

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年6月7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 横川 直
【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ノピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> （毎月決算型） 三菱UFJノピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> （毎月決算型）
【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】	三菱UFJノピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型> （毎月決算型） 1兆円を上限とします。 三菱UFJノピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし> （毎月決算型） 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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年12月7日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等および信託期間延長に伴う所要の変更を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前> および<訂正後> に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後> に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

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】

<更新後>

当ファンドは、信託財産の成長と収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、各ファンドについて、1兆円です。

* 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
		債券		
追加型	海外	不動産投信	MRF	特殊型 ()
	内外	その他資産 ()	ETF	
		資産複合		

属性区分表

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)

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり (限定ヘッジ)	日経225	ブル・ベア型
大型株	年2回		日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX
中小型株	年4回	北米	アジア			その他 ()
債券	年6回 (隔月)	欧州		オセアニア	その他 ()	
一般	年12回	アジア	中南米			その他 ()
公債	年12回 (毎月)	オセアニア		アフリカ	その他 ()	
社債	日々	中南米	中近東 (中東)			その他 ()
その他債券	その他	アフリカ		エマージング	その他 ()	
クレジット 属性 ()	()	中近東 (中東)	エマージング			その他 ()
不動産投信		エマージング				
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))						
資産複合 ()						

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）

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6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 TOPIX	ブル・ベア型 条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))						
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（<https://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、対円での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ないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	

	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。

条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

世界(新興国を含みます。)の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

投資対象

世界(新興国を含みます。以下同じ。)の米ドル建てを中心とする投資適格債券等が実質的な主要投資対象です。

- 主として円建外国投資信託への投資を通じて、世界の米ドル建てを中心とする投資適格債券等を実質的な投資を行います。また、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンド(わが国の短期公社債等に投資)への投資も行います。
- ・ファンドの主な投資対象は以下のとおりです。

国債

政府機関債

社債

モーゲージ証券

資産担保証券

ただし、BB格相当以下の債券、米国以外の債券、エマージング債券、バンクローン、転換社債などにも投資を行う場合があります。

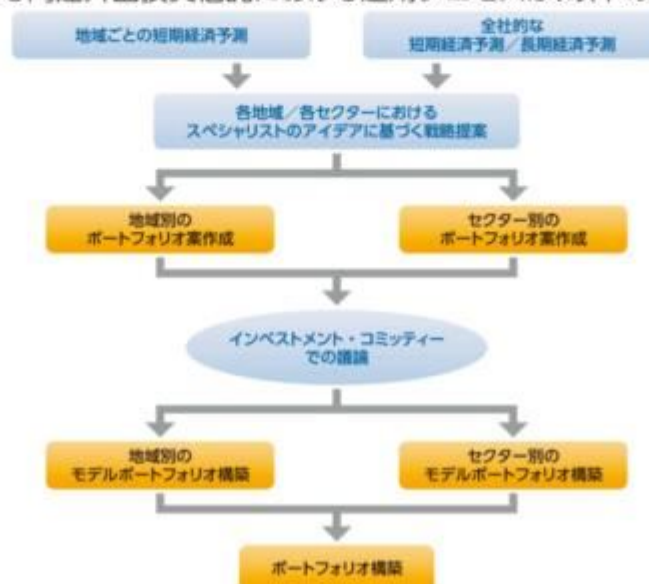
☐ モーゲージ証券とは住宅ローン等の債権を担保として、資産担保証券はカード・自動車ローン等のローン債権を担保として発行された証券です。

❗ 上記の債券が組入れられない場合や、上記以外の債券が組入れられる場合があります。

運用方法 運用プロセス

投資対象とする円建外国投資信託への投資は高位を維持することを基本とします。

- 投資対象とする円建外国投資信託において、世界の米ドル建てを中心とする投資適格債券等への分散投資を行うことにより、最大限のトータル・リターン(公社債等の利子および値上がりによる収益)を追求します。
- 投資対象とする円建外国投資信託における運用プロセスは、以下の通りです。



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。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。

☞ 「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(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

運用の委託先

投資信託証券への運用の指図に関する権限をピムコジャパンリミテッドに委託します。

- ピムコジャパンリミテッドは、ピムコ社が運用する円建外国投資信託(世界の米ドル建てを中心とする投資適格債券等に投資)への投資、およびマネー・マーケット・マザーファンドへの投資の指図を行います。
- ピムコ社(PIMCO=Pacific Investment Management Company LLC)は1971年に米国で設立された債券運用に強みを持つ会社です。
ピムコジャパンリミテッドは、PIMCOグループの日本における拠点です。

1 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。

為替対応方針

「米ドルヘッジ型」と「為替ヘッジなし」の2つがあります。

- 「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)は、原則として投資する外国投資信託において、当該外国投資信託の純資産総額を米ドル換算した額とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、為替変動リスクの低減を図ります。
 - ◆ 実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、実質的な組入外貨のうち、米ドル以外の通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
 - ◆ 為替取引を行うにあたっては、日米間の金利差に基づくコストがかかる場合があります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上の為替取引によるコストとなる場合があります。
- 「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)は、原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



- 1 スwitchingの取扱いについては、スitchingの取扱いを行わない販売会社もあるため、詳しくは、販売会社にご確認下さい。
- 1 スitchingの際の購入時手数料は、販売会社が定めるものとします。また、換金するファンドに対して税金がかかります。

分配方針

毎月の決算時に分配を行います。

- 毎月の決算時(8日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 原則として、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行います。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。また、分配金額は運用実績に応じて変動します。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。

収益分配金に関する留意事項

- ◆分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



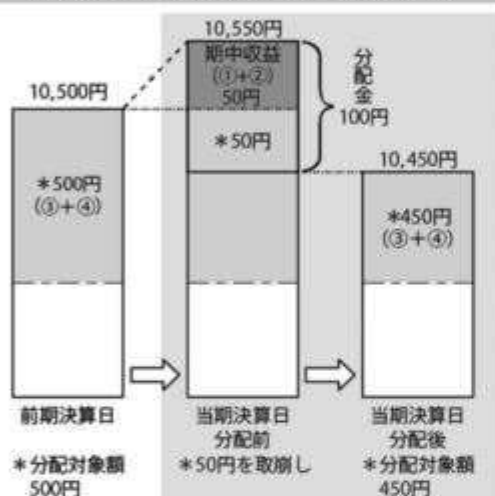
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

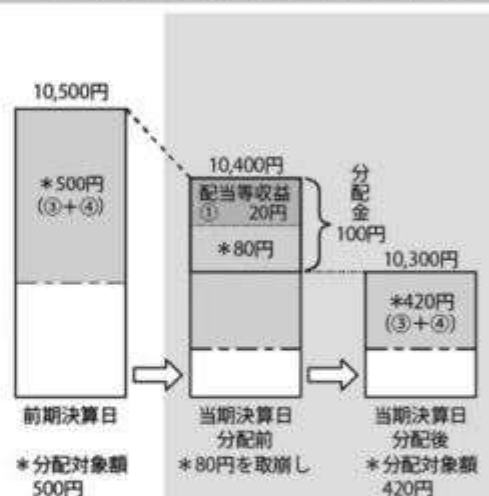
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合



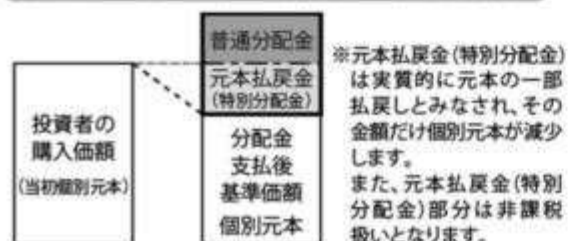
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

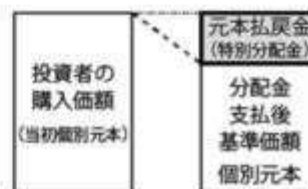
- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

■主な投資制限

投資信託証券	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への直接投資は行いません。

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】

<訂正前>

2013年10月25日 設定日、信託契約締結、運用開始

<訂正後>

2013年10月25日 設定日、信託契約締結、運用開始

2022年6月8日 信託期間を2023年9月8日までから2028年9月8日までに変更

（３）【ファンドの仕組み】

<訂正前>

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（2021年9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
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997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
2004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
2005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

2015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	211,581株	100.0%

<訂正後>

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（2022年3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
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997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
2004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
2005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
2015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	211,581株	100.0%

3【投資リスク】

<更新後>

(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、公社債等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公社債等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。

また、転換社債は、株式および債券の両方の性格を有しており、株式および債券の価格変動の影響を受け、組入転換社債の価格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

「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）」

実質的な組入外貨建資産の米ドル換算した額については、米ドル売り、円買いの為替取引を行い、円に対する米ドルの為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、組入外貨のうち、米ドル以外の通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。なお、円の金利が米ドルの金利より低いときには、これらの金利差相当分が為替取引によるコストとなります。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上の為替取引によるコストとなる場合があります。

「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）」

実質的な主要投資対象である海外の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（バンクローンを含みます。以下同じ。）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。また、バンクローンは、公社債と比べ、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

カントリーリスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。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可能性が高まる場合があります。

当ファンドは、格付けの低い公社債等も投資対象としており、格付けの高い公社債等への投資を行う場合に比べ、価格変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

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。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。こ

れにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

- ・投資対象ファンドにおいては、信用リスク管理上、政府機関の発行または保証する有価証券、およびそれらと同等と判断した銘柄^()について、同一発行体でファンドの純資産総額の10%を超えて保有する場合があります。
()には、米国の連邦住宅抵当公庫(ファニーメイ:FNMA)および連邦住宅抵当貸付公社(フレディ・マック:FHLMC)が発行または保証するモーゲージ証券等が該当します。

(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い、運用管理委員会において、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。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。運用管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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。

* 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。

<投資対象ファンド(国内投資信託を除く)の信用リスク管理方法>

投資対象ファンドの管理会社および投資運用会社は、投資対象ファンドにおいて、欧州委員会が制定した指令(UCITS指令)に定めるリスク管理方法に基づき信用リスクを管理します。

[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。

<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)



- 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のものとして計算しており、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。

<為替ヘッジなし> (毎月決算型)



- 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のものとして計算しており、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	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
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 (国債)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国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI (総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス (除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
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。当該指数の著作権は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。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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。

公募株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、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。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2021年9月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、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。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2022年3月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【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）】

（１）【投資状況】

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域	時価合計	投資比率 (%)
投資信託受益証券	ルクセンブルグ	2,002,930,033	99.40
親投資信託受益証券	日本	2,218,650	0.11
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		9,962,731	0.49
純資産総額		2,015,111,414	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

令和 4年 3月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ルクセンブルグ	投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY, Hedged)	231,954.8389	8,881	2,059,990,924	8,635	2,002,930,033	99.40
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	2,178,993	1.0182	2,218,650	1.0182	2,218,650	0.11

（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

令和 4年 3月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	99.40
親投資信託受益証券	0.11
合計	99.51

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和4年3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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成25年12月 9日)	541,476,986	541,476,986	9,919	9,919
第2計算期間末日 (平成26年 1月 8日)	735,397,592	735,397,592	9,890	9,890
第3計算期間末日 (平成26年 2月10日)	885,315,042	887,088,149	9,986	10,006
第4計算期間末日 (平成26年 3月10日)	1,017,456,458	1,019,506,375	9,927	9,947
第5計算期間末日 (平成26年 4月 8日)	1,098,811,164	1,101,027,566	9,915	9,935
第6計算期間末日 (平成26年 5月 8日)	1,462,592,781	1,465,536,631	9,937	9,957
第7計算期間末日 (平成26年 6月 9日)	1,484,945,203	1,487,923,725	9,971	9,991
第8計算期間末日 (平成26年 7月 8日)	1,457,846,788	1,460,782,725	9,931	9,951
第9計算期間末日 (平成26年 8月 8日)	1,496,994,069	1,500,000,971	9,957	9,977
第10計算期間末日 (平成26年 9月 8日)	1,518,807,261	1,521,859,817	9,951	9,971
第11計算期間末日 (平成26年10月 8日)	1,845,170,110	1,848,888,269	9,925	9,945
第12計算期間末日 (平成26年11月10日)	1,845,517,389	1,849,230,251	9,941	9,961
第13計算期間末日 (平成26年12月 8日)	1,812,421,875	1,816,065,644	9,948	9,968
第14計算期間末日 (平成27年 1月 8日)	1,752,981,268	1,756,486,559	10,002	10,022
第15計算期間末日 (平成27年 2月 9日)	1,691,340,673	1,694,708,502	10,044	10,064
第16計算期間末日 (平成27年 3月 9日)	1,593,964,227	1,597,172,295	9,937	9,957
第17計算期間末日 (平成27年 4月 8日)	1,495,958,143	1,498,934,370	10,053	10,073
第18計算期間末日 (平成27年 5月 8日)	1,500,071,810	1,503,116,299	9,854	9,874
第19計算期間末日 (平成27年 6月 8日)	1,469,763,689	1,472,774,045	9,765	9,785
第20計算期間末日 (平成27年 7月 8日)	1,453,931,439	1,456,900,868	9,793	9,813
第21計算期間末日 (平成27年 8月10日)	1,548,775,058	1,551,932,660	9,810	9,830
第22計算期間末日 (平成27年 9月 8日)	1,547,732,971	1,550,920,998	9,710	9,730
第23計算期間末日 (平成27年10月 8日)	1,537,774,045	1,540,935,497	9,728	9,748
第24計算期間末日 (平成27年11月 9日)	1,515,256,142	1,518,401,861	9,634	9,654
第25計算期間末日 (平成27年12月 8日)	1,663,343,833	1,666,790,961	9,651	9,671
第26計算期間末日 (平成28年 1月 8日)	1,804,285,405	1,808,048,420	9,590	9,610
第27計算期間末日 (平成28年 2月 8日)	1,828,779,920	1,832,587,550	9,606	9,626
第28計算期間末日 (平成28年 3月 8日)	1,948,671,102	1,952,747,586	9,561	9,581
第29計算期間末日 (平成28年 4月 8日)	2,145,939,209	2,150,365,516	9,696	9,716
第30計算期間末日 (平成28年 5月 9日)	2,549,355,114	2,554,630,378	9,665	9,685
第31計算期間末日 (平成28年 6月 8日)	3,082,264,213	3,088,627,259	9,688	9,708
第32計算期間末日 (平成28年 7月 8日)	4,040,254,719	4,048,500,461	9,800	9,820

