARCH COAL INC	73,178	28.480000	2,084,109.44	
	CHEVRON CORP	49,075	109.430000	5,370,277.25	
	CITIGROUP INC	50,446	40.320000	2,033,982.72	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,077	73.450000	1,474,655.65	
	COMERICA INC	19,675	33.940000	667,769.50	
	CYTEC INDUSTRIES INC	25,433	56.960000	1,448,663.68	
	DIRECTV-CLASS A	85,454	52.005000	4,444,035.27	
	DOVER CORP	37,589	66.360000	2,494,406.04	
	FOSTER WHEELER AG	69,800	28.290000	1,974,642.00	
	GENERAL DYNAMICS CORP	15,202	71.570000	1,088,007.14	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,156	135.580000	1,105,790.48	
	HALLIBURTON CO	31,496	56.930000	1,793,067.28	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,500	32.100000	722,250.00	
	MCDONALD'S CORP	12,670	86.540000	1,096,461.80	
	MERCADOLIBRE INC	19,029	80.350000	1,528,980.15	
	NII HOLDINGS INC	70,148	42.220000	2,961,648.56	
	ORACLE CORP	102,842	32.470000	3,339,279.74	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	42,482	71.490000	3,037,038.18	
	PRAXAIR INC	28,989	107.190000	3,107,330.91	
	SCHLUMBERGER LTD	25,526	90.960000	2,321,844.96	
	SPX CORP	33,223	82.570000	2,743,223.11	
	TCF FINANCIAL CORP	12,596	13.400000	168,786.40	
	TIFFANY & CO	21,620	83.090000	1,796,405.80	
	TRIMBLE NAVIGATION LTD	20,998	37.780000	793,304.44	
	VEECO INSTRUMENTS INC	35,419	40.740000	1,442,970.06	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	91,812	37.570000	3,449,376.84	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	39,008	51.170000	1,996,039.36	
	WELLS FARGO & CO	39,477	29.380000	1,159,834.26	
	アメリカドル 小計	1,348,555		67,683,191.21 (5,324,636,652)	
カナダドル					
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	92,401	37.730000	3,486,289.73	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	32,605	50.450000	1,644,922.25	
	カナダドル 小計	125,006		5,131,211.98 (427,173,397)	
イギリスポンド					
	AFREN PLC	142,480	1.485000	211,582.80	
	BARCLAYS PLC	308,144	2.398500	739,083.38	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	61,396	27.970000	1,717,246.12	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	107,616	21.330000	2,295,449.28	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,243,711	0.475600	591,508.95	
	MAN GROUP PLC	401,147	2.432000	975,589.50	
	PREMIER OIL PLC	43,272	4.067000	175,987.22	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	75,805	34.060000	2,581,918.30	
	RIO TINTO PLC	41,425	43.765000	1,812,965.12	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	92,619	22.825000	2,114,028.67	
	STANDARD CHARTERED PLC	64,392	16.295000	1,049,267.64	
	TULLOW OIL PLC	58,871	12.870000	757,669.77	
	イギリスポンド 小計	2,640,878		15,022,296.75 (1,927,961,564)	
スイスフラン					
	NOVARTIS AG-REG	84,094	51.200000	4,305,612.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	5,989	421.100000	2,521,967.90	
	スイスフラン 小計	90,083		6,827,580.70 (656,540,160)	
香港ドル					
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	284,000	27.000000	7,668,000.00	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	148,500	66.200000	9,830,700.00	
	HENGDELI HOLDINGS LTD	1,444,000	4.030000	5,819,320.00	
	LENOVO GROUP LTD	1,722,000	5.060000	8,713,320.00	
	PRADA S.P.A.	257,400	46.800000	12,046,320.00	
	SANDS CHINA LTD	611,600	21.300000	13,027,080.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,618,000	6.930000	11,212,740.00	
	香港ドル 小計	6,085,500		68,317,480.00 (690,006,548)	
シンガポールドル					
	GENTING SINGAPORE PLC	893,000	1.795000	1,602,935.00	
	シンガポールドル 小計	893,000		1,602,935.00 (104,238,863)	
ユーロ					
	AXA SA	72,930	14.410000	1,050,921.30	
	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	31,383	52.250000	1,639,761.75	
	HEINEKEN NV	58,379	41.105000	2,399,668.79	
	ING GROEP NV-CVA	182,529	8.099000	1,478,302.37	
	SANOFI	57,696	54.850000	3,164,625.60	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	18,234	105.950000	1,931,892.30	
	SOCIETE GENERALE	27,314	38.230000	1,044,214.22	
	TELEFONICA SA	157,800	16.250000	2,564,250.00	
	ユーロ 小計	606,265		15,273,636.33 (1,729,281,105)	
合計		11,789,287		10,859,838,289 (10,859,838,289)	

