

【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25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25年10月22日から平成26年10月21日までです。

(注)上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

### (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

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

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

### (9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

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

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

( )		エマージング			
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。

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

#### 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)	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家(受益者)に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

#### 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。	

決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。



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

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

## [ ファンドの目的・特色 ]

### ファンドの目的

内外の株式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 <sup>(注1)</sup> 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 <sup>(注2)</sup> に委託します。 <sup>(注3)</sup>
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

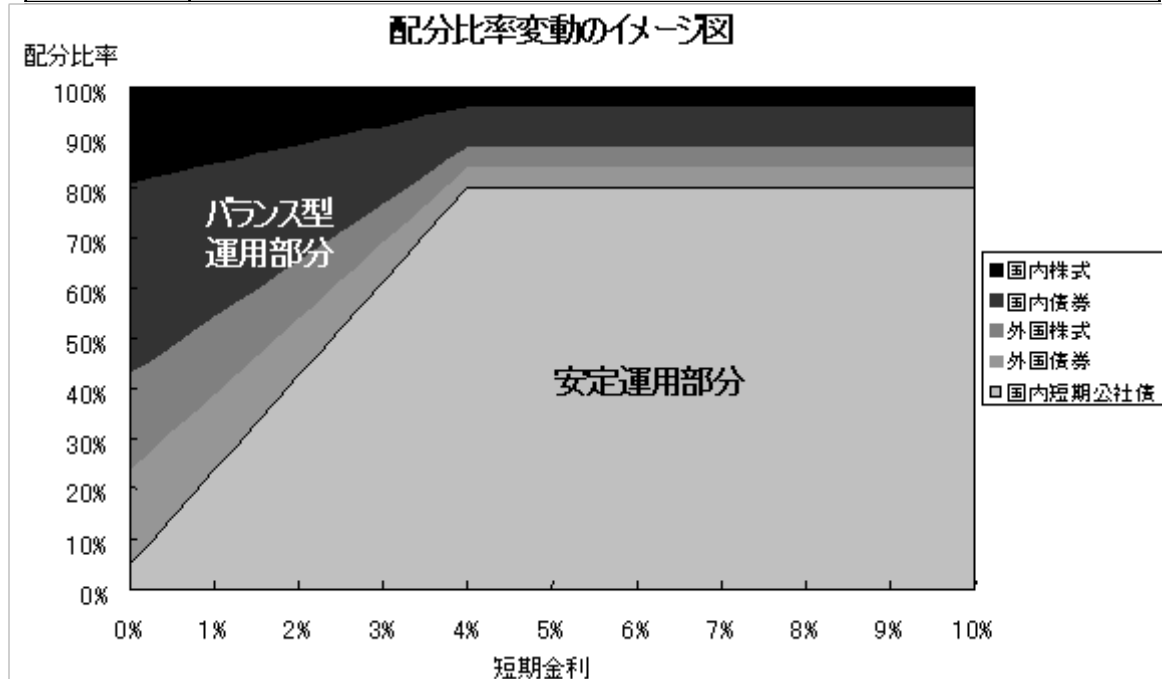
外国債券:三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド……20%程度

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O/N物レート(平均)」の月平均とします。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。

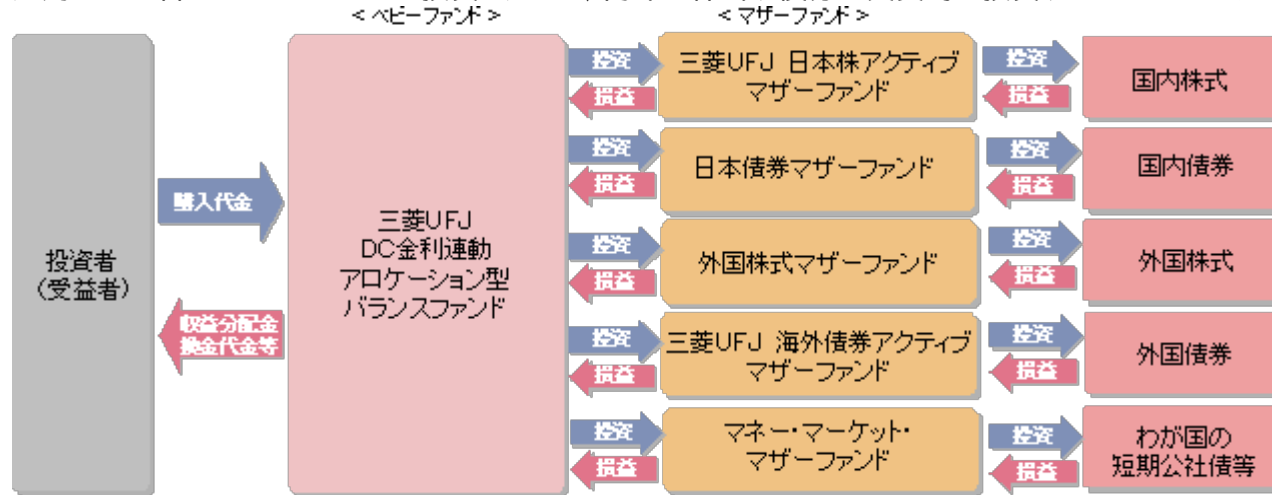
4

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

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、日本を除く世界の先進国で構成されています。

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

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

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

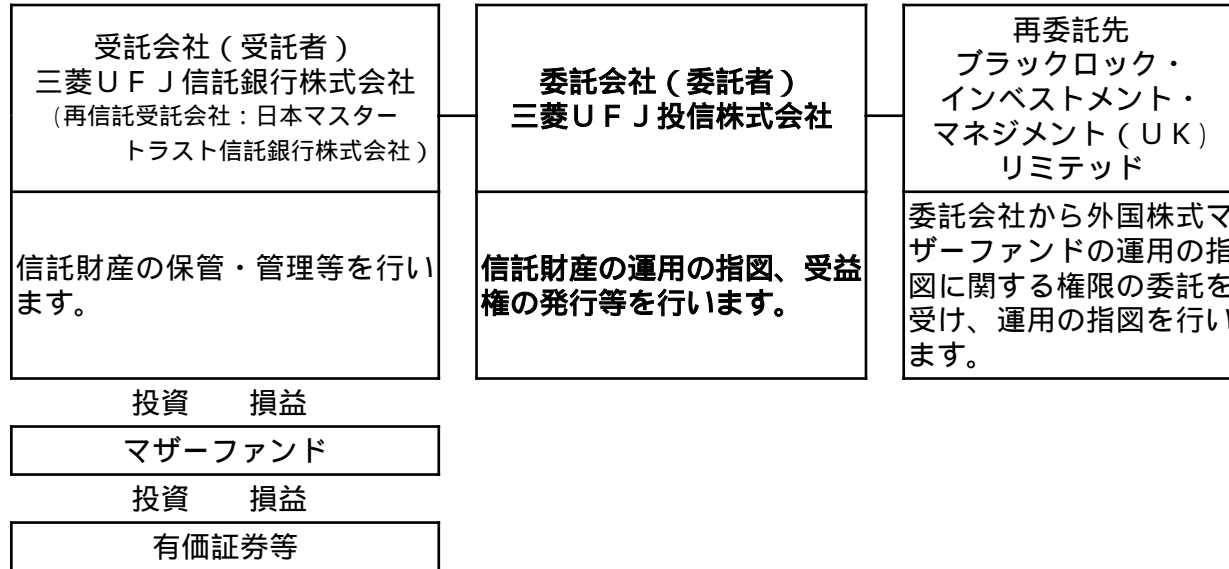
投資家（受益者）

お申込金 収益分配金、解約代金等

販売会社

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。

お申込金 収益分配金、解約代金等



## 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25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25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ま。

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

### 有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする三菱UFJ日本株アクティブマザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株マザーファンド、三菱UFJ海外債券アクティブマザーファンドおよびマネー・マーケット・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証券

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

１１．コマーシャル・ペーパー

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

１３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、１．から12．の証券または証書の性質を有するもの

１４．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）

１５．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。16．において同じ。）で16．で定めるもの以外のもの

１６．投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23.の有価証券の性質を有するもの

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

#### 金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みません。)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 - B P I 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割合のことをいいます。

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。

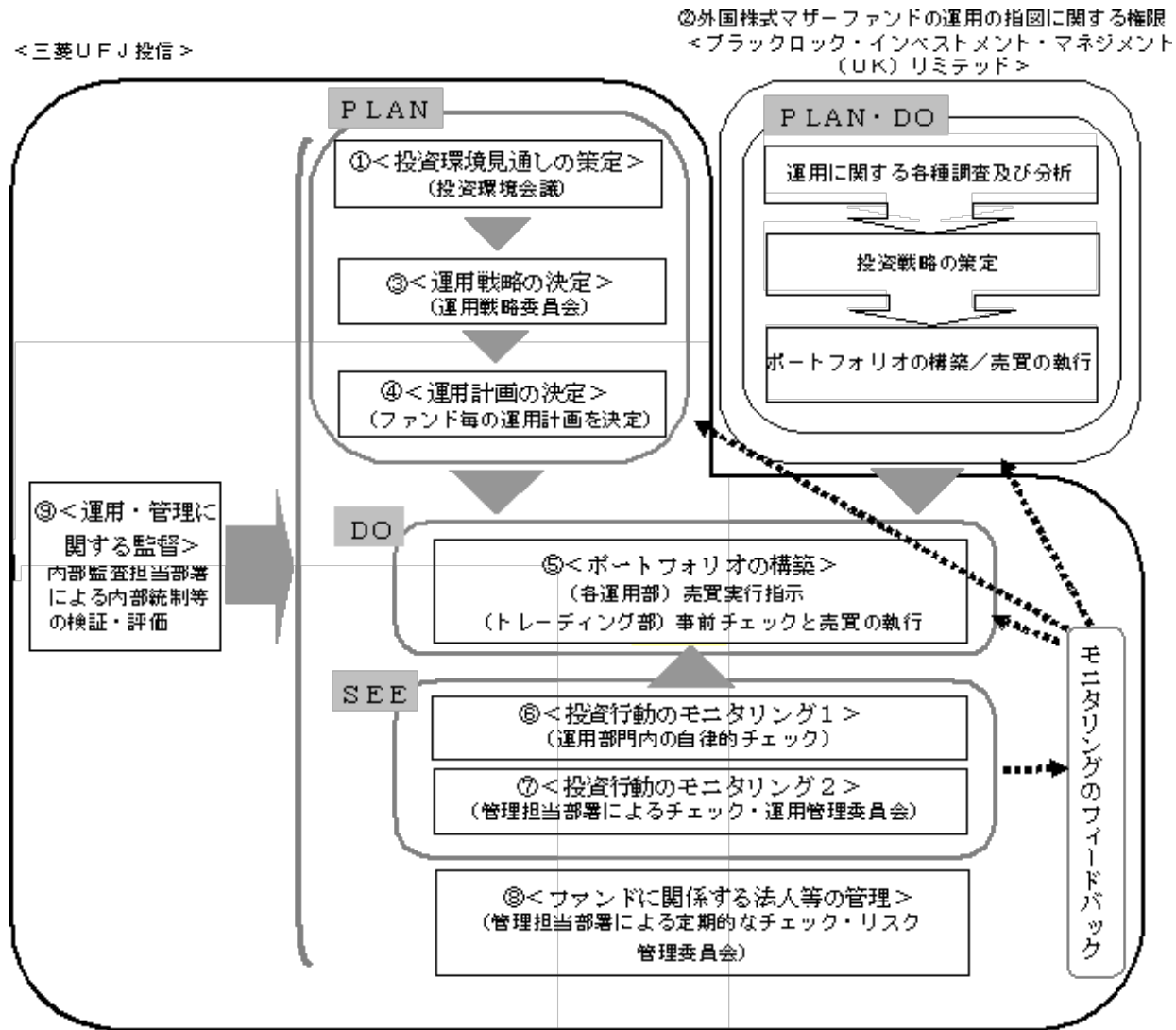
外貨建資産への投資は行いません。

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運用戦略を決定します。

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

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。

ファンドに関係する法人等の管理

再委託先、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せん。

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25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】

## &lt; 信託約款に定められた投資制限 &gt;

## 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て、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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証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ます。)の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。  
収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

「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<sup>\*</sup> 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。