第33計算期間末日	(平成28年 8月 8日)	5,032,130,102	5,042,447,001	9,755	9,775
第34計算期間末日	(平成28年 9月 8日)	5,702,748,263	5,714,420,436	9,772	9,792
第35計算期間末日	(平成28年10月11日)	6,548,108,494	6,561,639,764	9,678	9,698
第36計算期間末日	(平成28年11月 8日)	7,387,807,446	7,403,135,715	9,639	9,659
第37計算期間末日	(平成28年12月 8日)	8,161,450,938	8,178,846,103	9,384	9,404
第38計算期間末日	(平成29年 1月10日)	9,038,794,547	9,058,071,509	9,378	9,398
第39計算期間末日	(平成29年 2月 8日)	9,040,278,561	9,059,494,338	9,409	9,429
第40計算期間末日	(平成29年 3月 8日)	8,740,411,524	8,759,164,265	9,322	9,342
第41計算期間末日	(平成29年 4月10日)	7,933,709,443	7,950,650,525	9,366	9,386
第42計算期間末日	(平成29年 5月 8日)	7,527,079,171	7,543,145,480	9,370	9,390
第43計算期間末日	(平成29年 6月 8日)	7,181,533,663	7,196,783,919	9,418	9,438
第44計算期間末日	(平成29年 7月10日)	6,774,227,340	6,788,719,199	9,349	9,369
第45計算期間末日	(平成29年 8月 8日)	6,513,323,341	6,527,149,629	9,422	9,442
第46計算期間末日	(平成29年 9月 8日)	6,338,271,203	6,351,627,086	9,491	9,511
第47計算期間末日	(平成29年10月10日)	5,966,119,187	5,978,839,366	9,381	9,401
第48計算期間末日	(平成29年11月 8日)	5,715,695,933	5,727,886,882	9,377	9,397
第49計算期間末日	(平成29年12月 8日)	5,416,130,004	5,427,772,664	9,304	9,324
第50計算期間末日	(平成30年 1月 9日)	5,231,147,597	5,236,785,962	9,278	9,288
第51計算期間末日	(平成30年 2月 8日)	4,979,119,620	4,984,586,058	9,109	9,119
第52計算期間末日	(平成30年 3月 8日)	4,799,108,093	4,804,413,623	9,045	9,055
第53計算期間末日	(平成30年 4月 9日)	4,692,104,054	4,697,280,748	9,064	9,074
第54計算期間末日	(平成30年 5月 8日)	4,492,990,010	4,498,014,260	8,943	8,953
第55計算期間末日	(平成30年 6月 8日)	4,419,287,980	4,424,242,304	8,920	8,930
第56計算期間末日	(平成30年 7月 9日)	4,320,247,101	4,325,077,446	8,944	8,954
第57計算期間末日	(平成30年 8月 8日)	4,212,659,648	4,217,387,050	8,911	8,921
第58計算期間末日	(平成30年 9月10日)	4,071,598,183	4,076,211,484	8,826	8,836
第59計算期間末日	(平成30年10月 9日)	3,939,709,824	3,944,228,756	8,718	8,728
第60計算期間末日	(平成30年11月 8日)	3,771,740,601	3,776,078,631	8,695	8,705
第61計算期間末日	(平成30年12月10日)	3,694,403,795	3,698,622,228	8,758	8,768
第62計算期間末日	(平成31年 1月 8日)	3,656,164,871	3,660,329,756	8,779	8,789
第63計算期間末日	(平成31年 2月 8日)	3,646,996,391	3,651,111,427	8,863	8,873
第64計算期間末日	(平成31年 3月 8日)	3,626,138,344	3,630,242,378	8,836	8,846
第65計算期間末日	(平成31年 4月 8日)	3,610,983,435	3,615,042,113	8,897	8,907
第66計算期間末日	(令和 1年 5月 8日)	3,539,895,243	3,543,865,028	8,917	8,927
第67計算期間末日	(令和 1年 6月10日)	3,536,047,557	3,539,964,234	9,028	9,038
第68計算期間末日	(令和 1年 7月 8日)	3,528,245,366	3,532,151,240	9,033	9,043
第69計算期間末日	(令和 1年 8月 8日)	3,574,145,178	3,578,046,345	9,162	9,172
第70計算期間末日	(令和 1年 9月 9日)	3,575,982,829	3,579,858,940	9,226	9,236
第71計算期間末日	(令和 1年10月 8日)	3,521,219,381	3,525,044,815	9,205	9,215
第72計算期間末日	(令和 1年11月 8日)	3,418,033,472	3,419,924,667	9,037	9,047
第73計算期間末日	(令和 1年12月 9日)	3,392,128,851	3,393,999,284	9,068	9,078
第74計算期間末日	(令和 2年 1月 8日)	3,367,984,153	3,369,839,585	9,076	9,086

第75計算期間末日	(令和 2年 2月10日)	3,366,538,182	3,368,371,169	9,183	9,188
第76計算期間末日	(令和 2年 3月 9日)	3,381,395,116	3,383,185,830	9,441	9,446
第77計算期間末日	(令和 2年 4月 8日)	3,240,025,636	3,241,799,511	9,133	9,138
第78計算期間末日	(令和 2年 5月 8日)	3,259,549,870	3,261,312,411	9,247	9,252
第79計算期間末日	(令和 2年 6月 8日)	3,260,990,860	3,262,749,081	9,274	9,279
第80計算期間末日	(令和 2年 7月 8日)	3,240,489,429	3,242,210,522	9,414	9,419
第81計算期間末日	(令和 2年 8月11日)	3,139,010,215	3,140,659,614	9,516	9,521
第82計算期間末日	(令和 2年 9月 8日)	3,071,466,281	3,073,088,967	9,464	9,469
第83計算期間末日	(令和 2年10月 8日)	3,012,024,655	3,013,623,111	9,422	9,427
第84計算期間末日	(令和 2年11月 9日)	2,950,054,884	2,951,617,556	9,439	9,444
第85計算期間末日	(令和 2年12月 8日)	2,869,071,160	2,870,586,685	9,466	9,471
第86計算期間末日	(令和 3年 1月 8日)	2,810,440,734	2,811,932,503	9,420	9,425
第87計算期間末日	(令和 3年 2月 8日)	2,748,656,625	2,750,119,225	9,396	9,401
第88計算期間末日	(令和 3年 3月 8日)	2,644,465,798	2,645,902,631	9,202	9,207
第89計算期間末日	(令和 3年 4月 8日)	2,586,364,806	2,587,773,314	9,181	9,186
第90計算期間末日	(令和 3年 5月10日)	2,585,292,695	2,586,692,501	9,234	9,239
第91計算期間末日	(令和 3年 6月 8日)	2,563,280,365	2,564,666,707	9,245	9,250
第92計算期間末日	(令和 3年 7月 8日)	2,580,775,840	2,582,158,127	9,335	9,340
第93計算期間末日	(令和 3年 8月10日)	2,445,557,189	2,446,869,737	9,316	9,321
第94計算期間末日	(令和 3年 9月 8日)	2,402,547,188	2,403,838,272	9,304	9,309
第95計算期間末日	(令和 3年10月 8日)	2,344,866,480	2,346,138,003	9,221	9,226
第96計算期間末日	(令和 3年11月 8日)	2,295,505,732	2,296,745,115	9,261	9,266
第97計算期間末日	(令和 3年12月 8日)	2,228,568,837	2,229,783,049	9,177	9,182
第98計算期間末日	(令和 4年 1月11日)	2,188,387,782	2,189,595,459	9,060	9,065
第99計算期間末日	(令和 4年 2月 8日)	2,127,408,222	2,128,601,998	8,910	8,915
第100計算期間末日	(令和 4年 3月 8日)	2,104,454,803	2,105,646,751	8,828	8,833
	令和 3年 3月末日	2,576,565,554		9,138	
	4月末日	2,577,547,600		9,205	
	5月末日	2,567,144,301		9,235	
	6月末日	2,565,583,248		9,280	
	7月末日	2,533,378,881		9,354	
	8月末日	2,417,498,504		9,340	
	9月末日	2,361,146,780		9,248	
	10月末日	2,287,839,084		9,210	
	11月末日	2,240,914,012		9,177	
	12月末日	2,217,446,535		9,165	
	令和 4年 1月末日	2,169,272,153		9,002	
	2月末日	2,105,149,157		8,818	
	3月末日	2,015,111,414		8,577	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	円
第2計算期間	円
第3計算期間	20円
第4計算期間	20円
第5計算期間	20円
第6計算期間	20円
第7計算期間	20円
第8計算期間	20円
第9計算期間	20円
第10計算期間	20円
第11計算期間	20円
第12計算期間	20円
第13計算期間	20円
第14計算期間	20円
第15計算期間	20円
第16計算期間	20円
第17計算期間	20円
第18計算期間	20円
第19計算期間	20円
第20計算期間	20円
第21計算期間	20円
第22計算期間	20円
第23計算期間	20円
第24計算期間	20円
第25計算期間	20円
第26計算期間	20円
第27計算期間	20円
第28計算期間	20円
第29計算期間	20円
第30計算期間	20円
第31計算期間	20円
第32計算期間	20円
第33計算期間	20円
第34計算期間	20円
第35計算期間	20円
第36計算期間	20円
第37計算期間	20円
第38計算期間	20円
第39計算期間	20円
第40計算期間	20円
第41計算期間	20円
第42計算期間	20円

第43計算期間	20円
第44計算期間	20円
第45計算期間	20円
第46計算期間	20円
第47計算期間	20円
第48計算期間	20円
第49計算期間	20円
第50計算期間	10円
第51計算期間	10円
第52計算期間	10円
第53計算期間	10円
第54計算期間	10円
第55計算期間	10円
第56計算期間	10円
第57計算期間	10円
第58計算期間	10円
第59計算期間	10円
第60計算期間	10円
第61計算期間	10円
第62計算期間	10円
第63計算期間	10円
第64計算期間	10円
第65計算期間	10円
第66計算期間	10円
第67計算期間	10円
第68計算期間	10円
第69計算期間	10円
第70計算期間	10円
第71計算期間	10円
第72計算期間	5円
第73計算期間	5円
第74計算期間	5円
第75計算期間	5円
第76計算期間	5円
第77計算期間	5円
第78計算期間	5円
第79計算期間	5円
第80計算期間	5円
第81計算期間	5円
第82計算期間	5円
第83計算期間	5円
第84計算期間	5円
第85計算期間	5円

第86計算期間	5円
第87計算期間	5円
第88計算期間	5円
第89計算期間	5円
第90計算期間	5円
第91計算期間	5円
第92計算期間	5円
第93計算期間	5円
第94計算期間	5円
第95計算期間	5円
第96計算期間	5円
第97計算期間	5円
第98計算期間	5円
第99計算期間	5円
第100計算期間	5円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.81
第2計算期間	0.29
第3計算期間	1.17
第4計算期間	0.39
第5計算期間	0.08
第6計算期間	0.42
第7計算期間	0.54
第8計算期間	0.20
第9計算期間	0.46
第10計算期間	0.14
第11計算期間	0.06
第12計算期間	0.36
第13計算期間	0.27
第14計算期間	0.74
第15計算期間	0.61
第16計算期間	0.86
第17計算期間	1.36
第18計算期間	1.78
第19計算期間	0.70
第20計算期間	0.49
第21計算期間	0.37
第22計算期間	0.81
第23計算期間	0.39

第24計算期間	0.76
第25計算期間	0.38
第26計算期間	0.42
第27計算期間	0.37
第28計算期間	0.26
第29計算期間	1.62
第30計算期間	0.11
第31計算期間	0.44
第32計算期間	1.36
第33計算期間	0.25
第34計算期間	0.37
第35計算期間	0.75
第36計算期間	0.19
第37計算期間	2.43
第38計算期間	0.14
第39計算期間	0.54
第40計算期間	0.71
第41計算期間	0.68
第42計算期間	0.25
第43計算期間	0.72
第44計算期間	0.52
第45計算期間	0.99
第46計算期間	0.94
第47計算期間	0.94
第48計算期間	0.17
第49計算期間	0.56
第50計算期間	0.17
第51計算期間	1.71
第52計算期間	0.59
第53計算期間	0.32
第54計算期間	1.22
第55計算期間	0.14
第56計算期間	0.38
第57計算期間	0.25
第58計算期間	0.84
第59計算期間	1.11
第60計算期間	0.14
第61計算期間	0.83
第62計算期間	0.35
第63計算期間	1.07
第64計算期間	0.19
第65計算期間	0.80
第66計算期間	0.33

