

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年11月30日
【計算期間】	第4期中（自 平成23年3月1日 至 平成23年8月31日）
【ファンド名】	マン・AHL・エンハンスド・ストラテジーズ 償還時元本確保型ファンド2 （Man AHL Enhanced Strategies Principal Protected Fund 2）
【発行者名】	三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ （Mitsubishi UFJ Global Custody S.A.）
【代表者の役職氏名】	マネージング・ディレクター 皆川 宏
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L-1150、アーロン通り 287-289 番 （287-289, route d'Arlon, L-1150 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 中 野 春 芽
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 中 野 春 芽
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03（6212）8316
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

1【ファンドの運用状況】

マン・AHL・エンハンスド・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド2（Man AHL Enhanced Strategies Principal Protected Fund 2）（以下「ファンド」という。）の運用状況は、以下のとおりである。

（１）【投資状況】

（資産および地域別の投資状況）

（平成23年8月末日現在）

資産の種類	国名	時価合計 （アメリカ合衆国ドル）	投資比率 （％）
ゼロ・クーポン債	ケイマン諸島	550,105,398	95.52
パフォーマンス・ローン債	ケイマン諸島	25,770,985	4.48
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		75	0.00
合計 （純資産総額）		575,876,458 （約44,141百万円）	100.00

（注1）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う。

（注2）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）の円貨換算は、平成23年9月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝76.65円）による。以下同じ。

（注3）ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設立されているが、ファンドの受益証券は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨をもって行う。

（注4）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してある。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年8月末日以前1年間における各月末の純資産の推移は、以下のとおりである。

	純資産総額		一口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	米ドル	円
平成22年9月末日	657,351	50,386	0.8719	67
10月末日	646,522	49,556	0.8739	67
11月末日	627,276	48,081	0.8652	66
12月末日	593,465	45,489	0.8384	64
平成23年1月末日	578,336	44,329	0.8335	64
2月末日	568,643	43,586	0.8299	64
3月末日	556,727	42,673	0.8246	63
4月末日	561,852	43,066	0.8440	65
5月末日	563,836	43,218	0.8592	66
6月末日	552,485	42,348	0.8506	65
7月末日	560,227	42,941	0.8810	68
8月末日	575,876	44,141	0.9228	71

（注）上記に記載された各月末の数値は、評価および買戻目的のため計算されたものである。そのため、会計年度末（2月末日）および半期末（8月末日）の純資産総額および一口当たり純資産価格は、財務書類中の数値と一致しない場合がある。

【分配の推移】

該当事項なし。

【収益率の推移】

	収益率（％）（注）
平成22年9月1日～平成23年8月末日	5.56

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) \div b$

a＝平成23年8月末日現在の受益証券一口当たり純資産価格＋当該期間の分配金の合計額

b＝平成22年8月末日現在の受益証券一口当たり純資産価格（分配落の額）

2【販売及び買戻しの実績】

平成23年8月末日前1年間における受益証券の販売および買戻しの実績ならびに平成23年8月末日現在の受益証券の発行済口数は、以下のとおりである。

販売口数	買戻口数	発行済口数
0	138,580,000	624,010,000
(0)	(138,580,000)	(624,010,000)

（注）（ ）の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数である。

３【ファンドの経理状況】

- ａ． ファンドの日本文の中間財務書類は、英国における諸法令および英国において一般に認められた会計原則に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第４項ただし書の規定の適用によるものである。
- ｂ． ファンドの中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第１条の３第７項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- ｃ． ファンドの原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円による金額は、平成23年９月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝76.65円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド２