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。

消費税率が8%になった場合は、以下の通りとなります。

信託財産の純資産総額 × 年0.648%

なお、上記の配分についても相応分引き上げられます。

#### （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。元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

原則として、10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、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。

## 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。

10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、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、10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、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26年1月1日以降の税率は、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)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

7.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%)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26年1月1日以降の税率は、15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)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。

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

### 収益分配金について

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

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



上記は平成25年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成25年7月31日現在  
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,237,250,114	99.80
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		6,371,166	0.20
純資産総額		3,243,621,280	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25年7月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
日本	日本債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		936,415,529	1.3028 1.3030	1,220,046,989 1,220,149,434		37.62
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		503,856,614	1.2994 1.2160	654,756,099 612,689,642		18.89
日本	外国株マザーファンド	親投資信託 受益証券		375,498,479	1.6637 1.6240	624,716,820 609,809,529		18.80
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		262,769,612	2.3617 2.3161	620,605,951 608,600,698		18.76
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		182,801,780	1.0174 1.0175	186,000,806 186,000,811		5.73

(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25年7月31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25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)
第5計算期間末日 (平成24年7月23日)	2,117,400,183 (分配付) 2,117,400,183 (分配落)	8,520 (分配付) 8,520 (分配落)
第6計算期間末日 (平成25年7月22日)	3,259,640,820 (分配付) 3,259,640,820 (分配落)	10,862 (分配付) 10,862 (分配落)
平成24年7月末日	2,159,647,352	8,560

8月末日	2,196,882,554	8,588
9月末日	2,235,742,385	8,658
10月末日	2,290,334,993	8,762
11月末日	2,394,586,950	8,987
12月末日	2,637,601,639	9,391
平成25年 1月末日	2,792,866,361	9,841
2月末日	2,843,222,024	9,942
3月末日	2,924,134,172	10,215
4月末日	3,048,144,367	10,688
5月末日	3,167,723,289	10,761
6月末日	3,164,931,883	10,548
7月末日	3,243,621,280	10,632

## 【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
第5計算期間	0円
第6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
第5計算期間	2.96
第6計算期間	27.48

（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
第5計算期間	833,407,385	160,036,442	2,485,304,370
第6計算期間	929,756,183	414,103,313	3,000,957,240

## &lt; 参考 &gt;

## 「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25年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	40,094,914,800	99.51
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		198,587,334	0.49
純資産総額		40,293,502,134	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25年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	373,500	5,810.00 5,970.00	2,170,035,000 2,229,795,000		5.53
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	2,350,000	582.00 601.00	1,367,700,000 1,412,350,000		3.51
日本	三井不動産	株式	不動産業	362,000	2,630.04 2,963.00	952,074,480 1,072,606,000		2.66
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	231,000	4,273.36 4,485.00	987,147,520 1,036,035,000		2.57
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	290,700	3,441.12 3,425.00	1,000,333,584 995,647,500		2.47
日本	KDDI	株式	情報・通信業	167,400	4,771.81 5,410.00	798,801,913 905,634,000		2.25
日本	日立製作所	株式	電気機器	1,299,000	641.68 658.00	833,550,947 854,742,000		2.12
日本	住友商事	株式	卸売業	649,000	1,222.00 1,312.00	793,078,000 851,488,000		2.11
日本	三井物産	株式	卸売業	629,000	1,226.00 1,315.00	771,154,000 827,135,000		2.05
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	221,200	3,510.00 3,630.00	776,412,000 802,956,000		1.99
日本	デンソー	株式	輸送用機器	178,500	4,285.34 4,460.00	764,933,447 796,110,000		1.98
日本	東芝	株式	電気機器	1,722,000	477.47 425.00	822,216,133 731,850,000		1.82
日本	キヤノン	株式	電気機器	241,700	3,215.00 3,025.00	777,065,500 731,142,500		1.81
日本	富士重工業	株式	輸送用機器	282,000	2,286.08 2,422.00	644,675,886 683,004,000		1.70
日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	106,100	5,460.00 6,240.00	579,306,000 662,064,000		1.64
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	80,500	7,200.31 7,890.00	579,625,662 635,145,000		1.58
日本	新日鐵住金	株式	鉄鋼	2,220,000	271.58 285.00	602,907,600 632,700,000		1.57
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	166,700	3,405.00 3,700.00	567,613,500 616,790,000		1.53
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	2,960,000	195.00 203.00	577,200,000 600,880,000		1.49
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	190,500	3,035.00 3,135.00	578,167,500 597,217,500		1.48
日本	塩野義製薬	株式	医薬品	298,000	1,943.00 1,991.00	579,014,000 593,318,000		1.47
日本	日本電産	株式	電気機器	60,300	6,170.00 8,000.00	372,051,000 482,400,000		1.20
日本	三菱商事	株式	卸売業	265,000	1,778.00 1,789.00	471,170,000 474,085,000		1.18
日本	コニカミノルタ	株式	電気機器	558,000	721.67 803.00	402,696,254 448,074,000		1.11
日本	日立金属	株式	鉄鋼	379,000	1,114.84 1,179.00	422,524,960 446,841,000		1.11
日本	オリックス	株式	その他金融業	302,000	1,251.00 1,455.00	377,802,000 439,410,000		1.09
日本	大同特殊鋼	株式	鉄鋼	746,000	518.00 569.00	386,428,000 424,474,000		1.05

日本	大成建設	株式	建設業	1,107,000	345.42 382.00	382,379,940 422,874,000		1.05
日本	カネカ	株式	化学	614,000	637.00 664.00	391,118,000 407,696,000		1.01
日本	ソニー	株式	電気機器	196,000	2,013.00 2,068.00	394,548,000 405,328,000		1.01

(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25年7月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	建設業	1.52
	食料品	4.29
	パルプ・紙	0.49
	化学	6.60
	医薬品	1.47
	ゴム製品	0.96
	ガラス・土石製品	0.99
	鉄鋼	3.73
	非鉄金属	1.41
	金属製品	0.91
	機械	4.68
	電気機器	13.84
	輸送用機器	14.78
	精密機器	0.99
	その他製品	1.88
	電気・ガス業	0.95
	陸運業	1.58
	情報・通信業	6.74
	卸売業	7.23
	小売業	5.40
	銀行業	8.50
	証券、商品先物取引業	1.92
	保険業	1.95
その他金融業	1.61	
不動産業	3.59	
サービス業	1.52	
合計	99.51	

(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。

## &lt;参考&gt;

## 「日本債券マザーファンド」

## (1) 投資状況

平成25年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	7,669,939,900	70.96
社債券	日本	2,992,947,400	27.69
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		145,183,126	1.35
純資産総額		10,808,070,426	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25年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第85回利付国債(5年)	国債証券		900,000	100.68 100.6740	906,139,000 906,066,000	0.700000 2014/09/20	8.38
日本	第294回利付国債(10年)	国債証券		300,000	106.97 106.8640	320,910,000 320,592,000	1.700000 2018/06/20	2.97
日本	第107回利付国債(5年)	国債証券		300,000	99.86 99.8040	299,607,000 299,412,000	0.200000 2017/12/20	2.77
日本	第326回利付国債(10年)	国債証券		250,000	99.42 99.4300	248,572,500 248,575,000	0.700000 2022/12/20	2.30
日本	第111回利付国債(20年)	国債証券		200,000	111.86 111.5540	223,726,000 223,108,000	2.200000 2029/06/20	2.06
日本	第306回利付国債(10年)	国債証券		200,000	106.27 106.1840	212,550,000 212,368,000	1.400000 2020/03/20	1.96
日本	第303回利付国債(10年)	国債証券		200,000	106.26 106.1780	212,532,000 212,356,000	1.400000 2019/09/20	1.96
日本	第299回利付国債(10年)	国債証券		200,000	105.56 105.4490	211,120,000 210,898,000	1.300000 2019/03/20	1.95
日本	第315回利付国債(10年)	国債証券		200,000	104.29 104.3190	208,586,000 208,638,000	1.200000 2021/06/20	1.93
日本	第309回利付国債(10年)	国債証券		200,000	104.21 104.1300	208,428,000 208,260,000	1.100000 2020/06/20	1.93
日本	第319回利付国債(10年)	国債証券		200,000	103.38 103.4130	206,762,000 206,826,000	1.100000 2021/12/20	1.91
日本	第321回利付国債(10年)	国債証券		200,000	102.48 102.4830	204,978,000 204,966,000	1.000000 2022/03/20	1.90
日本	第70回住友不動産	社債券		200,000	101.57 101.5520	203,140,000 203,104,000	1.480000 2014/12/19	1.88
日本	第323回利付国債(10年)	国債証券		200,000	101.50 101.5020	203,012,000 203,004,000	0.900000 2022/06/20	1.88
日本	第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	社債券		200,000	101.32 101.3360	202,640,000 202,672,000	1.230000 2015/01/27	1.88
日本	第93回利付国債(5年)	国債証券		200,000	100.88 100.9030	201,776,000 201,806,000	0.500000 2015/12/20	1.87
日本	第39回野村ホールディングス	社債券		200,000	100.76 100.8040	201,520,000 201,608,000	0.853000 2018/02/26	1.87
日本	第97回利付国債(5年)	国債証券		200,000	100.72 100.7600	201,446,000 201,520,000	0.400000 2016/06/20	1.86
日本	第140回オリックス	社債券		160,000	100.99 100.9790	161,587,200 161,566,400	1.140000 2014/09/26	1.49
日本	第313回利付国債(10年)	国債証券		150,000	105.08 105.1070	157,620,000 157,660,500	1.300000 2021/03/20	1.46
日本	第128回利付国債(20年)	国債証券		140,000	104.97 104.9000	146,970,600 146,860,000	1.900000 2031/06/20	1.36
日本	第118回利付国債(20年)	国債証券		130,000	107.68 107.5320	139,993,100 139,791,600	2.000000 2030/06/20	1.29
日本	第34回利付国債(30年)	国債証券		120,000	108.28 108.5830	129,942,000 130,299,600	2.200000 2041/03/20	1.21
日本	第325回利付国債(10年)	国債証券		120,000	100.47 100.4700	120,565,200 120,564,000	0.800000 2022/09/20	1.12
日本	第70回利付国債(20年)	国債証券		100,000	116.05 116.0170	116,050,000 116,017,000	2.400000 2024/06/20	1.07
日本	第88回利付国債(20年)	国債証券		100,000	115.05 114.9010	115,058,000 114,901,000	2.300000 2026/06/20	1.06
日本	第27回利付国債(30年)	国債証券		100,000	114.09 114.4740	114,091,000 114,474,000	2.500000 2037/09/20	1.06

日本	第20回利付国債(30年)	国債証券		100,000	113.79 113.9650	113,792,000 113,965,000	2.500000 2035/09/20	1.05
日本	第90回利付国債(20年)	国債証券		100,000	113.75 113.6010	113,756,000 113,601,000	2.200000 2026/09/20	1.05
日本	第80回利付国債(20年)	国債証券		100,000	112.96 112.8810	112,966,000 112,881,000	2.100000 2025/06/20	1.04

(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25年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	70.96
社債券	27.69
合計	98.66

(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25年7月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	3,040,220,454	60.19
	イギリス	612,875,441	12.13
	スイス	380,262,725	7.53
	香港	194,765,978	3.86
	ベルギー	191,310,481	3.79
	フランス	143,730,577	2.85
	スウェーデン	105,340,599	2.09
	イタリア	100,332,440	1.99
	シンガポール	77,710,836	1.54
	オランダ	58,304,804	1.15
	ドイツ	45,608,469	0.90
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		100,163,915	1.98
純資産総額		5,050,626,719	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25年7月31日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
ベルギー	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	株式	食品・飲料・ タバコ	21,729	8,862.90 8,804.38	192,582,117 191,310,481		3.79
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	633,291	288.47 291.61	183,494,543 184,677,769		3.66
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	55,419	2,853.14 2,910.03	158,118,564 161,271,152		3.19
アメリカ	TIME WARNER INC	株式	メディア	26,079	6,058.40 6,087.82	157,997,055 158,764,403		3.14
イギリス	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	株式	食品・飲料・ タバコ	48,847	3,258.44 3,239.01	159,165,311 158,216,160		3.13
アメリカ	DIRECTV	株式	メディア	25,448	6,394.81 6,142.75	162,735,277 156,320,712		3.10
アメリカ	AUTOZONE INC	株式	小売	3,543	42,772.68 43,615.19	151,544,628 154,528,636		3.06