第67計算期間	1.35
第68計算期間	0.16
第69計算期間	1.53
第70計算期間	0.80
第71計算期間	0.11
第72計算期間	1.77
第73計算期間	0.39
第74計算期間	0.14
第75計算期間	1.23
第76計算期間	2.86
第77計算期間	3.20
第78計算期間	1.30
第79計算期間	0.34
第80計算期間	1.56
第81計算期間	1.13
第82計算期間	0.49
第83計算期間	0.39
第84計算期間	0.23
第85計算期間	0.33
第86計算期間	0.43
第87計算期間	0.20
第88計算期間	2.01
第89計算期間	0.17
第90計算期間	0.63
第91計算期間	0.17
第92計算期間	1.02
第93計算期間	0.14
第94計算期間	0.07
第95計算期間	0.83
第96計算期間	0.48
第97計算期間	0.85
第98計算期間	1.22
第99計算期間	1.60
第100計算期間	0.86

（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。

（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	557,660,901	11,777,625	545,883,276
第2計算期間	197,730,066	20,721	743,592,621
第3計算期間	143,161,808	200,800	886,553,629

第4計算期間	138,407,548	2,300	1,024,958,877
第5計算期間	115,016,175	31,774,035	1,108,201,017
第6計算期間	371,107,153	7,382,735	1,471,925,435
第7計算期間	51,246,178	33,910,414	1,489,261,199
第8計算期間	22,501,646	43,794,334	1,467,968,511
第9計算期間	60,809,183	25,326,259	1,503,451,435
第10計算期間	46,585,461	23,758,886	1,526,278,010
第11計算期間	695,492,681	362,690,736	1,859,079,955
第12計算期間	13,523,347	16,172,190	1,856,431,112
第13計算期間	27,532,173	62,078,588	1,821,884,697
第14計算期間	17,038,894	86,277,750	1,752,645,841
第15計算期間	3,391,061	72,122,299	1,683,914,603
第16計算期間	10,225,181	90,105,761	1,604,034,023
第17計算期間	11,348,475	127,268,682	1,488,113,816
第18計算期間	75,497,108	41,366,247	1,522,244,677
第19計算期間	23,255,729	40,321,959	1,505,178,447
第20計算期間	26,656,555	47,120,345	1,484,714,657
第21計算期間	96,681,638	2,595,226	1,578,801,069
第22計算期間	37,495,734	22,283,017	1,594,013,786
第23計算期間	3,457,557	16,745,339	1,580,726,004
第24計算期間	10,436,045	18,302,454	1,572,859,595
第25計算期間	165,016,337	14,311,532	1,723,564,400
第26計算期間	167,252,225	9,309,059	1,881,507,566
第27計算期間	54,658,694	32,351,182	1,903,815,078
第28計算期間	136,949,327	2,522,123	2,038,242,282
第29計算期間	263,903,376	88,992,039	2,213,153,619
第30計算期間	455,022,166	30,543,551	2,637,632,234
第31計算期間	551,665,192	7,774,253	3,181,523,173
第32計算期間	983,983,471	42,635,173	4,122,871,471
第33計算期間	1,116,477,855	80,899,509	5,158,449,817
第34計算期間	809,687,331	132,050,368	5,836,086,780
第35計算期間	1,215,741,676	286,193,333	6,765,635,123
第36計算期間	1,264,748,656	366,249,204	7,664,134,575
第37計算期間	1,230,214,257	196,766,292	8,697,582,540
第38計算期間	1,260,941,927	320,043,306	9,638,481,161
第39計算期間	257,776,175	288,368,625	9,607,888,711
第40計算期間	203,977,964	435,495,808	9,376,370,867
第41計算期間	105,222,365	1,011,051,766	8,470,541,466
第42計算期間	113,175,858	550,562,684	8,033,154,640
第43計算期間	48,133,809	456,160,118	7,625,128,331
第44計算期間	53,604,186	432,802,543	7,245,929,974
第45計算期間	14,852,743	347,638,336	6,913,144,381
第46計算期間	8,673,550	243,876,407	6,677,941,524

第47計算期間	10,487,089	328,339,098	6,360,089,515
第48計算期間	10,846,248	275,461,004	6,095,474,759
第49計算期間	7,995,532	282,140,107	5,821,330,184
第50計算期間	16,600,264	199,564,862	5,638,365,586
第51計算期間	1,037,812	172,964,680	5,466,438,718
第52計算期間	3,091,178	163,999,321	5,305,530,575
第53計算期間	873,964	129,709,642	5,176,694,897
第54計算期間	7,408,121	159,852,994	5,024,250,024
第55計算期間	1,205,413	71,131,295	4,954,324,142
第56計算期間	5,390,451	129,368,799	4,830,345,794
第57計算期間	826,859	103,770,261	4,727,402,392
第58計算期間	3,353,542	117,454,567	4,613,301,367
第59計算期間	798,746	95,167,204	4,518,932,909
第60計算期間	787,740	181,689,692	4,338,030,957
第61計算期間	6,780,607	126,378,507	4,218,433,057
第62計算期間	5,253,967	58,801,553	4,164,885,471
第63計算期間	741,464	50,590,846	4,115,036,089
第64計算期間	7,459,412	18,461,085	4,104,034,416
第65計算期間	1,160,538	46,516,467	4,058,678,487
第66計算期間	684,849	89,577,777	3,969,785,559
第67計算期間	1,547,794	54,655,735	3,916,677,618
第68計算期間	5,020,932	15,824,476	3,905,874,074
第69計算期間	15,854,178	20,560,745	3,901,167,507
第70計算期間	3,690,483	28,746,841	3,876,111,149
第71計算期間	6,007,702	56,684,791	3,825,434,060
第72計算期間	672,912	43,715,327	3,782,391,645
第73計算期間	395,402	41,919,444	3,740,867,603
第74計算期間	934,346	30,937,867	3,710,864,082
第75計算期間	517,600	45,405,740	3,665,975,942
第76計算期間	694,952	85,241,871	3,581,429,023
第77計算期間	11,551,287	45,229,404	3,547,750,906
第78計算期間	346,041	23,014,169	3,525,082,778
第79計算期間	416,181	9,055,059	3,516,443,900
第80計算期間	1,673,702	75,930,677	3,442,186,925
第81計算期間	497,282	143,885,189	3,298,799,018
第82計算期間	822,537	54,248,625	3,245,372,930
第83計算期間	274,627	48,734,654	3,196,912,903
第84計算期間	310,502	71,878,156	3,125,345,249
第85計算期間	477,804	94,771,401	3,031,051,652
第86計算期間	891,427	48,404,833	2,983,538,246
第87計算期間	455,833	58,793,761	2,925,200,318
第88計算期間	237,356	51,771,523	2,873,666,151
第89計算期間	216,799	56,866,517	2,817,016,433

第90計算期間	229,141	17,631,784	2,799,613,790
第91計算期間	245,650	27,175,071	2,772,684,369
第92計算期間	230,265	8,339,093	2,764,575,541
第93計算期間	245,551	139,723,802	2,625,097,290
第94計算期間	215,299	43,143,281	2,582,169,308
第95計算期間	1,260,567	40,383,258	2,543,046,617
第96計算期間	247,124	64,525,925	2,478,767,816
第97計算期間	227,468	50,569,464	2,428,425,820
第98計算期間	244,483	13,314,355	2,415,355,948
第99計算期間	235,896	28,039,729	2,387,552,115
第100計算期間	229,133	3,885,214	2,383,896,034

【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)】

(1) 【投資状況】

令和 4年 3月31日現在

(単位: 円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	ルクセンブルグ	4,694,294,062	99.03
親投資信託受益証券	日本	5,510,316	0.12
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		40,589,373	0.85
純資産総額		4,740,393,751	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

令和 4年 3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ルクセンブルグ	投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	436,191.6059	10,444	4,555,585,132	10,762	4,694,294,062	99.03
日本	親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	5,411,821	1.0182	5,510,316	1.0182	5,510,316	0.12

(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

令和 4年 3月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.03
親投資信託受益証券	0.12
合計	99.14

（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令和4年3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）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（平成25年12月9日）	849,615,126	849,615,126	10,464	10,464
第2計算期間末日（平成26年1月8日）	1,642,227,155	1,642,227,155	10,634	10,634
第3計算期間末日（平成26年2月10日）	2,118,485,164	2,124,546,081	10,486	10,516
第4計算期間末日（平成26年3月10日）	2,501,399,550	2,508,526,987	10,529	10,559
第5計算期間末日（平成26年4月8日）	2,861,844,828	2,870,028,361	10,491	10,521
第6計算期間末日（平成26年5月8日）	3,100,714,315	3,109,689,523	10,364	10,394
第7計算期間末日（平成26年6月9日）	3,337,831,730	3,347,387,715	10,479	10,509
第8計算期間末日（平成26年7月8日）	3,345,706,291	3,355,396,399	10,358	10,388
第9計算期間末日（平成26年8月8日）	3,454,502,452	3,464,455,643	10,412	10,442
第10計算期間末日（平成26年9月8日）	3,599,413,728	3,609,533,683	10,670	10,700
第11計算期間末日（平成26年10月8日）	3,657,323,365	3,667,310,462	10,986	11,016
第12計算期間末日（平成26年11月10日）	3,816,073,908	3,825,886,179	11,667	11,697
第13計算期間末日（平成26年12月8日）	3,678,236,677	3,687,193,799	12,319	12,349
第14計算期間末日（平成27年1月8日）	3,603,382,559	3,612,252,629	12,187	12,217
第15計算期間末日（平成27年2月9日）	3,530,533,279	3,539,217,786	12,196	12,226
第16計算期間末日（平成27年3月9日）	3,609,648,349	3,618,466,736	12,280	12,310
第17計算期間末日（平成27年4月8日）	3,389,882,901	3,398,126,504	12,336	12,366
第18計算期間末日（平成27年5月8日）	3,527,260,056	3,536,071,209	12,010	12,040
第19計算期間末日（平成27年6月8日）	3,639,693,568	3,648,420,605	12,512	12,542
第20計算期間末日（平成27年7月8日）	3,679,878,896	3,688,925,761	12,203	12,233

第21計算期間末日	(平成27年 8月10日)	4,026,724,758	4,036,442,000	12,432	12,462
第22計算期間末日	(平成27年 9月 8日)	4,197,441,665	4,208,109,777	11,804	11,834
第23計算期間末日	(平成27年10月 8日)	4,362,115,131	4,373,107,711	11,905	11,935
第24計算期間末日	(平成27年11月 9日)	4,415,668,169	4,441,299,463	12,059	12,129
第25計算期間末日	(平成27年12月 8日)	5,561,813,078	5,594,124,040	12,049	12,119
第26計算期間末日	(平成28年 1月 8日)	6,508,229,182	6,548,023,937	11,448	11,518
第27計算期間末日	(平成28年 2月 8日)	7,307,903,811	7,353,115,290	11,315	11,385
第28計算期間末日	(平成28年 3月 8日)	8,003,047,960	8,054,490,729	10,890	10,960
第29計算期間末日	(平成28年 4月 8日)	8,941,663,295	9,001,448,444	10,469	10,539
第30計算期間末日	(平成28年 5月 9日)	9,304,526,444	9,367,886,455	10,280	10,350
第31計算期間末日	(平成28年 6月 8日)	10,053,248,170	10,121,466,789	10,316	10,386
第32計算期間末日	(平成28年 7月 8日)	9,926,368,031	9,997,418,900	9,780	9,850
第33計算期間末日	(平成28年 8月 8日)	10,071,506,700	10,143,454,435	9,799	9,869
第34計算期間末日	(平成28年 9月 8日)	10,680,005,427	10,756,607,830	9,759	9,829
第35計算期間末日	(平成28年10月11日)	11,568,499,493	11,651,413,086	9,767	9,837
第36計算期間末日	(平成28年11月 8日)	12,244,247,760	12,331,515,538	9,821	9,891
第37計算期間末日	(平成28年12月 8日)	12,130,992,292	12,212,974,597	10,358	10,428
第38計算期間末日	(平成29年 1月10日)	11,770,422,673	11,848,231,846	10,589	10,659
第39計算期間末日	(平成29年 2月 8日)	10,947,513,147	11,022,597,621	10,206	10,276
第40計算期間末日	(平成29年 3月 8日)	10,930,965,289	11,005,744,116	10,232	10,302
第41計算期間末日	(平成29年 4月10日)	10,434,477,852	10,507,846,812	9,955	10,025
第42計算期間末日	(平成29年 5月 8日)	10,668,182,396	10,742,538,886	10,043	10,113
第43計算期間末日	(平成29年 6月 8日)	10,360,903,448	10,434,798,087	9,815	9,885
第44計算期間末日	(平成29年 7月10日)	10,325,822,341	10,397,267,205	10,117	10,187
第45計算期間末日	(平成29年 8月 8日)	9,758,927,934	9,828,079,092	9,879	9,949
第46計算期間末日	(平成29年 9月 8日)	9,681,724,137	9,751,529,010	9,709	9,779
第47計算期間末日	(平成29年10月10日)	9,720,391,071	9,788,827,738	9,942	10,012
第48計算期間末日	(平成29年11月 8日)	9,650,517,196	9,717,993,472	10,011	10,081
第49計算期間末日	(平成29年12月 8日)	9,236,620,756	9,302,722,728	9,781	9,851
第50計算期間末日	(平成30年 1月 9日)	9,065,967,689	9,130,997,686	9,759	9,829
第51計算期間末日	(平成30年 2月 8日)	8,489,550,599	8,554,120,907	9,203	9,273
第52計算期間末日	(平成30年 3月 8日)	8,036,458,003	8,100,236,546	8,820	8,890
第53計算期間末日	(平成30年 4月 9日)	8,020,108,809	8,083,244,993	8,892	8,962
第54計算期間末日	(平成30年 5月 8日)	7,971,926,361	8,034,590,085	8,905	8,975
第55計算期間末日	(平成30年 6月 8日)	7,950,113,294	8,012,623,717	8,903	8,973
第56計算期間末日	(平成30年 7月 9日)	7,931,235,450	7,993,464,078	8,922	8,992
第57計算期間末日	(平成30年 8月 8日)	7,857,468,251	7,919,214,082	8,908	8,978
第58計算期間末日	(平成30年 9月10日)	7,751,029,258	7,812,874,765	8,773	8,843
第59計算期間末日	(平成30年10月 9日)	7,789,418,590	7,851,170,418	8,830	8,900
第60計算期間末日	(平成30年11月 8日)	7,670,293,282	7,714,102,338	8,754	8,804
第61計算期間末日	(平成30年12月10日)	7,608,709,185	7,652,206,367	8,746	8,796
第62計算期間末日	(平成31年 1月 8日)	7,259,368,537	7,302,426,706	8,430	8,480