(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 31銘柄	100.00%	49.03%
カナダドル	株式 2銘柄	100.00%	3.93%
イギリスポンド	株式 12銘柄	100.00%	17.75%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.00%	6.05%
香港ドル	株式 7銘柄	100.00%	6.35%
シンガポールドル	株式 1銘柄	100.00%	0.96%
ユーロ	株式 8銘柄	100.00%	15.92%

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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,815,357,362	1,339,552,833
コール・ローン	796,245,148	394,586,244
国債証券	144,945,818,970	114,886,665,991
未収入金	172,171,378	
未収利息	1,073,877,042	835,313,495
前払費用	702,084,622	597,570,826
流動資産合計	151,505,554,522	118,053,689,389
資産合計	151,505,554,522	118,053,689,389
負債の部		
流動負債		
未払解約金	330,411,446	225,462,649
流動負債合計	330,411,446	225,462,649
負債合計	330,411,446	225,462,649
純資産の部		
元本等		
元本	1 83,915,119,515	66,822,242,955
剰余金		
剰余金又は欠損金()	67,260,023,561	51,005,983,785
元本等合計	151,175,143,076	117,828,226,740
純資産合計	151,175,143,076	117,828,226,740
負債純資産合計	151,505,554,522	118,053,689,389

(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21年7月23日 至平成22年7月22日)	(自平成22年7月23日 至平成23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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
1 期首	平成21年7月23日	平成22年7月23日
期首元本額	107,076,493,349円	83,915,119,515円
期首からの追加設定元本額	1,833,966,359円	2,640,064,902円
期首からの一部解約元本額	24,995,340,193円	19,732,941,462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）	40,166,778,856円	27,321,304,402円
三菱UFJ DC金利運動アロケーション型バランスファンド	102,536,082円	166,466,853円
三菱UFJ ライフプラン 25	17,190,605円	16,185,868円
三菱UFJ ライフプラン 50	29,540,998円	29,432,110円
三菱UFJ ライフプラン 75	5,758,513円	4,486,486円
三菱UFJ 海外債券オープン	2,610,141,156円	2,956,945,724円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式20型	171,398,134円	144,469,016円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式40型	51,652,138円	43,921,455円
三菱UFJ 海外債券オープン（3ヵ月決算型）	13,759,064,646円	10,242,698,281円
三菱UFJ ライフプラン 50VA（適格機関投資家限定）	303,859,433円	267,582,481円
三菱UFJ 海外債券オープンVA（適格機関投資家限定）	633,076,961円	575,652,621円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA（適格機関投資家限定）	23,415,793,068円	22,418,264,870円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限定）	2,648,328,925円	2,634,832,788円
（合計）	83,915,119,515円	66,822,242,955円
2 計算期間末日における受益権の総数	83,915,119,515口	66,822,242,955口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8015円 （18,015円）	1.7633円 （17,633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）	（自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]	[平成23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。	同左
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。	同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,527,198,687	688,404,606
合計	3,527,198,687	688,404,606