アメリカ	DANAHER CORP	株式	資本財	22,643	6,737.11 6,588.03	152,548,499 149,172,844	2.95
アメリカ	SCHLUMBERGER LTD	株式	エネルギー	17,433	8,115.13 7,986.65	141,471,221 139,231,346	2.76
アメリカ	NATIONAL OILWELL VARCO INC	株式	エネルギー	19,423	7,252.03 6,806.75	140,861,731 132,207,544	2.62
アメリカ	NEWELL RUBBERMAID INC	株式	耐久消費財・ アパレル	48,423	2,662.87 2,623.64	128,944,250 127,044,519	2.52
スイス	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	株式	耐久消費財・ アパレル	13,394	9,313.02 9,423.82	124,738,623 126,222,765	2.50
アメリカ	PRAXAIR INC	株式	素材	9,981	11,517.53 11,836.29	114,963,676 118,138,054	2.34
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	11,332	10,346.77 10,414.40	117,249,688 118,016,026	2.34
イギリス	STANDARD CHARTERED PLC	株式	銀行	52,345	2,279.41 2,248.02	119,355,228 117,673,067	2.33
アメリカ	US BANCORP	株式	銀行	28,955	3,654.46 3,697.61	105,814,912 107,064,471	2.12
スウェーデン	ATLAS COPCO AB-A SHS	株式	資本財	41,466	2,502.68 2,540.40	103,777,300 105,340,599	2.09
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	32,580	3,087.55 3,123.84	100,612,322 101,774,967	2.02
アメリカ	COACH INC	株式	耐久消費財・ アパレル	19,445	5,817.12 5,227.66	113,113,991 101,651,926	2.01
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	保険	8,912	11,661.71 11,356.68	103,929,177 101,210,760	2.00
イタリア	ENI SPA	株式	エネルギー	46,308	2,165.33 2,166.63	100,274,008 100,332,440	1.99
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	18,335	5,508.17 5,426.76	100,992,348 99,499,761	1.97
アメリカ	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	株式	各種金融	14,547	6,781.25 6,784.19	98,646,861 98,689,664	1.95
イギリス	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	食品・飲料・ タバコ	18,482	5,186.60 5,175.39	95,872,720 95,651,719	1.89
アメリカ	ECOLAB INC	株式	素材	9,863	9,160.67 9,195.00	90,351,707 90,690,285	1.80
アメリカ	WW GRAINGER INC	株式	資本財	3,553	25,747.96 25,515.51	91,482,507 90,656,614	1.79
スイス	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	株式	各種金融	30,057	2,947.45 2,882.02	88,591,591 86,625,004	1.72
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	16,255	5,134.48 5,078.58	83,461,102 82,552,356	1.63
スイス	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	3,319	24,757.33 24,430.19	82,169,604 81,083,817	1.61
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	16,984	4,687.24 4,712.74	79,608,138 80,041,244	1.58

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年7月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	8.89
	素材	4.55
	資本財	9.76
	耐久消費財・アパレル	8.28
	消費者サービス	1.42
	メディア	6.73
	小売	3.06
	食品・飲料・タバコ	13.19
	家庭用品・パーソナル用品	0.72
	ヘルスケア機器・サービス	0.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.72
	銀行	6.61
	各種金融	7.27
	保険	3.83
	ソフトウェア・サービス	5.36
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.40
	電気通信サービス	3.66
半導体・半導体製造装置	3.85	
合計	98.02	

(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25年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	39,276,277,746	38.34
	イタリア	14,910,720,187	14.56
	フランス	10,404,435,667	10.16
	ドイツ	8,802,629,325	8.59
	スペイン	7,160,481,472	6.99
	ベルギー	5,174,643,982	5.05
	メキシコ	3,459,324,968	3.38
	ポーランド	3,210,065,332	3.13
	カナダ	2,576,973,084	2.52
	イギリス	1,669,396,051	1.63
	スウェーデン	577,284,666	0.56
	南アフリカ	570,515,200	0.56
	マレーシア	523,447,812	0.51
	オランダ	439,959,150	0.43
	シンガポール	415,653,462	0.41
	ノルウェー	280,970,095	0.27
オーストラリア	19,322,938	0.02	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,966,707,436	2.89
純資産総額		102,438,808,573	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25年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					アメリカ	0.75 T-NOTE 140615	国債証券	
アメリカ	2.5 T-NOTE 150430	国債証券		48,000,000.00	10,207.01 10,189.2093	4,899,369,091 4,890,820,497	2.500000 2015/04/30	4.77
イタリア	4.5 ITALY GOVT 180801	国債証券		35,000,000.00	13,657.65 13,749.5362	4,780,177,623 4,812,337,687	4.500000 2018/08/01	4.70
ベルギー	3.75 BEL GOVT 200928	国債証券		28,000,000.00	14,783.14 14,640.3787	4,139,280,819 4,099,306,050	3.750000 2020/09/28	4.00
アメリカ	0.25 T-NOTE 150131	国債証券		40,000,000.00	9,807.92 9,814.1300	3,923,170,882 3,925,652,000	0.250000 2015/01/31	3.83
フランス	4 O.A.T 180425	国債証券		25,000,000.00	15,184.63 14,796.4387	3,796,159,500 3,699,109,687	4.000000 2018/04/25	3.61
ドイツ	4.25 BUND 170704	国債証券		24,000,000.00	14,959.65 14,927.1390	3,590,316,360 3,582,513,360	4.250000 2017/07/04	3.50
イタリア	4.25 ITALY GOVT 200301	国債証券		26,000,000.00	13,382.08 13,414.0072	3,479,343,394 3,487,641,885	4.250000 2020/03/01	3.40
アメリカ	0.125 T-NOTE 150430	国債証券		35,000,000.00	9,767.27 9,783.8631	3,418,547,750 3,424,352,092	0.125000 2015/04/30	3.34
フランス	4.25 O.A.T 190425	国債証券		15,000,000.00	15,486.35 15,154.7265	2,322,953,100 2,273,208,975	4.250000 2019/04/25	2.22
アメリカ	4.75 T-NOTE 170815	国債証券		20,000,000.00	11,669.98 11,246.2512	2,333,997,500 2,249,250,250	4.750000 2017/08/15	2.20
アメリカ	3.875 T-NOTE 180515	国債証券		20,000,000.00	11,414.82 10,986.1093	2,282,965,250 2,197,221,874	3.875000 2018/05/15	2.14
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券		20,000,000.00	11,121.35 10,621.7575	2,224,270,500 2,124,351,500	3.125000 2019/05/15	2.07

アメリカ	3.125 T-NOTE 170131	国債証券		20,000,000.00	10,840.78 10,585.7437	2,168,156,480 2,117,148,750	3.125000 2017/01/31	2.07
アメリカ	4.75 T-BOND 410215	国債証券		17,000,000.00	12,831.56 11,850.0562	2,181,366,017 2,014,509,562	4.750000 2041/02/15	1.97
イタリア	5.5 ITALY GOVT 221101	国債証券		14,000,000.00	14,081.73 14,129.2822	1,971,443,556 1,978,099,515	5.500000 2022/11/01	1.93
アメリカ	0.375 T-NOTE 160315	国債証券		20,000,000.00	9,777.73 9,778.4993	1,955,546,625 1,955,699,874	0.375000 2016/03/15	1.91
スペイン	4.25 SPAIN GOVT 161031	国債証券		14,000,000.00	13,135.05 13,560.3135	1,838,907,000 1,898,443,890	4.250000 2016/10/31	1.85
ドイツ	2.5 BUND 210104	国債証券		13,000,000.00	14,340.61 14,233.3222	1,864,279,755 1,850,331,892	2.500000 2021/01/04	1.81
スペイン	4.5 SPAIN GOVT 180131	国債証券		13,000,000.00	13,711.00 13,633.7917	1,782,430,186 1,772,392,927	4.500000 2018/01/31	1.73
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		11,000,000.00	16,488.94 15,842.6910	1,813,783,941 1,742,696,010	4.500000 2041/04/25	1.70
イタリア	5.5 ITALY GOVT 220901	国債証券		12,000,000.00	14,146.78 14,140.9867	1,697,614,177 1,696,918,410	5.500000 2022/09/01	1.66
カナダ	2 CAN GOVT 160601	国債証券		17,500,000.00	9,738.00 9,695.5488	1,704,151,400 1,696,721,040	2.000000 2016/06/01	1.66
メキシコ	6.5 MEXICAN BONOS 220609	国債証券		210,000,000.00	830.96 795.6689	1,745,023,721 1,670,904,732	6.500000 2022/06/09	1.63
スペイン	4.3 SPAIN GOVT 191031	国債証券		12,000,000.00	13,514.49 13,324.2727	1,621,739,106 1,598,912,730	4.300000 2019/10/31	1.56
イタリア	5 ITALY GOVT 400901	国債証券		12,000,000.00	12,936.16 12,925.6695	1,552,339,224 1,551,080,340	5.000000 2040/09/01	1.51
ドイツ	3.25 BUND 420704	国債証券		10,000,000.00	15,412.01 15,134.5687	1,541,201,742 1,513,456,875	3.250000 2042/07/04	1.48
ポーランド	5.25 POLAND 171025	国債証券		44,000,000.00	3,322.20 3,316.0830	1,461,770,645 1,459,076,520	5.250000 2017/10/25	1.42
アメリカ	8.125 T-BOND 210815	国債証券		10,000,000.00	15,213.89 14,123.5200	1,521,389,375 1,412,352,000	8.125000 2021/08/15	1.38
フランス	3.25 O.A.T 160425	国債証券		10,000,000.00	13,927.96 13,982.9760	1,392,796,485 1,398,297,600	3.250000 2016/04/25	1.37

(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25年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	97.10
合計	97.10

(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。

&lt;参考&gt;

「マネー・マーケット・マザーファンド」

## (1) 投資状況

平成25年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	2,999,707,300	83.69
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		584,517,668	16.31
純資産総額		3,584,224,968	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25年7月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					日本	第370回国庫短期証券	国債証券	
日本	第374回国庫短期証券	国債証券		500,000	99.97 99.9886	499,892,300 499,943,000	2013/09/17	13.95
日本	第377回国庫短期証券	国債証券		500,000	99.97 99.9846	499,882,500 499,923,000	2013/09/30	13.95
日本	第372回国庫短期証券	国債証券		400,000	99.98 99.9906	399,920,700 399,962,400	2013/09/09	11.16
日本	第369回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9940	299,933,400 299,982,000	2013/08/26	8.37
日本	第367回国庫短期証券	国債証券		200,000	99.97 99.9958	199,953,600 199,991,600	2013/08/19	5.58
日本	第363回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9984	99,987,800 99,998,400	2013/08/05	2.79
日本	第365回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9973	99,985,300 99,997,300	2013/08/12	2.79
日本	第376回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9862	99,977,800 99,986,200	2013/09/24	2.79
日本	第384回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9773	99,976,800 99,977,300	2013/10/28	2.79

(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25年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	83.69
合計	83.69

(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。

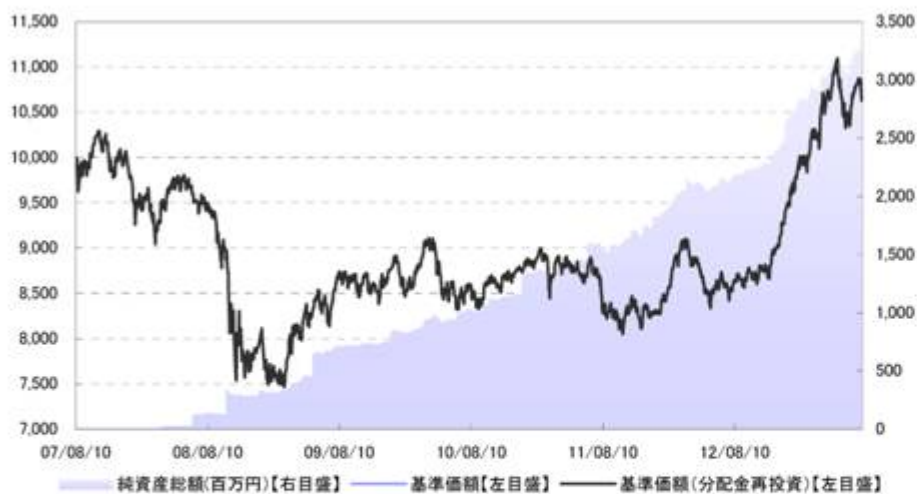
その他投資資産の主要なもの

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～2013年7月31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計算