第63計算期間末日	(平成31年 2月 8日)	7,355,056,838	7,397,840,420	8,596	8,646
第64計算期間末日	(平成31年 3月 8日)	7,386,373,706	7,428,896,562	8,685	8,735
第65計算期間末日	(平成31年 4月 8日)	7,396,023,831	7,438,328,358	8,741	8,791
第66計算期間末日	(令和 1年 5月 8日)	7,213,128,648	7,254,881,052	8,638	8,688
第67計算期間末日	(令和 1年 6月10日)	7,107,409,744	7,149,009,994	8,543	8,593
第68計算期間末日	(令和 1年 7月 8日)	7,100,946,582	7,142,419,816	8,561	8,611
第69計算期間末日	(令和 1年 8月 8日)	6,978,752,010	7,020,037,114	8,452	8,502
第70計算期間末日	(令和 1年 9月 9日)	7,038,152,129	7,079,220,900	8,569	8,619
第71計算期間末日	(令和 1年10月 8日)	6,986,898,914	7,027,795,236	8,542	8,592
第72計算期間末日	(令和 1年11月 8日)	6,873,121,206	6,897,190,648	8,567	8,597
第73計算期間末日	(令和 1年12月 9日)	6,690,674,356	6,714,199,702	8,532	8,562
第74計算期間末日	(令和 2年 1月 8日)	6,601,534,185	6,624,744,737	8,533	8,563
第75計算期間末日	(令和 2年 2月10日)	6,617,766,317	6,640,541,349	8,717	8,747
第76計算期間末日	(令和 2年 3月 9日)	6,480,231,484	6,502,843,908	8,597	8,627
第77計算期間末日	(令和 2年 4月 8日)	6,364,766,621	6,386,940,356	8,611	8,641
第78計算期間末日	(令和 2年 5月 8日)	6,275,449,480	6,297,571,448	8,510	8,540
第79計算期間末日	(令和 2年 6月 8日)	6,422,675,130	6,444,655,885	8,766	8,796
第80計算期間末日	(令和 2年 7月 8日)	6,306,013,567	6,327,757,927	8,700	8,730
第81計算期間末日	(令和 2年 8月11日)	6,230,558,850	6,252,198,066	8,638	8,668
第82計算期間末日	(令和 2年 9月 8日)	6,165,134,127	6,186,631,293	8,604	8,634
第83計算期間末日	(令和 2年10月 8日)	6,028,402,861	6,049,629,146	8,520	8,550
第84計算期間末日	(令和 2年11月 9日)	5,836,863,610	5,847,396,861	8,312	8,327
第85計算期間末日	(令和 2年12月 8日)	5,769,678,230	5,779,998,282	8,386	8,401
第86計算期間末日	(令和 3年 1月 8日)	5,652,427,173	5,662,599,912	8,335	8,350
第87計算期間末日	(令和 3年 2月 8日)	5,593,752,934	5,603,709,186	8,427	8,442
第88計算期間末日	(令和 3年 3月 8日)	5,499,458,213	5,509,205,573	8,463	8,478
第89計算期間末日	(令和 3年 4月 8日)	5,479,950,818	5,489,572,489	8,543	8,558
第90計算期間末日	(令和 3年 5月10日)	5,393,304,534	5,402,819,437	8,502	8,517
第91計算期間末日	(令和 3年 6月 8日)	5,293,822,241	5,303,099,311	8,560	8,575
第92計算期間末日	(令和 3年 7月 8日)	5,307,601,279	5,316,708,016	8,742	8,757
第93計算期間末日	(令和 3年 8月10日)	5,230,984,922	5,240,013,290	8,691	8,706
第94計算期間末日	(令和 3年 9月 8日)	5,150,758,518	5,159,676,371	8,664	8,679
第95計算期間末日	(令和 3年10月 8日)	5,061,142,891	5,069,889,049	8,680	8,695
第96計算期間末日	(令和 3年11月 8日)	5,007,738,829	5,016,217,053	8,860	8,875
第97計算期間末日	(令和 3年12月 8日)	4,877,072,745	4,885,395,593	8,790	8,805
第98計算期間末日	(令和 4年 1月11日)	4,847,718,535	4,855,961,648	8,821	8,836
第99計算期間末日	(令和 4年 2月 8日)	4,694,693,201	4,702,856,367	8,627	8,642
第100計算期間末日	(令和 4年 3月 8日)	4,655,588,013	4,663,743,211	8,563	8,578
	令和 3年 3月末日	5,513,708,305		8,564	
	4月末日	5,421,461,425		8,512	
	5月末日	5,344,780,748		8,613	
	6月末日	5,289,105,103		8,689	

7月末日	5,232,644,910		8,681
8月末日	5,170,388,560		8,682
9月末日	5,133,256,321		8,744
10月末日	5,014,285,072		8,816
11月末日	4,901,416,511		8,796
12月末日	4,887,701,689		8,880
令和 4年 1月末日	4,765,025,644		8,733
2月末日	4,665,572,966		8,577
3月末日	4,740,393,751		8,813

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	円
第2計算期間	円
第3計算期間	30円
第4計算期間	30円
第5計算期間	30円
第6計算期間	30円
第7計算期間	30円
第8計算期間	30円
第9計算期間	30円
第10計算期間	30円
第11計算期間	30円
第12計算期間	30円
第13計算期間	30円
第14計算期間	30円
第15計算期間	30円
第16計算期間	30円
第17計算期間	30円
第18計算期間	30円
第19計算期間	30円
第20計算期間	30円
第21計算期間	30円
第22計算期間	30円
第23計算期間	30円
第24計算期間	70円
第25計算期間	70円
第26計算期間	70円
第27計算期間	70円
第28計算期間	70円
第29計算期間	70円

第30計算期間	70円
第31計算期間	70円
第32計算期間	70円
第33計算期間	70円
第34計算期間	70円
第35計算期間	70円
第36計算期間	70円
第37計算期間	70円
第38計算期間	70円
第39計算期間	70円
第40計算期間	70円
第41計算期間	70円
第42計算期間	70円
第43計算期間	70円
第44計算期間	70円
第45計算期間	70円
第46計算期間	70円
第47計算期間	70円
第48計算期間	70円
第49計算期間	70円
第50計算期間	70円
第51計算期間	70円
第52計算期間	70円
第53計算期間	70円
第54計算期間	70円
第55計算期間	70円
第56計算期間	70円
第57計算期間	70円
第58計算期間	70円
第59計算期間	70円
第60計算期間	50円
第61計算期間	50円
第62計算期間	50円
第63計算期間	50円
第64計算期間	50円
第65計算期間	50円
第66計算期間	50円
第67計算期間	50円
第68計算期間	50円
第69計算期間	50円
第70計算期間	50円
第71計算期間	50円
第72計算期間	30円

第73計算期間	30円
第74計算期間	30円
第75計算期間	30円
第76計算期間	30円
第77計算期間	30円
第78計算期間	30円
第79計算期間	30円
第80計算期間	30円
第81計算期間	30円
第82計算期間	30円
第83計算期間	30円
第84計算期間	15円
第85計算期間	15円
第86計算期間	15円
第87計算期間	15円
第88計算期間	15円
第89計算期間	15円
第90計算期間	15円
第91計算期間	15円
第92計算期間	15円
第93計算期間	15円
第94計算期間	15円
第95計算期間	15円
第96計算期間	15円
第97計算期間	15円
第98計算期間	15円
第99計算期間	15円
第100計算期間	15円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	4.64
第2計算期間	1.62
第3計算期間	1.10
第4計算期間	0.69
第5計算期間	0.07
第6計算期間	0.92
第7計算期間	1.39
第8計算期間	0.86
第9計算期間	0.81
第10計算期間	2.76

第11計算期間	3.24
第12計算期間	6.47
第13計算期間	5.84
第14計算期間	0.82
第15計算期間	0.32
第16計算期間	0.93
第17計算期間	0.70
第18計算期間	2.39
第19計算期間	4.42
第20計算期間	2.22
第21計算期間	2.12
第22計算期間	4.81
第23計算期間	1.10
第24計算期間	1.88
第25計算期間	0.49
第26計算期間	4.40
第27計算期間	0.55
第28計算期間	3.13
第29計算期間	3.22
第30計算期間	1.13
第31計算期間	1.03
第32計算期間	4.51
第33計算期間	0.91
第34計算期間	0.30
第35計算期間	0.79
第36計算期間	1.26
第37計算期間	6.18
第38計算期間	2.90
第39計算期間	2.95
第40計算期間	0.94
第41計算期間	2.02
第42計算期間	1.58
第43計算期間	1.57
第44計算期間	3.79
第45計算期間	1.66
第46計算期間	1.01
第47計算期間	3.12
第48計算期間	1.39
第49計算期間	1.59
第50計算期間	0.49
第51計算期間	4.98
第52計算期間	3.40
第53計算期間	1.60

第54計算期間	0.93
第55計算期間	0.76
第56計算期間	0.99
第57計算期間	0.62
第58計算期間	0.72
第59計算期間	1.44
第60計算期間	0.29
第61計算期間	0.47
第62計算期間	3.04
第63計算期間	2.56
第64計算期間	1.61
第65計算期間	1.22
第66計算期間	0.60
第67計算期間	0.52
第68計算期間	0.79
第69計算期間	0.68
第70計算期間	1.97
第71計算期間	0.26
第72計算期間	0.64
第73計算期間	0.05
第74計算期間	0.36
第75計算期間	2.50
第76計算期間	1.03
第77計算期間	0.51
第78計算期間	0.82
第79計算期間	3.36
第80計算期間	0.41
第81計算期間	0.36
第82計算期間	0.04
第83計算期間	0.62
第84計算期間	2.26
第85計算期間	1.07
第86計算期間	0.42
第87計算期間	1.28
第88計算期間	0.60
第89計算期間	1.12
第90計算期間	0.30
第91計算期間	0.85
第92計算期間	2.30
第93計算期間	0.41
第94計算期間	0.13
第95計算期間	0.35
第96計算期間	2.24

第97計算期間	0.62
第98計算期間	0.52
第99計算期間	2.02
第100計算期間	0.56

（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。

（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	811,918,967	1,266	811,917,701
第2計算期間	748,797,038	16,341,396	1,544,373,343
第3計算期間	542,265,918	66,333,293	2,020,305,968
第4計算期間	362,148,262	6,641,648	2,375,812,582
第5計算期間	399,768,973	47,737,133	2,727,844,422
第6計算期間	317,431,165	53,539,575	2,991,736,012
第7計算期間	230,429,734	36,837,272	3,185,328,474
第8計算期間	127,072,985	82,365,226	3,230,036,233
第9計算期間	156,331,228	68,637,117	3,317,730,344
第10計算期間	178,401,616	122,813,313	3,373,318,647
第11計算期間	283,026,941	327,312,989	3,329,032,599
第12計算期間	187,098,061	245,373,625	3,270,757,035
第13計算期間	155,122,702	440,172,103	2,985,707,634
第14計算期間	199,594,272	228,611,845	2,956,690,061
第15計算期間	125,680,969	187,535,051	2,894,835,979
第16計算期間	170,086,378	125,459,864	2,939,462,493
第17計算期間	134,556,701	326,151,357	2,747,867,837
第18計算期間	279,982,612	90,799,213	2,937,051,236
第19計算期間	127,205,371	155,244,250	2,909,012,357
第20計算期間	225,678,222	119,068,592	3,015,621,987
第21計算期間	303,687,627	80,228,925	3,239,080,689
第22計算期間	416,271,026	99,314,214	3,556,037,501
第23計算期間	162,209,226	54,053,116	3,664,193,611
第24計算期間	64,257,236	66,837,312	3,661,613,535
第25計算期間	1,028,822,222	74,583,954	4,615,851,803
第26計算期間	1,172,691,898	103,578,677	5,684,965,024
第27計算期間	850,966,208	77,148,496	6,458,782,736
第28計算期間	930,779,739	40,595,401	7,348,967,074
第29計算期間	1,261,480,939	69,712,422	8,540,735,591
第30計算期間	570,505,532	59,810,963	9,051,430,160
第31計算期間	777,562,462	83,475,502	9,745,517,120
第32計算期間	624,983,776	220,376,615	10,150,124,281
第33計算期間	294,678,765	166,555,085	10,278,247,961