結合財政状態計算書

2011年８月31日現在

	未監査 2011年８月31日現在		監査済 2011年２月28日現在	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
流動資産				
銀行預金	9,846,982	754,771	875,377	67,098
ブローカー預金	9,707	744	9,716	745
損益を通じて公正価値で測定する 投資有価証券	37,060,461	2,840,684	49,529,318	3,796,422
損益を通じて公正価値で測定する 米国財務省証券ストリップス債	544,746,542	41,754,822	523,786,811	40,148,259
米国財務省証券ストリップス債の 売却に係る未収金	5,358,856	410,756	7,671,887	588,050
その他のファンドの申込前払金	-	-	14,132	1,083
流動資産合計	597,022,548	45,761,778	581,887,241	44,601,657
流動負債				
受益証券の買戻しに係わる未払金	(10,466,280)	(802,240)	(7,234,780)	(554,546)
未払金および未払費用	(2,697,920)	(206,796)	(2,319,581)	(177,796)
借入金	(7,981,890)	(611,812)	(3,706,429)	(284,098)
流動負債合計	(21,146,090)	(1,620,848)	(13,260,790)	(1,016,440)
純資産	575,876,458	44,140,931	568,626,451	43,585,217
内訳：				
受益者に対する負債				
受益証券一口当たり純資産価格0.9228米ドル (2011年２月28日は0.8299米ドル)の 受益証券624,010,000口 (2011年２月28日は685,180,000口)	575,876,458	44,140,931	568,626,451	43,585,217
	575,876,458	44,140,931	568,626,451	43,585,217

2011年11月2日に受託会社を代表して、承認され、発行を認可された。

〔 署 名 〕	〔 署 名 〕
エドウィン・マシャンガンビ	リチャード・アレン
署名権者	署名権者

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド2の受託会社としてのCIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッドのために。

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド2

結合包括利益計算書

2011年8月31日終了期間

	未監査 2011年8月31日終了期間		未監査 2010年8月31日終了期間	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
収益				
受取利息	7,973	611	10,309	790
外貨純損失	-	-	(3,794)	(291)
損益を通じて公正価値で測定する 投資有価証券の未実現純利益 / (損失)の変動	(2,240,577)	(171,740)	8,665,539	664,214
損益を通じて公正価値で測定する 投資有価証券の実現利益 / (損失)	306	23	(2,507,423)	(192,194)
損益を通じて公正価値で測定する 米国財務省証券ストリップス債の 未実現利益 / (損失)の変動	57,613,174	4,416,050	72,694,827	5,572,058
損益を通じて公正価値で測定する 米国財務省証券ストリップス債の 実現利益	9,963,159	763,676	10,654,158	816,641
	65,344,035	5,008,620	89,513,616	6,861,219
費用				
取引およびブローカー手数料	(270,860)	(20,761)	(246,763)	(18,914)
運用報酬および成功報酬	(1,102,738)	(84,525)	(1,176,370)	(90,169)
リスク移転報酬	(1,018,381)	(78,059)	(1,188,766)	(91,119)
保証報酬	(809,582)	(62,054)	(1,001,715)	(76,781)
登録事務代行報酬	(176,815)	(13,553)	(195,470)	(14,983)
流動性および管理事務報酬	(690,228)	(52,906)	(445,787)	(34,170)
評価事務報酬	(421,586)	(32,315)	(490,564)	(37,602)
支払利息	(135,971)	(10,422)	(164,530)	(12,611)
監査報酬	(28,284)	(2,168)	(17,785)	(1,363)
代行協会員報酬	(1,404,506)	(107,655)	(1,634,447)	(125,280)
専門家報酬および一般管理費用	(102,336)	(7,844)	(456,773)	(35,012)
	(6,161,287)	(472,263)	(7,018,970)	(538,004)
受益者に帰属する当期純利益	59,182,748	4,536,358	82,494,646	6,323,215

