

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年10月23日提出
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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の受益権です。

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。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

平成29年10月24日から平成30年10月22日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（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国際投信株式会社

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

（ 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。

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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（ 1 0 ）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（ 1 1 ）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ）【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。

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

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			TOPIX	条件付運用型
債券	年4回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
一般	年6回	欧州				その他 ()
公債	(隔月)	アジア				
社債	年12回	オセアニア				
その他債券	(毎月)	中南米				
クレジット	日々	アフリカ				
属性	その他 ()	中近東 (中東)				
()		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。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

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

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

内外の株式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

特色 1

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

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

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

特色 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。

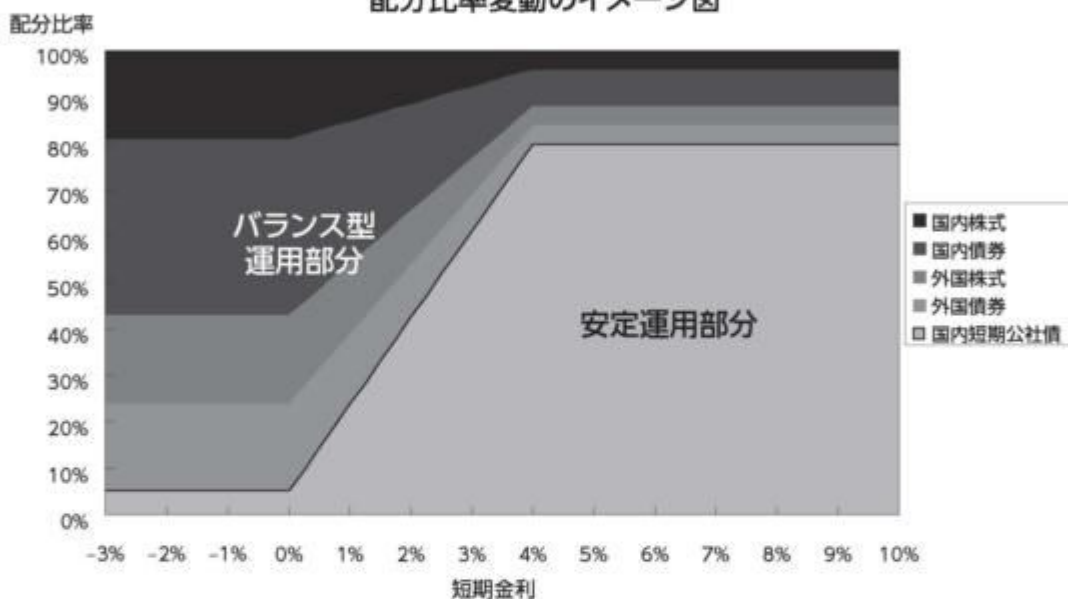
国内株式:三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド ……20%程度
国内債券:日本債券マザーファンド ……………40%程度
外国株式:外国株式マザーファンド ……………20%程度
外国債券:三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド ……20%程度

特色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%以下のとき、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

配分比率変動のイメージ図



※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。

- ・短期金利水準が0%を下回った場合:0%のときの配分比率と同じ
- ・短期金利水準が4%を上回った場合:4%のときの配分比率と同じ

※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)」の月中平均とします。なお、当該指標については今後見直す場合があります。

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

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

将来の運用成果等を保証するものではありません。

特色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。

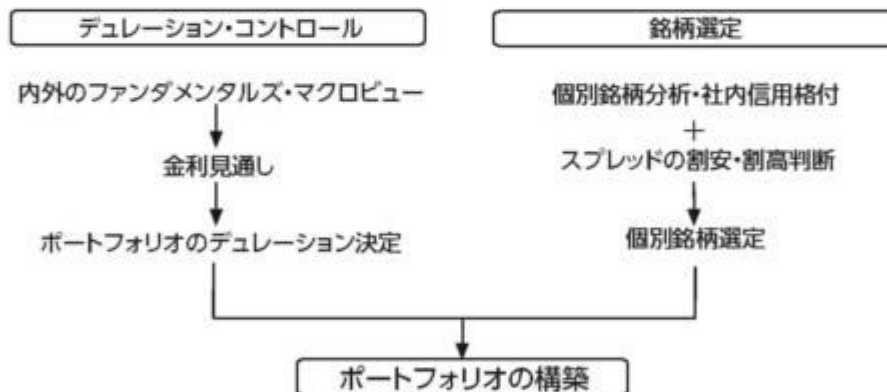
実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

<各マザーファンドの運用プロセス>

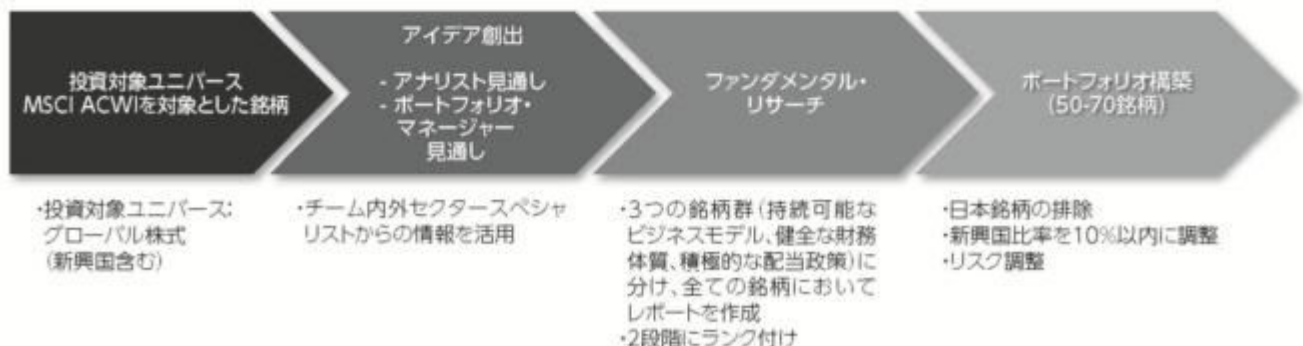
・三菱UFJ日本株アクティブマザーファンド



・日本債券マザーファンド



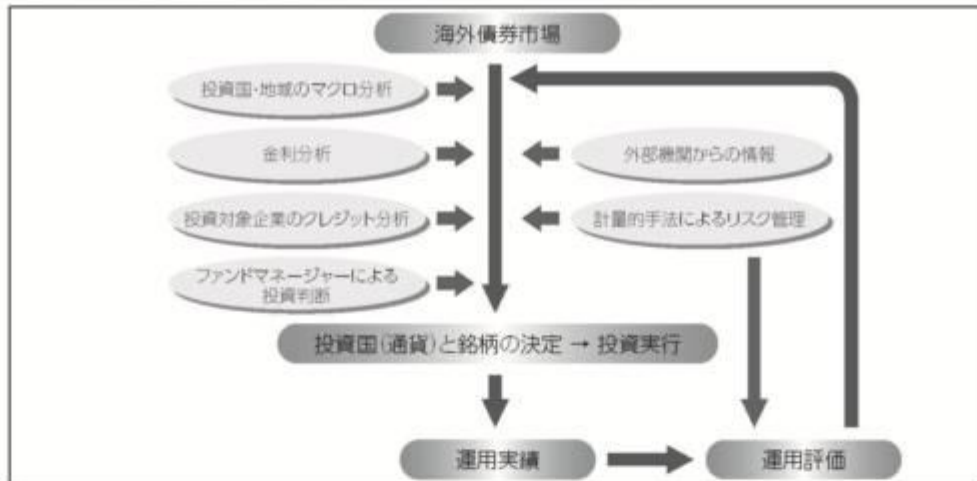
・外国株式マザーファンド



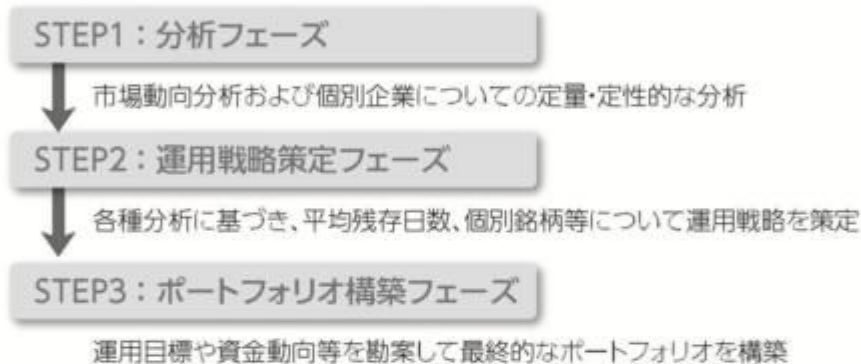
※ MSCI ACWI(MSCI オール・カンTRY・ワールド・インデックス)はMSCI Worldに新興国を加えたもので構成されています。

※ 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。

・三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド



・マネー・マーケット・マザーファンド



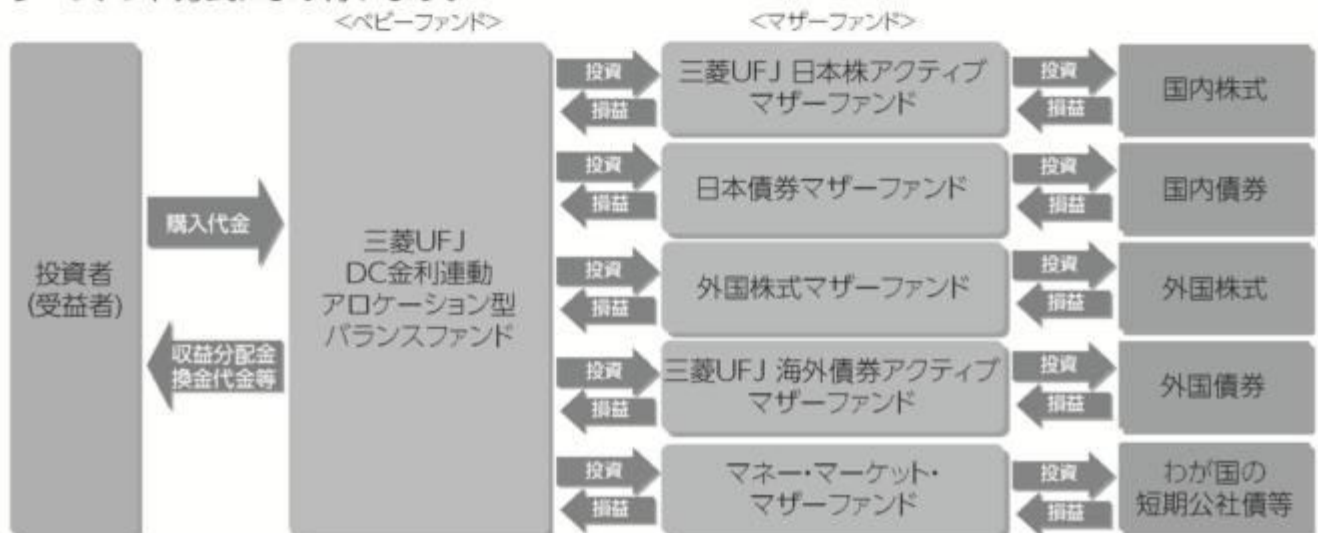
□ デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

❗ 上記の各運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。なお、今後、変更される場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ (<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>) でご覧いただけます。

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

指数について

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・デュー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。

シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

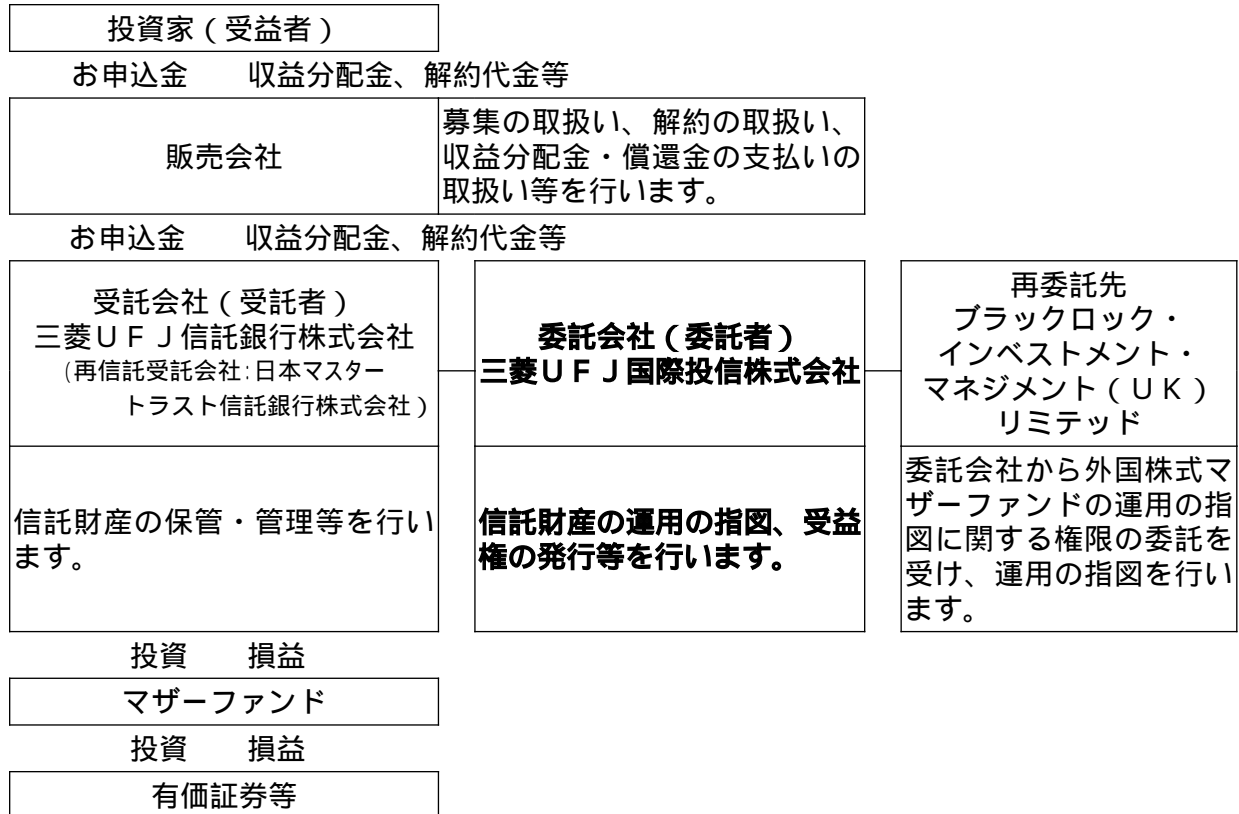
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(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



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。
委託会社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（平成29年7月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日
昭和60年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

- 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、
商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
- 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三
菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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%以下のとき、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。

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

イ. 有価証券

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

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
19. 預託証券（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券
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23. の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
- その他の投資対象
信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

銘柄選定は、主に以下の観点で行います。

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

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

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

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

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

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

(投資制限)

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

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、信託約款の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款の範囲で行います。

日本債券マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中長期的に信託財産の成長をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

ポートフォリオのデュレーション 調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。

ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。

銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。

NOMURA - BPI総合インデックスをベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

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

（投資制限）

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。

この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

外国株式マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、中長期的に信託財産の成長を目標として運用を行います。

（運用方法）

投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

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

企業訪問を含めた独自の調査に基づくアクティブ運用を行います。

超過収益の源泉は、地域配分・銘柄選択の双方におきます。

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

銘柄選択の基準としては、経営資源の効率的活用の視点を重視します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

運用の指図に関する権限は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミ

テッドに委託します。

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

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

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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、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。

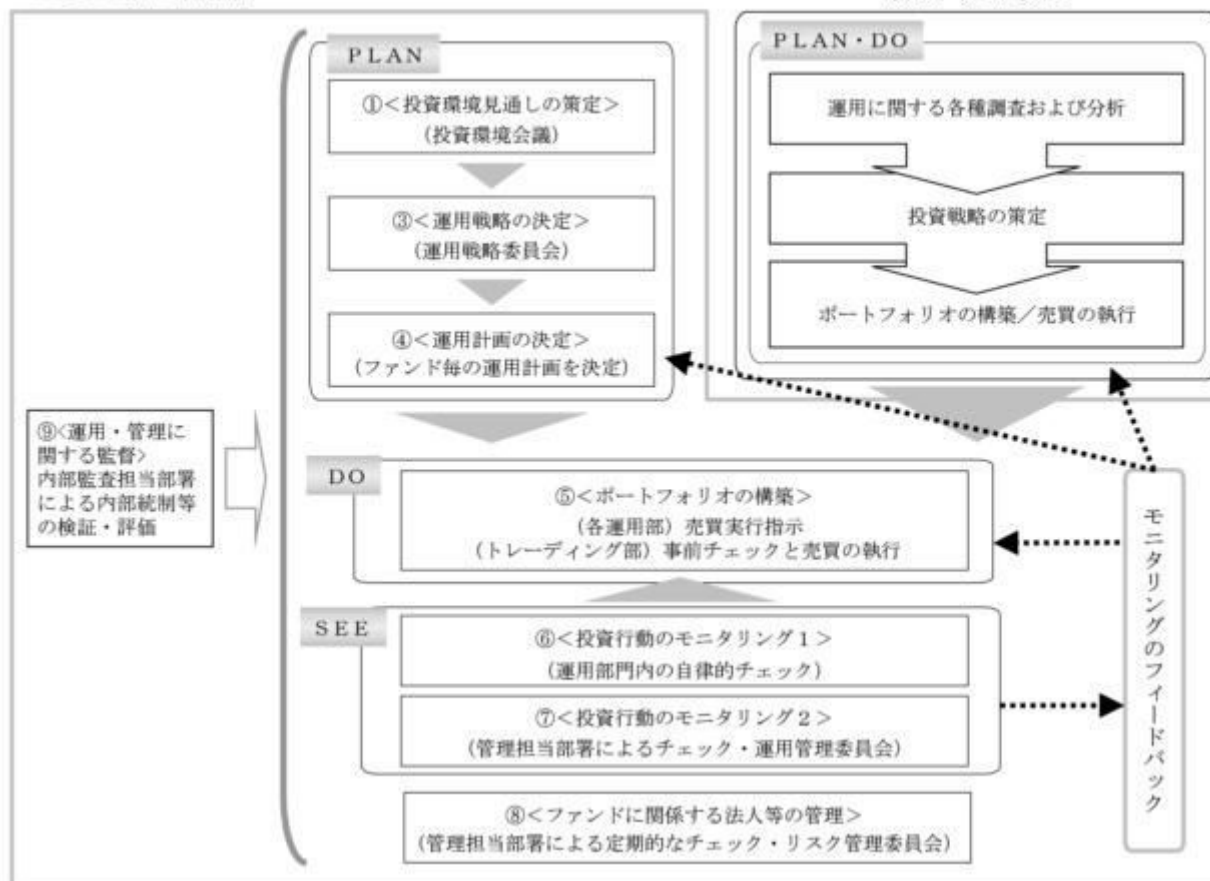
スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

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】

②外国株式マザーファンドの運用の指図に関する権限
＜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＞

<三菱UFJ国際投信>



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（40～60名程度）が、運用に関するパ

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す。

運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

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

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

外貨建資産

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

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

新株引受権証券および新株予約権証券

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

同一銘柄の転換社債等

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

有価証券先物取引等

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

上回らない範囲内とします。

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

スワップ取引

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

総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

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

信用取引

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

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産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間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

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

有価証券の貸付

- a．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- 1．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b．a．に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c．委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等

の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

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

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

<流動性リスクに対する管理体制>

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

[再委託先の管理体制]

リスク管理およびコンプライアンスの機能は、運用部門から独立したコンプライアンスおよびオ

ペレーション・リスク管理部門によって実施しております。同部門により、全てのファンドについて投資ガイドライン違反やリスク管理指標からの逸脱がないかどうかのチェックを行なっています。

また、このほかに、投資ガイドラインなどに関するチェックの機能としては、コンプライアンス・スクリーニング・システムにより売買執行前および執行後のモニタリングを行いチェックします。

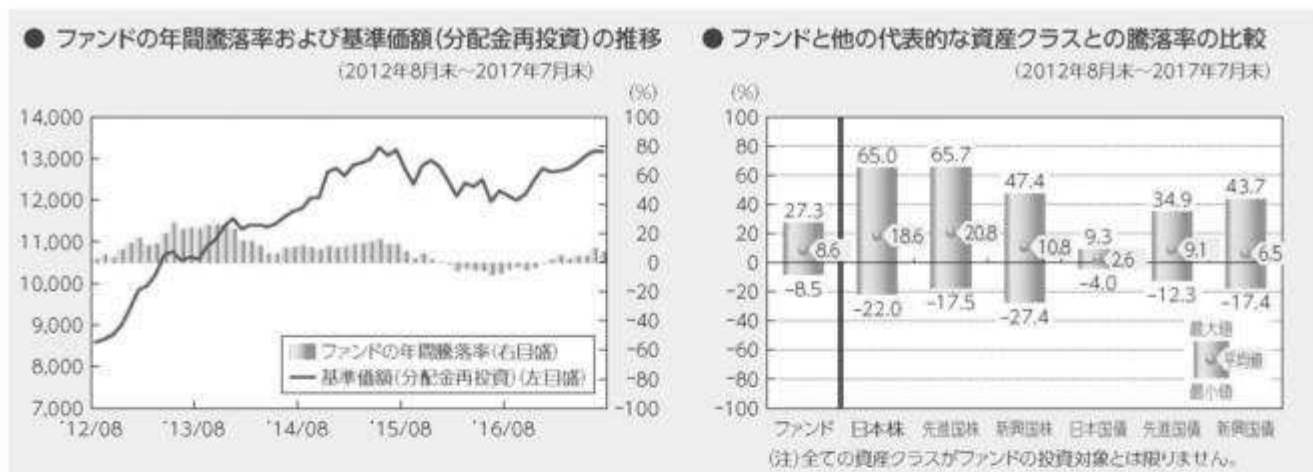
〔委託会社における再委託先に対する確認体制〕

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、ファンドの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。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

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

（１）【申込手数料】

ありません。

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

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.648%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とします。

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

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

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.275%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.275%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.05%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

個人の受益者に対する課税

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

１．収益分配金の課税

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

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・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。

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回って

いる場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は平成29年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】

【三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド】

(1)【投資状況】

平成29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	6,308,318,952	99.80
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		12,358,014	0.20
純資産総額		6,320,676,966	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成29年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(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	日本債券マザーファンド	親投資信託 受益証券		1,665,250,750	1.4493 1.4489	2,413,613,272 2,412,781,811		38.17
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		649,912,957	1.8707 1.8549	1,215,792,169 1,205,523,543		19.07
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		414,833,237	2.9080 2.8965	1,206,373,336 1,201,564,470		19.01
日本	外国株式マザーファンド	親投資信託 受益証券		519,310,491	2.3298 2.2791	1,209,927,524 1,183,560,540		18.73
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		299,379,997	1.0183 1.0184	304,888,588 304,888,588		4.82

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成29年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29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)
第7計算期間末日 (平成26年 7月22日)	4,290,633,492 (分配付) 4,290,633,492 (分配落)	11,637 (分配付) 11,637 (分配落)
第8計算期間末日 (平成27年 7月22日)	5,316,803,189 (分配付) 5,316,803,189 (分配落)	13,217 (分配付) 13,217 (分配落)
第9計算期間末日 (平成28年 7月22日)	5,370,149,763 (分配付) 5,370,149,763 (分配落)	12,241 (分配付) 12,241 (分配落)
第10計算期間末日 (平成29年 7月24日)	6,318,929,248 (分配付) 6,318,929,248 (分配落)	13,252 (分配付) 13,252 (分配落)
平成28年 7月末日	5,404,353,512	12,227
8月末日	5,400,070,314	12,106
9月末日	5,384,287,646	11,999
10月末日	5,551,994,002	12,144
11月末日	5,708,662,695	12,471
12月末日	5,849,396,278	12,761
平成29年 1月末日	5,835,107,705	12,678
2月末日	5,849,110,496	12,703
3月末日	5,965,202,356	12,755
4月末日	6,084,778,809	12,885
5月末日	6,186,857,136	13,063
6月末日	6,285,745,465	13,182
7月末日	6,320,676,966	13,162