第34計算期間	854,553,726	189,601,133	10,943,200,554
第35計算期間	1,105,373,156	203,774,710	11,844,799,000
第36計算期間	851,602,353	229,575,839	12,466,825,514
第37計算期間	767,050,769	1,522,118,298	11,711,757,985
第38計算期間	550,271,638	1,146,433,475	11,115,596,148
第39計算期間	330,514,647	719,757,293	10,726,353,502
第40計算期間	342,140,184	385,804,070	10,682,689,616
第41計算期間	540,618,679	742,028,291	10,481,280,004
第42計算期間	310,242,016	169,166,286	10,622,355,734
第43計算期間	321,048,871	387,027,528	10,556,377,077
第44計算期間	194,631,379	544,599,244	10,206,409,212
第45計算期間	127,703,365	455,375,701	9,878,736,876
第46計算期間	254,976,092	161,588,164	9,972,124,804
第47計算期間	200,167,663	395,625,742	9,776,666,725
第48計算期間	192,654,796	329,853,474	9,639,468,047
第49計算期間	118,358,626	314,687,698	9,443,138,975
第50計算期間	89,001,237	242,140,508	9,289,999,704
第51計算期間	41,564,674	107,234,527	9,224,329,851
第52計算期間	33,535,488	146,644,835	9,111,220,504
第53計算期間	33,924,477	125,689,986	9,019,454,995
第54計算期間	23,909,058	91,403,399	8,951,960,654
第55計算期間	39,130,246	61,030,379	8,930,060,521
第56計算期間	57,053,305	97,309,689	8,889,804,137
第57計算期間	55,226,887	124,197,904	8,820,833,120
第58計算期間	117,352,263	103,112,856	8,835,072,527
第59計算期間	45,076,539	58,459,319	8,821,689,747
第60計算期間	23,569,698	83,448,091	8,761,811,354
第61計算期間	17,897,612	80,272,541	8,699,436,425
第62計算期間	24,862,939	112,665,391	8,611,633,973
第63計算期間	30,882,683	85,800,186	8,556,716,470
第64計算期間	20,570,840	72,716,020	8,504,571,290
第65計算期間	17,956,812	61,622,700	8,460,905,402
第66計算期間	13,202,717	123,627,154	8,350,480,965
第67計算期間	16,671,091	47,101,914	8,320,050,142
第68計算期間	28,577,403	53,980,720	8,294,646,825
第69計算期間	41,416,588	79,042,524	8,257,020,889
第70計算期間	25,663,879	68,930,484	8,213,754,284
第71計算期間	14,492,662	48,982,474	8,179,264,472
第72計算期間	20,220,348	176,337,270	8,023,147,550
第73計算期間	8,139,102	189,504,460	7,841,782,192
第74計算期間	10,591,658	115,523,117	7,736,850,733
第75計算期間	6,200,185	151,373,508	7,591,677,410
第76計算期間	55,518,866	109,721,326	7,537,474,950

第77計算期間	4,802,567	151,032,457	7,391,245,060
第78計算期間	5,381,091	22,636,699	7,373,989,452
第79計算期間	7,275,978	54,346,836	7,326,918,594
第80計算期間	7,245,954	86,044,491	7,248,120,057
第81計算期間	5,805,448	40,853,376	7,213,072,129
第82計算期間	21,461,624	68,811,682	7,165,722,071
第83計算期間	5,276,477	95,570,107	7,075,428,441
第84計算期間	5,104,384	58,365,262	7,022,167,563
第85計算期間	3,247,380	145,379,800	6,880,035,143
第86計算期間	3,627,106	101,836,093	6,781,826,156
第87計算期間	5,690,112	150,014,339	6,637,501,929
第88計算期間	2,910,535	142,171,912	6,498,240,552
第89計算期間	2,063,746	85,856,887	6,414,447,411
第90計算期間	2,671,476	73,849,881	6,343,269,006
第91計算期間	1,993,549	160,549,056	6,184,713,499
第92計算期間	1,808,382	115,363,625	6,071,158,256
第93計算期間	1,779,206	54,025,008	6,018,912,454
第94計算期間	2,439,585	76,116,109	5,945,235,930
第95計算期間	1,837,080	116,300,353	5,830,772,657
第96計算期間	2,979,322	181,602,472	5,652,149,507
第97計算期間	3,370,573	106,954,605	5,548,565,475
第98計算期間	1,823,092	54,979,476	5,495,409,091
第99計算期間	4,726,454	58,024,804	5,442,110,741
第100計算期間	24,520,492	29,832,294	5,436,798,939

(参考)

マネー・マーケット・マザーファンド

投資状況

令和 4年 3月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,763,364,967	100.00
純資産総額		1,763,364,967	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

該当事項はありません。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

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

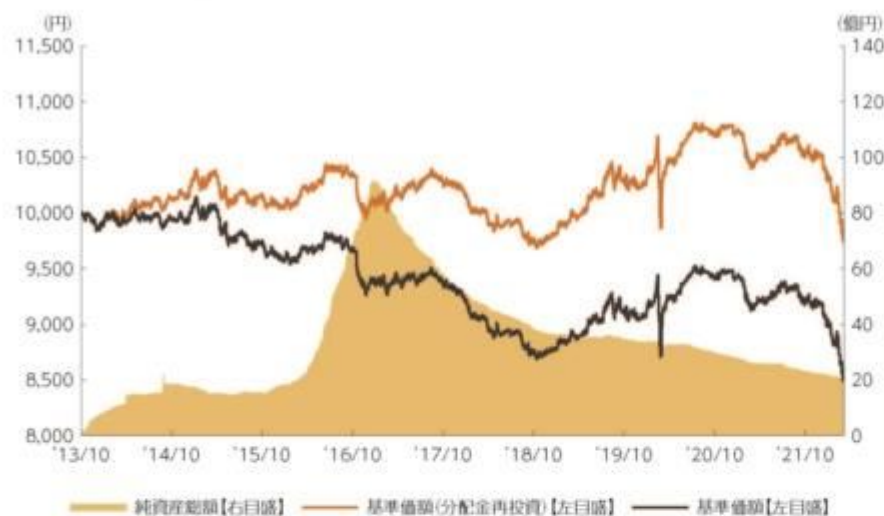


運用実績

2022年3月31日現在

<米ドルヘッジ型> (毎月決算型)

■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2022年3月31日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)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	8,577円
純資産総額	20.1億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年 3月	5円
2022年 2月	5円
2022年 1月	5円
2021年 12月	5円
2021年 11月	5円
2021年 10月	5円

直近1年間累計 60円

設定来累計 1,305円

•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

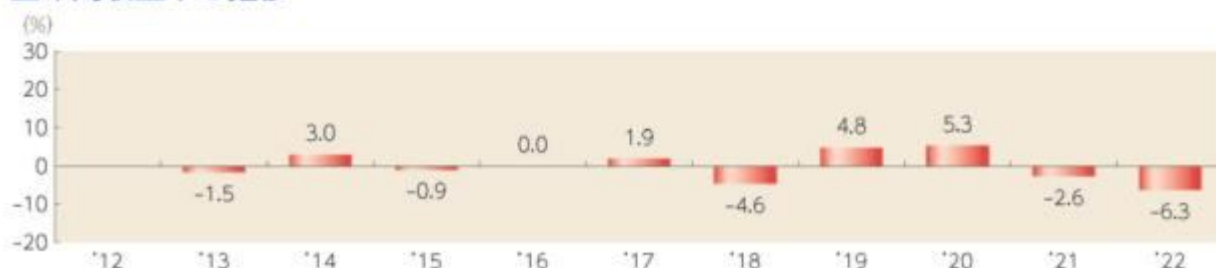
資産構成	比率
ビムコトータルリターン・ファンドII - クラスJUPY, Hedged)	99.4%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.1%
コールローン他 (負債控除後)	0.5%
合計	100.0%

- 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)
- 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。

組入上位銘柄	クーポン	償還日	比率
1 FNMA TBA 3.0% MAY 30YR	3.0000%	2052/05/12	12.2%
2 FNMA TBA 3.5% JUN 30YR	3.5000%	2052/06/13	9.6%
3 U S TREASURY BOND	3.3750%	2044/05/15	3.8%
4 U S TREASURY NOTE	2.1250%	2024/09/30	3.5%
5 FNMA TBA 3.0% JUN 30YR	3.0000%	2052/06/13	2.7%
6 U S TREASURY BOND	3.1250%	2044/08/15	1.7%
7 U S TREASURY BOND	1.3750%	2040/11/15	1.4%
8 SOUTH AFRICA (REP) BD SER R186	10.5000%	2026/12/21	1.4%
9 FNMA TBA 2.5% JUN 30YR	2.5000%	2052/06/13	1.4%
10 U S TREASURY BOND	2.7500%	2042/11/15	1.2%

- 比率は実質的な投資を行う投資信託証券の純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移

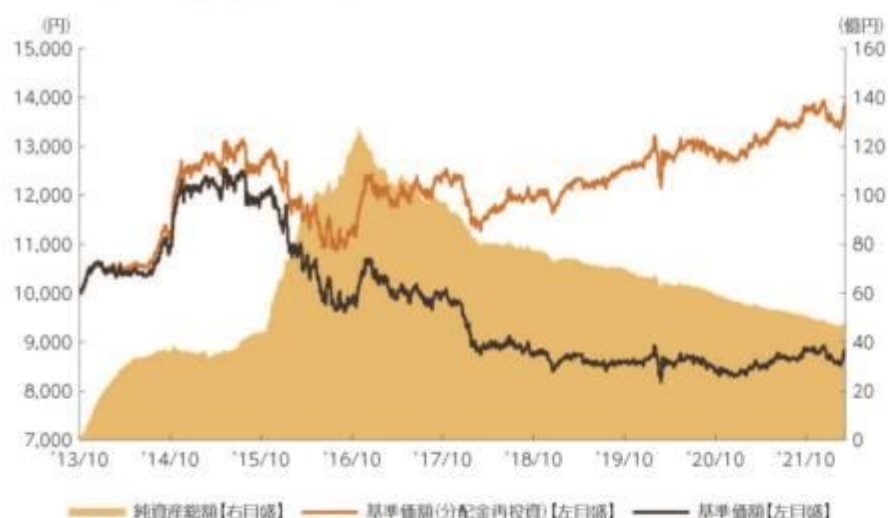


- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2022年は年初から3月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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。

<為替ヘッジなし> (毎月決算型)

■基準価額・純資産の推移 2013年10月25日(設定日)～2022年3月31日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)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	8,813円
純資産総額	47.4億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2022年 3月	15円
2022年 2月	15円
2022年 1月	15円
2021年 12月	15円
2021年 11月	15円
2021年 10月	15円
直近1年間累計	180円
設定来累計	4,365円

●分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

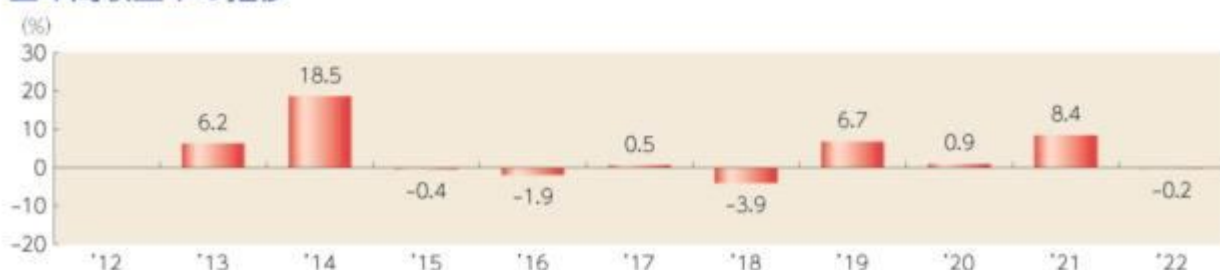
資産構成	比率
ビムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ(JPY)	99.0%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.1%
コールローン他 (負債控除後)	0.9%
合計	100.0%

- 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)
- 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。

組入上位銘柄	クーポン	償還日	比率
1 FNMA TBA 3.0% MAY 30YR	3.0000%	2052/05/12	12.2%
2 FNMA TBA 3.5% JUN 30YR	3.5000%	2052/06/13	9.6%
3 U S TREASURY BOND	3.3750%	2044/05/15	3.8%
4 U S TREASURY NOTE	2.1250%	2024/09/30	3.5%
5 FNMA TBA 3.0% JUN 30YR	3.0000%	2052/06/13	2.7%
6 U S TREASURY BOND	3.1250%	2044/08/15	1.7%
7 U S TREASURY BOND	1.3750%	2040/11/15	1.4%
8 SOUTH AFRICA (REP) BD SER R186	10.5000%	2026/12/21	1.4%
9 FNMA TBA 2.5% JUN 30YR	2.5000%	2052/06/13	1.4%
10 U S TREASURY BOND	2.7500%	2042/11/15	1.2%