## 2 分配の推移

2013年7月	0円
2012年7月	0円
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

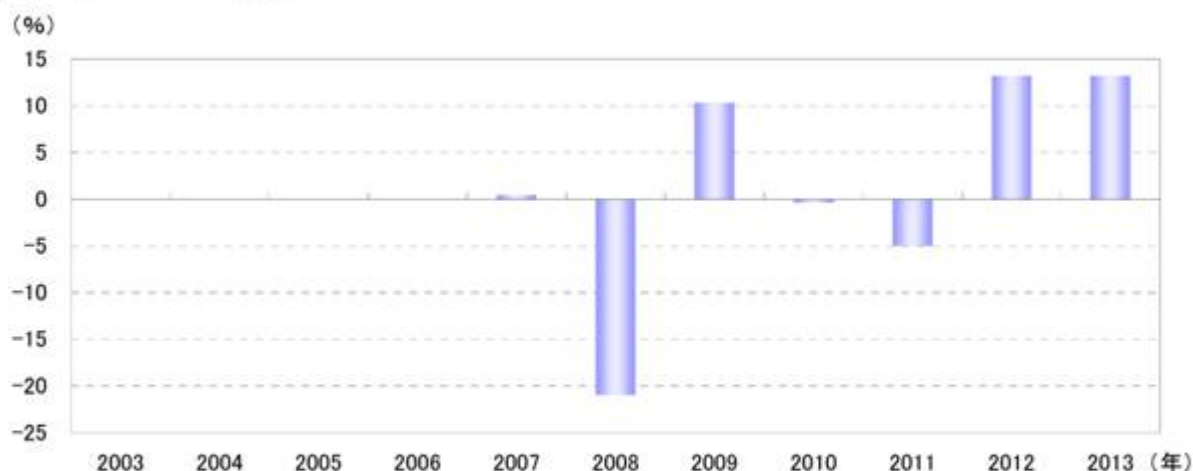
・分配金は1万口当たり、税引前

## 3 主要な資産の状況(2013年7月31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	18.8%	円	62.6%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	1.0%
国内債券	41.9%	アメリカドル	18.9%	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	株式	食品・飲料・タバコ	ベルギー	0.7%
外国株式	18.4%	ユーロ	10.8%	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	イギリス	0.7%
外国債券	18.2%	イギリスポンド	2.6%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.7%
		スイスフラン	1.4%	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.6%
		香港ドル	0.7%	第85回利付国債(5年)	債券	国債	日本	3.2%
		メキシコペソ	0.7%	第370回国庫短期証券	債券	国債	日本	1.1%
コールローン他 (負債控除後)	2.7%	ポーランドズロチ	0.6%	第294回利付国債(10年)	債券	国債	日本	1.1%
		その他	1.7%	第107回利付国債(5年)	債券	国債	日本	1.0%
合計	100.0%	合計	100.0%	0.75 T-NOTE 140615	債券	国債	アメリカ	0.9%

- ・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、2013年は7月31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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
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。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a></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、ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。 委託会社と再委託先との間で締結された契約は、契約締結の日から1年間とし、期間満了の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、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の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6期計算期間(平成24年7月24日から平成25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5期 [平成24年7月23日現在]	第6期 [平成25年7月22日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	11,929,725	12,495,696
親投資信託受益証券	2,113,238,729	3,257,361,626
未収入金	30,262	38,416
未収利息	27	22
流動資産合計	2,125,198,743	3,269,895,760
資産合計	2,125,198,743	3,269,895,760
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,287,860	840,643
未払受託者報酬	539,329	779,855
未払委託者報酬	5,932,603	8,578,344
その他未払費用	38,768	56,098
流動負債合計	7,798,560	10,254,940
負債合計	7,798,560	10,254,940
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,485,304,370	<sup>1</sup> 3,000,957,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sup>2</sup> 367,904,187	<sup>2</sup> 258,683,580
(分配準備積立金)	63,402,615	572,491,902
元本等合計	2,117,400,183	3,259,640,820
純資産合計	2,117,400,183	3,259,640,820
負債純資産合計	2,125,198,743	3,269,895,760

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 5 期 自 平成23年 7月23日 至 平成24年 7月23日	第 6 期 自 平成24年 7月24日 至 平成25年 7月22日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,246	8,038
有価証券売買等損益	35,998,378	668,274,204
営業収益合計	35,993,132	668,282,242
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	977,033	1,395,532
委託者報酬	<sup>1</sup> 10,747,293	<sup>1</sup> 15,350,721
その他費用	70,223	100,361
営業費用合計	11,794,549	16,846,614
営業利益	47,787,681	651,435,628
経常利益	47,787,681	651,435,628
当期純利益	47,787,681	651,435,628
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,513,216	56,532,877
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	221,108,304	367,904,187
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,627,657	55,283,748
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,627,657	55,283,748
剰余金減少額又は欠損金増加額	122,149,075	23,598,732
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,149,075	23,598,732
分配金	<sup>2</sup> -	<sup>2</sup> -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	367,904,187	258,683,580

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<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。 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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最終相場で評価しております。 金融商品取引所等の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。 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られ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られた価額で評価しております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年7月22日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年7月24日から平成25年7月22日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	第 5 期 [ 平成24年7月23日現在 ]	第 6 期 [ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,811,933,427円 833,407,385円 160,036,442円	2,485,304,370円 929,756,183円 414,103,313円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	367,904,187円	
3 受益権の総数	2,485,304,370口	3,000,957,240口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8520円 (8,520円)	1.0862円 (10,862円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 5 期 (自 平成23年7月23日 至 平成24年7月23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	28,338,798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	51,900,698円
分配準備積立金額	D	35,063,817円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	115,303,313円
当ファンドの期末残存口数	F	2,485,304,370口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	463円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金額	I=F*H/10,000	

第6期（自平成24年7月24日 至平成25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	51,942,879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	465,837,312円
収益調整金額	C	85,523,786円
分配準備積立金額	D	54,711,711円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	658,015,688円
当ファンドの期末残存口数	F	3,000,957,240口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,192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5期 (自平成23年7月23日 至平成24年7月23日)	第6期 (自平成24年7月24日 至平成25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、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左  同 左  同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。 実質的な主要投資対象である親投資信託受益証券は、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。	同 左  同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第5期 [平成24年7月23日現在]	第6期 [平成25年7月22日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(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。	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	(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 5 期 [平成24年7月23日現在]	第 6 期 [平成25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)	
親投資信託受益証券	32,400,255	599,310,095
合計	32,400,255	599,310,095

## (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	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	487,462,087	634,724,383	
	三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	258,467,683	610,604,054	
	日本債券マザーファンド	923,110,157	1,202,720,223	
	外国株式マザーファンド	376,610,921	626,567,589	
	マネー・マーケット・マザーファンド	179,602,337	182,745,377	
	親投資信託受益証券 小計	2,225,253,185	3,257,361,626	
	合計	2,225,253,185	3,257,361,626	

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。

## &lt;参考&gt;

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24年7月23日現在]	[平成25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	228,609,722	604,427,622
株式	31,023,054,700	42,723,187,500
未収入金	151,671,037	1,040,788,553
未収配当金	33,230,800	35,310,500
未収利息	522	1,065
流動資産合計	31,436,566,781	44,403,715,240
資産合計	31,436,566,781	44,403,715,240
負債の部		
流動負債		
未払金	129,778,036	830,948,977
未払解約金	9,372,093	214,919,274
流動負債合計	139,150,129	1,045,868,251
負債合計	139,150,129	1,045,868,251
純資産の部		
元本等		
元本	1 41,833,981,549	33,297,611,811
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2 10,536,564,897	10,060,235,178
元本等合計	31,297,416,652	43,357,846,989
純資産合計	31,297,416,652	43,357,846,989
負債純資産合計	31,436,566,781	44,403,715,240

(注1) 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)

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>
-------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首	平成23年7月23日	平成24年7月24日
期首元本額	46,375,554,902円	41,833,981,549円
期首からの追加設定元本額	3,778,181,397円	1,833,604,664円
期首からの一部解約元本額	8,319,754,750円	10,369,974,402円
元本の内訳*		
三菱UFJ 日本株アクティブオープン	11,678,039,753円	9,913,045,724円
三菱UFJ 日本株アクティブオープン（確定拠出年金）	9,918,078,249円	9,823,525,351円
三菱UFJ バランスインカムオープン（毎月決算型）	18,570,460,350円	11,968,321,350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	507,235,605円	487,462,087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）	1,160,167,592円	1,105,257,299円
（合計）	41,833,981,549円	33,297,611,811円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	10,536,564,897円	
3 受益権の総数	41,833,981,549口	33,297,611,811口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.7481円 (7,481円)	1.3021円 (13,021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23年7月23日 至平成24年7月23日）	（自平成24年7月24日 至平成25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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	(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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	2,086,236,305	4,076,242,120
合計	2,086,236,305	4,076,242,120

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引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	
1801	大成建設	1,110,000	407	451,770,000	
1963	日揮	55,000	3,730	205,150,000	
2503	麒麟ホールディングス	246,000	1,613	396,798,000	
2607	不二製油	230,000	1,724	396,520,000	
2914	日本たばこ産業	291,000	3,670	1,067,970,000	
3941	レンゴー	396,000	513	203,148,000	
4091	太陽日酸	284,000	755	214,420,000	
4118	カネカ	616,000	696	428,736,000	
4182	三菱瓦斯化学	509,000	748	380,732,000	
4202	ダイセル	440,000	873	384,120,000	
4205	日本ゼオン	343,000	1,114	382,102,000	
4631	D I C	735,000	252	185,220,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	61,000	3,405	207,705,000	
6988	日東電工	31,500	5,890	185,535,000	
8113	ユニ・チャーム	71,000	5,680	403,280,000	
4507	塩野義製薬	299,000	2,241	670,059,000	
5108	ブリヂストン	112,700	3,790	427,133,000	
5233	太平洋セメント	1,217,000	357	434,469,000	
5401	新日鐵住金	2,220,000	299	663,780,000	
5471	大同特殊鋼	748,000	592	442,816,000	
5486	日立金属	373,000	1,057	394,261,000	
5711	三菱マテリアル	557,000	358	199,406,000	
5714	D O W Aホールディングス	213,000	955	203,415,000	
5741	古河スカイ	685,000	276	189,060,000	
3436	S U M C O	191,000	994	189,854,000	
5938	L I X I Lグループ	71,000	2,410	171,110,000	
6273	S M C	9,100	21,410	194,831,000	
6301	小松製作所	174,000	2,387	415,338,000	
6326	クボタ	261,000	1,598	417,078,000	
6361	荏原製作所	363,000	572	207,636,000	
6481	T H K	90,500	2,188	198,014,000	
7011	三菱重工業	656,000	608	398,848,000	
7013	I H I	482,000	431	207,742,000	
4902	コニカミノルタ	530,000	776	411,280,000	
6448	ブラザー工業	169,000	1,188	200,772,000	
6501	日立製作所	1,571,000	679	1,066,709,000	
6502	東芝	1,715,000	493	845,495,000	
6503	三菱電機	205,000	1,073	219,965,000	
6594	日本電産	60,500	7,150	432,575,000	
6645	オムロン	73,000	3,125	228,125,000	
6758	ソニー	196,500	2,219	436,033,500	
6971	京セラ	38,400	10,910	418,944,000	
6981	村田製作所	54,200	6,950	376,690,000	
7751	キヤノン	250,000	3,380	845,000,000	
7752	リコー	343,000	1,236	423,948,000	
6902	デンソー	173,500	4,965	861,427,500	
7202	いすゞ自動車	569,000	806	458,614,000	
7203	トヨタ自動車	374,000	6,490	2,427,260,000	
7205	日野自動車	140,000	1,719	240,660,000	
7242	カヤバ工業	373,000	540	201,420,000	
7261	マツダ	540,000	446	240,840,000	
7267	本田技研工業	221,500	3,920	868,280,000	
7270	富士重工業	263,000	2,861	752,443,000	
7313	テイ・エス テック	63,200	3,530	223,096,000	
7731	ニコン	76,000	2,298	174,648,000	
7762	シチズンホールディングス	711,000	589	418,779,000	
7832	パンダイナムコホールディングス	116,000	1,693	196,388,000	
7911	凸版印刷	584,000	731	426,904,000	
7951	ヤマハ	149,000	1,322	196,978,000	