マン・ＡＨＬ・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド２

受益証券保有者に帰属する金額の結合変動計算書

結合資本変動計算書

受益証券保有者に帰属する金額の結合変動計算書

2011年８月31日終了期間

	未監査 2011年８月31日終了期間		未監査 2010年８月31日終了期間	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
期首残高	568,626,451	43,585,217	653,576,763	50,096,659
受益証券61,170,000口 (2010年は86,570,000口)の 買戻し支払額	(51,932,741)	(3,980,645)	(69,462,597)	(5,324,308)
	516,693,710	39,604,573	584,114,166	44,772,351
受益者に帰属する当期純利益	59,182,748	4,536,358	82,494,646	6,323,215
期末残高	575,876,458	44,140,931	666,608,812	51,095,565

結合資本変動計算書

当期および前期のいずれにおいてもファンドに資本はない。

マン・ＡＨＬ・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド２

結合キャッシュ・フロー計算書

2011年８月31日終了期間

	未監査 2011年８月31日終了期間		未監査 2010年８月31日終了期間	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(千円)
営業活動によるキャッシュ・フロー				
受益者に帰属する当期純利益	59,182,748	4,536,358	82,494,646	6,323,215
当期純利益の営業活動による純現金への調整：				
損益を通じて公正価値で測定する 米国財務省証券ストリップス債の 未実現利益の変動	(57,613,174)	(4,416,050)	(72,694,827)	(5,572,058)
損益を通じて公正価値で測定する 米国財務省証券ストリップス債の 実現利益	(9,963,159)	(763,676)	(10,654,158)	(816,641)
	(8,393,585)	(643,368)	(854,339)	(65,485)
運用資産および負債の純変動：				
純資産および負債の変動：				
損益を通じて公正価値で測定する 投資有価証券	12,468,857	955,738	13,982,985	1,071,796
前払金およびその他資産	-	-	18,224	1,397
受益証券の買戻しに係わる未払金	-	-	3,775,086	289,360

未払金および未払費用	378,339	29,000	295,910	22,682
その他のファンドの申込前払金	14,132	1,083	-	-
営業活動による純現金	4,467,743	342,453	17,217,866	1,319,749
投資活動によるキャッシュ・フロー				
米国財務省証券ストリップス債の 売却手取金	48,929,633	3,750,456	64,913,654	4,975,632
投資活動による純現金	48,929,633	3,750,456	64,913,654	4,975,632
財務活動によるキャッシュ・フロー				
受益証券の買戻し支払金	(48,701,241)	(3,732,950)	(69,462,597)	(5,324,308)
借入金の増加／（減少）	4,275,461	327,714	(8,657,156)	(663,571)
財務活動で使用された純現金	(44,425,780)	(3,405,236)	(78,119,753)	(5,987,879)
現金および現金同等物の純変動	8,971,596	687,673	4,011,767	307,502
現金および現金同等物の期首残高	885,093	67,842	11,293,295	865,631
現金および現金同等物の期末残高	9,856,689	755,515	15,305,062	1,173,133
現金および現金同等物に含まれる項目：				
銀行預金	9,846,982	754,771	15,295,443	1,172,396
ブローカー預金	9,707	744	9,619	737
	9,856,689	755,515	15,305,062	1,173,133

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド2

結合財務書類に対する注記

1. 概要

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ償還時元本確保型ファンド2（以下「ファンド」という。）は、2007年12月7日にケイマン諸島の法律に準拠して設定されたユニット・トラストであり、ケイマン諸島のミューチュアル・ファンド法（2009年改正）および一般投資家向け投資信託（日本）規則（2007年改正）に準拠して登録され、中期的に相場変動の水準に見合った安定した資産成長を目指す。ファンドは、2008年4月1日に取引を開始した。

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ・プリンシパル・プロテクトド（ZC）2リミテッド（以下「ゼロ・クーポン債発行会社」という。）は、米国財務省証券ストリップス債を保有する目的で、ケイマン諸島の法律に準拠して、2007年11月15日に設立された。

マン・AHL・エンハンスト・ストラテジーズ・プリンシパル・プロテクトド・トレーディング2リミテッド（以下「トレーディング・カンパニー」という。）は、投資活動および関連資産、負債、収益および費用をゼロ・クーポン債発行会社のものと区別するために、ケイマン諸島の法律に準拠して、2007年11月15日に設立された。