【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
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円

【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
第7計算期間	7.13
第8計算期間	13.57
第9計算期間	7.38
第10計算期間	8.25

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第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
第7計算期間	1,076,477,858	390,274,433	3,687,160,665
第8計算期間	1,027,593,242	692,112,098	4,022,641,809
第9計算期間	750,501,178	386,134,577	4,387,008,410
第10計算期間	798,924,527	417,674,596	4,768,258,341

<参考>

「三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド」

（１）投資状況

平成29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	34,011,692,200	98.62
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		476,130,941	1.38
純資産総額		34,487,823,141	100.00

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年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	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	150,000	9,273.00 8,958.00	1,390,950,000 1,343,700,000		3.90
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	1,888,700	729.60 700.00	1,377,995,520 1,322,090,000		3.83
日本	東京エレクトロン	株式	電気機器	53,000	16,350.45 15,575.00	866,573,950 825,475,000		2.39
日本	SUMCO	株式	金属製品	458,000	1,755.73 1,796.00	804,127,296 822,568,000		2.39
日本	スズキ	株式	輸送用機器	157,000	5,418.00 5,230.00	850,626,000 821,110,000		2.38
日本	東京応化工業	株式	化学	220,000	3,850.00 3,595.00	847,000,000 790,900,000		2.29

日本	三井金属鉱業	株式	非鉄金属	1,481,000	417.00 483.00	617,577,000 715,323,000	2.07
日本	ファナック	株式	電気機器	31,200	21,725.00 22,565.00	677,820,000 704,028,000	2.04
日本	ペプチドリーム	株式	医薬品	198,600	3,560.00 3,470.00	707,016,000 689,142,000	2.00
日本	任天堂	株式	その他製品	17,600	37,450.00 37,480.00	659,120,000 659,648,000	1.91
日本	オムロン	株式	電気機器	114,000	5,194.85 5,510.00	592,213,269 628,140,000	1.82
日本	ソニーフィナンシャルホールディングス	株式	保険業	325,000	1,893.22 1,911.00	615,298,042 621,075,000	1.80
日本	ダイキン工業	株式	機械	48,000	11,450.43 11,700.00	549,620,656 561,600,000	1.63
日本	熊谷組	株式	建設業	1,463,000	360.00 382.00	526,680,000 558,866,000	1.62
日本	東海カーボン	株式	ガラス・土石製品	781,000	651.00 715.00	508,431,000 558,415,000	1.62
日本	安川電機	株式	電気機器	186,000	2,478.00 2,961.00	460,908,000 550,746,000	1.60
日本	ディスコ	株式	機械	27,700	18,780.00 19,570.00	520,206,000 542,089,000	1.57
日本	キーエンス	株式	電気機器	10,300	50,310.00 51,020.00	518,193,000 525,506,000	1.52
日本	五洋建設	株式	建設業	789,000	667.00 657.00	526,263,000 518,373,000	1.50
日本	朝日インテック	株式	精密機器	100,000	5,020.00 4,960.00	502,000,000 496,000,000	1.44
日本	S M C	株式	機械	14,000	34,600.00 35,110.00	484,400,000 491,540,000	1.43
日本	西武ホールディングス	株式	陸運業	250,000	2,145.26 1,926.00	536,315,899 481,500,000	1.40
日本	三菱商事	株式	卸売業	198,000	2,286.50 2,396.50	452,727,000 474,507,000	1.38
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	100,000	4,854.00 4,645.00	485,400,000 464,500,000	1.35
日本	アウトソーシング	株式	サービス業	78,000	5,600.00 5,510.00	436,800,000 429,780,000	1.25
日本	オリックス	株式	その他金融業	242,000	1,766.24 1,751.50	427,430,222 423,863,000	1.23
日本	昭和電工	株式	化学	139,000	2,493.00 2,886.00	346,527,000 401,154,000	1.16
日本	山一電機	株式	電気機器	182,000	1,849.00 2,153.00	336,518,000 391,846,000	1.14
日本	ファーストリテイリング	株式	小売業	11,600	37,130.00 33,120.00	430,708,000 384,192,000	1.11
日本	ポーラ・オルビスホールディングス	株式	化学	124,000	3,105.00 3,065.00	385,020,000 380,060,000	1.10

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
建設業	3.12
食料品	3.45
化学	7.42
医薬品	2.52
ガラス・土石製品	1.62
非鉄金属	4.10
金属製品	2.39
機械	6.87
電気機器	17.76
輸送用機器	7.17
精密機器	3.33
その他製品	3.86
電気・ガス業	0.96
陸運業	3.48
情報・通信業	7.43
卸売業	1.38
小売業	3.89
銀行業	6.55
保険業	4.12
その他金融業	1.69
不動産業	1.44
サービス業	4.04
合計	98.62

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考>

「日本債券マザーファンド」

(1) 投資状況

平成29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	5,566,316,600	59.68
社債券	日本	3,536,929,000	37.92
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		223,633,521	2.40
純資産総額		9,326,879,121	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年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125回利付国債(20年)	国債証券		190,000	126.23 126.1180	239,850,300 239,624,200	2.200000 2031/03/20	2.57
日本	第20回みずほ銀行(劣後特約付)	社債券		200,000	105.70 105.6650	211,404,000 211,330,000	1.490000 2022/06/03	2.27
日本	第28回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)	社債券		200,000	104.71 104.6730	209,422,000 209,346,000	1.560000 2021/01/20	2.24
日本	第12回パナソニック	社債券		200,000	100.65 100.6490	201,304,000 201,298,000	0.387000 2020/03/19	2.16
日本	第43回野村ホールディングス	社債券		200,000	100.50 100.5030	201,010,000 201,006,000	0.454000 2019/02/25	2.16
日本	第39回野村ホールディングス	社債券		200,000	100.44 100.4300	200,886,000 200,860,000	0.853000 2018/02/26	2.15
日本	第19回大和証券グループ本社	社債券		200,000	100.39 100.3890	200,782,000 200,778,000	0.412000 2020/02/25	2.15
日本	第19回ルノー	社債券		200,000	100.00 99.9950	200,016,000 199,990,000	0.360000 2020/07/06	2.14
日本	第15回パナソニック	社債券		200,000	99.94 99.9100	199,884,000 199,820,000	0.190000 2021/09/17	2.14
日本	第334回利付国債(10年)	国債証券		160,000	104.32 104.2720	166,912,000 166,835,200	0.600000 2024/06/20	1.79
日本	第114回利付国債(20年)	国債証券		130,000	123.59 123.4070	160,667,000 160,429,100	2.100000 2029/12/20	1.72
日本	第333回利付国債(10年)	国債証券		150,000	104.19 104.1500	156,285,000 156,225,000	0.600000 2024/03/20	1.67
日本	第339回利付国債(10年)	国債証券		140,000	103.11 103.0710	144,366,600 144,299,400	0.400000 2025/06/20	1.55
日本	第148回利付国債(20年)	国債証券		110,000	117.53 117.5180	129,290,700 129,269,800	1.500000 2034/03/20	1.39
日本	第335回利付国債(10年)	国債証券		120,000	103.72 103.6410	124,470,000 124,369,200	0.500000 2024/09/20	1.33
日本	第338回利付国債(10年)	国債証券		120,000	103.09 103.0520	123,718,800 123,662,400	0.400000 2025/03/20	1.33
日本	第99回利付国債(20年)	国債証券		100,000	120.84 120.7390	120,840,000 120,739,000	2.100000 2027/12/20	1.29
日本	第147回利付国債(20年)	国債証券		100,000	119.11 119.0000	119,113,000 119,000,000	1.600000 2033/12/20	1.28
日本	第5回利付国債(40年)	国債証券		90,000	130.78 130.4180	117,702,900 117,376,200	2.000000 2052/03/20	1.26
日本	第80回利付国債(20年)	国債証券		100,000	116.54 116.4600	116,546,000 116,460,000	2.100000 2025/06/20	1.25
日本	第150回利付国債(20年)	国債証券		100,000	115.86 115.8490	115,866,000 115,849,000	1.400000 2034/09/20	1.24
日本	第152回利付国債(20年)	国債証券		100,000	112.44 112.4340	112,446,000 112,434,000	1.200000 2035/03/20	1.21
日本	第154回利付国債(20年)	国債証券		100,000	112.30 112.2920	112,304,000 112,292,000	1.200000 2035/09/20	1.20

日本	第140回利付国債（20年）	国債証券	90,000	120.37 120.2670	108,341,100 108,240,300	1.700000 2032/09/20	1.16
日本	第90回利付国債（20年）	国債証券	90,000	119.69 119.5490	107,729,100 107,594,100	2.200000 2026/09/20	1.15
日本	第469回東北電力	社債券	100,000	107.29 107.2320	107,290,000 107,232,000	1.543000 2023/06/23	1.15
日本	第92回利付国債（20年）	国債証券	90,000	119.24 119.0900	107,316,900 107,181,000	2.100000 2026/12/20	1.15
日本	第34回利付国債（30年）	国債証券	80,000	132.31 132.2920	105,851,200 105,833,600	2.200000 2041/03/20	1.13
日本	第326回利付国債（10年）	国債証券	100,000	104.09 104.0480	104,091,000 104,048,000	0.700000 2022/12/20	1.12
日本	第336回利付国債（10年）	国債証券	100,000	103.81 103.7300	103,816,000 103,730,000	0.500000 2024/12/20	1.11

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	59.68
社債券	37.92
合計	97.60

（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29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	3,653,767,984	46.33
	イギリス	1,186,276,331	15.04
	スイス	772,313,880	9.79
	オランダ	267,287,761	3.39
	カナダ	242,457,767	3.07
	台湾	240,084,225	3.04
	オーストラリア	222,197,696	2.82
	ドイツ	212,869,369	2.70
	フランス	200,402,928	2.54
	フィンランド	164,417,990	2.08
	香港	146,941,402	1.86
	ベルギー	138,754,234	1.76
	スウェーデン	109,562,900	1.39
	デンマーク	85,924,787	1.09
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		243,123,267	3.10
純資産総額		7,886,382,521	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年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)		
					イギリス	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		
イギリス	IMPERIAL BRANDS PLC	株式	食品・飲料・タバコ	61,437	5,068.55 4,805.48	311,396,616 295,234,624	3.74	

アメリカ	ALTRIA GROUP INC	株式	食品・飲料・タバコ	37,998	8,101.89 7,386.82	307,855,882 280,684,728	3.56
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	20,191	13,195.65 13,077.57	266,433,429 264,049,387	3.35
アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,953	14,931.45 14,549.64	268,064,474 261,209,821	3.31
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,431	9,161.42 9,315.44	251,307,104 255,532,067	3.24
イギリス	ASTRAZENECA PLC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	38,277	7,467.30 6,495.48	285,826,178 248,627,720	3.15
カナダ	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	株式	電気通信サービス	42,580	5,828.62 5,694.17	248,183,039 242,457,767	3.07
アメリカ	TELUS CORP	株式	電気通信サービス	57,409	3,977.01 4,007.91	228,316,396 230,090,220	2.92
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	61,036	3,694.51 3,658.10	225,498,600 223,275,944	2.83
ドイツ	DEUTSCHE POST AG-REG	株式	運輸	50,126	4,287.52 4,246.68	214,916,503 212,869,369	2.70
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	21,959	9,423.83 9,321.15	206,937,970 204,683,198	2.60
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	58,527	3,513.54 3,478.23	205,637,189 203,570,484	2.58
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	18,945	10,569.06 10,578.14	200,230,993 200,402,928	2.54
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	39,272	4,969.06 5,077.20	195,144,943 199,391,935	2.53
アメリカ	GENUINE PARTS CO	株式	小売	20,800	9,127.04 9,261.67	189,842,608 192,642,850	2.44
アメリカ	H&R BLOCK INC	株式	消費者サービス	56,963	3,288.43 3,335.88	187,318,838 190,021,760	2.41
アメリカ	INTERNATIONAL PAPER CO	株式	素材	30,784	6,250.22 6,040.55	192,406,895 185,952,568	2.36
フィンランド	KONE OYJ-B	株式	資本財	28,947	5,678.67 5,679.96	164,380,460 164,417,990	2.08
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	16,456	9,778.11 9,954.67	160,908,635 163,814,107	2.08
オランダ	UNILEVER NV-CVA	株式	家庭用品・パーソナル用品	25,297	6,438.41 6,409.24	162,889,083 162,134,739	2.06
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	12,418	12,870.12 12,867.91	159,821,156 159,793,749	2.03
アメリカ	UNITED TECHNOLOGIES CORP	株式	資本財	12,152	13,368.90 13,117.30	162,464,087 159,401,484	2.02
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	19,278	8,142.72 8,059.96	156,975,481 155,379,985	1.97
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	187,000	781.10 777.45	146,065,700 145,383,150	1.84
アメリカ	3M CO	株式	資本財	6,341	23,301.50 22,039.10	147,754,849 139,749,945	1.77
イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,972	2,340.78 2,200.91	147,403,661 138,595,950	1.76
イギリス	DIAGEO PLC	株式	食品・飲料・タバコ	35,954	3,311.87 3,539.43	119,101,353 127,256,838	1.61
スイス	GIVAUDAN-REG	株式	素材	559	219,166.89 218,254.17	122,514,291 122,004,081	1.55
アメリカ	US BANCORP	株式	銀行	20,933	5,751.44 5,801.09	120,394,935 121,434,415	1.54