9509	北海道電力	155,000	1,491	231,105,000	
9531	東京瓦斯	343,000	567	194,481,000	
9020	東日本旅客鉄道	80,500	8,280	666,540,000	
4307	野村総合研究所	58,200	3,395	197,589,000	
4768	大塚商会	18,000	11,990	215,820,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	58,900	3,470	204,383,000	
9404	日本テレビホールディングス	227,000	1,889	428,803,000	
9433	K D D I	165,600	5,250	869,400,000	
9602	東宝	80,000	2,228	178,240,000	
9984	ソフトバンク	106,300	6,490	689,887,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	55,000	3,815	209,825,000	
8015	豊田通商	153,800	2,955	454,479,000	
8031	三井物産	630,000	1,327	836,010,000	
8053	住友商事	650,000	1,329	863,850,000	
8058	三菱商事	266,000	1,850	492,100,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	129,000	1,367	176,343,000	
2670	エービーシー・マート	48,000	4,515	216,720,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	167,200	3,980	665,456,000	
3391	ツルハホールディングス	20,600	9,730	200,438,000	
7453	良品計画	22,900	8,800	201,520,000	
7532	ドン・キホーテ	39,600	5,490	217,404,000	
8227	しまむら	15,800	12,050	190,390,000	
8282	ケーズホールディングス	61,200	3,450	211,140,000	
9843	ニトリホールディングス	22,200	8,510	188,922,000	
9989	サンドラッグ	48,700	4,405	214,523,500	
8303	新生銀行	840,000	245	205,800,000	
8304	あおぞら銀行	643,000	316	203,188,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,350,000	672	1,579,200,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	228,000	4,875	1,111,500,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	2,965,000	222	658,230,000	
8595	ジャフコ	52,000	4,045	210,340,000	
8604	野村ホールディングス	515,000	814	419,210,000	
8609	岡三証券グループ	237,000	901	213,537,000	
8750	第一生命保険	1,400	152,500	213,500,000	
8766	東京海上ホールディングス	191,000	3,420	653,220,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	73,600	3,190	234,784,000	
8591	オリックス	303,000	1,550	469,650,000	
8801	三井不動産	367,000	3,230	1,185,410,000	
8870	住友不動産販売	34,000	5,840	198,560,000	
8923	トーセイ	240,000	775	186,000,000	
2181	テンブホールディングス	90,000	2,598	233,820,000	
4681	リゾートトラスト	64,000	3,245	207,680,000	
9735	セコム	36,700	5,800	212,860,000	
	合 計	36,552,800		42,723,187,500	

(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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	289,208,580	268,780,337
国債証券	7,978,580,600	7,650,215,000
社債券	3,498,221,400	2,993,539,200
未収入金		425,478,000
未収利息	32,431,708	25,730,007
前払費用	1,779,831	2,344,372
流動資産合計	11,800,222,119	11,366,086,916
資産合計	11,800,222,119	11,366,086,916
負債の部		
流動負債		
未払金		402,752,000
未払解約金	12,377,420	30,571,983
流動負債合計	12,377,420	433,323,983
負債合計	12,377,420	433,323,983
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,106,797,219	8,391,007,169
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,681,047,480	2,541,755,764
元本等合計	11,787,844,699	10,932,762,933
純資産合計	11,787,844,699	10,932,762,933
負債純資産合計	11,800,222,119	11,366,086,916

(注1) 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)

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>
-------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首	平成23年7月23日	平成24年7月24日
期首元本額	9,983,578,052円	9,106,797,219円
期首からの追加設定元本額	1,666,295,968円	1,763,829,732円
期首からの一部解約元本額	2,543,076,801円	2,479,619,782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	616,621,249円	923,110,157円
三菱UFJ 日本債券ファンドF（適格機関投資家限定）	216,334,526円	231,321,551円
三菱UFJ グローバルバランス（積極型）	313,013,429円	335,730,885円
三菱UFJ グローバルバランス（安定型）	816,707,463円	749,504,297円
三菱UFJ グローバルバランスVA	2,378,314,417円	1,780,975,610円
三菱UFJ 日本バランス20	246,346,140円	233,255,569円
三菱UFJ 日本バランス50	142,375,512円	147,963,550円
三菱UFJ 国内バランス20	2,750,483,946円	2,258,335,881円
三菱UFJ 国内バランス50	350,322,926円	339,940,796円
三菱UFJ <DC>日本債券ファンド	963,565,439円	998,340,674円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	110,709,486円	139,453,071円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	120,957,264円	144,741,878円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	81,045,422円	108,333,250円
（合計）	9,106,797,219円	8,391,007,169円
2 受益権の総数	9,106,797,219口	8,391,007,169口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2944円 （12,944円）	1.3029円 （13,029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23年7月23日 至平成24年7月23日）	（自平成24年7月24日 至平成25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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	270,183,500	35,683,900
社債券	14,127,600	862,200
合計	256,055,900	36,546,100

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引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85回利付国債(5年)	700,000,000	704,774,000	
	第93回利付国債(5年)	200,000,000	201,776,000	
	第97回利付国債(5年)	200,000,000	201,446,000	
	第107回利付国債(5年)	300,000,000	299,607,000	
	第5回利付国債(40年)	50,000,000	51,228,500	
	第285回利付国債(10年)	100,000,000	105,518,000	
	第294回利付国債(10年)	400,000,000	427,904,000	
	第299回利付国債(10年)	200,000,000	211,120,000	
	第301回利付国債(10年)	100,000,000	106,809,000	
	第303回利付国債(10年)	200,000,000	212,532,000	
	第305回利付国債(10年)	100,000,000	105,656,000	
	第306回利付国債(10年)	200,000,000	212,550,000	
	第309回利付国債(10年)	200,000,000	208,428,000	
	第310回利付国債(10年)	100,000,000	103,277,000	
	第312回利付国債(10年)	100,000,000	104,478,000	
	第313回利付国債(10年)	200,000,000	210,168,000	
	第315回利付国債(10年)	200,000,000	208,586,000	
	第318回利付国債(10年)	10,000,000	10,267,200	
	第319回利付国債(10年)	200,000,000	206,762,000	
	第321回利付国債(10年)	200,000,000	204,978,000	
	第323回利付国債(10年)	200,000,000	203,012,000	
	第325回利付国債(10年)	120,000,000	120,565,200	
	第326回利付国債(10年)	250,000,000	248,572,500	
	第11回利付国債(30年)	60,000,000	60,000,000	
	第15回利付国債(30年)	50,000,000	56,827,000	
	第20回利付国債(30年)	100,000,000	113,792,000	
	第23回利付国債(30年)	40,000,000	45,538,400	
	第26回利付国債(30年)	100,000,000	111,998,000	
	第27回利付国債(30年)	100,000,000	114,091,000	
	第28回利付国債(30年)	50,000,000	57,147,500	
	第30回利付国債(30年)	50,000,000	55,211,000	
	第32回利付国債(30年)	50,000,000	55,249,500	
	第34回利付国債(30年)	120,000,000	129,942,000	
	第36回利付国債(30年)	50,000,000	51,939,500	
	第59回利付国債(20年)	70,000,000	75,977,300	
	第66回利付国債(20年)	20,000,000	21,953,200	
	第70回利付国債(20年)	100,000,000	116,050,000	
	第76回利付国債(20年)	50,000,000	55,391,000	
	第80回利付国債(20年)	100,000,000	112,966,000	
	第84回利付国債(20年)	50,000,000	55,827,000	
	第88回利付国債(20年)	100,000,000	115,058,000	
	第90回利付国債(20年)	100,000,000	113,756,000	
	第94回利付国債(20年)	50,000,000	56,135,500	
	第99回利付国債(20年)	100,000,000	111,742,000	
	第100回利付国債(20年)	10,000,000	11,295,500	
	第104回利付国債(20年)	100,000,000	111,450,000	
	第108回利付国債(20年)	100,000,000	108,188,000	
	第111回利付国債(20年)	200,000,000	223,726,000	
	第114回利付国債(20年)	100,000,000	109,853,000	
	第116回利付国債(20年)	20,000,000	22,205,800	
	第118回利付国債(20年)	130,000,000	139,993,100	
	第123回利付国債(20年)	100,000,000	108,657,000	
	第128回利付国債(20年)	140,000,000	146,970,600	

	第132回利付国債(20年)	110,000,000	111,404,700	
	第136回利付国債(20年)	100,000,000	99,357,000	
	第140回利付国債(20年)	100,000,000	100,508,000	
	国債証券 小計	7,250,000,000	7,650,215,000	
社債券	第12回GEキャピタルコーポレーション	100,000,000	101,903,000	
	第10回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	99,865,000	
	第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション	200,000,000	202,640,000	
	第3回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,944,000	
	第11回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,209,000	
	第16回電気化学工業	100,000,000	100,828,000	
	第51回日産自動車	100,000,000	100,910,000	
	第16回 ニコン	100,000,000	100,911,000	
	第75回丸紅	100,000,000	101,296,000	
	第62回アコム	100,000,000	100,699,000	
	第63回アコム	100,000,000	100,487,000	
	第38回日立キャピタル	100,000,000	100,936,000	
	第40回日立キャピタル	100,000,000	100,821,000	
	第140回オリックス	160,000,000	161,587,200	
	第159回オリックス	100,000,000	100,800,000	
	第163回オリックス	100,000,000	100,998,000	
	第167回オリックス	100,000,000	99,822,000	
	第16回三菱UFJリース	100,000,000	100,169,000	
	第20回三菱UFJリース	100,000,000	100,082,000	
	第17回野村ホールディングス	100,000,000	101,269,000	
	第29回野村ホールディングス	100,000,000	100,813,000	
	第39回野村ホールディングス	200,000,000	201,520,000	
	第70回住友不動産	200,000,000	203,140,000	
	第72回住友不動産	100,000,000	101,310,000	
	第383回東北電力	100,000,000	109,071,000	
	第469回東北電力	100,000,000	100,509,000	
	社債券 小計	2,960,000,000	2,993,539,200	
	合計	10,210,000,000	10,643,754,200	

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24年7月23日現在]	[平成25年7月22日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,517,183	
コール・ローン	82,052,583	68,069,990
株式	8,094,118,486	5,068,798,557
派生商品評価勘定	623,458	6,812
未収入金	205,698,340	90,159,156
未収配当金	16,834,439	11,236,863
未収利息	187	119
流動資産合計	8,401,844,676	5,238,271,497
資産合計	8,401,844,676	5,238,271,497
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,458
未払金	166,080,767	11,634,830
未払解約金	5,169,907	29,910,285
流動負債合計	171,250,674	41,547,573
負債合計	171,250,674	41,547,573
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,822,601,874	3,123,539,298
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	407,992,128	2,073,184,626
元本等合計	8,230,594,002	5,196,723,924
純資産合計	8,230,594,002	5,196,723,924
負債純資産合計	8,401,844,676	5,238,271,497

(注1) 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)

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最終相場（外貨建証券の場合は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>
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対顧客先物相場の仲値で評価しております。</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>



## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首	平成23年7月23日	平成24年7月24日
期首元本額	10,061,826,738円	7,822,601,874円
期首からの追加設定元本額	5,267,640,302円	1,352,706,020円
期首からの一部解約元本額	7,506,865,166円	6,051,768,596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	379,928,526円	376,610,921円
三菱UFJ / ブラックロック 海外株式オープン (FOF用) (適格機関投資家限定)	4,365,390,196円	
三菱UFJ グローバルバランス (積極型)	237,764,647円	191,805,412円
三菱UFJ グローバルバランス (安定型)	239,114,347円	160,180,059円
三菱UFJ グローバルバランスVA	691,695,626円	377,971,542円
三菱UFJ <DC> 海外株式オープン	1,802,618,697円	1,915,468,920円
三菱UFJ <DC> グローバルバランス 20型	9,441,855円	9,647,973円
三菱UFJ <DC> グローバルバランス 40型	35,772,087円	31,482,832円
三菱UFJ <DC> グローバルバランス 60型	60,875,893円	60,371,639円
(合計)	7,822,601,874円	3,123,539,298円
2 受益権の総数	7,822,601,874口	3,123,539,298口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0522円 (10,522円)	1.6637円 (16,637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23年7月23日 至平成24年7月23日)	(自平成24年7月24日 至平成25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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(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。	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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	400,257,661	553,106,828
合計	400,257,661	553,106,828