2. 重要な会計方針の要約

会計の基礎

ファンドの中間要約結合財務書類は、国際会計基準第34号「中間財務報告」に準拠して作成されている。中間要約結合財務書類の作成に使用される会計方針は、2011年2月28日に終了した事業年度の年次監査済財務書類の作成に使用された会計方針と一致しており、また2012年2月28日に終了する事業年度の年次監査済財務書類の作成に使用されることが予想される会計方針とも一致している。

本結合中間財務書類は、ファンドならびに注記1に詳述したゼロ・クーポン債発行会社およびトレーディン

グ・カンパニーの勘定を結合している。かかる結合財務書類の作成は、信託証書による純資産価額の決定方法と一致している。

トレーディング・カンパニー、ゼロ・クーポン債発行会社およびファンドの間のすべての取引が消去された。

3. 関連当事者

マスター・マルチ・プロダクト・ホールディングス・リミテッドは、トレーディング・カンパニーおよびゼロ・クーポン債発行会社の普通株式を100%保有しているため、関連当事者である。

ケイマン諸島で設立され、ファンドの受託会社であるCIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッドは、ファンドに対する受託会社としての役割により関連当事者である。最終的な支配権を所有する関連当事者はいない。

マン・インベストメンツ・リミテッドは、トレーディング・カンパニーの投資運用会社であるため、関連当事者である。マン・インベストメンツ・リミテッドは、マン・グループ・ピーエルシーの子会社であるため、マン・グループ・ピーエルシーのすべての子会社も関連当事者である。

当期中に、ファンドはマン・グループ・ピーエルシーの以下の子会社と取引を行った：

マン・インベストメンツ・エイ・ジー

マン・コーポレート・サービスズ（アイルランド）リミテッド

マン・バリュエーション・サービスズ・リミテッド

マン・グループ・ピーエルシーの企業は、ファンドの投資先企業すべての運用にも様々な役割で関わっている。

ホワイト・モーフ・ファンディング・リミテッドもまたトレーディング・カンパニーおよびゼロ・クーポン債発行会社と共通して、マイケル・コリンズ氏、フィリップ・M・ボドマン氏およびドーン・C・グリフィス氏が取締役を務めるため関連当事者である。ホワイト・モーフ・ファンディング・リミテッドは、特別目的会社であり、実質上、トレーディング・カンパニーからホワイト・モーフ・ファンディング・リミテッドに支払われるすべての手数料および利息は、ホワイト・モーフ・ファンディング・リミテッドが信用枠設定契約を提供できるように資金を提供する第三者に対する債務に充当するために使用される。

フィリップ・M・ボドマン氏は、マン・ファンド・マネジメント（ガーンジー）リミテッド、トレーディング・カンパニーおよびゼロ・クーポン債発行会社の共同の取締役を務めるために関連当事者である。

以下は、ファンドと関連当事者の間に発生した取引である。

2011年8月31日終了期間

関連当事者	報酬の種類	報酬総額 (米ドル)	未払報酬 (米ドル)
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	ディーリング・アレンジメント報酬	27,078	11,863
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	流動性および管理事務報酬	383,080	191,885
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	借入金支払利息	135,933	-
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	運用報酬	1,102,738	486,405
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	リスク移転報酬	1,018,381	511,694
マン・コーポレート・サービスズ (アイルランド)リミテッド	登録事務支払費用	200	-
マン・コーポレート・サービスズ (アイルランド)リミテッド	副登録事務代行会社手数料	3,000	667
マン・コーポレート・サービスズ (アイルランド)リミテッド	受益者サービス代行報酬	500	3,242
マン・バリュエーション・ サービスズ・リミテッド	評価事務報酬	421,586	211,173

CIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド	会社登記費用	4,288	-
CIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド	受託報酬	28,153	9,468
取締役	取締役報酬	7,833	6,167