（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）

取引の時価等に関する事項
 該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル				
国債証券	1.25 T-NOTE 140415	30,000,000	30,513,281.40	
	2.5 T-NOTE 150430	70,000,000	73,855,469.10	
	2.625 T-NOTE 140630	30,000,000	31,692,187.50	
	3.125 T-NOTE 190515	25,000,000	26,085,937.50	
	3.375 T-NOTE 130731	20,000,000	21,190,625.00	
	3.625 T-NOTE 190815	52,000,000	55,997,500.00	
	3.625 T-NOTE 210215	40,000,000	42,218,750.00	
	3.875 T-BOND 400815	8,000,000	7,412,500.00	
	3.875 T-NOTE 130215	30,000,000	31,640,625.00	
	3.875 T-NOTE 180515	50,000,000	55,398,437.50	
	4.25 T-NOTE 131115	30,000,000	32,573,437.50	
	4.25 T-NOTE 150815	50,000,000	56,171,875.00	
	4.5 T-BOND 360215	18,000,000	18,826,875.00	
	4.75 T-BOND 410215	10,000,000	10,753,125.00	
	4.75 T-NOTE 170815	40,000,000	46,493,750.00	
	5.375 T-BOND 310215	15,000,000	17,840,625.00	
	6 T-BOND 260215	10,000,000	12,621,875.00	
	6.25 T-BOND 230815	10,000,000	12,848,437.50	
	7.5 T-BOND 161115	8,000,000	10,396,250.00	
8.75 T-BOND 200515	8,000,000	11,790,000.00		
国債証券 小計		554,000,000	606,321,563.00 (47,699,317,361)	
アメリカドル 小計		554,000,000	606,321,563.00 (47,699,317,361)	
カナダドル				
国債証券	2 CAN GOVT 160601	9,000,000	8,908,470.00	
	3.5 CAN GOVT 130601	13,000,000	13,468,000.00	
	3.5 CAN GOVT 200601	8,000,000	8,368,480.00	
	4 CAN GOVT 410601	5,500,000	6,080,250.00	
国債証券 小計		35,500,000	36,825,200.00 (3,065,697,900)	
カナダドル 小計		35,500,000	36,825,200.00 (3,065,697,900)	
オーストラリアドル				
国債証券	5.25 AUST GOVT 190315	8,000,000	8,217,464.00	
	5.75 AUST GOVT 220715	4,000,000	4,240,000.00	
	6 AUST GOVT 170215	4,000,000	4,268,176.00	
	6.25 AUST GOVT 150415	7,000,000	7,432,334.00	
	6.5 AUST GOVT 130515	9,000,000	9,330,804.00	
国債証券 小計		32,000,000	33,488,778.00 (2,854,918,324)	
オーストラリアドル 小計		32,000,000	33,488,778.00 (2,854,918,324)	
イギリスポンド				