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	[平成24年7月23日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 イギリスポンド	63,592,722		62,969,264	623,458
	合計	63,592,722		62,969,264	623,458

区分	種類	[平成25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		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル ユーロ	7,574,255 2,484,964		7,567,443 2,487,422	6,812 2,458
	合計	10,059,219		10,054,865	4,354

(注)時価の算定方法

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

(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					
	AMETEK INC	8,836	45.810000	404,777.16	
	AUTOZONE INC	3,362	435.970000	1,465,731.14	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	8,912	118.900000	1,059,636.80	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	20,017	65.760000	1,316,317.92	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,547	69.140000	1,005,779.58	
	CERNER CORP	7,502	49.790000	373,524.58	
	CHEVRON CORP	2,107	126.910000	267,399.37	
	CITIGROUP INC	16,255	52.350000	850,949.25	
	COACH INC	19,445	59.310000	1,153,282.95	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,991	72.360000	288,788.76	
	COMCAST CORP-CLASS A	5,866	44.580000	261,506.28	
	CUMMINS INC	2,308	118.140000	272,667.12	
	DANAHER CORP	22,643	68.690000	1,555,347.67	
	DIRECTV	25,448	65.200000	1,659,209.60	
	ECOLAB INC	9,863	93.400000	921,204.20	
	ELLIE MAE INC	10,546	25.190000	265,653.74	
	INTUIT INC	8,996	64.080000	576,463.68	
	JPMORGAN CHASE & CO	18,335	56.160000	1,029,693.60	
	KRAFT FOODS GROUP INC	13,806	57.660000	796,053.96	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,536	27.600000	207,993.60	
	MERCADOLIBRE INC	5,168	105.720000	546,360.96	
	MERCK & CO. INC.	16,984	47.790000	811,665.36	
	MICROSOFT CORP	27,403	31.395000	860,317.18	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	18,597	74.050000	1,377,107.85	
	NEWELL RUBBERMAID INC	48,423	27.150000	1,314,684.45	
	PFIZER INC	55,419	29.090000	1,612,138.71	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	8,089	88.610000	716,766.29	

PRAXAIR INC	7,856	117.140000	920,251.84	
PROGRESSIVE CORP	22,036	26.300000	579,546.80	
QUALCOMM INC	11,183	61.480000	687,530.84	
SCHLUMBERGER LTD	17,433	82.740000	1,442,406.42	
TEXAS INSTRUMENTS INC	14,480	37.270000	539,669.60	
TEXTRON INC	19,070	28.540000	544,257.80	
TIME WARNER INC	26,079	61.770000	1,610,899.83	
US BANCORP	28,955	37.260000	1,078,863.30	
VEECO INSTRUMENTS INC	10,542	34.930000	368,232.06	
WW GRAINGER INC	3,553	262.520000	932,733.56	
アメリカドル 小計	571,591		31,675,413.81 (3,166,907,872)	
イギリスポンド				
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	18,482	34.705000	641,417.81	
HSBC HOLDINGS PLC	28,406	7.375000	209,494.25	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	50,399	21.800000	1,098,698.20	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	7,682	22.305000	171,347.01	
STANDARD CHARTERED PLC	52,345	15.255000	798,522.97	
VODAFONE GROUP PLC	633,291	1.938500	1,227,634.60	
イギリスポンド 小計	790,605		4,147,114.84 (634,218,272)	
スイスフラン				
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	13,394	88.250000	1,182,020.50	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,057	27.930000	839,492.01	
NESTLE SA-REG	3,508	63.100000	221,354.80	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,319	234.600000	778,637.40	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,088	528.000000	574,464.00	
スイスフラン 小計	51,366		3,595,968.71 (383,042,586)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	79,000	34.550000	2,729,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	34,000	80.600000	2,740,400.00	
SANDS CHINA LTD	136,400	40.400000	5,510,560.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	377,000	10.160000	3,830,320.00	
香港ドル 小計	626,400		14,810,730.00 (190,910,309)	
シンガポールドル				
DBS GROUP HOLDINGS LTD	60,000	16.560000	993,600.00	
シンガポールドル 小計	60,000		993,600.00 (78,703,056)	
スウェーデンクローネ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	32,208	167.200000	5,385,177.60	
スウェーデンクローネ 小計	32,208		5,385,177.60 (82,447,069)	
ユーロ				
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	25,094	68.150000	1,710,156.10	
ASML HOLDING NV	6,594	67.680000	446,281.92	
ENI SPA	37,631	16.640000	626,179.84	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	28,073	7.050000	197,914.65	
LINDE AG	1,123	147.000000	165,081.00	
SANOFI	11,332	79.560000	901,573.92	
ユーロ 小計	109,847		4,047,187.43 (532,569,393)	
合計	2,242,017		5,068,798,557 (5,068,798,557)	

(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 37銘柄	100.00%	62.48%
イギリスポンド	株式 6銘柄	100.00%	12.51%
スイスフラン	株式 5銘柄	100.00%	7.56%
香港ドル	株式 4銘柄	100.00%	3.77%

シンガポールドル	株式	1銘柄	100.00%	1.55%
スウェーデンクローネ	株式	1銘柄	100.00%	1.63%
ユーロ	株式	6銘柄	100.00%	10.51%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)   [次へ](#)

「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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,002,338,868	1,311,784,406
コール・ローン	157,546,521	74,050,478
国債証券	93,561,567,288	102,454,575,910
派生商品評価勘定	15,055,593	27,671,275
未収入金	6,750,346,427	4,345,631,829
未収利息	736,942,102	812,690,137
前払費用	284,043,455	289,199,936
流動資産合計	102,507,840,254	109,315,603,971
資産合計	102,507,840,254	109,315,603,971
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,228,092	33,003,850
未払金	6,026,383,978	4,164,544,459
未払解約金	181,846,474	24,559,560
流動負債合計	6,222,458,544	4,222,107,869
負債合計	6,222,458,544	4,222,107,869
純資産の部		
元本等		
元本	1 54,187,326,183	44,486,104,067
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	42,098,055,527	60,607,392,035
元本等合計	96,285,381,710	105,093,496,102
純資産合計	96,285,381,710	105,093,496,102
負債純資産合計	102,507,840,254	109,315,603,971

(注1) 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)

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最終相場（外貨建証券の場合は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られ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られた価額で評価しております。</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対顧客先物相場の仲値で評価しております。</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>

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首	平成23年7月23日	平成24年7月24日
期首元本額	66,822,242,955円	54,187,326,183円
期首からの追加設定元本額	2,566,537,259円	794,123,599円
期首からの一部解約元本額	15,201,454,031円	10,495,345,715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）	19,243,700,517円	15,536,054,949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	221,593,330円	258,467,683円
三菱UFJ ライフプラン 25	28,906,614円	26,880,845円
三菱UFJ ライフプラン 50	50,448,134円	50,173,646円
三菱UFJ ライフプラン 75	16,922,986円	17,952,581円
三菱UFJ 海外債券オープン	3,152,703,470円	3,218,418,987円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式20型	154,005,345円	91,568,581円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式40型	51,013,373円	41,340,327円
三菱UFJ 海外債券オープン（3ヵ月決算型）	7,632,586,960円	5,966,719,878円
三菱UFJ ライフプラン 50VA（適格機関投資家限定）	382,128,041円	301,136,182円
三菱UFJ 海外債券オープンVA（適格機関投資家限定）	538,754,591円	455,219,906円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA（適格機関投資家限定）	20,283,314,049円	16,299,671,113円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限定）	2,431,248,773円	2,222,499,389円
（合計）	54,187,326,183円	44,486,104,067円
2 受益権の総数	54,187,326,183口	44,486,104,067口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7769円 （17,769円）	2.3624円 （23,624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23年7月23日 至平成24年7月23日）	（自平成24年7月24日 至平成25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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(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。	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24年7月23日現在]	[平成25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	1,822,742,020	1,856,366,454
合計	1,822,742,020	1,856,366,454

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)  
 取引の時価等に関する事項  
 通貨関連

区 分	種 類	[平成24年7月23日現在]		
		契 約 額 等(円)	時 価	評 価 損 益
		うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建			
	アメリカドル	1,998,240,122	1,997,985,245	254,877
	ユーロ	2,196,550,182	2,193,675,662	2,874,520
	買建			
	オーストラリアドル	1,998,240,122	1,984,012,030	14,228,092
	マレーシアリングット	1,997,050,222	2,008,976,418	11,926,196
	合 計	8,190,080,648	8,184,649,355	827,501

区 分	種 類	[平成25年7月22日現在]		
		契 約 額 等(円)	時 価	評 価 損 益
		うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建			
	アメリカドル	3,999,686,433	3,978,286,808	21,399,625
	イギリスポンド	608,632,000	611,680,000	3,048,000
	買建			
	メキシコペソ	2,349,955,850	2,320,000,000	29,955,850
	ユーロ	2,164,963,350	2,171,235,000	6,271,650
	合 計	9,123,237,633	9,081,201,808	5,332,575

(注) 時価の算定方法

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

(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	0.125 T-NOTE 150430	35,000,000.00	34,908,398.42	
	0.25 T-NOTE 150131	40,000,000.00	40,021,875.00	
	0.375 T-NOTE 130731	10,000,000.00	10,001,171.87	
	0.75 T-NOTE 140615	50,000,000.00	50,275,390.60	
	1.75 T-NOTE 220515	20,000,000.00	19,093,750.00	
	2.5 T-NOTE 150430	48,000,000.00	49,888,124.97	
	2.75 T-BOND 420815	3,000,000.00	2,555,156.25	
	2.875 T-BOND 430515	4,000,000.00	3,490,625.00	
	3.125 T-BOND 430215	17,000,000.00	15,657,265.62	
	3.125 T-NOTE 170131	20,000,000.00	21,618,750.00	
	3.125 T-NOTE 190515	20,000,000.00	21,765,625.00	
	3.625 T-NOTE 190815	5,000,000.00	5,579,492.18	
	3.875 T-BOND 400815	9,000,000.00	9,608,906.25	
	3.875 T-NOTE 180515	20,000,000.00	22,468,750.00	
	4.25 T-NOTE 131115	30,000,000.00	30,397,265.61	
	4.5 T-BOND 360215	7,000,000.00	8,251,250.00	
	4.75 T-BOND 410215	17,000,000.00	20,864,843.75	
	4.75 T-NOTE 170815	20,000,000.00	22,989,062.50	
	5.375 T-BOND 310215	4,000,000.00	5,176,250.00	
	6 T-BOND 260215	5,000,000.00	6,691,796.87	
6.25 T-BOND 230815	10,000,000.00	13,394,531.25		
8.125 T-BOND 210815	10,000,000.00	14,507,031.25		
8.75 T-BOND 200515	8,000,000.00	11,597,500.00		
国債証券 小計		412,000,000.00	440,802,812.39 (44,071,465,182)	
アメリカドル 小計		412,000,000.00	440,802,812.39 (44,071,465,182)	
カナダドル				
国債証券	2 CAN GOVT 160601	17,500,000.00	17,876,425.00	
	3.5 CAN GOVT 200601	3,500,000.00	3,829,140.00	
	4 CAN GOVT 410601	4,600,000.00	5,566,460.00	
国債証券 小計		25,600,000.00	27,272,025.00 (2,632,841,293)	
カナダドル 小計		25,600,000.00	27,272,025.00 (2,632,841,293)	
オーストラリアドル				
国債証券	4.75 AUST GOVT 270421	100,000.00	107,804.00	
	5.25 AUST GOVT 190315	100,000.00	110,665.00	
国債証券 小計		200,000.00	218,469.00 (20,129,733)	
オーストラリアドル 小計		200,000.00	218,469.00 (20,129,733)	
イギリスポンド				
国債証券	4.25 GILT 551207	1,900,000.00	2,218,630.00	
	4.75 GILT 150907	1,300,000.00	1,421,745.00	
	4.75 GILT 200307	4,000,000.00	4,786,000.00	
	6 GILT 281207	2,000,000.00	2,769,800.00	
国債証券 小計		9,200,000.00	11,196,175.00 (1,712,231,042)	
イギリスポンド 小計		9,200,000.00	11,196,175.00 (1,712,231,042)	
シンガポールドル				
国債証券	2.5 SINGAPORGOVT 190601	800,000.00	849,600.00	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	1,800,000.00	1,958,400.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	900,000.00	956,250.00	
	3.625 SINGAPORGOVT 140701	500,000.00	516,300.00	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	1,000,000.00	1,109,300.00	
国債証券 小計		5,000,000.00	5,389,850.00 (426,930,018)	
シンガポールドル 小計		5,000,000.00	5,389,850.00 (426,930,018)	
マレーシアリングット				