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
素材	3.90
資本財	5.88
商業・専門サービス	1.13
運輸	4.44
耐久消費財・アパレル	0.84
消費者サービス	3.43
小売	2.44
食品・飲料・タバコ	25.86
家庭用品・パーソナル用品	4.13
ヘルスケア機器・サービス	2.82
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	20.64

銀行	7.81
ソフトウェア・サービス	1.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.58
電気通信サービス	7.19
半導体・半導体製造装置	1.84
合計	96.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考>

「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29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	13,557,118,217	30.79
	スペイン	7,869,842,773	17.87
	イタリア	6,336,391,710	14.39
	メキシコ	2,277,382,308	5.17
	ポーランド	1,533,926,002	3.48
	アイルランド	1,505,695,720	3.42
	フランス	1,481,120,562	3.36
	スウェーデン	1,248,214,691	2.83
	イギリス	965,647,502	2.19
	オランダ	900,595,444	2.05
	ドイツ	883,542,709	2.01
	オーストラリア	841,229,115	1.91
	ベルギー	382,264,468	0.87
	南アフリカ	225,783,146	0.51
	シンガポール	161,122,894	0.37
	ノルウェー	132,542,217	0.30
マレーシア	99,043,253	0.22	
カナダ	9,077,588	0.02	
特殊債券	アメリカ	545,929,589	1.24
社債券	アメリカ	922,325,163	2.09
	フランス	698,126,355	1.59
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,459,660,487	3.32
純資産総額		44,036,581,913	100.00

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

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年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 171231	国債証券		34,000,000.00	11,015.14 11,017.7578	3,745,148,304 3,746,037,656	0.750000 2017/12/31	8.51
スペイン	5.9 SPAIN GOVT 260730	国債証券		17,000,000.00	18,087.76 17,942.7691	3,074,920,070 3,050,270,752	5.900000 2026/07/30	6.93
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		21,000,000.00	10,828.13 10,876.3718	2,273,908,308 2,284,038,093	2.000000 2025/08/15	5.19
スペイン	4.3 SPAIN GOVT 191031	国債証券		15,000,000.00	14,367.12 14,285.4852	2,155,068,230 2,142,822,787	4.300000 2019/10/31	4.87
アメリカ	1.75 T-NOTE 230515	国債証券		16,000,000.00	10,722.09 10,903.0972	1,715,535,412 1,744,495,562	1.750000 2023/05/15	3.96
アメリカ	1.625 T-NOTE 190630	国債証券		15,000,000.00	11,097.24 11,093.6234	1,664,586,989 1,664,043,515	1.625000 2019/06/30	3.78

イタリア	4.75 ITALY GOVT 280901	国債証券	10,000,000.00	16,524.28 16,068.4320	1,652,428,663 1,606,843,205	4.750000 2028/09/01	3.65
イタリア	5.5 ITALY GOVT 220901	国債証券	10,000,000.00	16,197.31 15,922.6795	1,619,731,711 1,592,267,952	5.500000 2022/09/01	3.62
スペイン	5.5 SPAIN GOVT 210430	国債証券	9,000,000.00	15,758.48 15,620.9969	1,418,263,390 1,405,889,724	5.500000 2021/04/30	3.19
イタリア	2 ITALY GOVT 251201	国債証券	10,000,000.00	13,242.85 13,126.2846	1,324,285,291 1,312,628,460	2.000000 2025/12/01	2.98
スペイン	4.9 SPAIN GOVT 400730	国債証券	7,000,000.00	18,444.06 18,155.1358	1,291,084,519 1,270,859,508	4.900000 2040/07/30	2.89
イタリア	4.25 ITALY GOVT 200301	国債証券	8,000,000.00	14,525.37 14,364.4939	1,162,029,613 1,149,159,516	4.250000 2023/03/01	2.61
アメリカ	3.875 T-BOND 400815	国債証券	7,000,000.00	12,496.27 13,051.4738	874,739,276 913,603,167	3.875000 2040/08/15	2.07
オランダ	0.25 NETH GOVT 250715	国債証券	7,000,000.00	12,869.57 12,865.6492	900,870,432 900,595,444	0.250000 2025/07/15	2.05
メキシコ	10 MEXICAN BONOS 241205	国債証券	115,000,000.00	724.25 736.5743	832,897,899 847,060,456	10.000000 2024/12/05	1.92
オーストラリア	3.25 AUST GOVT 250421	国債証券	9,100,000.00	9,241.73 9,244.2759	840,998,193 841,229,115	3.250000 2025/04/21	1.91
アメリカ	4.75 T-BOND 410215	国債証券	5,000,000.00	14,192.90 14,762.7609	709,645,331 738,138,046	4.750000 2041/02/15	1.68
フランス	1.75 O.A.T 230525	国債証券	5,000,000.00	14,217.96 14,225.6388	710,898,176 711,281,940	1.750000 2023/05/25	1.62
フランス	2.25 BNP PARIBAS 210113	社債券	5,000,000.00	14,000.57 13,962.5271	700,028,968 698,126,355	2.250000 2021/01/13	1.59
イタリア	5 ITALY GOVT 400901	国債証券	4,000,000.00	17,450.72 16,887.3144	698,029,117 675,492,576	5.000000 2040/09/01	1.53
アイルランド	2 IRISH GOVT 450218	国債証券	5,000,000.00	13,204.30 13,143.2687	660,215,398 657,163,437	2.000000 2045/02/18	1.49
ドイツ	4.75 BUND 340704	国債証券	3,000,000.00	21,245.74 20,676.0374	637,372,365 620,281,124	4.750000 2034/07/04	1.41
アイルランド	2.4 IRISH GOVT 300515	国債証券	4,000,000.00	14,767.48 14,643.8767	590,699,402 585,755,069	2.400000 2030/05/15	1.33
アメリカ	4.5 T-BOND 360215	国債証券	4,000,000.00	13,809.26 14,173.9402	552,370,718 566,957,609	4.500000 2036/02/15	1.29
メキシコ	5 MEXICAN BONOS 191211	国債証券	94,000,000.00	591.80 598.2527	556,296,117 562,357,603	5.000000 2019/12/11	1.28
アメリカ	1.625 BK NEDERLAN 210419	特殊債券	5,000,000.00	10,783.99 10,918.5917	539,199,894 545,929,589	1.625000 2021/04/19	1.24
スウェーデン	5 SWD GOVT 201201	国債証券	34,000,000.00	1,625.08 1,604.2560	552,527,200 545,447,040	5.000000 2020/12/01	1.24
ポーランド	5.25 POLAND 201025	国債証券	16,000,000.00	3,344.16 3,339.6344	535,066,817 534,341,504	5.250000 2020/10/25	1.21
ポーランド	3.25 POLAND 250725	国債証券	17,000,000.00	3,088.54 3,075.6985	525,052,727 522,868,745	3.250000 2025/07/25	1.19
メキシコ	8.5 MEXICAN BONOS 381118	国債証券	70,000,000.00	684.13 712.0386	478,897,093 498,427,020	8.500000 2038/11/18	1.13

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	91.77
特殊債券	1.24
社債券	3.68
合計	96.69

（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 >

「マネー・マーケット・マザーファンド」

(1) 投資状況

平成29年7月31日現在

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,250,083,337	100.00
純資産総額		1,250,083,337	100.00

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄
該当事項はありません。

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

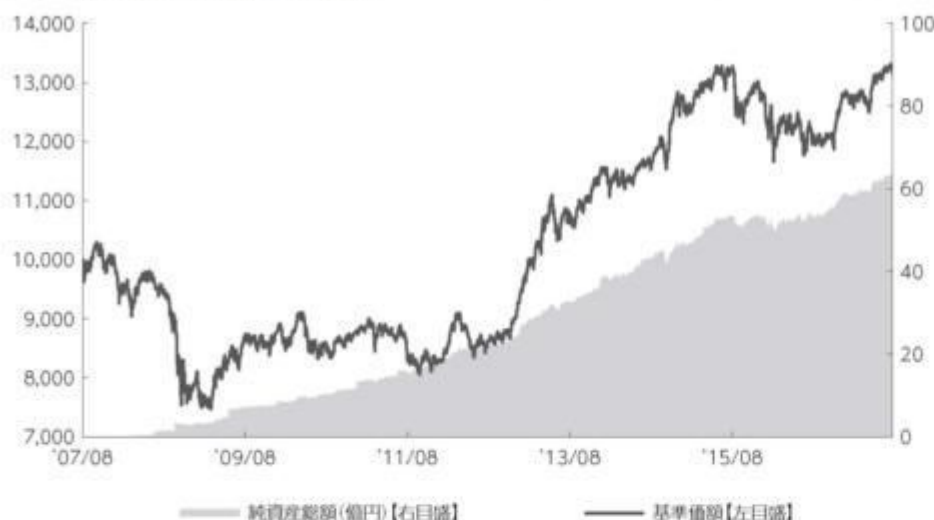
参考情報



運用実績

2017年7月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2007年8月10日(設定日)～2017年7月31日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	13,162円
純資産総額	63.2億円

■分配の推移

2017年7月	0円
2016年7月	0円
2015年7月	0円
2014年7月	0円
2013年7月	0円
2012年7月	0円
設定来累計	0円

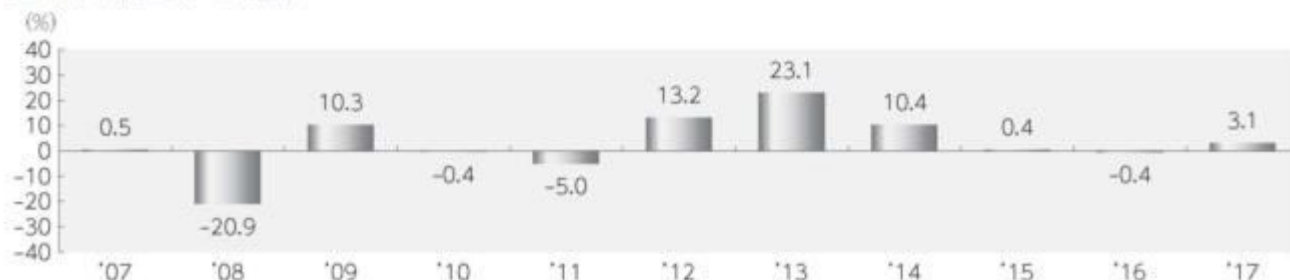
•分配金は1万円当たり、税引前

■主要な資産の状況

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	18.8%	円	62.6%	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	日本	0.7%
国内債券	37.3%	アメリカドル	15.6%	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	株式	食品・飲料・タバコ	イギリス	0.7%
外国株式	18.1%	ユーロ	11.3%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.7%
外国債券	18.4%	イギリスポンド	3.2%	IMPERIAL BRANDS PLC	株式	食品・飲料・タバコ	イギリス	0.7%
		スイスフラン	1.8%	ALTRIA GROUP INC	株式	食品・飲料・タバコ	アメリカ	0.7%
		メキシコペソ	1.0%	0.75 T-NOTE 171231	債券	国債	アメリカ	1.6%
		オーストラリアドル	0.9%	5.9 SPAIN GOVT 260730	債券	国債	スペイン	1.3%
コールローン他 (負債控除後)	7.4%	スウェーデンクローネ	0.8%	2 T-NOTE 250815	債券	国債	アメリカ	1.0%
合計	100.0%	その他	2.8%	第125回利付国債(20年)	債券	国債	日本	1.0%
		合計	100.0%	4.3 SPAIN GOVT 191031	債券	国債	スペイン	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(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2007年は設定日から年末までの、2017年は年初から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。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