国債証券	4.25 GILT 320607	6,300,000	6,425,685.00
	4.25 GILT 551207	14,000,000	14,327,600.00
	4.5 GILT 130307	10,000,000	10,605,000.00
	4.75 GILT 150907	12,000,000	13,461,000.00
	4.75 GILT 200307	19,900,000	22,477,050.00
	6 GILT 281207	4,000,000	5,036,600.00
国債証券 小計		66,200,000	72,332,935.00 (9,283,208,877)
イギリスポンド 小計		66,200,000	72,332,935.00 (9,283,208,877)
シンガポールドル			
国債証券	2.5 SINGAPOREGOVT 190601	2,200,000	2,301,191.20
	3.25 SINGAPOREGOVT 200901	3,000,000	3,282,744.00
	3.5 SINGAPOREGOVT 270301	2,100,000	2,299,516.80
	3.625SINGAPOREGOVT 140701	8,500,000	9,313,807.00
	3.75 SINGAPOREGOVT 160901	2,000,000	2,284,702.00
	国債証券 小計		17,800,000
シンガポールドル 小計		17,800,000	19,481,961.00 (1,266,911,923)
マレーシアリングギット			
国債証券	3.502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000	2,796,612.00
	3.718MALAYSIAGOVT 120615	13,000,000	13,106,145.00
	3.814MALAYSIAGOVT 170215	12,500,000	12,638,487.50
	4.16 MALAYSIAGOVT 210715	4,500,000	4,609,998.00
	4.378MALAYSIAGOVT 191129	5,500,000	5,727,139.00
	5.094MALAYSIAGOVT 140430	4,000,000	4,193,772.00
国債証券 小計		42,500,000	43,072,153.50 (1,135,812,687)
マレーシアリングギット 小計		42,500,000	43,072,153.50 (1,135,812,687)
スウェーデンクローネ			
国債証券	3 SWD GOVT 160712	20,000,000	20,372,200.00
	3.5 SWD GOVT 390330	7,000,000	7,186,620.00
	3.75 SWD GOVT 170812	24,000,000	25,353,600.00
	5 SWD GOVT 201201	39,000,000	45,650,670.00
	6.75 SWD GOVT 140505	25,000,000	28,005,000.00
国債証券 小計		115,000,000	126,568,090.00 (1,578,304,082)
スウェーデンクローネ 小計		115,000,000	126,568,090.00 (1,578,304,082)
ノルウェークローネ			
国債証券	4.25 NORWE GOVT 170519	6,000,000	6,471,000.00
	4.5 NORWE GOVT 190522	5,000,000	5,480,400.00
	5 NORWE GOVT 150515	5,000,000	5,452,250.00
	6.5 NORWE GOVT 130515	4,000,000	4,384,000.00
国債証券 小計		20,000,000	21,787,650.00 (317,010,307)
ノルウェークローネ 小計		20,000,000	21,787,650.00 (317,010,307)
ポーランドズロチ			
国債証券	4.75 POLAND 120425	5,000,000	4,998,500.00
	5 POLAND 131024	8,000,000	8,041,600.00
	5.25 POLAND 171025	5,000,000	4,925,000.00
	5.25 POLAND 201025	2,000,000	1,912,000.00
	5.75 POLAND 220923	8,000,000	7,880,000.00
	6.25 POLAND 151024	10,000,000	10,425,000.00
国債証券 小計		38,000,000	38,182,100.00 (1,082,462,535)
ポーランドズロチ 小計		38,000,000	38,182,100.00 (1,082,462,535)
ユーロ			
国債証券	2 OBL 160226	30,000,000	29,961,000.00
	2.3 SPAIN GOVT 130430	15,000,000	14,630,250.00
	2.5 BUND 210104	45,000,000	43,794,000.00
	3.25 BUND 420704	25,000,000	23,387,500.00
	3.25 NETH GOVT 210715	30,000,000	30,054,000.00
	3.5 O.A.T 150425	5,000,000	5,234,000.00
	3.75 BEL GOVT 200928	15,000,000	14,529,000.00
	3.75 BUND 150104	30,000,000	31,986,000.00
	3.75 BUND 190104	35,000,000	37,784,250.00

4 NETH GOVT 160715	10,000,000	10,757,000.00	
4.25 O.A.T 231025	10,000,000	10,647,500.00	
4.5 BTAN 120712	20,000,000	20,602,000.00	
4.5 NETH GOVT 170715	55,000,000	60,588,000.00	
4.75 ITALY GOVT 130201	20,000,000	20,382,000.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	10,000,000	9,437,000.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	5,000,000	4,190,500.00	
5 BEL GOVT 350328	5,000,000	5,174,000.00	
5 ITALY GOVT 120201	23,000,000	23,284,050.00	
5 ITALY GOVT 340801	10,000,000	9,000,500.00	
5 ITALY GOVT 400901	7,000,000	6,192,200.00	
国債証券 小計	405,000,000	411,614,750.00 (46,603,021,995)	
ユーロ 小計	405,000,000	411,614,750.00 (46,603,021,995)	
合 計		114,886,665,991 (114,886,665,991)	

(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%	41.52%
カナダドル	国債証券 4銘柄	100.00%	2.67%
オーストラリアドル	国債証券 5銘柄	100.00%	2.48%
イギリスポンド	国債証券 6銘柄	100.00%	8.08%
シンガポールドル	国債証券 5銘柄	100.00%	1.10%
マレーシアリングgit	国債証券 6銘柄	100.00%	0.99%
スウェーデンクローネ	国債証券 5銘柄	100.00%	1.37%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.28%
ポーランドズロチ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.94%
ユーロ	国債証券 20銘柄	100.00%	40.56%

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22年7月22日現在]	[平成23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	154,557,543	273,615,571
国債証券	589,927,140	1,249,838,150
未収利息	440	592
流動資産合計	744,485,123	1,523,454,313
資産合計	744,485,123	1,523,454,313
負債の部		
流動負債		
未払金	39,989,480	
未払解約金	461,791	7,361
流動負債合計	40,451,271	7,361
負債合計	40,451,271	7,361
純資産の部		
元本等		
元本	693,929,785	1,499,963,627
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,104,067	23,483,325
元本等合計	704,033,852	1,523,446,952
純資産合計	704,033,852	1,523,446,952
負債純資産合計	744,485,123	1,523,454,313