国債証券	3.502MALAYSIAGOV 270531	3,400,000.00	3,215,108.00	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	6,000,000.00	6,045,720.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	5,000,000.00	5,162,300.00	
	5.094MALAYSIAGOV 140430	3,000,000.00	3,044,880.00	
国債証券 小計		17,400,000.00	17,468,008.00 (549,368,851)	
マレーシアリングギット 小計		17,400,000.00	17,468,008.00 (549,368,851)	
スウェーデンクローネ				
国債証券	3 SWD GOVT 160712	15,000,000.00	15,801,600.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	6,000,000.00	6,740,220.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	7,000,000.00	7,668,710.00	
	5 SWD GOVT 201201	7,000,000.00	8,534,540.00	
国債証券 小計		35,000,000.00	38,745,070.00 (593,187,021)	
スウェーデンクローネ 小計		35,000,000.00	38,745,070.00 (593,187,021)	
ノルウェークローネ				
国債証券	3.75 NORWE GOVT 210525	3,500,000.00	3,846,850.00	
	4.25 NORWE GOVT 170519	4,000,000.00	4,371,600.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	5,000,000.00	5,667,000.00	
	5 NORWE GOVT 150515	3,000,000.00	3,189,600.00	
国債証券 小計		15,500,000.00	17,075,050.00 (286,348,588)	
ノルウェークローネ 小計		15,500,000.00	17,075,050.00 (286,348,588)	
メキシコペソ				
国債証券	6.25 MEXICAN BONO 160616	80,000,000.00	83,945,600.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	210,000,000.00	220,901,100.00	
	7 MEXICAN BONOS 140619	55,000,000.00	56,463,550.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	80,000,000.00	96,014,400.00	
国債証券 小計		425,000,000.00	457,324,650.00 (3,663,170,446)	
メキシコペソ 小計		425,000,000.00	457,324,650.00 (3,663,170,446)	
ポーランドズロチ				
国債証券	5 POLAND 131024	1,000,000.00	1,005,850.00	
	5.25 POLAND 171025	7,000,000.00	7,567,350.00	
	5.25 POLAND 201025	2,000,000.00	2,206,100.00	
	5.75 POLAND 220923	9,000,000.00	10,278,000.00	
	6.25 POLAND 151024	8,000,000.00	8,576,400.00	
国債証券 小計		27,000,000.00	29,633,700.00 (921,015,396)	
ポーランドズロチ 小計		27,000,000.00	29,633,700.00 (921,015,396)	
南アフリカランド				
国債証券	6.25 SOUTH AFRICA 360331	25,000,000.00	19,086,500.00	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	22,000,000.00	22,075,900.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	16,000,000.00	16,884,160.00	
国債証券 小計		63,000,000.00	58,046,560.00 (591,494,446)	
南アフリカランド 小計		63,000,000.00	58,046,560.00 (591,494,446)	
ユーロ				
国債証券	2.5 BUND 210104	17,000,000.00	18,819,850.00	
	3.25 BUND 420704	10,000,000.00	11,870,500.00	
	3.25 NETH GOVT 210715	2,000,000.00	2,254,300.00	
	3.25 O.A.T 160425	10,000,000.00	10,778,000.00	
	3.5 BUND 190704	16,000,000.00	18,598,400.00	
	3.5 O.A.T 260425	3,000,000.00	3,282,600.00	
	3.75 BEL GOVT 200928	14,000,000.00	15,816,500.00	
	3.75 O.A.T 170425	6,000,000.00	6,683,700.00	
	4 O.A.T 180425	25,000,000.00	28,590,000.00	
	4.25 BUND 170704	34,000,000.00	39,256,400.00	
	4.25 ITALY GOVT 200301	26,000,000.00	26,807,300.00	
	4.25 O.A.T 190425	15,000,000.00	17,575,500.00	
	4.25 SPAIN GOVT 161031	14,000,000.00	14,597,100.00	
	4.3 SPAIN GOVT 191031	12,000,000.00	12,265,200.00	
	4.5 BEL GOVT 260328	2,000,000.00	2,347,200.00	

4.5 ITALY GOVT 180801	35,000,000.00	37,026,500.00	
4.5 NETH GOVT 170715	1,000,000.00	1,151,600.00	
4.5 O.A.T 410425	11,000,000.00	13,461,250.00	
4.5 SPAIN GOVT 180131	13,000,000.00	13,601,250.00	
4.75 ITALY GOVT 170501	10,000,000.00	10,647,500.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	5,000,000.00	4,759,000.00	
5 BEL GOVT 350328	1,000,000.00	1,254,600.00	
5 ITALY GOVT 400901	12,000,000.00	11,937,600.00	
5.5 ITALY GOVT 220901	12,000,000.00	13,041,600.00	
5.5 ITALY GOVT 221101	10,000,000.00	10,852,000.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	2,000,000.00	2,161,700.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	3,000,000.00	3,268,950.00	
6.25 BUND 240104	3,000,000.00	4,360,500.00	
国債証券 小計	324,000,000.00	357,066,600.00 (46,986,393,894)	
ユーロ 小計	324,000,000.00	357,066,600.00 (46,986,393,894)	
合 計		102,454,575,910 (102,454,575,910)	

(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 23銘柄	100.00%	43.02%
カナダドル	国債証券 3銘柄	100.00%	2.57%
オーストラリアドル	国債証券 2銘柄	100.00%	0.02%
イギリスポンド	国債証券 4銘柄	100.00%	1.67%
シンガポールドル	国債証券 5銘柄	100.00%	0.42%
マレーシアリングgit	国債証券 4銘柄	100.00%	0.54%
スウェーデンクローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.58%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.28%
メキシコペソ	国債証券 4銘柄	100.00%	3.58%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.00%	0.90%
南アフリカランド	国債証券 3銘柄	100.00%	0.58%
ユーロ	国債証券 28銘柄	100.00%	45.86%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	374,429,223	708,246,477
国債証券	2,949,685,550	3,099,662,600
未収利息	855	1,248
流動資産合計	3,324,115,628	3,807,910,325
資産合計	3,324,115,628	3,807,910,325
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,158,947	22,861,060
流動負債合計	25,158,947	22,861,060
負債合計	25,158,947	22,861,060
純資産の部		
元本等		
元本	3,245,085,349	3,719,968,150
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	53,871,332	65,081,115
元本等合計	3,298,956,681	3,785,049,265
純資産合計	3,298,956,681	3,785,049,265
負債純資産合計	3,324,115,628	3,807,910,325

(注1) 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)

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>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成23年7月23日 1,499,963,627円	平成24年7月24日 3,245,085,349円
期首からの追加設定元本額	8,223,306,623円	6,168,431,131円
期首からの一部解約元本額	6,478,184,901円	5,693,548,330円
元本の内訳*		
三菱UFJ DC金利運動アロケーション型バランスファンド	139,790,721円	179,602,337円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)ファンド・マネジャー(新興国株式)	24,866,713円	24,866,713円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	32,418円	
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	308,759円	
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)	38,059,510円	38,059,510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)	997,724円	2,727,794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)	170,286円	170,286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)	126,013,765円	126,013,765円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	584,396,001円	584,396,001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)	724,288円	724,288円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	1,480,020円	31,749,196円

三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	1,844,268,853円	1,440,650,304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)	197,649円	197,649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)	2,712,786円	2,712,786円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	11,510,067円	2,132,879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)	641,165円	424,906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)	1,843,150円	1,086,244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)	2,571,019円	2,571,019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)	1,694,849円	1,114,882円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	5,757,273円	13,570,826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)	1,784,527円	1,057,111円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	68,417,834円	68,417,834円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	1,081,386円	3,558,532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)	55,440,512円	55,440,512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)	2,363,393円	1,518,017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)	929,681円	358,088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)	6,098,505円	2,100,667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)	12,197,893円	3,836,590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)	5,416,358円	1,787,931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<マネーボールファンド>	3,439,178円	18,579,146円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	19,365,265円	125,756,119円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	501,843円	15,756,663円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	7,122,869円	6,320,690円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	10,133,370円	68,076,479円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 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)	560,929円	1,170,386円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>(毎月分配型)	1,613,828円	3,628,967円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	8,393,693円	294,770,035円
三菱UFJ 欧州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)	2,221,253円	2,221,253円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)	42,187円	422,811円
三菱UFJ 欧州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)	31,180円	239,996円
三菱UFJ 欧州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)	35,726円	1,509,575円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 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)	67,305円	67,305円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	981,916円	2,422,196円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<円コース>	19,109,690円	609,253円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<米ドルコース>	1,879,348円	30,312円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<豪ドルコース>	7,812,992円	141,405円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)	1,479,827円	531,213円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	984円	3,765円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	984円	4,476円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	984円	50,185円

新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	984円	99,292円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり> (毎月決算型)		491,836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)		98,368円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド 2012-11(円ヘッジ)(限定追加型)		10,816,126円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコ ペソコース>(毎月分配型)		42,446,077円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回 分配型)		128,774円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(年 2回分配型)		227,039円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドル コース>(年2回分配型)		40,301円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジル レアルコース>(年2回分配型)		10,814円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコ ペソコース>(年2回分配型)		2,438,810円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリ ーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)		10,938,381円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリ ーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)		1,965,408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<米ドルコース>(毎月分配型)		19,658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<メキシコペソコース>(毎月分配型)		19,658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<トルコリラコース>(毎月分配型)		19,658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)		491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)		9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨 分散コース>(毎月分配型)		218,892円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨 分散コース>(年2回分配型)		14,547円
Navio インド債券ファンド	885,566円	885,566円
Navio マネーボールファンド	1,046,327円	1,198,518円
三菱UFJ インド債券オープン(毎月決算型)	39,351円	39,351円
マネーボールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限 定)	112,082円	116,474円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデッ クスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	193,367,390円	170,318,470円
MUAMトピックスリスクコントロール(10%)インデッ クスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)		263,188,153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)	16,982,851円	16,982,851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)	6,088,342円	53,765,806円
(合計)	3,245,085,349円	3,719,968,150円
2 受益権の総数	3,245,085,349口	3,719,968,150口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0166円 (10,166円)	1.0175円 (10,175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23年7月23日 至平成24年7月23日)	(自平成24年7月24日 至平成25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24年7月23日現在 ]	[ 平成25年7月22日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	(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ぬ。 (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24年7月23日現在 ]	[ 平成25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	9,958	5,711
合計	9,958	5,711

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引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ぬ。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありませぬ。

## (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ぬ。

(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362回国庫短期証券	200,000,000	199,996,800	
	第363回国庫短期証券	100,000,000	99,996,800	
	第365回国庫短期証券	100,000,000	99,995,000	
	第367回国庫短期証券	200,000,000	199,987,000	
	第369回国庫短期証券	300,000,000	299,975,400	
	第370回国庫短期証券	700,000,000	699,930,700	
	第372回国庫短期証券	400,000,000	399,953,600	
	第374回国庫短期証券	500,000,000	499,932,000	
	第376回国庫短期証券	100,000,000	99,983,800	
	第377回国庫短期証券	500,000,000	499,911,500	
	国債証券 小計	3,100,000,000	3,099,662,600	
	合計	3,100,000,000	3,099,662,600	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありませぬ。

## 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ぬ。

[前へ](#)



2【ファンドの現況】  
【純資産額計算書】

平成25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	3,245,080,061
負債総額	1,458,781
純資産総額( - )	3,243,621,280
発行済口数	3,050,851,675 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0632 ( 1万口当たり 10,632 )

<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25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	40,611,288,819
負債総額	317,786,685
純資産総額( - )	40,293,502,134
発行済口数	33,135,021,172 口
1口当たり純資産価額( / )	1.2160 ( 1万口当たり 12,160 )