1円以上1円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込価額の照会方法

申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

申込受付時間

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

取得申込みの受付の中止および取消し

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

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

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

解約単位

1口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>**支払開始日**

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

解約請求受付時間

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

解約請求受付の中止および取消し

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

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】**(1)【資産の評価】****基準価額の算出方法**

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

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

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

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

・外国為替予約取引

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

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限（平成19年8月10日設定）

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

（４）【計算期間】

毎年7月23日から翌年7月22日まで

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

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

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

信託約款の変更

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

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

ファンドの償還等に関する開示方法

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

異議申立ておよび反対者の買取請求権

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

関係法人との契約の更改

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

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、その後もまた同様とします。

運用報告書

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

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

信託事務の再信託

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

公告

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

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

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

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成28年7月23日から平成29年7月24日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ DC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9期 [平成28年 7月22日現在]	第10期 [平成29年 7月24日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,405,734	34,552,584
親投資信託受益証券	5,365,145,200	6,306,577,859
未収入金	2,917,011	109,737
流動資産合計	5,391,467,945	6,341,240,180
資産合計	5,391,467,945	6,341,240,180
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,469,478	2,549,062
未払受託者報酬	1,395,692	1,637,003
未払委託者報酬	15,352,562	18,006,999
未払利息	26	64
その他未払費用	100,424	117,804
流動負債合計	21,318,182	22,310,932
負債合計	21,318,182	22,310,932
純資産の部		
元本等		
元本	4,387,008,410	4,768,258,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	983,141,353	1,550,670,907
(分配準備積立金)	1,107,125,636	1,098,652,180
元本等合計	5,370,149,763	6,318,929,248
純資産合計	5,370,149,763	6,318,929,248
負債純資産合計	5,391,467,945	6,341,240,180

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期		第10期	
	自	平成27年 7月23日 至 平成28年 7月22日	自	平成28年 7月23日 至 平成29年 7月24日
営業収益				
受取利息		7,654		220
有価証券売買等損益		363,150,571		510,348,875
営業収益合計		363,142,917		510,349,095
営業費用				
支払利息		3,699		11,291
受託者報酬		2,815,453		3,144,045
委託者報酬		30,969,902		34,584,400
その他費用		202,603		226,251
営業費用合計		33,991,657		37,965,987
営業利益又は営業損失（ ）		397,134,574		472,383,108
経常利益又は経常損失（ ）		397,134,574		472,383,108
当期純利益又は当期純損失（ ）		397,134,574		472,383,108
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		25,391,732		17,263,174
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,294,161,380		983,141,353
剰余金増加額又は欠損金減少額		183,274,600		206,476,731
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		183,274,600		206,476,731
剰余金減少額又は欠損金増加額		122,551,785		94,067,111
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		122,551,785		94,067,111
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		983,141,353		1,550,670,907

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年7月22日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成28年7月23日から平成29年7月24日までとなっております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	

（貸借対照表に関する注記）

	第 9 期 [平成28年7月22日現在]	第 10 期 [平成29年7月24日現在]
1 期首元本額	4,022,641,809円	4,387,008,410円
期中追加設定元本額	750,501,178円	798,924,527円
期中一部解約元本額	386,134,577円	417,674,596円
2 受益権の総数	4,387,008,410口	4,768,258,341口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2241円 (12,241円)	1.3252円 (13,252円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 9 期（自 平成27年7月23日 至 平成28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	50,855,601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	780,362,733円
分配準備積立金額	D	1,056,270,035円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,887,488,369円
当ファンドの期末残存口数	F	4,387,008,410口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,302円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金額	I=F*H/10,000	

第 10 期（自 平成28年7月23日 至 平成29年7月24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	87,526,236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	1,041,327,691円
分配準備積立金額	D	1,011,125,944円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,139,979,871円
当ファンドの期末残存口数	F	4,768,258,341口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,487円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金額	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 9 期 (自 平成27年 7月23日 至 平成28年 7月22日)	第 10 期 (自 平成28年 7月23日 至 平成29年 7月24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	<p>当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 9 期 [平成28年7月22日現在]	第 10 期 [平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 9 期 [平成28年7月22日現在]	第 10 期 [平成29年7月24日現在]
親投資信託受益証券	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) 350,650,006	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) 479,999,994
合計	350,650,006	479,999,994

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド	649,961,180	1,215,882,379	
	三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド	412,358,313	1,199,179,210	
	日本債券マザーファンド	1,655,317,400	2,399,217,039	
	外国株式マザーファンド	510,442,827	1,189,382,831	
	マネー・マーケット・マザーファンド	297,443,441	302,916,400	
	親投資信託受益証券 小計	3,525,523,161	6,306,577,859	
	合計	3,525,523,161	6,306,577,859	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

<参考>

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
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の状況は以下の通りです。

「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28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	472,108,832	409,554,305
株式	31,781,025,130	34,295,496,780
未収入金	472,573,359	98,599,751
未収配当金	24,094,183	34,944,000
流動資産合計	32,749,801,504	34,838,594,836
資産合計	32,749,801,504	34,838,594,836
負債の部		
流動負債		
未払金	412,094,442	
未払解約金	21,360,681	27,687,459
未払利息	537	768
流動負債合計	433,455,660	27,688,227
負債合計	433,455,660	27,688,227
純資産の部		
元本等		
元本	21,550,497,268	18,608,863,875
剰余金		
剰余金又は欠損金()	10,765,848,576	16,202,042,734
元本等合計	32,316,345,844	34,810,906,609
純資産合計	32,316,345,844	34,810,906,609
負債純資産合計	32,749,801,504	34,838,594,836

(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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 期首	平成27年7月23日	平成28年7月23日
期首元本額	22,223,000,791円	21,550,497,268円
期首からの追加設定元本額	1,935,957,312円	759,865,726円
期首からの一部解約元本額	2,608,460,835円	3,701,499,119円
元本の内訳*		
三菱UFJ 日本株アクティブオープン	5,937,484,694円	5,092,519,217円
三菱UFJ 日本株アクティブオープン(確定拠出年金)	9,110,160,968円	8,667,999,995円
三菱UFJ バランスインカムオープン(毎月決算型)	5,250,297,771円	3,758,321,736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	684,874,956円	649,961,180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)	567,678,879円	440,061,747円

(合計)	21,550,497,268円	18,608,863,875円
2 受益権の総数	21,550,497,268口	18,608,863,875口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4996円 (14,996円)	1.8707円 (18,707円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年7月23日 至平成28年7月22日)	(自平成28年7月23日 至平成29年7月24日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24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	1,008,336,364	328,081,259
合計	1,008,336,364	328,081,259

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1861	熊谷組	1,463,000	384.00	561,792,000	
1893	五洋建設	789,000	662.00	522,318,000	
2201	森永製菓	52,000	6,690.00	347,880,000	
2502	アサヒグループホールディングス	77,000	4,419.00	340,263,000	
2802	味の素	143,000	2,409.50	344,558,500	
2815	アリアケジャパン	25,000	7,990.00	199,750,000	
4004	昭和電工	139,000	3,140.00	436,460,000	
4005	住友化学	500,000	678.00	339,000,000	
4186	東京応化工業	220,000	3,685.00	810,700,000	
4612	日本ペイントホールディングス	78,000	4,340.00	338,520,000	
4911	資生堂	85,000	3,942.00	335,070,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	124,000	2,941.00	364,684,000	

4516	日本新薬	26,000	7,130.00	185,380,000	
4587	ペプチドリーム	198,600	3,490.00	693,114,000	
5301	東海カーボン	781,000	747.00	583,407,000	
5706	三井金属鉱業	1,481,000	488.00	722,728,000	
5741	U A C J	1,069,000	328.00	350,632,000	
5802	住友電気工業	195,000	1,738.00	338,910,000	
3436	S U M C O	458,000	1,809.00	828,522,000	
6134	富士機械製造	115,000	1,826.00	209,990,000	
6146	ディスコ	27,700	19,980.00	553,446,000	
6222	島精機製作所	35,000	5,900.00	206,500,000	
6273	S M C	14,000	35,930.00	503,020,000	
6305	日立建機	120,000	2,981.00	357,720,000	
6367	ダイキン工業	48,000	11,870.00	569,760,000	
6506	安川電機	186,000	2,844.00	528,984,000	
6592	マブチモーター	60,000	5,710.00	342,600,000	
6594	日本電産	45,000	11,730.00	527,850,000	
6645	オムロン	65,000	5,200.00	338,000,000	
6724	セイコーエプソン	127,000	2,620.00	332,740,000	
6728	アルバック	58,000	5,960.00	345,680,000	
6817	スミダコーポレーション	84,000	2,292.00	192,528,000	
6861	キーエンス	10,300	51,360.00	529,008,000	
6941	山一電機	182,000	2,195.00	399,490,000	
6952	カシオ計算機	100,000	1,778.00	177,800,000	
6954	ファナック	31,200	22,490.00	701,688,000	
6963	ローム	41,000	9,230.00	378,430,000	
7276	小糸製作所	58,400	5,870.00	342,808,000	
8035	東京エレクトロン	53,000	16,280.00	862,840,000	
7205	日野自動車	240,000	1,206.00	289,440,000	
7242	K Y B	627,000	637.00	399,399,000	
7267	本田技研工業	111,000	3,042.00	337,662,000	
7269	スズキ	157,000	5,301.00	832,257,000	
7270	S U B A R U	90,400	4,006.00	362,142,400	
7272	ヤマハ発動機	110,000	2,801.00	308,110,000	
4543	テルモ	75,000	4,240.00	318,000,000	
7701	島津製作所	156,000	2,198.00	342,888,000	
7747	朝日インテック	100,000	4,970.00	497,000,000	
7867	タカラトミー	230,000	1,411.00	324,530,000	
7951	ヤマハ	93,000	3,975.00	369,675,000	
7974	任天堂	17,600	36,240.00	637,824,000	
9508	九州電力	254,600	1,329.00	338,363,400	
9024	西武ホールディングス	250,000	1,941.00	485,250,000	
9048	名古屋鉄道	334,000	508.00	169,672,000	
9086	日立物流	139,000	2,447.00	340,133,000	
9090	丸和運輸機関	49,000	3,900.00	191,100,000	
3660	アイスタイル	304,000	759.00	230,736,000	
8056	日本ユニシス	175,000	1,916.00	335,300,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	95,800	3,630.00	347,754,000	
9719	S C S K	70,000	5,090.00	356,300,000	
9984	ソフトバンクグループ	150,000	9,256.00	1,388,400,000	
8058	三菱商事	198,000	2,385.00	472,230,000	
3092	スタートトゥデイ	119,000	2,940.00	349,860,000	
8174	日本瓦斯	49,000	3,680.00	180,320,000	
9843	ニトリホールディングス	16,100	14,960.00	240,856,000	
9983	ファーストリテイリング	11,600	33,100.00	383,960,000	
9997	ペルーナ	132,000	1,294.00	170,808,000	
8303	新生銀行	1,637,000	184.00	301,208,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,888,700	705.40	1,332,288,980	
8308	りそなホールディングス	560,000	566.30	317,128,000	
8358	スルガ銀行	121,000	2,702.00	326,942,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	325,000	1,915.00	622,375,000	
8750	第一生命ホールディングス	88,000	1,931.00	169,928,000	
8766	東京海上ホールディングス	100,000	4,690.00	469,000,000	
8795	T & Dホールディングス	103,000	1,631.50	168,044,500	
8515	アイフル	419,000	395.00	165,505,000	
8591	オリックス	242,000	1,750.50	423,621,000	
8801	三井不動産	65,000	2,534.00	164,710,000	
8804	東京建物	222,000	1,496.00	332,112,000	
2331	総合警備保障	65,000	4,935.00	320,775,000	
2413	エムスリー	113,000	3,065.00	346,345,000	
2427	アウトソーシング	78,000	5,680.00	443,040,000	
4801	セントラルスポーツ	18,000	4,745.00	85,410,000	
6534	D . A . コンソーシアムホールディングス	167,000	1,572.00	262,524,000	