(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21年7月23日 至平成22年7月22日)	(自平成22年7月23日 至平成23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22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
1 期首	平成21年7月23日	平成22年7月23日
期首元本額	399,143,491円	693,929,785円
期首からの追加設定元本額	2,382,169,309円	2,985,550,158円
期首からの一部解約元本額	2,087,383,015円	2,179,516,316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	65,191,672円	89,170,196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
ファンド・マネジャー（新興国債券）	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<円 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<米ド ルコース>（毎月分配型）	38,654,392円	36,524,829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）	1,795,545円	1,155,219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）	878,253円	1,942,088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）	25,382,478円	65,793,999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）	366,963,045円	702,558,753円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トル コリアコース>（毎月分配型）	1,393,530円	1,038,889円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーブルファンド>	1,046,465円	1,627,718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）	132,846,445円	442,705,201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）	433,750円	473,193円
マネーブル・ファンド	2,691,177円	3,736,576円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円 コース>（毎月分配型）	3,584,179円	10,004,564円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ド ルコース>（毎月分配型）		1,211,938円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラ ジルリアルコース>（毎月分配型）		2,797,347円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<新興 国バスケット通貨コース>（毎月分配型）		2,797,408円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーブルファンド>		2,275,624円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源 国バスケット通貨コース>（毎月分配型）		982,867円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド		2,237,352円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド		17,737,246円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドル コース>（毎月分配型）		1,445,483円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジル リアルコース>（毎月分配型）		17,231,567円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シ リーズ<円コース>（毎月分配型）		2,924,497円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シ リーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）		1,398,326円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シ リーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）		7,582,472円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シ リーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）		22,018,710円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シ リーズ<マネーブルファンド>		12,191,039円
マネーブルファンド（FOFs用）（適格機関投資家限 定）		982,247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）	26,407,926円	82,596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）	1,453,038円	
（合計）	693,929,785円	1,499,963,627円
2 計算期間末日における受益権の総数	693,929,785口	1,499,963,627口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0146円 （10,146円）	1.0157円 （10,157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）	（自平成22年7月23日 至平成23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。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成22年7月22日現在]	[平成23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。	同左
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。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成22年7月22日現在]	[平成23年7月22日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,602	8,834
合計	3,602	8,834

（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）

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188回国庫短期証券	100,000,000	99,998,300	
	第189回国庫短期証券	50,000,000	49,999,150	
	第190回国庫短期証券	50,000,000	49,998,350	
	第192回国庫短期証券	50,000,000	49,997,350	
	第194回国庫短期証券	100,000,000	99,992,800	
	第196回国庫短期証券	100,000,000	99,990,900	
	第197回国庫短期証券	100,000,000	99,989,000	
	第199回国庫短期証券	100,000,000	99,987,100	
	第202回国庫短期証券	100,000,000	99,984,900	
	第203回国庫短期証券	100,000,000	99,984,100	
	第204回国庫短期証券	100,000,000	99,981,300	
	第206回国庫短期証券	150,000,000	149,968,650	
	第207回国庫短期証券	150,000,000	149,966,250	

国債証券 小計	1,250,000,000	1,249,838,150	
合計	1,250,000,000	1,249,838,150	

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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	1,601,534,578
負債総額	265,826
純資産総額(-)	1,601,268,752
発行済口数	1,846,107,877 口
1口当たり純資産価額(/)	0.8674 (1万口当たり 8,674)

<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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	41,021,530,304
負債総額	549,275,591
純資産総額(-)	40,472,254,713
発行済口数	46,065,614,500 口
1口当たり純資産価額(/)	0.8786 (1万口当たり 8,786)

<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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	12,586,938,436
負債総額	119,888,098
純資産総額(-)	12,467,050,338
発行済口数	9,982,993,499 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2488 (1万口当たり 12,488)

<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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	11,311,284,300
負債総額	365,604,921
純資産総額(-)	10,945,679,379
発行済口数	10,076,583,369 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0862 (1万口当たり 10,862)