- 比率は実質的な投資を行う投資信託証券の純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2022年は年初から3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】

3【資産管理等の概要】

(3) 【信託期間】

<訂正前>

2023年9月8日まで（2013年10月25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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

<訂正後>

2028年9月8日まで（2013年10月25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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- 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。
- 毎月決算ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 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（令和3年9月9日から令和4年3月8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/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）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,163,478	14,363,262
投資信託受益証券	2,387,280,470	2,091,567,495
親投資信託受益証券	3,368,651	2,218,650
流動資産合計	2,406,812,599	2,108,149,407
資産合計	2,406,812,599	2,108,149,407
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,291,084	1,191,948
未払受託者報酬	63,598	53,512
未払委託者報酬	2,904,376	2,443,798
未払利息	2	1
その他未払費用	6,351	5,345
流動負債合計	4,265,411	3,694,604
負債合計	4,265,411	3,694,604
純資産の部		
元本等		
元本	2,582,169,308	2,383,896,034
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	179,622,120	279,441,231
（分配準備積立金）	43,835,761	47,331,145
元本等合計	2,402,547,188	2,104,454,803
純資産合計	2,402,547,188	2,104,454,803
負債純資産合計	2,406,812,599	2,108,149,407

(2)【損益及び剰余金計算書】

	前期		当期	
	自 至	令和3年 3月9日 令和3年 9月8日	自 至	令和3年 9月9日 令和4年 3月8日
営業収益				
受取配当金		36,598,611		29,921,031
受取利息		31		21
有価証券売買等損益		20,472,972		121,334,007
営業収益合計		57,071,614		91,412,955
営業費用				
支払利息		2,082		1,639
受託者報酬		424,299		367,479
委託者報酬		19,376,331		16,781,468
その他費用		42,368		36,694
営業費用合計		19,845,080		17,187,280
営業利益又は営業損失（ ）		37,226,534		108,600,235
経常利益又は経常損失（ ）		37,226,534		108,600,235
当期純利益又は当期純損失（ ）		37,226,534		108,600,235
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（ ）		293,879		567,520
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		229,200,353		179,622,120
剰余金増加額又は欠損金減少額		20,929,351		15,730,257
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		20,929,351		15,730,257
剰余金減少額又は欠損金増加額		103,198		198,134
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		103,198		198,134
分配金		8,180,575		7,318,519
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		179,622,120		279,441,231

（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	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。 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。
--------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	前期	当期
	[令和3年9月8日現在]	[令和4年3月8日現在]
1. 期首元本額	2,873,666,151円	2,582,169,308円
期中追加設定元本額	1,382,705円	2,444,671円
期中一部解約元本額	292,879,548円	200,717,945円
2. 元本の欠損		

	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	179,622,120円	279,441,231円
3. 受益権の総数	2,582,169,308口	2,383,896,034口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日																																																																																																												
<p>1. 運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>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49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。</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第89期 令和 3年 3月 9日 令和 3年 4月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,921,255円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>58,703,872円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>33,622,312円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>95,247,439円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,817,016,433口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>338円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>1,408,508円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第90期 令和 3年 4月 9日 令和 3年 5月10日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>5,200,099円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>58,344,067円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>34,915,163円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>98,459,329円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,799,613,790口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>351円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,921,255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	円	収益調整金額	C	58,703,872円	分配準備積立金額	D	33,622,312円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	95,247,439円	当ファンドの期末残存口数	F	2,817,016,433口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	338円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,408,508円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,200,099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	円	収益調整金額	C	58,344,067円	分配準備積立金額	D	34,915,163円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,459,329円	当ファンドの期末残存口数	F	2,799,613,790口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	351円	<p>1. 運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>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49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。</p> <p>2. 分配金の計算過程</p> <p>第95期 令和 3年 9月 9日 令和 3年10月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,496,327円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>53,033,102円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>43,150,254円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>98,679,683円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,543,046,617口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>388円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>1,271,523円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第96期 令和 3年10月 9日 令和 3年11月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,599,916円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>51,696,870円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>43,249,214円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>99,546,000円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,478,767,816口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>401円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,496,327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	円	収益調整金額	C	53,033,102円	分配準備積立金額	D	43,150,254円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,679,683円	当ファンドの期末残存口数	F	2,543,046,617口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	388円	1万口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,271,523円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,599,916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	円	収益調整金額	C	51,696,870円	分配準備積立金額	D	43,249,214円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,546,000円	当ファンドの期末残存口数	F	2,478,767,816口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	401円
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,921,255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	円																																																																																																											
収益調整金額	C	58,703,872円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	33,622,312円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	95,247,439円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,817,016,433口																																																																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	338円																																																																																																											
1万口当たり分配金額	H	5円																																																																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,408,508円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	5,200,099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	円																																																																																																											
収益調整金額	C	58,344,067円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	34,915,163円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,459,329円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,799,613,790口																																																																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	351円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,496,327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	円																																																																																																											
収益調整金額	C	53,033,102円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	43,150,254円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,679,683円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,543,046,617口																																																																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	388円																																																																																																											
1万口当たり分配金額	H	5円																																																																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,271,523円																																																																																																											
項目																																																																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	4,599,916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	円																																																																																																											
収益調整金額	C	51,696,870円																																																																																																											
分配準備積立金額	D	43,249,214円																																																																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	99,546,000円																																																																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,478,767,816口																																																																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	401円																																																																																																											

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日			当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日		
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,399,806円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,239,383円
第91期 令和 3年 5月11日 令和 3年 6月 8日			第97期 令和 3年11月 9日 令和 3年12月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	3,589,879円	費用控除後の配当等収益額	A	2,873,689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	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	円
収益調整金額	C	57,786,250円	収益調整金額	C	50,651,148円
分配準備積立金額	D	38,339,690円	分配準備積立金額	D	45,658,937円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,715,819円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,183,774円
当ファンドの期末残存口数	F	2,772,684,369口	当ファンドの期末残存口数	F	2,428,425,820口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	359円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	408円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,386,342円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,214,212円
第92期 令和 3年 6月 9日 令和 3年 7月 8日			第98期 令和 3年12月 9日 令和 4年 1月11日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,562,353円	費用控除後の配当等収益額	A	2,514,360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	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	円
収益調整金額	C	57,620,634円	収益調整金額	C	50,383,309円
分配準備積立金額	D	40,421,301円	分配準備積立金額	D	47,058,998円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	103,604,288円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,956,667円
当ファンドの期末残存口数	F	2,764,575,541口	当ファンドの期末残存口数	F	2,415,355,948口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	374円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	413円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,382,287円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,207,677円
第93期 令和 3年 7月 9日 令和 3年 8月10日			第99期 令和 4年 1月12日 令和 4年 2月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,202,883円	費用控除後の配当等収益額	A	733,432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	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	円
収益調整金額	C	54,717,430円	収益調整金額	C	49,808,011円
分配準備積立金額	D	42,347,425円	分配準備積立金額	D	47,804,266円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	99,267,738円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	98,345,709円
当ファンドの期末残存口数	F	2,625,097,290口	当ファンドの期末残存口数	F	2,387,552,115口

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日			当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日		
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	378円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	411円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,312,548円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,193,776円
第94期 令和 3年 8月11日 令和 3年 9月 8日			第100期 令和 4年 2月 9日 令和 4年 3月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,599,644円	費用控除後の配当等収益額	A	1,256,207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	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	円
収益調整金額	C	53,826,134円	収益調整金額	C	49,736,270円
分配準備積立金額	D	42,527,201円	分配準備積立金額	D	47,266,886円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	98,952,979円	当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	98,259,363円
当ファンドの期末残存口数	F	2,582,169,308口	当ファンドの期末残存口数	F	2,383,896,034口
1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	383円	1万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	412円
1万口当たり分配金額	H	5円	1万口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,291,084円	収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,191,948円

(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	前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8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、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。 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

区分	前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日
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>当ファンドは、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	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8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>(1) 有価証券 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>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 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	金融商品の時価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	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	4,326,961	19,787,899
親投資信託受益証券		
合計	4,326,961	19,787,899

（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。

（1口当たり情報）

	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
1口当たり純資産額	0.9304円	0.8828円
(1万口当たり純資産額)	(9,304円)	(8,828円)

（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
投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY, Hedged)	235,510.35	2,091,567,495	
投資信託受益証券 合計		235,510.35	2,091,567,495	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	2,178,993	2,218,650	

親投資信託受益証券 合計	2,178,993	2,218,650	
合計	2,414,503.35	2,093,786,145	

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 / 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）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,603,882	26,506,876
投資信託受益証券	5,091,517,561	4,609,965,479
親投資信託受益証券	5,510,316	5,510,316
未収入金	41,400,000	27,300,000
流動資産合計	5,166,031,759	4,669,282,671
資産合計	5,166,031,759	4,669,282,671
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	8,917,853	8,155,198
未払受託者報酬	135,896	118,450
未払委託者報酬	6,205,908	5,409,172
未払利息	4	3
その他未払費用	13,580	11,835
流動負債合計	15,273,241	13,694,658
負債合計	15,273,241	13,694,658
純資産の部		
元本等		
元本	5,945,235,930	5,436,798,939
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	794,477,412	781,210,926
（分配準備積立金）	3,024,725	99,485
元本等合計	5,150,758,518	4,655,588,013
純資産合計	5,150,758,518	4,655,588,013
負債純資産合計	5,166,031,759	4,669,282,671

（2）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日
営業収益		
受取配当金	81,250,661	70,590,628

	前期		当期	
	自 至	令和 3年 3月 9日 令和 3年 9月 8日	自 至	令和 3年 9月 9日 令和 4年 3月 8日
受取利息		60		59
有価証券売買等損益		141,461,206		31,742,710
営業収益合計		222,711,927		38,847,977
営業費用				
支払利息		3,817		4,020
受託者報酬		888,025		803,168
委託者報酬		40,553,104		36,677,964
その他費用		88,737		80,255
営業費用合計		41,533,683		37,565,407
営業利益又は営業損失（ ）		181,178,244		1,282,570
経常利益又は経常損失（ ）		181,178,244		1,282,570
当期純利益又は当期純損失（ ）		181,178,244		1,282,570
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（ ）		971,297		1,918,127
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		998,782,339		794,477,412
剰余金増加額又は欠損金減少額		81,375,612		69,296,445
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		81,375,612		69,296,445
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,811,030		5,285,695
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,811,030		5,285,695
分配金		55,466,602		50,108,707
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		794,477,412		781,210,926

（ 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	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。 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。
--------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	前期	当期
	[令和 3年 9月 8日現在]	[令和 4年 3月 8日現在]
1. 期首元本額	6,498,240,552円	5,945,235,930円
期中追加設定元本額	12,755,944円	39,257,013円
期中一部解約元本額	565,760,566円	547,694,004円
2. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	794,477,412円	781,210,926円
3. 受益権の総数	5,945,235,930口	5,436,798,939口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日																																																																																																																								
<p>1.運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>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49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。</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>第89期 令和 3年 3月 9日 令和 3年 4月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,689,823円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>711,758,863円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,695,120円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>727,143,806円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,414,447,411口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>1,133円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>9,621,671円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第90期 令和 3年 4月 9日 令和 3年 5月10日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>6,641,367円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>703,863,332円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>5,696,942円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>716,201,641円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>6,343,269,006口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>1,129円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>9,514,903円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第91期 令和 3年 5月11日 令和 3年 6月 8日</p>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,689,823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	円	収益調整金額	C	711,758,863円	分配準備積立金額	D	2,695,120円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	727,143,806円	当ファンドの期末残存口数	F	6,414,447,411口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,133円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,621,671円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	6,641,367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	円	収益調整金額	C	703,863,332円	分配準備積立金額	D	5,696,942円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,201,641円	当ファンドの期末残存口数	F	6,343,269,006口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,129円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,514,903円	<p>1.運用に係る権限を委託するための費用</p> <p>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49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。</p> <p>2.分配金の計算過程</p> <p>第95期 令和 3年 9月 9日 令和 3年10月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>9,491,175円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>647,003,954円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,965,573円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>659,460,702円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,830,772,657口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>1,130円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>8,746,158円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第96期 令和 3年10月 9日 令和 3年11月 8日</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>12,595,679円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>627,186,854円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>3,595,052円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>643,377,585円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>5,652,149,507口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F*10,000</td> <td>1,138円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>15円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F*H/10,000</td> <td>8,478,224円</td> </tr> </tbody> </table> <p>第97期 令和 3年11月 9日 令和 3年12月 8日</p>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	9,491,175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	円	収益調整金額	C	647,003,954円	分配準備積立金額	D	2,965,573円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	659,460,702円	当ファンドの期末残存口数	F	5,830,772,657口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,130円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,746,158円	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,595,679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	円	収益調整金額	C	627,186,854円	分配準備積立金額	D	3,595,052円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	643,377,585円	当ファンドの期末残存口数	F	5,652,149,507口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,138円	1万口当たり分配金額	H	15円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,478,224円
項目																																																																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	12,689,823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	円																																																																																																																							
収益調整金額	C	711,758,863円																																																																																																																							
分配準備積立金額	D	2,695,120円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	727,143,806円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	6,414,447,411口																																																																																																																							
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,133円																																																																																																																							
1万口当たり分配金額	H	15円																																																																																																																							
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,621,671円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	6,641,367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	円																																																																																																																							
収益調整金額	C	703,863,332円																																																																																																																							
分配準備積立金額	D	5,696,942円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,201,641円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	6,343,269,006口																																																																																																																							
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,129円																																																																																																																							
1万口当たり分配金額	H	15円																																																																																																																							
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,514,903円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	9,491,175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	円																																																																																																																							
収益調整金額	C	647,003,954円																																																																																																																							
分配準備積立金額	D	2,965,573円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	659,460,702円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	5,830,772,657口																																																																																																																							
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,130円																																																																																																																							
1万口当たり分配金額	H	15円																																																																																																																							
収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,746,158円																																																																																																																							
項目																																																																																																																									
費用控除後の配当等収益額	A	12,595,679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	円																																																																																																																							
収益調整金額	C	627,186,854円																																																																																																																							
分配準備積立金額	D	3,595,052円																																																																																																																							
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	643,377,585円																																																																																																																							
当ファンドの期末残存口数	F	5,652,149,507口																																																																																																																							
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,138円																																																																																																																							
1万口当たり分配金額	H	15円																																																																																																																							
収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,478,224円																																																																																																																							

