

【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27年9月7日
【計算期間】	第2期中(自平成26年12月9日 至平成27年6月8日)
【ファンド名】	グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)2013-05
【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 金上 孝
【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
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

平成27年6月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
社債券	アメリカ	8,560,294,918	34.41
	フランス	7,027,445,377	28.25
	イギリス	4,244,012,869	17.06
	ジャージー島	2,415,750,191	9.71
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,631,450,442	10.57
純資産総額		24,878,953,797	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)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成27年6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26年12月8日)	29,699,090,989 (分配付) 29,671,497,208 (分配落)	10,763 (分配付) 10,753 (分配落)
平成26年 6月末日	33,902,756,517	10,725
7月末日	32,904,890,043	10,708
8月末日	32,123,407,176	10,722
9月末日	31,042,762,566	10,729
10月末日	30,311,344,313	10,698
11月末日	29,865,981,892	10,756
12月末日	29,079,736,393	10,767
平成27年 1月末日	28,713,171,919	10,794
2月末日	28,204,959,138	10,836
3月末日	27,578,147,444	10,855
4月末日	27,161,097,255	10,871
5月末日	26,244,790,045	10,849
6月末日	24,878,953,797	10,796

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	10円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.63
第1計算期間末日から 平成27年6月末日までの期間	0.39

(注) 「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額)を控除した額を当該基準価額(分配落の額)で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。ただし、第1計算期間末日から平成27年6月末日までの期間については平成27年6月末日の基準価額から当該基準価額(分配落の額)を控除した額を当該基準価額(分配落の額)で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

2【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	38,723,390,031	11,129,608,643	27,593,781,388
第2計算期期首から 平成27年6月30日までの期間		4,549,460,329	23,044,321,059

3【ファンドの経理状況】

【中間財務諸表】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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、当中間計算期間(平成26年12月9日から平成27年6月8日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた監査法人により中間監査を受けております

グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-05
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第 1 期 [平成26年12月8日現在]	第 2 期中間計算期間末 [平成27年6月8日現在]
資産の部		
流動資産		
預金	6,016,453	87,077,868
コール・ローン	1,363,098,359	1,399,673,452
社債券	29,008,930,580	24,662,326,365
未収入金	-	571,684,005
未収利息	728,102,715	360,585,077
前払費用	13,111,577	88,553,549
流動資産合計	31,119,259,684	27,169,900,316
資産合計	31,119,259,684	27,169,900,316
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	747,815,763	803,925,815
未払金	-	22,623,212
未払収益分配金	27,593,781	-
未払解約金	115,804,514	194,684,239
未払受託者報酬	13,538,933	5,616,721
未払委託者報酬	541,553,419	224,666,686
その他未払費用	1,456,066	542,563
流動負債合計	1,447,762,476	1,252,059,236
負債合計	1,447,762,476	1,252,059,236
純資産の部		
元本等		
元本	1 27,593,781,388	1 23,887,751,075
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,077,715,820	2,030,090,005
元本等合計	29,671,497,208	25,917,841,080
純資産合計	29,671,497,208	25,917,841,080
負債純資産合計	31,119,259,684	27,169,900,316

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自平成25年5月13日 至平成25年11月12日	第2期中間計算期間 自平成26年12月9日 至平成27年6月8日
営業収益		
受取利息	970,929,734	694,025,838
有価証券売買等損益	1,246,735,023	243,726,630
為替差損益	21,995,590	38,996,210
その他収益	-	57,150,447
営業収益合計	2,195,669,167	468,453,445
営業費用		
受託者報酬	8,265,584	6,029,117
委託者報酬	1,330,623,436	1,241,164,557
その他費用	2,504,503	3,296,511
営業費用合計	341,393,523	250,490,185
営業利益	1,854,275,644	217,963,260
経常利益	1,854,275,644	217,963,260
中間純利益	1,854,275,644	217,963,260
期首剰余金又は期首欠損金()	-	2,077,715,820
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,403,517	265,589,075
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,403,517	265,589,075
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,850,872,127	2,030,090,005

(3) 【中間注記表】

(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	公社債は個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、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	為替予約取引は個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 [平成26年12月8日現在]	第2期中間計算期間末 [平成27年6月8日現在]
1 設定年月日	平成25年5月13日	平成25年5月13日
設定元本額	38,723,390,031円	38,723,390,031円
期首元本額	38,723,390,031円	27,593,781,388円
元本残存率	71.2%	61.6%
2 受益権の総数	27,593,781,388口	23,887,751,075口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0753円 (10,753円)	1.0850円 (10,850円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期中間計算期間(自平成25年5月13日 至 平成25年11月12日)

1 運用に係る権限を委託するための費用

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、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の38以内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。

第2期中間計算期間(自平成26年12月9日 至 平成27年6月8日)

1 運用に係る権限を委託するための費用

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、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の38以内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。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [平成26年12月8日現在]	第2期中間計算期間末 [平成27年6月8日現在]
1 中間貸借対照表計上額、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、(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。</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

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	第1期[平成26年12月8日現在]		
		契約額等(円)		評価損益 (円)
		うち1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル	10,871,993,340	11,157,372,000	285,378,660
	イギリスポンド	3,372,361,085	3,438,672,500	66,311,415
	ユーロ	14,516,982,312	14,913,108,000	396,125,688
	合計	28,761,336,737	29,509,152,500	747,815,763

区 分	種 類	第 2 期中間計算期間末 [平成27年6月8日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	10,161,635,730		10,528,069,385	366,433,655
	イギリスポンド	4,408,998,650		4,488,564,500	79,565,850
	ユーロ	10,255,177,890		10,613,104,200	357,926,310
	合 計	24,825,812,270		25,629,738,085	803,925,815

(注) 時価の算定方法

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

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

半期代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

半期代替書面については、(<http://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>)でもご覧いただけます。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

半期代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

(3)【その他】

委託会社は平成27年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更しました。

上記以外、該当事項はありません。

5【委託会社等の経理状況】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

(1)【貸借対照表】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(1)「貸借対照表」の記載のとおりです。

(2)【損益計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(2)「損益計算書」の記載のとおりです。

(3)【株主資本等変動計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(3)「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年7月22日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-05の平成26年12月9日から平成27年6月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル金融機関ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）2013-05の平成27年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年12月9日から平成27年6月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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、独立監査人の中間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データは中間監査の対象に含まれていません。