<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25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	10,902,754,959
負債総額	94,684,533
純資産総額( - )	10,808,070,426
発行済口数	8,294,813,119 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3030 ( 1万口当たり 13,030 )

<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25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	5,144,463,531
負債総額	93,836,812
純資産総額( - )	5,050,626,719
発行済口数	3,110,025,241 口
1口当たり純資産価額( / )	1.6240 ( 1万口当たり 16,240 )

<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25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	103,244,926,780
負債総額	806,118,207
純資産総額( - )	102,438,808,573
発行済口数	44,228,593,505 口
1口当たり純資産価額( / )	2.3161 ( 1万口当たり 23,161 )

<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25年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	3,604,590,092
負債総額	20,365,124
純資産総額( - )	3,584,224,968
発行済口数	3,522,521,877 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0175 ( 1万口当たり 10,175 )

## 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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### （5）受益権の譲渡の対抗要件

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

### （6）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25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運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに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25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25年7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	419	6,274,655
追加型公社債投資信託	18	707,760
単位型株式投資信託	8	150,782
単位型公社債投資信託	3	81,557
合計	448	7,214,754

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。

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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25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27期 (平成24年3月31日現在)		第28期 (平成25年3月31日現在)	
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	14,298,590	2	22,261,065
有価証券	2	8,000,000	2	8,000,000
前払費用		154,925		159,117
未収入金		13,813		5,504
未収委託者報酬		3,977,324		4,489,181
未収収益	2	42,563	2	47,936
繰延税金資産		339,052		402,791
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		27,621		39,167
流動資産合計		26,883,891		35,434,764
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	281,399	1	270,058
器具備品	1	177,757	1	171,754
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,664,188		1,646,844
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		881,368		857,424
ソフトウェア仮勘定		402,721		430,432
その他		24		
無形固定資産合計		1,299,937		1,303,679
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		14,456,313		15,689,317
関係会社株式		320,136		320,136
長期性預金	2	8,500,000	2	3,500,000
長期差入保証金	2	837,456	2	825,804
繰延税金資産		139,650		
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		24,268,591		20,350,294
固定資産合計		27,232,718		23,300,818
資産合計		54,116,609		58,735,583

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	79,079	75,221
未払金		
未払収益分配金	185,817	33,936
未払償還金	1,159,445	1,004,879
未払手数料	2 1,557,726	2 1,761,746
その他未払金	50,899	84,763
未払費用	2 1,174,572	2 1,333,574
未払消費税等	63,602	128,077
未払法人税等	1,532,874	1,686,070
賞与引当金	520,000	594,000
その他	278,521	348,389
流動負債合計	6,602,539	7,050,661
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	119,902	119,776
役員退職慰労引当金	49,735	65,103
時効後支払損引当金	195,228	201,877
繰延税金負債		251,776
固定負債合計	364,866	638,533
負債合計	6,967,405	7,689,194
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
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	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計	44,203,921	47,026,806
株主資本合計	46,426,148	49,249,033
評価・換算差額等		
その他有価証券	723,054	1,797,355
評価差額金		
評価・換算差額等合計	723,054	1,797,355
純資産合計	47,149,203	51,046,388
負債純資産合計	54,116,609	58,735,583

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		47,476,170		48,411,166
投資顧問料		15,335		13,601
その他営業収益		153,305		138,788
営業収益合計		47,644,812		48,563,556
営業費用				
支払手数料	2	19,292,904	2	19,724,426
広告宣伝費		516,886		543,508
公告費		7,961		1,748
調査費				
調査費		909,999		942,478
委託調査費		9,975,300		10,699,987
事務委託費		306,137		242,537
営業雑経費				
通信費		90,066		89,308
印刷費		400,552		443,177
協会費		40,636		39,963
諸会費		7,593		7,621
事務機器関連費		958,507		971,457
その他営業雑経費		16,396		8,989
営業費用合計		32,522,943		33,715,204
一般管理費				
給料				
役員報酬		202,812		198,915
給料・手当		3,623,556		3,740,875
賞与引当金繰入		520,000		594,000
福利厚生費		520,897		593,073
交際費		26,743		23,259
旅費交通費		153,892		139,968
租税公課		102,255		115,450
不動産賃借料		698,539		699,860
退職給付費用		142,883		162,650
役員退職慰労引当金繰入		22,805		19,007
固定資産減価償却費		481,601		442,844
諸経費		247,162		270,874
一般管理費合計		6,743,148		7,000,782
営業利益		8,378,719		7,847,569



(単位：千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		153,215		213,088
有価証券利息	2	8,160	2	6,698
受取利息	2	25,661	2	25,684
投資有価証券償還益		1,876		6,072
収益分配金等時効完成分		318,285		412,323
その他		7,856		1,935
営業外収益合計		515,056		665,802
営業外費用				
投資有価証券償還損				8,689
時効後支払損引当金繰入		15,288		16,881
事務過誤費		7,845		186
その他		82		45
営業外費用合計		23,216		25,802
経常利益		8,870,559		8,487,569
特別利益				
投資有価証券売却益		150,103		334,775
特別利益合計		150,103		334,775
特別損失				
投資有価証券売却損		153,276		32,155
関係会社株式売却損		13,563		
投資有価証券評価損		1,925		
固定資産除却損	1	17,034	1	253
その他		412		
特別損失合計		186,212		32,409
税引前当期純利益		8,834,449		8,789,934
法人税、住民税及び事業税		3,510,046		3,441,310
法人税等調整額		175,067		55,499
法人税等合計		3,685,113		3,385,811
当期純利益		5,149,336		5,404,123

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	34,903,313	36,863,331
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計		
当期首残高	42,243,903	44,203,921
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	44,203,921	47,026,806
株主資本合計		
当期首残高	44,466,131	46,426,148
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	46,426,148	49,249,032
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	391,537	723,054

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
評価・換算差額等合計		
当期首残高	391,537	723,054
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
純資産合計		
当期首残高	44,857,668	47,149,203
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	2,291,534	3,897,185
当期末残高	47,149,203	51,046,388

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 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。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 4. 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。

## (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。

## (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。

## (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。

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## （会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## (未適用の会計基準等)

- ・「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日)
- ・「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日)

## (1)概要

本会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、退職給付債務の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものです。

## (2)適用予定日

平成26年3月期の期末より適用予定です。ただし、退職給付債務の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首より適用予定です。

## (3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中です。

## (貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
建物	208,976千円	233,990千円
器具備品	294,294千円	351,481千円

## 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
預金	11,773,728千円	19,410,015千円
有価証券	8,000,000千円	8,000,000千円
未収収益	42,563千円	40,120千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	8,500,000千円	3,500,000千円
長期差入保証金	828,908千円	816,823千円
未払手数料	851,491千円	927,107千円
未払費用	135,926千円	148,712千円

## (損益計算書関係)

## 1.固定資産除却損の内訳

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
器具備品	1,144千円	253千円
ソフトウェア	15,890千円	-
計	17,034千円	253千円

## 2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
支払手数料	10,760,427千円	10,230,968千円
有価証券利息	6,532千円	5,170千円
受取利息	25,661千円	25,684千円

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

(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24年6月26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	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	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24年6月26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	2,581,238千円
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27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25年6月24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	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(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

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

### 第27期(平成24年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

### 第28期(平成25年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	22,261,065	22,261,065	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,489,181	4,489,181	-
(4) 長期性預金	3,500,000	3,505,795	5,795
(5) 投資有価証券	15,650,417	15,650,417	-
資産計	53,900,663	53,906,459	5,795
(1) 未払手数料	1,761,746	1,761,746	-
(2) 未払法人税等	1,686,070	1,686,070	-
負債計	3,447,816	3,447,816	-

### (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

#### 資産

#### (1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(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。

#### 負債

#### (1) 未払手数料、(2) 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

(単位:千円)

区分	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
非上場株式	38,900	38,900
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
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	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

第28期(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	22,261,065	-	-	-
未収委託者報酬	4,489,181	-	-	-
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	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	4,150,204	2,167,462	2,151,428
長期性預金	-	3,500,000	-	-
合計	34,750,246	7,650,204	2,167,462	2,151,428

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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



## 2. その他有価証券

第27期（平成24年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
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	3,325,285	3,446,474	121,188
	小計	3,325,285	3,446,474	121,188
合計		14,417,413	13,440,240	977,173

第28期（平成25年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	12,625,086	10,181,990	2,443,096
	小計	12,625,086	10,181,990	2,443,096
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	3,025,331	3,033,767	8,436
	小計	3,025,331	3,033,767	8,436
合計		15,650,417	13,215,757	2,434,660

## 3. 売却したその他有価証券

第27期（自平成23年4月1日至平成24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	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合計	3,195,269	150,103	153,276

第28期（自平成24年4月1日至平成25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	7,033,368	334,775	32,155
合計	7,033,368	334,775	32,155

（デリバティブ取引関係）  
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、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。  
なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(1)退職給付債務	475,564	382,988
(2)年金資産	198,994	143,462
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	276,569	239,525
(4)未認識数理計算上の差異	156,666	119,749
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	119,902	119,776
(6)退職給付引当金	119,902	119,776

3.退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
(1)勤務費用	27,806	26,748
(2)利息費用	8,420	7,087
(3)期待運用収益	4,635	2,984
(4)数理計算上の差異の費用処理額	13,599	27,653
(5)退職給付費用	45,191	58,504
(6)その他	97,692	104,146
(7)合計	142,883	162,650

（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.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）退職給付見込額の期間配分方法  
期間定額基準

（2）割引率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

（3）期待運用収益率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

（4）数理計算上の差異の処理年数

8年（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。）

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		

		有価証券届出書(内国投資信託受益証券)
減損損失	557,868 千円	542,460 千円
投資有価証券評価損	362,665	226,404
ゴルフ会員権評価損	8,505	8,505
未払事業税	109,608	140,336
賞与引当金	197,652	225,779
役員退職慰労引当金	17,725	23,202
退職給付引当金	42,783	45,495
減価償却超過額	19,890	10,083
委託者報酬	99,265	124,166
長期差入保証金	21,895	26,203
時効後支払損引当金	69,579	71,948
その他	39,304	48,666
繰延税金資産 小計	1,546,744	1,493,253
評価性引当額	813,923	704,932
繰延税金資産 合計	732,821	788,320
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	254,118	637,305
繰延税金負債 合計	254,118	637,305
繰延税金資産の純額	478,702	151,015

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日至平成25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27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
親会社	三菱UFJ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 50.0%	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	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	667,780 千円	長期差入保証金	812,027 千円
							投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却		98,112 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 25.0%	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	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	6,532 千円	未収収益	544 千円
								マルチコーラブル預金の預入	7,000,000 千円	現金及び預金	5,500,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,415 千円	未収収益	2,886 千円
							長期性預金	8,500,000 千円			

## 第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	三菱UFJ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 50.0%	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	4,556,241 千円	未払手数料	324,725 千円
						事務所の賃借	事務所賃借料	671,086 千円	長期差入保証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	167,142 千円	未払費用	85,301 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 25.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,674,726 千円	未払手数料	602,382 千円
						取引銀行	譲渡性預金の預入	30,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金に係る受取利息	5,170 千円	未収収益	717 千円
							マルチコーラブル預金の預入	5,500,000 千円	現金及び預金	10,500,000 千円
							マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,246 千円	未収収益	2,301 千円
								長期性預金	3,500,000 千円	

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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  
第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱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	3,914,481 千円	未払手数料	285,874 千円

## 第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱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	3,513,173 千円	未払手数料	321,822 千円

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、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）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
1株当たり純資産額	379,935.23円	411,339.33円
1株当たり当期純利益金額	41,494.11円	43,547.22円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	第28期 （自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）
当期純利益金額（千円）	5,149,336	5,404,123
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	5,149,336	5,404,123
期中平均株式数（株）	124,098	124,098

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 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

平成25年6月21日付で、定款について次の変更を行いました。

- ・公告方法の変更(日本経済新聞に掲載する方法から電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告による公告ができない場合は日本経済新聞に掲載する方法による)に変更)

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25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25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：94,485千英ポンド（平成24年12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25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25年8月28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 柴 毅 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24年7月24日から平成25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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンドの平成25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。

### 利害関係

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25年6月24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	長島 拓也	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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。