<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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	122,136,337,100
負債総額	5,197,733,836
純資産総額(-)	116,938,603,264
発行済口数	66,801,729,970 口
1口当たり純資産価額(/)	1.7505 (1万口当たり 17,505)

<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23年7月29日現在

(単位:円)

資産総額	1,509,219,114
負債総額	1
純資産総額(-)	1,509,219,113
発行済口数	1,485,927,329 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0157 (1万口当たり 10,157)

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23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23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23年7月29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	348	5,950,577
追加型公社債投資信託	18	437,233
単位型株式投資信託	10	48,681
単位型公社債投資信託	8	135,173
合計	384	6,571,665

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26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23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25期事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）及び第26期事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)		第26期 (平成23年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	8,675,536	2	17,056,128
有価証券	2	14,000,000	2	10,000,000
前払費用		136,193		156,230
未収入金	2	45,397	2	19,641
未収委託者報酬		4,345,110		4,517,987
未収収益	2	43,835	2	63,656
繰延税金資産		407,456		429,080
金銭の信託	2	500,000	2	30,000
その他		8,190		28,070
流動資産合計		28,161,721		32,300,796
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	333,687	1	306,543
器具備品	1	158,971	1	184,985
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,697,691		1,696,560
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		787,767		909,905
ソフトウェア仮勘定		72,475		146,761
その他		112		68
無形固定資産合計		876,178		1,072,557
投資その他の資産				
投資有価証券		11,797,311		9,405,012
関係会社株式		431,812		431,812
長期性預金	2	5,000,000	2	7,000,000
長期差入保証金	2	1,030,783	2	797,041
長期前払費用		142		52
繰延税金資産		474,632		442,254
その他		16,075		15,035
投資その他の資産合計		18,750,756		18,091,208
固定資産合計		21,324,626		20,860,326
資産合計		49,486,347		53,161,123

(単位：千円)

	第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	51,838	47,528
未払金		
未払収益分配金	274,776	245,085
未払償還金	1,607,485	1,328,820
未払手数料	2 1,748,905	2 1,768,519
その他未払金	52,889	104,042
未払費用	2 1,034,566	2 1,240,586
未払消費税等	104,853	184,873
未払法人税等	1,727,215	2,228,870
賞与引当金	580,826	550,000
デリバティブ債務	7,536	
その他		227,518
流動負債合計	7,190,892	7,925,844
固定負債		
退職給付引当金	68,206	105,461
役員退職慰労引当金	66,197	76,024
時効後支払損引当金		196,123
固定負債合計	134,404	377,609
負債合計	7,325,296	8,303,454
(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	31,383,254	34,903,313
利益剰余金合計	38,723,843	42,243,903
株主資本合計	40,946,071	44,466,131
評価・換算差額等		
その他有価証券		
評価差額金	1,277,237	391,537
繰延ヘッジ損益	62,258	
評価・換算差額等合計	1,214,979	391,537
純資産合計	42,161,050	44,857,668
負債純資産合計	49,486,347	53,161,123

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		40,630,847		48,411,622
その他営業収益				
投資顧問料		7,619		16,400
その他		85,040		236,596
営業収益合計		40,723,506		48,664,618
営業費用				
支払手数料	2	17,208,659	2	19,778,797
広告宣伝費		579,833		696,640
公告費		7,195		7,795
調査費				
調査費		799,697		895,558
委託調査費		5,231,920		8,991,373
事務委託費		183,931		243,109
営業雑経費				
通信費		98,055		98,144
印刷費		607,867		569,763
協会費		35,983		37,616
諸会費		5,761		6,248
事務機器関連費		841,349		880,509
営業費用合計		25,600,255		32,205,558
一般管理費				
給料				
役員報酬		194,520		199,168
給料・手当		3,445,656		3,576,037
賞与引当金繰入		580,826		550,000
福利厚生費		458,092		492,032
交際費		21,080		23,412
旅費交通費		108,299		156,920
租税公課		102,967		108,850
不動産賃借料		654,768		655,939
退職給付費用		177,435		163,440
役員退職慰労引当金繰入		18,448		18,106
固定資産減価償却費		382,798		406,176
諸経費		287,163		369,603
一般管理費合計		6,432,057		6,719,689
営業利益		8,691,194		9,739,370