合計	19,930,000		34,295,496,780
----	------------	--	----------------

(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。

「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28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	144,529,401	154,591,132
国債証券	6,023,327,000	5,601,913,000
社債券	3,465,648,000	3,537,531,000
未収入金		31,219,500
未収利息	20,045,854	19,951,403
前払費用	1,071,905	456,461
流動資産合計	9,654,622,160	9,345,662,496
資産合計	9,654,622,160	9,345,662,496
負債の部		
流動負債		
未払金		13,596,900
未払解約金	1,698,239	34,507,069
未払利息	164	289
流動負債合計	1,698,403	48,104,258
負債合計	1,698,403	48,104,258
純資産の部		
元本等		
元本	6,483,610,898	6,414,967,492
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,169,312,859	2,882,590,746
元本等合計	9,652,923,757	9,297,558,238
純資産合計	9,652,923,757	9,297,558,238
負債純資産合計	9,654,622,160	9,345,662,496

(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	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 期首	平成27年7月23日	平成28年7月23日
期首元本額	6,983,243,582円	6,483,610,898円
期首からの追加設定元本額	1,367,951,054円	1,013,514,155円
期首からの一部解約元本額	1,867,583,738円	1,082,157,561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	1,344,898,488円	1,655,317,400円
三菱UFJ 日本債券ファンドF(適格機関投資家限 定)	87,924,416円	82,710,274円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	191,266,778円	187,628,546円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	438,063,598円	330,329,311円
三菱UFJ グローバルバランスVA	168,239,642円	106,847,114円
三菱UFJ 日本バランス20	174,194,029円	156,442,015円
三菱UFJ 日本バランス50	134,391,203円	116,069,502円
三菱UFJ 国内バランス20	1,998,397,279円	1,871,662,412円
三菱UFJ 国内バランス50	251,387,486円	239,602,823円
三菱UFJ <DC>日本債券ファンド	1,220,066,506円	1,180,469,534円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス20型	178,132,392円	178,578,089円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス40型	185,450,388円	189,307,469円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス60型	111,198,693円	120,003,003円

(合計)	6,483,610,898円	6,414,967,492円
2 受益権の総数	6,483,610,898口	6,414,967,492口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4888円 (14,888円)	1.4494円 (14,494円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年7月23日 至平成28年7月22日)	(自平成28年7月23日 至平成29年7月24日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24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	508,107,700	280,253,200
社債券	1,288,000	18,671,000
合計	509,395,700	298,924,200

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第5回利付国債(40年)	90,000,000	117,702,900	
	第7回利付国債(40年)	50,000,000	60,855,500	
	第10回利付国債(40年)	10,000,000	9,526,700	
	第325回利付国債(10年)	80,000,000	83,556,000	
	第326回利付国債(10年)	100,000,000	104,091,000	
	第330回利付国債(10年)	80,000,000	84,144,800	
	第332回利付国債(10年)	50,000,000	52,037,000	
	第333回利付国債(10年)	180,000,000	187,554,600	
	第334回利付国債(10年)	160,000,000	166,912,000	

第335回利付国債(10年)	120,000,000	124,470,000	
第336回利付国債(10年)	100,000,000	103,816,000	
第338回利付国債(10年)	120,000,000	123,718,800	
第339回利付国債(10年)	140,000,000	144,366,600	
第340回利付国債(10年)	60,000,000	61,906,200	
第341回利付国債(10年)	40,000,000	40,939,200	
第342回利付国債(10年)	100,000,000	100,647,000	
第343回利付国債(10年)	100,000,000	100,576,000	
第344回利付国債(10年)	10,000,000	10,050,100	
第345回利付国債(10年)	40,000,000	40,186,800	
第23回利付国債(30年)	50,000,000	67,678,000	
第26回利付国債(30年)	60,000,000	80,324,400	
第27回利付国債(30年)	10,000,000	13,587,000	
第28回利付国債(30年)	50,000,000	68,079,500	
第29回利付国債(30年)	10,000,000	13,467,200	
第30回利付国債(30年)	60,000,000	79,849,200	
第31回利付国債(30年)	20,000,000	26,283,000	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	53,558,800	
第33回利付国債(30年)	10,000,000	12,781,100	
第34回利付国債(30年)	80,000,000	105,851,200	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	77,044,800	
第37回利付国債(30年)	30,000,000	37,902,000	
第39回利付国債(30年)	60,000,000	75,952,800	
第42回利付国債(30年)	80,000,000	97,638,400	
第44回利付国債(30年)	20,000,000	24,423,800	
第46回利付国債(30年)	80,000,000	93,740,000	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	35,883,600	
第48回利付国債(30年)	10,000,000	11,457,600	
第49回利付国債(30年)	20,000,000	22,909,800	
第50回利付国債(30年)	30,000,000	29,757,000	
第52回利付国債(30年)	20,000,000	18,236,600	
第53回利付国債(30年)	30,000,000	28,103,400	
第80回利付国債(20年)	100,000,000	116,546,000	
第84回利付国債(20年)	50,000,000	58,304,500	
第86回利付国債(20年)	10,000,000	11,963,400	
第88回利付国債(20年)	50,000,000	60,076,000	
第90回利付国債(20年)	90,000,000	107,729,100	
第92回利付国債(20年)	90,000,000	107,316,900	
第94回利付国債(20年)	40,000,000	47,874,400	
第96回利付国債(20年)	30,000,000	36,023,700	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	84,325,500	
第99回利付国債(20年)	100,000,000	120,840,000	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,676,800	
第103回利付国債(20年)	20,000,000	24,744,800	
第105回利付国債(20年)	20,000,000	24,385,200	
第108回利付国債(20年)	30,000,000	36,006,600	
第111回利付国債(20年)	40,000,000	49,646,000	
第114回利付国債(20年)	150,000,000	185,389,500	
第116回利付国債(20年)	30,000,000	37,518,000	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	99,775,200	
第125回利付国債(20年)	190,000,000	239,850,300	
第128回利付国債(20年)	50,000,000	61,206,500	
第130回利付国債(20年)	40,000,000	48,475,200	
第132回利付国債(20年)	40,000,000	47,996,400	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,926,400	
第140回利付国債(20年)	90,000,000	108,341,100	
第141回利付国債(20年)	60,000,000	72,260,400	
第145回利付国債(20年)	60,000,000	72,364,200	
第146回利付国債(20年)	10,000,000	12,064,000	
第147回利付国債(20年)	100,000,000	119,113,000	
第148回利付国債(20年)	110,000,000	129,290,700	
第150回利付国債(20年)	100,000,000	115,866,000	
第152回利付国債(20年)	100,000,000	112,446,000	
第153回利付国債(20年)	30,000,000	34,224,300	
第154回利付国債(20年)	100,000,000	112,304,000	
第155回利付国債(20年)	50,000,000	54,350,000	
第158回利付国債(20年)	50,000,000	49,566,500	
第159回利付国債(20年)	80,000,000	80,560,000	
国債証券 小計	4,860,000,000	5,601,913,000	
社債券			
第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	101,027,000	
第2回エイチエスピーシー・ホールディングス	100,000,000	102,365,000	
第1回ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー	100,000,000	100,899,000	

第9回モルガン・スタンレー	100,000,000	100,318,000
第17回ルノー	100,000,000	100,789,000
第19回ルノー	200,000,000	200,016,000
第1回ソシエテ ジェネラル円貨社債（2017）	100,000,000	100,327,000
第10回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,807,000
第4回富士フイルムホールディングス	100,000,000	99,675,000
第50回日本電気	100,000,000	99,928,000
第12回パナソニック	200,000,000	201,304,000
第15回パナソニック	200,000,000	199,884,000
第10回デンソー	100,000,000	100,048,000
第28回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	200,000,000	209,422,000
第20回みずほ銀行（劣後特約付）	200,000,000	211,404,000
第38回日産フィナンシャルサービス	100,000,000	99,593,000
第64回アコム	100,000,000	100,694,000
第163回オリックス	100,000,000	100,021,000
第167回オリックス	100,000,000	100,167,000
第26回三菱UFJリース	100,000,000	100,558,000
第19回大和証券グループ本社	200,000,000	200,782,000
第39回野村ホールディングス	200,000,000	200,886,000
第43回野村ホールディングス	200,000,000	201,010,000
第54回三井不動産	100,000,000	99,693,000
第469回東北電力	100,000,000	107,290,000
第450回九州電力	100,000,000	99,636,000
第2回ファーストリテイリング	100,000,000	99,988,000
社債券 小計	3,500,000,000	3,537,531,000
合計	8,360,000,000	9,139,444,000

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。

「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28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,547,757	106,915,842
コール・ローン	263,662,898	95,908,487
株式	6,181,210,912	7,776,076,446
未収入金		51,676,082
未収配当金	9,929,130	10,805,031
流動資産合計	6,458,350,697	8,041,381,888
資産合計	6,458,350,697	8,041,381,888
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,459,294	14,174,481
未払利息	300	179
流動負債合計	11,459,594	14,174,660
負債合計	11,459,594	14,174,660
純資産の部		
元本等		
元本	3,441,268,545	3,445,023,087
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,005,622,558	4,582,184,141
元本等合計	6,446,891,103	8,027,207,228
純資産合計	6,446,891,103	8,027,207,228
負債純資産合計	6,458,350,697	8,041,381,888

(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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。
---------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 期首	平成27年7月23日	平成28年7月23日
期首元本額	3,129,130,209円	3,441,268,545円
期首からの追加設定元本額	575,759,236円	328,719,009円
期首からの一部解約元本額	263,620,900円	324,964,467円
元本の内訳*		
三菱UFJ D C金利連動アロケーション型バランスファンド	567,253,821円	510,442,827円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	106,989,477円	77,498,668円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	95,538,480円	51,162,250円
三菱UFJ グローバルバランスVA	35,795,246円	16,509,119円
三菱UFJ <DC>海外株式オープン	2,520,738,488円	2,703,056,573円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	12,909,324円	7,977,782円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	39,582,416円	29,132,472円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	62,461,293円	49,243,396円
(合計)	3,441,268,545円	3,445,023,087円
2 受益権の総数	3,441,268,545口	3,445,023,087口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8734円 (18,734円)	2.3301円 (23,301円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年7月23日 至平成28年7月22日)	(自平成28年7月23日 至平成29年7月24日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24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	19,713,219	202,604,675
合計	19,713,219	202,604,675