2011年2月28日終了年度

関連当事者	報酬の種類	報酬総額 (米ドル)	未払報酬 (米ドル)
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	ディーリング・アレンジメント報酬	71,353	10,598
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	流動性および管理事務報酬	863,014	130,339
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	ローン利息費用	274,646	-
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	運用および成功報酬	2,712,417	425,948
マン・インベストメンツ・エイ・ジー	リスク移転報酬	2,301,370	347,570
マン・コーポレート・サービス (アイルランド)リミテッド	登録事務支払費用	805	-
マン・コーポレート・サービス (アイルランド)リミテッド	副登録事務代行会社手数料	(1,250)	2,917
マン・コーポレート・サービス (アイルランド)リミテッド	受益者サービス代行報酬	1,000	2,742
マン・バリュエーション・サービス・リミテッド	評価事務報酬	949,711	143,438
CIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド	会社登記費用	2,400	-
CIBCバンク・アンド・トラスト・カンパニー（ケイマン）リミテッド	受託報酬	63,329	36,153
取締役	取締役報酬	20,248	7,000

4. 純資産価額に対する評価の調整

設立費に関する会計方針は、法定会計目的と受益証券の評価および買戻目的とは異なる。

結合財務書類による純資産価額と評価・買戻しのための受益証券一口当たりの純資産価格の調整は、以下のとおりである。

	2011年8月31日 (米ドル)	2011年2月28日 (米ドル)
結合財政状態計算書上の純資産価額	575,876,459	568,626,451
未償却の設立費の加算	-	16,990

月次評価による純資産価額

受益証券一口当たりの純資産価格0.9228米ドル
(2011年2月28日は0.8299米ドル)の
受益証券624,010,000口
(2011年2月28日は685,180,000口)

	575,876,459	568,643,441
--	-------------	-------------

（２）【投資有価証券明細表等】

結合財政状態計算書、結合包括利益計算書および財務書類に対する注記を参照のこと。

4【管理会社の概況】

（１）【資本金の額】（平成23年９月末日現在）

払込済資本金の額 37,117,968.52米ドル（約28億円）

発行済株式総数 1,002,080株

管理会社が発行する株式総数の上限については制限がない。

（２）【事業の内容及び営業の状況】

管理会社は、投資信託の事務管理、国際的な保管業務、信託会計の事務管理およびこれらに関する一般的な銀行業務ならびに外国為替業務に従事する。

管理会社は、信託証書に基づき、期間の限定なく任命されているが、受託会社は、以下の場合、かかる任命を解除することができる。（a）管理会社が清算される場合、（b）管理会社の事業に関して財産保全管理人が任命された場合、（c）受託会社が、管理会社の変更が受益者の利益にとって望ましいとの見解を有し、受益者に対してその旨を書面で表明した場合、（d）法律により許される限り速やかに管理会社を解任することを定めた決議が総会において受益者により決議された場合、または（e）発行済受益証券の価値の4分の3を保有する受益者が管理会社の解任を書面で受託会社に要求した場合、管理会社がファンドの管理者でなくなった場合、受託会社は、ファンドの管理者になる資格を有する他の者を任命しなければならない。管理会社はまた、受託会社への通知により、管理会社の関係会社である他の管理者を後任者として、直ちに退任する権利を有する。ただし、管理会社が関係会社でない他の管理者を後任者として退任することを希望する場合、受託会社への60日前の通知が行われなければならない。

信託証書の規定に基づき、管理会社は、故意の不履行、誠実に行為しないこと、重過失詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視の場合を除き、ファンド、受益者または受託会社に対していかなる責任も負わない。