(単位：千円)

	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	30,250	29,543
有価証券利息	2 29,170	2 11,040
受取利息	2 19,853	2 20,465
投資有価証券償還益	73,517	371,171
収益分配金等時効完成分	421,674	438,693
その他	8,586	8,257
営業外収益合計	583,053	879,170
営業外費用		
投資有価証券償還損	181,632	192,004
収益分配金等時効完成分支払額	10,520	
時効後支払損引当金繰入		666
事務過誤費	7,510	32,187
その他	3,626	7,757
営業外費用合計	203,289	232,615
経常利益	9,070,957	10,385,925
特別利益		
投資有価証券売却益	231,903	351,930
ゴルフ会員権売却益	10,190	
特別利益合計	242,093	351,930
特別損失		
投資有価証券売却損	129,159	127,114
過年度時効後支払損引当金繰入		204,138
固定資産除却損	1 701	1 3,431
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		37,264
その他		2,429
特別損失合計	129,860	374,378
税引前当期純利益	9,183,190	10,363,477
法人税、住民税及び事業税	3,627,233	4,027,373
法人税等調整額	118,635	25,800
法人税等合計	3,508,597	4,001,573
当期純利益	5,674,592	6,361,903

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23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	27,520,492	31,383,254
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	31,383,254	34,903,313
利益剰余金合計		
前期末残高	34,861,082	38,723,843
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	38,723,843	42,243,903
株主資本合計		
前期末残高	37,083,309	40,946,071
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
当期変動額合計	3,862,761	3,520,059
当期末残高	40,946,071	44,466,131
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	621,031	1,277,237
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,898,269	885,699
当期変動額合計	1,898,269	885,699
当期末残高	1,277,237	391,537
繰延ヘッジ損益		
前期末残高		62,258

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	62,258	62,258
当期変動額合計	62,258	62,258
当期末残高	62,258	
評価・換算差額等合計		
前期末残高	621,031	1,214,979
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,836,011	823,441
当期変動額合計	1,836,011	823,441
当期末残高	1,214,979	391,537
純資産合計		
前期末残高	36,462,278	42,161,050
当期変動額		
剰余金の配当	1,811,830	2,841,844
当期純利益	5,674,592	6,361,903
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,836,011	823,441
当期変動額合計	5,698,772	2,696,617
当期末残高	42,161,050	44,857,668

重要な会計方針

項目	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23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
(4) 時効後支払損引当金	-	時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. ヘッジ会計の手法		
(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25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23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。	当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」(企業会計基準第18号 平成20年3月31日)及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日)を適用しております。これにより、営業利益、経常利益はそれぞれ12,085千円、税引前当期純利益は49,350千円減少しております。

追加情報

第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
-	従来は時効が成立し、利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者から支払請求を受けた時点で支払予定額を費用計上しておりましたが、信頼性のある見積もりを行うための社内体制を整備し、当事業年度より将来の支払見込額を合理的に見積もることが可能となりました。そのため、当事業年度より受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を「時効後支払損引当金」として計上しております。この結果、従来の方法に比べて経常利益は8,014千円多く計上され、税引前当期純利益は196,123千円少なく計上されています。

注記事項

（貸借対照表関係）

項目	第25期 （平成22年3月31日現在）		第26期 （平成23年3月31日現在）	
	1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 152,240千円	器具備品 167,633千円	建物 181,085千円
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。		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		預金 13,335,700千円	
	有価証券 14,000,000千円		有価証券 10,000,000千円	
	未収入金 2,072千円		未収入金 1,500千円	
	未収収益 43,545千円		未収収益 63,656千円	
	金銭の信託 500,000千円		金銭の信託 30,000千円	
	長期性預金 5,000,000千円		長期性預金 7,000,000千円	
	長期差入保証金 837,940千円		長期差入保証金 788,590千円	
	未払手数料 1,005,639千円		未払手数料 986,786千円	
	未払費用 153,908千円		未払費用 134,713千円	

（損益計算書関係）

項目	第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）		第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	
	1.固定資産除却損の内訳	器具備品 701千円		器具備品 3,431千円
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。		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		支払手数料 11,685,424千円	
	有価証券利息 26,197千円		有価証券利息 8,718千円	
	受取利息 19,853千円		受取利息 20,465千円	