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	3M CO	6,341	211.160000	1,338,965.56	
	ABBVIE INC	14,582	74.630000	1,088,254.66	
	ALTRIA GROUP INC	37,998	73.420000	2,789,813.16	
	CISCO SYSTEMS INC	58,527	31.840000	1,863,499.68	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,821	34.480000	717,908.08	
	COCA-COLA CO/THE	39,272	45.030000	1,768,418.16	
	GENUINE PARTS CO	20,800	82.710000	1,720,368.00	
	H&R BLOCK INC	56,963	29.800000	1,697,497.40	
	INTERNATIONAL PAPER CO	30,784	56.640000	1,743,605.76	
	JOHNSON & JOHNSON	17,953	135.310000	2,429,220.43	
	M & T BANK CORP	6,767	158.110000	1,069,930.37	
	MICROSOFT CORP	19,278	73.790000	1,422,523.62	
	PEPSICO INC	12,418	116.630000	1,448,311.34	
	PFIZER INC	61,036	33.480000	2,043,485.28	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	20,191	119.580000	2,414,439.78	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	16,456	88.610000	1,458,166.16	
	REYNOLDS AMERICAN INC	4,899	66.890000	327,694.11	
	TELUS CORP	57,409	36.040000	2,069,020.36	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,344	112.680000	827,521.92	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	6,469	123.490000	798,856.81	
	US BANCORP	20,933	52.120000	1,091,027.96	
	WELLS FARGO & CO	20,554	54.170000	1,113,410.18	
	アメリカドル 小計	557,795		33,241,938.78 (3,685,866,171)	
カナダドル					
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	42,580	65.890000	2,805,596.20	
	カナダドル 小計	42,580		2,805,596.20 (247,958,592)	
オーストラリアドル					
	ANSELL LTD	58,374	22.210000	1,296,486.54	
	SONIC HEALTHCARE LTD	54,750	22.670000	1,241,182.50	
	オーストラリアドル 小計	113,124		2,537,669.04 (222,604,328)	
イギリスポンド					
	ASTRAZENECA PLC	38,277	51.520000	1,972,031.04	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	43,495	54.850000	2,385,700.75	
	DIAGEO PLC	35,954	22.855000	821,728.67	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	62,972	16.150000	1,016,997.80	
	IMPERIAL BRANDS PLC	61,437	34.970000	2,148,451.89	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	662,702	0.681100	451,366.33	
	イギリスポンド 小計	904,837		8,796,276.48 (1,269,302,696)	
スイスフラン					
	GIVAUDAN-REG	559	1,921.000000	1,073,839.00	
	NESTLE SA-REG	21,959	82.600000	1,813,813.40	
	NOVARTIS AG-REG	27,431	80.300000	2,202,709.30	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,651	244.000000	890,844.00	
	SGS SA-REG	363	2,214.000000	803,682.00	
	スイスフラン 小計	53,963		6,784,887.70 (795,053,140)	
香港ドル					
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	173,000	25.850000	4,472,050.00	
	SANDS CHINA LTD	158,000	36.000000	5,688,000.00	
	香港ドル 小計	331,000		10,160,050.00 (144,272,710)	
スウェーデンクローネ					
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,142	123.100000	8,142,080.20	

スウェーデンクローネ 小計	66,142		8,142,080.20 (109,510,978)
デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	18,592	273.300000	5,081,193.60
デンマーククローネ 小計	18,592		5,081,193.60 (88,412,768)
ニュー台湾ドル			
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	353,000	73.500000	25,945,500.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	187,000	214.000000	40,018,000.00
ニュー台湾ドル 小計	540,000		65,963,500.00 (240,766,775)
ユーロ			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	6,738	98.500000	663,693.00
BPOST SA	14,721	21.730000	319,887.33
DEUTSCHE POST AG-REG	50,126	33.070000	1,657,666.82
HEINEKEN NV	9,180	87.860000	806,554.80
KONE OYJ-B	28,947	43.800000	1,267,878.60
SANOFI	18,945	81.520000	1,544,396.40
UNILEVER NV-CVA	25,297	49.665000	1,256,375.50
ユーロ 小計	153,954		7,516,452.45 (972,328,288)
合計	2,781,987		7,776,076,446 (7,776,076,446)

(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 22銘柄	100.00%	47.40%
カナダドル	株式 1銘柄	100.00%	3.19%
オーストラリアドル	株式 2銘柄	100.00%	2.86%
イギリスポンド	株式 6銘柄	100.00%	16.32%
スイスフラン	株式 5銘柄	100.00%	10.22%
香港ドル	株式 2銘柄	100.00%	1.86%
スウェーデンクローネ	株式 1銘柄	100.00%	1.41%
デンマーククローネ	株式 1銘柄	100.00%	1.14%
ニュー台湾ドル	株式 2銘柄	100.00%	3.10%
ユーロ	株式 7銘柄	100.00%	12.50%

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。

「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28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,503,603,149	765,900,606
コール・ローン	169,039,087	95,755,488
国債証券	42,528,377,780	40,605,872,993
特殊債券	534,247,240	548,536,665
社債券	904,213,318	1,623,727,144
未収入金	2,673,162,273	
未収利息	310,077,882	337,317,631
前払費用	70,156,436	226,597,272
流動資産合計	48,692,877,165	44,203,707,799
資産合計	48,692,877,165	44,203,707,799
負債の部		
流動負債		
未払金	3,629,544,592	
未払解約金	26,330,169	37,707,054

未払利息	192	179
流動負債合計	3,655,874,953	37,707,233
負債合計	3,655,874,953	37,707,233
純資産の部		
元本等		
元本	16,386,988,279	15,187,179,248
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,650,013,933	28,978,821,318
元本等合計	45,037,002,212	44,166,000,566
純資産合計	45,037,002,212	44,166,000,566
負債純資産合計	48,692,877,165	44,203,707,799

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

（貸借対照表に関する注記）

	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 期首	平成27年7月23日	平成28年7月23日
期首元本額	20,484,147,647円	16,386,988,279円
期首からの追加設定元本額	934,552,140円	1,288,925,853円
期首からの一部解約元本額	5,031,711,508円	2,488,734,884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）	6,688,214,801円	5,603,875,165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	370,446,936円	412,358,313円
三菱UFJ ライフプラン 25	29,350,709円	25,499,632円
三菱UFJ ライフプラン 50	56,421,188円	51,806,729円
三菱UFJ ライフプラン 75	17,629,955円	14,632,502円
三菱UFJ 海外債券オープン	3,413,532,968円	3,479,260,249円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式20型	56,032,740円	
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式40型	27,569,644円	
三菱UFJ 海外債券オープン（3ヵ月決算型）	4,313,751,445円	3,970,751,465円
三菱UFJ ライフプラン 50VA（適格機関投資家限定）	80,413,660円	54,415,599円
三菱UFJ 海外債券オープンVA（適格機関投資家限定）	140,151,039円	126,518,448円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA（適格機関投資家限定）	399,650,596円	255,008,963円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA（適格機関投資家限定）	793,822,598円	723,126,658円
三菱UFJ 国際 海外債券オープン（適格機関投資家限定）		469,925,525円
（合計）	16,386,988,279円	15,187,179,248円
2 受益権の総数	16,386,988,279口	15,187,179,248口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7483円 (27,483円)	2.9081円 (29,081円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成27年7月23日 至平成28年7月22日）	（自平成28年7月23日 至平成29年7月24日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	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
	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24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	1,417,388,864	143,653,186
特殊債券	6,051,369	6,747,048
社債券	9,653,014	18,752,580
合計	1,433,093,247	169,152,814

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通 貨		券面総額	評 価 額	備考
種 類	銘 柄			
アメリカドル				
国債証券	0.75 T-NOTE 171231	34,000,000.00	33,944,218.75	
	1.25 T-NOTE 210331	4,000,000.00	3,945,312.50	
	1.625 T-NOTE 190630	15,000,000.00	15,082,031.25	
	1.625 T-NOTE 260215	3,000,000.00	2,869,687.50	
	1.75 T-NOTE 230515	16,000,000.00	15,846,250.00	
	2 T-NOTE 250815	21,000,000.00	20,771,953.12	
	2.75 T-NOTE 240215	2,000,000.00	2,091,875.00	
	3 T-BOND 451115	2,000,000.00	2,077,812.50	
	3.125 T-BOND 430215	3,000,000.00	3,195,468.75	
	3.125 T-BOND 440815	3,000,000.00	3,197,109.37	
	3.875 T-BOND 400815	7,000,000.00	8,398,359.37	
	4.5 T-BOND 360215	4,000,000.00	5,196,875.00	
	4.75 T-BOND 410215	5,000,000.00	6,783,203.12	
	国債証券 小 計		119,000,000.00	123,400,156.23 (13,682,609,322)
特殊債券	1.625 BK NEDERLAN 210419	5,000,000.00	4,947,120.00	
	特殊債券 小 計		5,000,000.00	4,947,120.00 (548,536,665)
社債券	2.7 GENERAL ELECT 221009	4,000,000.00	4,099,596.00	
	3.875 COOPERATIEV 220208	4,000,000.00	4,265,472.00	
社債券 小 計		8,000,000.00	8,365,068.00 (927,518,739)	

アメリカドル 小計		132,000,000.00	136,712,344.23 (15,158,664,726)
カナダドル			
国債証券	2.25 CAN GOVT 250601	100,000.00	103,697.00
	国債証券 小計	100,000.00	103,697.00 (9,164,740)
カナダドル 小計		100,000.00	103,697.00 (9,164,740)
オーストラリアドル			
国債証券	3.25 AUST GOVT 250421	9,100,000.00	9,557,720.90
	国債証券 小計	9,100,000.00	9,557,720.90 (838,403,277)
オーストラリアドル 小計		9,100,000.00	9,557,720.90 (838,403,277)
イギリスポンド			
国債証券	2.25 GILT 230907	600,000.00	656,079.00
	4.25 GILT 551207	1,400,000.00	2,405,883.20
	4.75 GILT 200307	1,500,000.00	1,677,525.00
	6 GILT 281207	1,300,000.00	1,955,642.00
	国債証券 小計	4,800,000.00	6,695,129.20 (966,107,143)
イギリスポンド 小計		4,800,000.00	6,695,129.20 (966,107,143)
シンガポールドル			
国債証券	3.25 SINGAPORGVOT 200901	600,000.00	635,040.00
	3.5 SINGAPORGVOT 270301	1,200,000.00	1,351,002.00
	国債証券 小計	1,800,000.00	1,986,042.00 (161,703,539)
シンガポールドル 小計		1,800,000.00	1,986,042.00 (161,703,539)
マレーシアリングギット			
国債証券	3.502MALAYSIAGOV 270531	3,000,000.00	2,842,179.00
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	1,000,000.00	1,010,756.00
	国債証券 小計	4,000,000.00	3,852,935.00 (99,752,487)
マレーシアリングギット 小計		4,000,000.00	3,852,935.00 (99,752,487)
スウェーデンクローネ			
国債証券	1 SWD GOVT 261112	16,000,000.00	16,560,544.00
	1.5 SWD GOVT 231113	24,000,000.00	25,986,312.00
	3.5 SWD GOVT 390330	7,000,000.00	9,543,289.00
	5 SWD GOVT 201201	34,000,000.00	40,202,416.00
	国債証券 小計	81,000,000.00	92,292,561.00 (1,241,334,945)
スウェーデンクローネ 小計		81,000,000.00	92,292,561.00 (1,241,334,945)
ノルウェークローネ			
国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	5,000,000.00	5,104,200.00
	3.75 NORWE GOVT 210525	4,000,000.00	4,423,992.00
	国債証券 小計	9,000,000.00	9,528,192.00 (131,203,203)
ノルウェークローネ 小計		9,000,000.00	9,528,192.00 (131,203,203)
メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	115,000,000.00	136,632,650.00
	5 MEXICAN BONOS 191211	94,000,000.00	90,479,700.00
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	60,000,000.00	59,569,200.00
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	70,000,000.00	79,739,100.00
	国債証券 小計	339,000,000.00	366,420,650.00 (2,304,785,888)
メキシコペソ 小計		339,000,000.00	366,420,650.00 (2,304,785,888)
ポーランドズロチ			
国債証券	3.25 POLAND 250725	17,000,000.00	17,165,750.00
	5.25 POLAND 171025	3,000,000.00	3,030,000.00
	5.25 POLAND 201025	16,000,000.00	17,552,000.00
	5.75 POLAND 220923	11,000,000.00	12,629,100.00
	国債証券 小計	47,000,000.00	50,376,850.00 (1,528,433,629)
ポーランドズロチ 小計		47,000,000.00	50,376,850.00 (1,528,433,629)
南アフリカランド			
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	5,000,000.00	5,635,350.00