信託証書に基づき、受託会社は、ファンドのために、かつファンドの資産からのみ、管理会社ならびに管理会社の関係会社、代理人および受任者ならびに管理会社およびこれらの者の役員、取締役、株主および支配者に対して、（ ）ファンドの運営もしくはファンドの受益証券の募集もしくは（ ）かかる者の行為に関係し、もしくはこれらから生じ、もしくはこれらに基づき、または信託証書に基づきファンドのために行われた事業もしくは業務に別途に関連して、管理会社が現実に一時的に負担したあらゆる損失、責任、損害、費用または経費（弁護士費用および会計士費用を含むが、これらに限定されない。）、判決および和解において支払われる金額（ただし、受託会社が、ファンドを代表して、かかる和解を承認していることを条件とする。）を補償するものとし、上記の者を上記のあらゆる損失、責任、損害、費用または経費から免責するものとする。ただし、かかる行為が故意の不履行、誠実に行為しないこと、重過失詐欺、または信託証書に基づく管理会社の義務の重要な違反もしくはかかる義務の不注意な無視を構成する場合はこの限りでない。

管理会社は、平成23年8月末日現在、以下の投資信託の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別 （基本的性格）	本数	純資産価額の総額 （通貨別）
ケイマン諸島	アンブレラ・ファンドのサブ・ファンド	24	8,215,644,033米ドル

（３）【その他】

本書提出前6月以内において、訴訟事件その他管理会社およびファンドに重要な影響を与えた事実または与えることが予想される事実は生じていない。

5【管理会社の経理の概況】

- a . 管理会社の日本文の中間財務書類は、管理会社が作成した原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . 管理会社の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- c . 管理会社の原文の中間財務書類は米ドルで表示されている。日本文の財務書類には、円貨換算が併記されている。日本円による金額は、平成23年9月30日現在における株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝76.65円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

三菱UFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

資 産

		米ドル	千円
1.1	現金および中央銀行における現金残高	30,727,952.00	2,355,298
1.2	売買目的で保有される金融資産	1,748,169.00	133,997
1.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	1,748,169.00	133,997
1.2.2	持分証券		
1.2.3	債務証券		
1.2.4	ローンおよび貸付金		
1.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産	0.00	0
1.3.1	持分証券		
1.3.2	債務証券		
1.3.3	ローンおよび貸付金		
1.4	売却可能金融資産	2,104,952.00	161,345
1.4.1	持分証券	2,104,952.00	161,345
1.4.2	債務証券		
1.4.3	ローンおよび貸付金		
1.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む）	1,086,205,285.00	83,257,635
1.5.1	債務証券		
1.5.2	ローンおよび貸付金	1,086,205,285.00	83,257,635
1.6	満期保有目的投資有価証券	0.00	0
1.6.1	債務証券		
1.6.2	ローンおよび貸付金		
1.7	デリバティブ - ヘッジ会計	0.00	0
1.7.1	公正価値ヘッジ		
1.7.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.7.3	外国事業純投資のヘッジ		
1.7.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
1.7.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
1.8	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおけるヘッジ項目の公正価値変動		
1.9	有形資産	386,163.00	29,599
1.9.1	有形固定資産	386,163.00	29,599
1.9.2	投資不動産		

1.10	無形資産	1,165,631.00	89,346
1.10.1	営業権		
1.10.99	その他の無形資産	1,165,631.00	89,346
1.12	税金資産	1,703,114.00	130,544
1.12.1	現行税金資産	1,703,114.00	130,544
1.12.2	繰延税金資産		
1.13	その他の資産	24,816,525.00	1,902,187
1.14	売却目的保有に分類される非流動資産および 売却グループ		
1.15	資産合計	1,148,857,791.00	88,059,950

ミツビシUFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

負 債

		米ドル	千円
2.1	中央銀行預金		
2.2	売買目的で保有される金融負債	239,784.00	18,379
2.2.1	売買目的で保有されるデリバティブ	239,784.00	18,379
2.2.2	ショート・ポジション		
2.2.3	金融機関からの預金		
2.2.4	金融機関以外からの預金		
2.2.5	債務証書（短期間で買戻す予定の債券を含む）		
2.2.99	その他の金融負債		
2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債	0.00	0
2.3.1	金融機関からの預金		
2.3.2	金融機関以外からの預金		
2.3.3	債務証書（債券を含む）		
2.3.4	劣後債務		
2.3.99	その他の金融負債		
2.4	償却後原価で測定される金融負債	1,022,637,911.00	78,385,196
2.4.1	金融機関からの預金	752,787,973.00	57,701,198
2.4.2	金融機関以外からの預金	269,849,938.00	20,683,998
2.4.3	債務証書（債券を含む）		
2.4.4	劣後債務		
2.4.99	その他の金融負債		
2.5	譲渡された金融資産に関連する金融負債		
2.6	デリバティブ・ヘッジ会計	0.00	0
2.6.1	公正価値ヘッジ		
2.6.2	キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.6.3	外国事業純投資のヘッジ		
2.6.4	金利リスクの公正価値ヘッジ		
2.6.5	金利リスク・キャッシュ・フロー・ヘッジ		
2.7	金利リスクのポートフォリオ・ヘッジにおける ヘッジ項目の公正価値変動		
2.8	引当金	0.00	0
2.8.1	再編		
2.8.2	係属中の法的問題および租税訟務		
2.8.3	年金およびその他の退職後給付金債務		
2.8.4	ローン契約および保証		
2.8.5	有償契約		
2.8.99	その他の引当金	0.00	0
2.9	税金負債	13,469,496.00	1,032,437
2.9.1	現行税金負債	11,023,417.00	844,945
2.9.2	繰延税金負債	2,446,079.00	187,492

2.10	その他の負債	10,757,985.00	824,600
2.11	要求払株式資本（例えば、共同株式）		
2.12	売却目的保有に分類される売却グループに含まれる負債		
2.13	負債合計	1,047,105,176.00	80,260,612

ミツビシUFJグローバルカストディ・エス・エイ

貸借対照表

2011年6月30日現在

（単位：米ドル）

資 本

		米ドル	千円
3.1	発行済み資本	37,117,969.00	2,845,092
3.1.1	払込資本	37,117,969.00	2,845,092
3.1.2	未払込請求資本		
3.2	株式発行差金		
3.3	その他のエクイティ	0.00	0
3.3.1	複合金融商品のエクイティ部分		
3.3.99	その他のエクイティ商品		
3.4	再評価準備金およびその他の評価差額：	1,186,131.00	90,917
3.4.1	有形資産		
3.4.2	無形資産		
3.4.3	外国事業純投資のヘッジ（有効部分）		
3.4.4	外貨換算		
3.4.5	キャッシュ・フロー・ヘッジ（有効部分）		
3.4.6	売却可能金融資産	1,186,131.00	90,917
3.4.7	売却目的で保有される非流動資産および売却グループ		
3.4.99	その他の項目		
3.5	準備金（利益剰余金を含む）	50,184,867.00	3,846,670
3.6	<自己株式>		
3.7	当期利益	13,263,648.00	1,016,659
3.8	<中間配当>		
3.10	資本合計	101,752,615.00	7,799,338
3.11	負債および資本合計	1,148,857,791.00	88,059,950

（２）【損益の状況】

ミツビシUFJグローバルカストディ・エス・エイ

損益計算書

2011年6月30日に終了した期間

（単位：米ドル）

		米ドル	千円
5.1	金融および運用収益および費用（＋／－）	30,896,321.00	2,368,203
5.2	利息収益	5,889,587.00	451,437
5.2.1	現金および中央銀行における現金残高	127,622.00	9,782
5.2.2	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）	2,665,530.00	204,313
5.2.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.2.4	売却可能金融資産		
5.2.5	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）	3,096,435.00	237,342
5.2.6	満期保有目的投資有価証券		