（株主資本等変動計算書関係）

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

第26期（自平成22年4月1日至平成23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
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

(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23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	3,189,318千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30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。

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23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。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23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	17,056,128	17,056,128	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,517,987	4,517,987	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,010,576	10,576
(5) 投資有価証券	9,140,755	9,140,755	-
(6) 未払手数料	(1,768,519)	(1,768,519)	-
(7) 未払法人税等	(2,228,870)	(2,228,870)	-

(*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。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(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、基準価額によっております。

(6) 未払手数料及び(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。

（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	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
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	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

（有価証券関係）

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

第26期（平成23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	4,026,733	3,476,499	550,234
	小計	4,026,733	3,476,499	550,234
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	5,114,022	5,236,164	122,142
	小計	5,114,022	5,236,164	122,142
	合計	9,140,755	8,712,663	428,091

(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22年4月1日至平成23年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,283,999	392,809	127,114
合計	4,283,999	392,809	127,114

(デリバティブ取引関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

- ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当するものはありません。
- 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。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

重要な取引はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
(1)退職給付債務	661,846	567,377
(2)年金資産	416,582	309,065
(3)未積立退職給付債務(1)+(2)	245,263	258,311
(4)未認識数理計算上の差異	177,056	152,850
(5)貸借対照表計上額純額(3)+(4)	68,206	105,461
(6)退職給付引当金	68,206	105,461

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
(1) 勤務費用	28,685	28,585
(2) 利息費用	11,367	9,774
(3) 期待運用収益	6,824	6,248
(4) 数理計算上の差異の費用処理額	57,581	37,969
(5) 退職給付費用	90,809	70,080
(6) その他	86,626	93,360
(7) 合計	177,435	163,440

(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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23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25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	669,724	651,260
投資有価証券評価損	849,883	408,754
ゴルフ会員権評価損	9,710	9,710
未払事業税	136,281	172,269
賞与引当金	236,338	223,795
役員退職慰労引当金	26,935	30,934
退職給付引当金	27,753	42,912
減価償却超過額	54,520	39,127
委託者報酬	106,666	92,577
長期差入保証金	-	20,080
時効後支払損引当金	-	79,802
その他	62,287	34,708
繰延税金資産 小計	2,180,101	1,805,934
評価性引当額	1,298,012	898,045
繰延税金資産 合計	882,088	907,888
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	36,553
繰延税金負債 合計	-	36,553
繰延税金資産(負債)の純額	882,088	871,334

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25期 (平成22年3月31日現在)		第26期 (平成23年3月31日現在)	
	(%)		(%)
法定実効税率 (調整)	40.7	法定実効税率 (調整)	40.7
投資有価証券評価損認容	2.1	投資有価証券評価損認容	2.9
その他	0.4	その他	0.8
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.2	税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

(追加情報)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(企業会計基準第17号 平成21年3月27日)及び「セグメント情報等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20号 平成20年3月21日)を適用しております。

(関連当事者情報)

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	
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	631,409 千円	長期差入保証金	833,144 千円	
							投資の助言	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）

第26期（自平成22年4月1日至平成23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
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	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円
							事務所の賃借	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	189,915 千円	未払費用	88,454 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	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円
							取引銀行	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
								8,718 千円	未収利息	675 千円
							マルチコーラル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
									長期性預金	7,000,000 千円
	18,499 千円	未収利息	3,069 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 モルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	3,000 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	4,447,569 千円	未払手数料	408,084 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)は、平成22年5月1日付で三菱UFJ証券(株)から商号変更をしております。

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

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25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1株当たり純資産額	339,739円97銭	361,469円71銭
1株当たり当期純利益	45,726円70銭	51,265円16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、記載していません。

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25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
当期純利益（千円）	5,674,592	6,361,903
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）	5,674,592	6,361,903
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23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23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23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23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50.0%(62,050株)、株式会社三菱東京UFJ銀行は25.0%(31,023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23年8月31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22年7月23日から平成23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 DC金利連動アロケーション型バランスファンドの平成23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23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	山田 信之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26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23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。