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日			当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,936,553円	費用控除後の配当等収益額	A	7,305,343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	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	円
収益調整金額	C	686,270,700円	収益調整金額	C	615,697,321円
分配準備積立金額	D	2,751,964円	分配準備積立金額	D	7,566,645円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	700,959,217円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	630,569,309円
当ファンドの期末残存口数	F	6,184,713,499口	当ファンドの期末残存口数	F	5,548,565,475口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,133円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,136円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,277,070円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,322,848円
第92期 令和 3年 6月 9日 令和 3年 7月 8日			第98期 令和 3年12月 9日 令和 4年 1月11日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	12,686,916円	費用控除後の配当等収益額	A	10,520,389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	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	円
収益調整金額	C	673,671,620円	収益調整金額	C	609,800,946円
分配準備積立金額	D	5,310,525円	分配準備積立金額	D	6,484,263円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	691,669,061円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	626,805,598円
当ファンドの期末残存口数	F	6,071,158,256口	当ファンドの期末残存口数	F	5,495,409,091口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,139円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,140円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,106,737円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,243,113円
第93期 令和 3年 7月 9日 令和 3年 8月10日			第99期 令和 4年 1月12日 令和 4年 2月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,952,598円	費用控除後の配当等収益額	A	2,370,191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	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	円
収益調整金額	C	667,877,090円	収益調整金額	C	603,894,276円
分配準備積立金額	D	8,811,609円	分配準備積立金額	D	8,669,069円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	682,641,297円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	614,933,536円
当ファンドの期末残存口数	F	6,018,912,454口	当ファンドの期末残存口数	F	5,442,110,741口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,134円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,129円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,028,368円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,163,166円
第94期 令和 3年 8月11日			第100期 令和 4年 2月 9日		

前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日			当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日		
令和 3年 9月 8日			令和 4年 3月 8日		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,279,253円	費用控除後の配当等収益額	A	3,763,252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	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	円
収益調整金額	C	659,704,196円	収益調整金額	C	603,317,556円
分配準備積立金額	D	5,663,325円	分配準備積立金額	D	2,860,391円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	671,646,774円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	609,941,199円
当ファンドの期末残存口数	F	5,945,235,930口	当ファンドの期末残存口数	F	5,436,798,939口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,129円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,121円
1万口当たり分配金額	H	15円	1万口当たり分配金額	H	15円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,917,853円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	8,155,198円

(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	前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8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、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。 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

区分	前期 自 令和 3年 3月 9日 至 令和 3年 9月 8日	当期 自 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8日
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>当ファンドは、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	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8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>(1) 有価証券 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>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 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	金融商品の時価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	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	13,509,687	30,006,267
親投資信託受益証券		
合計	13,509,687	30,006,267

（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。

（1口当たり情報）

	前期 [令和 3年 9月 8日現在]	当期 [令和 4年 3月 8日現在]
	1口当たり純資産額	0.8664円
(1万口当たり純資産額)	(8,664円)	(8,563円)

（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
投資信託受益証券	ピムコ・トータル・リターン・ファンドII - クラスJ (JPY)	441,398.45	4,609,965,479	
投資信託受益証券 合計		441,398.45	4,609,965,479	
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	5,411,821	5,510,316	

親投資信託受益証券 合計	5,411,821	5,510,316	
合計	5,853,219.45	4,615,475,795	

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）

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

マネー・マーケット・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 4年 3月 8日現在]

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		327,124,263
現先取引勘定		1,399,999,826
流動資産合計		1,727,124,089
資産合計		1,727,124,089
負債の部		
流動負債		
未払解約金		13,726
未払利息		44
流動負債合計		13,770
負債合計		13,770
純資産の部		
元本等		
元本		1,696,277,924
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		30,832,395
元本等合計		1,727,110,319
純資産合計		1,727,110,319
負債純資産合計		1,727,124,089

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 4年 3月 8日現在]
1. 期首	令和 3年 9月 9日
期首元本額	1,317,243,370円
期中追加設定元本額	454,724,438円
期中一部解約元本額	75,689,884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	495,203,381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)	3,683,862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)	2,590,474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)	111,354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)	9,893,887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)	24,765,135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)	282,290円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース> (毎月分配型)	1,074,934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>	49,373,977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
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
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
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	10,715,809円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	1,378,553円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (毎月分配型)	5,548,198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)	123,415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)	3,857,128円

[令和 4年 3月 8日現在]

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)	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)	1,145,161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)	16,341,949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)	953,994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)	642,729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<マネープールファンド>	93,715,489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)	7,489,236円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	3,947,842円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	4,289,171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)	4,489,124円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回分配型)	30,649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)	60,179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)	69,757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)	10,814円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(年2回分配型)	278,281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)	665,580円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	1,149,232円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	3,307,993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)	132,542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
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
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
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
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)	3,156,977円

[令和 4年 3月 8日現在]

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)	7,196,270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)	1,491,640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)	3,517,041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)	845,131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)	1,016,827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)	5,114,733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)	1,528,278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)	2,664,317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)	215,434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)	490,224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)	175,974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)	213,510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)	345,928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>	43,188,416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>	1,355,232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)	2,178,993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)	5,411,821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)	1,020,693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
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)	521,457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)	354,513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)	1,628,892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)	5,812,610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
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

	[令和 4年 3月 8日現在]
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
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
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	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)	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	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)	3,319,056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)	13,122,469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
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)	5,899,118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)	4,433,586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)	1,171,788円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(毎月分配型)	20,609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)	10,795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)	511,609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)	177,761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)	368,276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)	89,371円
三菱UFJ J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
三菱UFJ J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
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	643,276,332円
マクロ・トータル・リターン・ファンド	9,820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)	89,287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)	138,420円
テンブルトン新興国小型株ファンド	49,097円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(毎月決算型)	1,453,944円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)	6,675,966円

	[令和 4年 3月 8日現在]
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	2,474,981円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし> (年2回決算型)	9,376,245円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	169,198円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	87,384円
わたしの未来設計<安定重視型>(分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<安定重視型>(分配抑制コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型>(分配コース)	9,820円
わたしの未来設計<成長重視型>(分配抑制コース)	9,820円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
グローバル・インカム・フルコース(為替リスク軽減型)	983円
グローバル・インカム・フルコース(為替ヘッジなし)	983円
<DC>ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド	9,821円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド	9,821円
<DC>ベイリー・ギフォード ESG世界株ファンド	9,822円
ベイリー・ギフォード世界長期成長株ファンド(予想分配金提示型)	9,822円
ベイリー・ギフォード インパクト投資ファンド(予想分配金提示型)	9,822円
米国株式トレンド・ウォッチ戦略ファンド	983円
三菱UFJ インド債券オープン(毎月決算型)	39,351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
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,876,729円
ピムコ・グローバル・ハイイールド・ファンド(毎月分配型)	11,784,347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
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)	9,187,206円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	3,987,431円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	41,131,411円
合計	1,696,277,924円
2. 受益権の総数	1,696,277,924口

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 令和 3年 9月 9日 至 令和 4年 3月 8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。
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。
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>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 4年 3月 8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。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、該当事項はありません。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</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	金融商品の時価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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報）

	[令和 4年 3月 8日現在]
1口当たり純資産額	1.0182円
(1万口当たり純資産額)	(10,182円)

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 / 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）】

【純資産額計算書】

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	2,025,679,016
負債総額	10,567,602
純資産総額（ - ）	2,015,111,414
発行済口数	2,349,536,659口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.8577
（10,000口当たり）	（8,577）

【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）】

【純資産額計算書】

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	4,769,920,920
負債総額	29,527,169
純資産総額（ - ）	4,740,393,751
発行済口数	5,378,720,131口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.8813
（10,000口当たり）	（8,813）

（参考）

マネー・マーケット・マザーファンド

純資産額計算書

令和 4年 3月31日現在

（単位：円）

資産総額	1,763,365,161
負債総額	194
純資産総額（ - ）	1,763,364,967
発行済口数	1,731,885,013口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0182
（10,000口当たり）	（10,182）

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】

< 更新後 >

(1) 資本金の額等

2022年3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

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

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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。

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】

<更新後>

「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」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2022年3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	902	19,898,902
追加型公社債投資信託	16	1,365,892
単位型株式投資信託	91	421,250
単位型公社債投資信託	52	183,921
合計	1,061	21,869,965

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】

<更新後>

(1) 財務諸表及び中間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。

また、当社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間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36期事業年度（自令和2年4月1日至令和3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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度に係る中間会計期

間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人
トーマツにより中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第35期 (令和2年3月31日現在)		第36期 (令和3年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	56,398,457	2	56,803,388
有価証券		1,960,318		2,001
前払費用		575,904		598,135
未収入金		14,559		31,359
未収委託者報酬		10,296,453		13,216,357
未収収益	2	638,994	2	662,230
金銭の信託		100,000		2,300,000
その他		254,330		269,506
流動資産合計		70,239,017		73,882,978
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	584,048	1	548,902
器具備品	1	871,893	1	1,435,369
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		2,084,375		2,612,705
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,369,611		3,569,171
ソフトウェア仮勘定		1,374,932		1,895,190
無形固定資産合計		4,760,365		5,480,184
投資その他の資産				
投資有価証券		16,704,756		18,616,670
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	819,255	1	814,684
長期差入保証金		565,358		538,497
前払年金費用		375,031		258,835
繰延税金資産		1,912,824		916,962
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		20,718,993		21,487,417
固定資産合計		27,563,734		29,580,307
資産合計		97,802,752		103,463,286

（単位：千円）

	第35期 (令和2年3月31日現在)		第36期 (令和3年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		687,565		533,622

未払金				
未払収益分配金		131,478		158,856
未払償還金		395,400		133,877
未払手数料	2	4,026,078	2	5,200,810
その他未払金	2	3,818,195	2	4,412,521
未払費用	2	4,402,578	2	4,755,909
未払消費税等		629,469		752,617
未払法人税等		617,341		873,027
賞与引当金		933,517		933,381
役員賞与引当金		124,590		160,710
その他		701,285		691,143
流動負債合計		16,467,499		18,606,476
固定負債				
長期未払金		32,400		21,600
退職給付引当金		1,010,401		1,145,514
役員退職慰労引当金		130,784		117,938
時効後支払損引当金		238,811		245,426
固定負債合計		1,412,398		1,530,479
負債合計		17,879,897		20,136,956
(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		25,847,605		26,951,289
利益剰余金合計		33,188,194		34,291,879
株主資本合計		79,921,039		81,024,723

(単位：千円)

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3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	1,815	2,301,606
評価・換算差額等合計	1,815	2,301,606
純資産合計	79,922,854	83,326,329
負債純資産合計	97,802,752	103,463,286

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)		第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		67,967,489		67,963,712
投資顧問料		2,385,084		2,443,980
その他営業収益		16,085		21,613
営業収益合計		70,368,658		70,429,306
営業費用				
支払手数料	2	27,106,451	2	26,689,896
広告宣伝費		696,418		668,150
公告費		1,000		250
調査費				
調査費		1,857,271		2,077,942
委託調査費		11,579,175		12,035,954
事務委託費		847,769		798,528
営業雑経費				
通信費		153,731		296,490
印刷費		427,118		378,180
協会費		52,053		51,841
諸会費		15,990		16,613
事務機器関連費		1,953,926		1,977,769
その他営業雑経費				8,391
営業費用合計		44,690,907		45,000,009
一般管理費				
給料				
役員報酬		331,987		352,879
給料・手当		6,611,427		6,461,546
賞与引当金繰入		933,517		933,381
役員賞与引当金繰入		124,590		160,710
福利厚生費		1,276,950		1,272,568
交際費		11,871		2,721
旅費交通費		165,891		22,768
租税公課		360,165		402,939
不動産賃借料		647,402		666,331
退職給付費用		422,919		481,135
役員退職慰労引当金繰入		48,183		11,763
固定資産減価償却費		1,307,555		1,358,911
諸経費		427,212		413,538
一般管理費合計		12,669,674		12,541,193
営業利益		13,008,076		12,888,103

(単位：千円)

	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)		第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		90,965		170,807
受取利息	2	4,169	2	2,726
投資有価証券償還益		585,179		81,557
収益分配金等時効完成分		101,734		275,835