5.2.7	デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク		
5.2.99	その他の資産		
5.3	（支払利息）（-）	2,146,641.00	164,540
5.3.1	中央銀行からの預金	0.00	0
5.3.2	売買目的で保有される金融負債（区別して計上される場合）	17,188.00	1,317
5.3.3	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融負債		
5.3.4	償却後原価で測定される金融負債	2,129,453.00	163,223
5.3.5	デリバティブ - ヘッジ会計、金利リスク		
5.3.99	その他の負債		
5.4	要求払株式資本に係る費用（-）		
5.5	受取配当（+）	348,254.00	26,694
5.5.1	売買目的で保有される金融資産（区別して計上される場合）		
5.5.2	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産		
5.5.3	売却可能金融資産	348,254.00	26,694
5.6	受取手数料（+）	44,460,362.00	3,407,887
5.7	（支払手数料）（-）	18,861,846.00	1,445,760
5.8	損益計算書を通じて公正価値で測定されない金融資産 および負債に係る実現利益（損失）、純額（+/-）	0.00	0
5.8.1	売却可能金融資産		
5.8.2	ローンおよび未収金（ファイナンス・リースを含む。）		
5.8.3	満期保有目的投資有価証券		
5.8.4	償却後原価で測定される金融負債		
5.8.99	その他		
5.9	売買目的で保有される金融資産および負債に係る 利益（損失）、純額（+/-）	1,093,544.00	83,820
5.9.1	デリバティブに関するエクイティ商品		
5.9.2	金利商品およびデリバティブ関連		
5.9.3	為替取引	1,093,544.00	83,820
5.9.4	信用リスク商品およびデリバティブ関連		
5.9.5	商品およびデリバティブ関連		
5.9.99	その他（ハイブリッド・デリバティブを含む。）		
5.10	損益計算書を通じて公正価値で測定される金融資産 および負債に係る利益（損失）、純額（+/-）		
5.11	ヘッジ会計からの利益（損失）、純額（+/-）		
5.12	為替差額、純額（+/-）		
5.13	売却目的以外で保有される資産の認識除外に係る 利益（損失）、純額（+/-）		
5.14	その他の事業収益（+）	634,960.00	48,670
5.15	その他の事業費用（-）	521,899.00	40,004
5.16	一般管理費（-）	13,719,082.00	1,051,568
5.16.1	従業員費用（-）	6,627,339.00	507,986
5.16.2	一般管理費用（-）	7,091,743.00	543,582
5.17	減価償却（+/-）	576,073.00	44,156
5.17.1	有形固定資産	152,968.00	11,725
5.17.2	投資不動産		
5.17.3	無形資産（営業権を除く）	423,105.00	32,431
5.18	引当金（+/-）	0.00	0
5.19	減損（+/-）	0.00	0
5.19.1	損益計算書を通じて公正価値で測定されない 金融資産に係る減損（+/-）	0.00	0
5.19.1.1	取得原価で測定される金融資産 （値付けされていないエクイティ）		
5.19.1.2	売却可能金融資産		
5.19.1.3	償却後原価で測定されるローンおよび未収金 （ファイナンス・リースを含む）		
5.19.1.4	償却後原価で測定される満期保有目的投資証券		
5.19.2	非金融資産に係る減損、純額（+/-）	0.00	0
5.19.2.1	有形固定資産		
5.19.2.2	投資不動産		
5.19.2.3	営業権		
5.19.2.4	その他の無形資産		

5.19.2.99	その他		
5.20	直ちに損益認識されるマイナスの営業権（＋）		
5.22	非流動資産および非継続事業の条件を満たさない 売却目的保有に分類される除却グループからの 損益（＋／－）		
5.23	継続事業からの税引前損益合計（＋／－）	16,601,166.00	1,272,479
5.24	継続事業からの損益に関する税金費用（収入）（－／＋）	3,337,518.00	255,821
5.25	継続事業からの税引後損益合計（＋／－）	13,263,648.00	1,016,659
5.26	非継続事業からの税引後損益（＋／－）		
5.27	当期利益または損失（＋／－）	13,263,648.00	1,016,659