	6.25 SOUTH AFRICA 360331	21,000,000.00	15,130,626.00
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	6,000,000.00	5,999,934.00
	国債証券 小計	32,000,000.00	26,765,910.00 (229,383,848)
	南アフリカランド 小計	32,000,000.00	26,765,910.00 (229,383,848)
	ユーロ		
国債証券	0.25 NETH GOVT 250715	7,000,000.00	6,964,594.00
	0.5 BUND 260215	2,000,000.00	2,036,328.00
	1 IRISH GOVT 260515	2,000,000.00	2,034,788.00
	1 O.A.T 270525	3,000,000.00	3,072,045.00
	1.25 O.A.T 360525	3,000,000.00	2,912,700.00
	1.6 BEL GOVT 470622	1,000,000.00	958,329.00
	1.75 O.A.T 230525	5,000,000.00	5,489,575.00
	2 IRISH GOVT 450218	5,000,000.00	5,138,400.00
	2 ITALY GOVT 251201	10,000,000.00	10,147,620.00
	2.4 IRISH GOVT 300515	4,000,000.00	4,552,400.00
	4.25 ITALY GOVT 200301	8,000,000.00	8,862,968.00
	4.3 SPAIN GOVT 191031	15,000,000.00	16,567,800.00
	4.5 BEL GOVT 260328	1,500,000.00	2,013,751.50
	4.75 BUND 340704	3,000,000.00	4,813,482.00
	4.75 ITALY GOVT 280901	10,000,000.00	12,471,500.00
	4.9 SPAIN GOVT 400730	7,000,000.00	9,951,221.00
	5 ITALY GOVT 400901	4,000,000.00	5,268,200.00
	5.5 ITALY GOVT 220901	10,000,000.00	12,289,500.00
	5.5 SPAIN GOVT 210430	9,000,000.00	10,853,145.00
	5.9 SPAIN GOVT 260730	17,000,000.00	23,671,157.00
	国債証券 小計	126,500,000.00	150,069,503.50 (19,412,990,972)
社債券	2.25 BNP PARIBAS 210113	5,000,000.00	5,381,945.00
	社債券 小計	5,000,000.00	5,381,945.00 (696,208,405)
	ユーロ 小計	131,500,000.00	155,451,448.50 (20,109,199,377)
	合計		42,778,136,802 (42,778,136,802)

(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 13銘柄	90.26%	31.99%
	特殊債券 1銘柄	3.62%	1.28%
	社債券 2銘柄	6.12%	2.17%
カナダドル	国債証券 1銘柄	100.00%	0.02%
オーストラリアドル	国債証券 1銘柄	100.00%	1.96%
イギリスポンド	国債証券 4銘柄	100.00%	2.26%
シンガポールドル	国債証券 2銘柄	100.00%	0.38%
マレーシアリングgit	国債証券 2銘柄	100.00%	0.23%
スウェーデンクローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	2.90%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.00%	0.31%
メキシコペソ	国債証券 4銘柄	100.00%	5.39%
ポーランドズロチ	国債証券 4銘柄	100.00%	3.57%
南アフリカランド	国債証券 3銘柄	100.00%	0.54%
ユーロ	国債証券 20銘柄	96.54%	45.38%
	社債券 1銘柄	3.46%	1.63%

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。

「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28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	253,130,765	39,389,233
国債証券	83,766,750	
特殊債券	300,111,000	
社債券	1,282,358,524	
現先取引勘定	3,999,999,616	1,299,999,631
未収利息	3,371,582	
前払費用	588,289	
流動資産合計	5,923,326,526	1,339,388,864
資産合計	5,923,326,526	1,339,388,864
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,569,656	31,390
未払利息	288	73
流動負債合計	1,569,944	31,463
負債合計	1,569,944	31,463
純資産の部		
元本等		
元本	5,814,879,238	1,315,177,497
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	106,877,344	24,179,904
元本等合計	5,921,756,582	1,339,357,401
純資産合計	5,921,756,582	1,339,357,401
負債純資産合計	5,923,326,526	1,339,388,864

（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	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 期首	平成27年7月23日	平成28年7月23日
期首元本額	1,689,112,720円	5,814,879,238円
期首からの追加設定元本額	28,339,636,806円	1,140,392,425円
期首からの一部解約元本額	24,213,870,288円	5,640,094,166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	250,421,471円	297,443,441円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド（毎月決算型）	5,226,135円	5,226,135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）	8,898,354円	8,898,354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）	1,628,029円	1,048,688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）	101,543円	62,265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）	47,179,877円	31,213,655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）	94,134,350円	94,134,350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）	233,263円	635,856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）	4,757,576円	3,078,471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>	328,959,642円	260,435,778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）	89,620円	89,620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）	1,033,322円	1,033,322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	2,017,012円	2,383,778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）	212,322円	212,322円
PI MCO ニューワールド円インカムファンド（毎月分配型）	26,506,400円	26,506,400円
PI MCO ニューワールド米ドルインカムファンド（毎月分配型）	2,272,200円	2,272,200円
PI MCO 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）	15,211,722円	15,211,722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)	457,302円	457,302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)	358,088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)	2,100,667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)	3,836,590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)	383,682円	393,503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<マネーパールファンド>	6,333,714円	5,793,295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)	13,745,897円	9,071,898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)	3,037,917円	2,016,707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)	1,970,066円	1,970,066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)	43,682,881円	43,682,881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)	217,654円	551,512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)	407,171円	407,171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<マネーパールファンド>	27,424,668円	78,327,428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	1,364,852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)	945,824円	600,566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)	2,576,702円	1,647,957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)	3,148,614円	3,148,614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<マネーパールファンド>	3,491,807円	3,491,435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)	47,026,508円	31,208,972円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	1,285,463円	756,099円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	1,147,224円	684,529円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	1,068円	
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	10,884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	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	98,368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)	20,181,510円	12,561,714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回分配型)	109,209円	69,931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)	158,381円	158,381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)	20,660円	20,660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>(年2回分配型)	40,278円	40,278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)	955,887円	955,887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)	1,559,264円	1,559,264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)	442,974円	924,121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	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	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	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	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	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)	12,234,366円	12,234,366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)	554,804円	348,598円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	1,936,118円	1,936,118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	9,829円	9,829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	9,834,580円	9,834,580円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	20,551,717円	13,128,307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	3,730,759円	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	5,059,469円	14,819,878円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	2,347,787円	3,123,514円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	163,666円	2,863,981円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>(毎月分配型)	3,908,079円	24,184,985円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(年2回分配型)	3,737,703円	3,737,703円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(年2回分配型)	6,435,081円	4,117,720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(年2回分配型)	686,803円	686,803円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(年2回分配型)	1,590,082円	961,645円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(年2回分配型)	608,110円	608,110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(年2回分配型)	46,726円	243,113円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>(年2回分配型)	581,687円	1,809,102円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドA>	27,478,863円	11,900,109円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドB>	979,547円	979,545円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(毎月決算型)	3,730,849円	8,473,583円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,859,081円	8,859,081円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(年1回決算型)	1,168,184円	2,464,335円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	2,065,331円	2,065,331円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Cコース(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	983円	983円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11(円ヘッジ)(限定追加型)	982,608円	
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(毎月分配型)	2,827,156円	5,920,244円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	9,387,547円	9,387,547円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド2014	256,356円	256,356円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	3,545,187円	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,124,755円	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>(年1回決算型)	2,990,177円	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	3,377,211円	3,377,211円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	357,495円	8,478,079円

PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(年2回分配型)	168,922円	2,034,594円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	3,874,252円	8,067,104円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	658,018円	1,551,577円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	9,991,470円	20,075,917円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	1,616,484円	1,616,484円
三菱UFJ/AMP オーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム(毎月決算型)	25,537,767円	25,537,767円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム(毎月分配型)	42,906,570円	25,781,668円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム(年2回分配型)	4,824,746円	3,165,280円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(毎月分配型)	10,804円	128,636円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(年2回分配型)	10,804円	79,540円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	1,375,824円	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	1,071,396円	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド(ラップ向け)	491,015円	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	564,702円	564,702円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	138,468円	89,371円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	983円	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	983円	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJ リート不動産株ファンド<米ドル投資型>(3ヵ月決算型)	3,063,931円	3,063,931円
三菱UFJ リート不動産株ファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	6,324,266円	6,324,266円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820円	9,820円
スマート・プロテクター90(限定追加型)2016-12		6,313,826円
米国政策テーマ株式オープン(為替ヘッジあり)		412,412円
米国政策テーマ株式オープン(為替ヘッジなし)		1,188,139円
スマート・プロテクター90オープン		981,933円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(資産成長型)		30,440円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(資産成長型)		118,814円
Navigo インド債券ファンド	885,566円	885,566円
Navigo マネープールファンド	2,488,307円	2,451,461円
三菱UFJ インド債券オープン(毎月決算型)	39,351円	39,351円
三菱UFJ グローバル好利回りCBファンド2013-09(円ヘッジ)(限定追加型)	638,275,376円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,276,286,700円	
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	42,678,508円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	365,273,064円	
三菱UFJ/AMP オーストラリアREITファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	11,293,333円	11,293,333円
バンクローンファンドUSA(為替ヘッジあり)2014-08	11,276,260円	
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,897,857円	9,992,715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)	7,331,857円	3,743,971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)	174,754,174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)	10,766,608円	10,766,608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)	21,620,196円	21,620,196円

(合計)	5,814,879,238円	1,315,177,497円
2 受益権の総数	5,814,879,238口	1,315,177,497口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0184円 (10,184円)	1.0184円 (10,184円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成27年7月23日 至平成28年7月22日)	(自平成28年7月23日 至平成29年7月24日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	売買目的有価証券は、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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成28年7月22日現在]	[平成29年7月24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	34,337	
特殊債券	201,000	
社債券	1,676,016	
合計	1,911,353	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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。

2【ファンドの現況】

【三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンド】

【純資産額計算書】

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	6,323,398,954
負債総額	2,721,988
純資産総額(-)	6,320,676,966
発行済口数	4,802,077,666 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3162 (1万口当たり 13,162)

(参考)

三菱UFJ 日本株アクティブマザーファンド

純資産額計算書

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	34,619,356,178
負債総額	131,533,037
純資産総額(-)	34,487,823,141
発行済口数	18,593,275,655 口
1口当たり純資産価額(/)	1.8549 (1万口当たり 18,549)

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	9,457,742,272
負債総額	130,863,151
純資産総額(-)	9,326,879,121
発行済口数	6,437,423,852 口
1口当たり純資産価額(/)	1.4489 (1万口当たり 14,489)

外国株式マザーファンド

純資産額計算書

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	7,965,149,892
負債総額	78,767,371
純資産総額(-)	7,886,382,521
発行済口数	3,460,357,908 口
1口当たり純資産価額(/)	2.2791 (1万口当たり 22,791)

三菱UFJ 海外債券アクティブマザーファンド

純資産額計算書

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	44,061,808,496
負債総額	25,226,583
純資産総額(-)	44,036,581,913
発行済口数	15,203,548,120 口
1口当たり純資産価額(/)	2.8965 (1万口当たり 28,965)

マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

平成29年7月31日現在
(単位：円)

資産総額	1,250,084,553
負債総額	1,216
純資産総額(-)	1,250,083,337
発行済口数	1,227,517,069 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0184 (1万口当たり 10,184)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

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

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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

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

数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【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29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、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。平成29年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	824	10,899,072
追加型公社債投資信託	16	1,409,840
単位型株式投資信託	52	390,995
単位型公社債投資信託	1	6,385
合計	893	12,706,291

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表の作成方法について

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

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

(2) 監査証明について

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(単位：千円)

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

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

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

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

ります。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

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

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

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

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

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

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

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

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

未払費用

442,340千円

456,748千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

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

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

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

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

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

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

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

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

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金

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

（リース取引関係）

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第31期(平成28年3月31日現在)

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

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

となる項目については()で表示しております。

第32期(平成29年3月31日現在)

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

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

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

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

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

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

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

第32期(平成29年3月31日現在)

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

3. 売却したその他有価証券

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

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

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

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

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

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

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

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

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

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

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

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

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成29年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容

株式会社三菱東京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。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(3) 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28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29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51.0%（107,855株）、株式会社三菱東京UFJ銀行は15.0%（31,757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、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。

(2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。

- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
- ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
- ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
- ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

(3) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。

(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29年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成29年8月30日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランスファンドの平成28年7月23日から平成29年7月24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29年7月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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