受取賃貸料	2	65,808	2	65,808
その他		19,987		12,504
営業外収益合計		867,845		609,239
営業外費用				
投資有価証券償還損		96,379		95,946
時効後支払損引当金繰入				16,395
事務過誤費		3,483		
賃貸関連費用		20,339		13,472
その他		1,920		2,932
営業外費用合計		122,122		128,747
経常利益		13,753,799		13,368,595
特別利益				
投資有価証券売却益		174,842		2,007,655
特別利益合計		174,842		2,007,655
特別損失				
投資有価証券売却損		75,963		51,737
投資有価証券評価損		163,865		26,317
固定資産除却損	1	8,832	1	536
固定資産売却損		435		
特別損失合計		249,096		78,591
税引前当期純利益		13,679,545		15,297,659
法人税、住民税及び事業税	2	4,146,534	2	4,755,427
法人税等調整額		79,824		19,122
法人税等合計		4,226,359		4,736,304
当期純利益		9,453,186		10,561,354

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期（自平成31年4月1日至令和2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	その他利益剰余金		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		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	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計							221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186

株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当期変動額									
剰余金の配当							9,457,670	9,457,670	9,457,670
当期純利益							10,561,354	10,561,354	10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							1,103,684	1,103,684	1,103,684
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,815	1,815	79,922,854
当期変動額			
剰余金の配当			9,457,670
当期純利益			10,561,354
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	2,299,791	2,299,791	2,299,791
当期変動額合計	2,299,791	2,299,791	3,403,475
当期末残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託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) 有形固定資産及び投資不動産

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

投資不動産 3年～47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。

(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.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(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。

(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用により、翌事業年度の期首の純資産に累積的影響額が反映され、繰越利益剰余金の期首残高が475,687千円増加すると見込まれます。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
建物	599,542千円	643,920千円
器具備品	1,408,613千円	1,545,179千円
投資不動産	145,391千円	151,833千円

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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
--	-----------------------	-----------------------

預金	314,247千円	40,328,414千円
未収収益	15,773千円	14,138千円
未払手数料	712,210千円	772,495千円
その他未払金	3,029,426千円	3,425,136千円
未払費用	432,019千円	349,222千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
器具備品	8,832千円	536千円
計	8,832千円	536千円

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35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)	第36期 (自 令和2年4月1日 至 令和3年3月31日)
支払手数料	5,234,629千円	5,128,270千円
受取利息	2千円	143千円
受取賃貸料	65,808千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,030,180千円	3,492,898千円

(株主資本等変動計算書関係)

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和元年6月27日

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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2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

令和3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	10,576,511千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
1年内	675,956千円	709,808千円
1年超		709,808千円
合計	675,956千円	1,419,616千円

(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、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 金銭の信託	100,000	100,000	-
(4) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(5) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-

資産計	85,428,625	85,428,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

第36期(令和3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	56,803,388	56,803,388	-
(2) 有価証券	2,001	2,001	-
(3) 金銭の信託	2,300,000	2,300,000	-
(4) 未収委託者報酬	13,216,357	13,216,357	-
(5) 投資有価証券	18,585,310	18,585,310	-
資産計	90,907,057	90,907,057	-
(1) 未払手数料	5,200,810	5,200,810	-
負債計	5,200,810	5,200,810	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(4) 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、(5) 投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

(3) 金銭の信託

時価は取引金融機関から提示された価格によっております。

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。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
非上場株式	31,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
金銭の信託	100,000	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,755,228	5,652,257	4,813,929	27,375

第36期(令和3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	56,803,388	-	-	-
金銭の信託	2,300,000	-	-	-
未収委託者報酬	13,216,357	-	-	-
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	2,001	8,412,286	3,123,026	11,398
合計	72,321,747	8,412,286	3,123,026	11,398

(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35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,874,369	10,037,087	1,162,718
	小計	8,874,369	10,037,087	1,162,718
合計		18,733,714	18,731,098	2,616

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は100,000千円）を含めておりません。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）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、含めておりません。

第36期(令和3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	14,810,957	11,362,471	3,448,485
	小計	14,810,957	11,362,471	3,448,485
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	6,076,354	6,207,447	131,093
	小計	6,076,354	6,207,447	131,093
合計		20,887,311	17,569,919	3,317,392

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は2,300,000千円）を含めております。

非上場株式（貸借対照表計上額は31,360千円）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、含めておりません。

3.売却したその他有価証券

第35期（自平成31年4月1日至令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

第36期（自令和2年4月1日至令和3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	5,747,529	2,007,655	51,737
合計	5,747,529	2,007,655	51,737

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163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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26,317千円（その他有価証券のその他26,317千円）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。

（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35期 （自平成31年4月1日 至令和2年3月31日）	第36期 （自令和2年4月1日 至令和3年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,712,289 千円	3,718,736 千円
勤務費用	204,225	203,106
利息費用	17,557	19,110
数理計算上の差異の 発生額	52,430	18,826
退職給付の支払額	162,904	192,890
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,718,736	3,729,235

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第35期 （自平成31年4月1日 至令和2年3月31日）	第36期 （自令和2年4月1日 至令和3年3月31日）
年金資産の期首残高	2,666,937 千円	2,460,824 千円
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の 発生額	164,633	304,281
事業主からの拠出額	51,282	-
退職給付の支払額	140,518	159,390
年金資産の期末残高	2,460,824	2,649,846

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,969,807 千円	2,810,893 千円
年金資産	2,460,824	2,649,846
非積立型制度の退職給付債務	508,982	161,046
未積立退職給付債務	748,929	918,342
未認識数理計算上の差異	1,257,911	1,079,388
未認識過去勤務費用	203,136	161,333
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	419,405	354,043
	635,370	886,678
退職給付引当金	1,010,401	1,145,514
前払年金費用	375,031	258,835
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635,370	886,678

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)	第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)
勤務費用	204,225 千円	203,106 千円
利息費用	17,557	19,110
期待運用収益	47,757	44,130
数理計算上の差異の 費用処理額	24,035	41,361
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	6,427	44,446
確定給付制度に係る 退職給付費用	269,848	329,255

(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、再就職支援金及び退職金です。

(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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
債券	64.7 %	62.7 %
株式	32.3	35.4
その他	3.0	1.9
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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
--	-----------------------	-----------------------

割引率	0.095～0.52%	0.051～0.59%
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153,070千円、当事業年度151,880千円であります。

（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35期 (令和2年3月31日現在)	第36期 (令和3年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	427,046千円	418,394千円
投資有価証券評価損	226,322	188,859
未払事業税	117,461	180,263
賞与引当金	285,842	285,801
役員賞与引当金	19,703	25,472
役員退職慰労引当金	40,046	36,112
退職給付引当金	309,384	350,756
減価償却超過額	96,767	68,024
委託者報酬	213,044	209,938
長期差入保証金	40,180	48,639
時効後支払損引当金	73,124	75,149
連結納税適用による時価評価	57,656	38,873
その他	123,248	87,023
繰延税金資産 小計	2,029,829	2,013,308
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,029,829	2,013,308
繰延税金負債		
前払年金費用	114,834	79,225
連結納税適用による時価評価	1,260	1,203
その他有価証券評価差額金	801	1,015,785
その他	109	101
繰延税金負債 合計	117,005	1,096,346
繰延税金資産の純額	1,912,824	916,962

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35期（令和2年3月31日現在）及び第36期（令和3年3月31日現在）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）及び第36期（自令和2年4月1日至令和3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35期（自平成31年4月1日至令和2年3月31日）及び第36期（自令和2年4月1日至令和3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35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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(注4)	科目	期末残高(注4)
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	連結納税に伴う支払(注1)	3,030,180千円	その他未払金	3,029,426千円
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100.0%	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(注2)	5,234,629千円	未払手数料	712,210千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料(注3)	583,270千円	未払費用	302,681千円

第36期（自 令和2年4月1日 至 令和3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(注4)	科目	期末残高(注4)
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	連結納税に伴う支払(注1)	3,492,898千円	その他未払金	3,425,136千円
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100.0%	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(注2)	5,128,270千円	未払手数料	772,495千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料(注3)	523,327千円	未払費用	290,120千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 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。
2. 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。
3. 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。
4. 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35期(自平成31年4月1日至令和2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(注3)	科目	期末残高(注3)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
							取引銀行	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の払戻(注2)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金の預入(注2)	4,126 千円	未収収益	997 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

第36期(自令和2年4月1日至令和3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(注3)	科目	期末残高(注3)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	3,729,785 千円	未払手数料	764,501 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券㈱	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料 の支払 (注1)	5,655,482 千円	未払手数料	1,193,245 千円
-------------	--------------------------------	-----------------	---------------	-----	----	---	---------------------------------------	-----------------	-------	-----------------

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 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。
2. 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。
3. 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35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)	第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)
1株当たり純資産額	377,741.17円	393,827.09円
1株当たり当期純利益金額	44,678.80円	49,916.36円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 (自平成31年4月1日 至令和2年3月31日)	第36期 (自令和2年4月1日 至令和3年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,453,186	10,561,354
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）	9,453,186	10,561,354
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第37期中間会計期間
(令和3年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金	48,742,270
有価証券	1,291,000
前払費用	682,143
未収入金	166,605
未収委託者報酬	15,228,560
未収収益	694,402
金銭の信託	5,301,000
その他	226,759

流動資産合計		72,332,741
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	527,772
器具備品	1	1,371,778
土地		628,433
有形固定資産合計		2,527,984
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,217,271
ソフトウェア仮勘定		1,478,970
無形固定資産合計		5,712,064
投資その他の資産		
投資有価証券		14,943,458
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	813,041
長期差入保証金		531,230
前払年金費用		224,272
繰延税金資産		733,199
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		17,586,969
固定資産合計		25,827,017
資産合計		98,159,759

(単位：千円)

第37期中間会計期間
(令和3年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		663,405
未払金		
未払収益分配金		187,200
未払償還金		7,418
未払手数料		6,029,978
その他未払金		2,623,176
未払費用		5,348,002
未払消費税等	2	757,223
未払法人税等		702,806
賞与引当金		924,214
役員賞与引当金		65,985
その他		5,517
流動負債合計		17,314,927
固定負債		
長期末払金		10,800
退職給付引当金		1,204,214
役員退職慰労引当金		117,938
時効後支払損引当金		256,262
固定負債合計		1,589,215
負債合計		18,904,143
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		2,000,131

資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	23,330,110
利益剰余金合計	30,670,700
株主資本合計	77,403,544

(単位：千円)

第37期中間会計期間
(令和3年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,852,071
評価・換算差額等合計	1,852,071
純資産合計	79,255,616
負債純資産合計	98,159,759

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第37期中間会計期間
(自 令和3年4月1日
至 令和3年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	39,061,243
投資顧問料	1,319,230
その他営業収益	7,249
営業収益合計	40,387,723
営業費用	
支払手数料	15,372,436
広告宣伝費	277,284
公告費	250
調査費	
調査費	1,187,915
委託調査費	7,042,637
事務委託費	653,911
営業雑経費	
通信費	75,781
印刷費	194,857
協会費	25,068
諸会費	9,036
事務機器関連費	1,066,190
その他営業雑経費	649
営業費用合計	25,906,022
一般管理費	
給料	
役員報酬	202,454
給料・手当	2,828,313
賞与引当金繰入	924,214
役員賞与引当金繰入	65,985
福利厚生費	637,293
交際費	2,635

旅費交通費		12,678
租税公課		232,446
不動産賃借料		364,289
退職給付費用		195,737
固定資産減価償却費	1	969,675
諸経費		193,083
一般管理費合計		6,628,807
営業利益		7,852,893

(単位：千円)

第37期中間会計期間

(自 令和3年4月1日

至 令和3年9月30日)

営業外収益		
受取配当金		203,195
受取利息		2,567
投資有価証券償還益		753,216
収益分配金等時効完成分		136,491
受取賃貸料		32,904
その他		4,621
営業外収益合計		1,132,996
営業外費用		
投資有価証券償還損		62
時効後支払損引当金繰入		21,921
事務過誤費		66,316
賃貸関連費用	1	7,921
その他		7,123
営業外費用合計		103,345
経常利益		8,882,544
特別利益		
投資有価証券売却益		522,323
特別利益合計		522,323
特別損失		
投資有価証券売却損		8,073
投資有価証券評価損		36,558
固定資産除却損		7,408
特別損失合計		52,039
税引前中間純利益		9,352,828
法人税、住民税及び事業税		2,700,962
法人税等調整額		172,220
法人税等合計		2,873,183
中間純利益		6,479,644

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30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	その他利益剰余金		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		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	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更による累積的影響額							475,687	475,687	475,687

会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当中間期変動額									
剰余金の配当							10,576,511	10,576,511	10,576,511
中間純利益							6,479,644	6,479,644	6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							3,621,178	3,621,178	3,621,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	23,330,110	30,670,700	77,403,544

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当中間期変動額			
剰余金の配当			10,576,511
中間純利益			6,479,644
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	449,534	449,534	449,534
当中間期変動額合計	449,534	449,534	4,070,713
当中間期末残高	1,852,071	1,852,071	79,255,616

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

中間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。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託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) 有形固定資産及び投資不動産

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

投資不動産 3年～47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. 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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
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。
 - (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、内規に基づく中間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。
5. 収益および費用の計上基準
当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
- (1) 委託者報酬
投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。
 - (2) 投資顧問料
顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。
6. 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、中間決算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。
7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項
- (1) 連結納税制度の適用
連結納税制度を適用しております。
 - (2) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用
令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月31日に公布されておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

[会計方針の変更]

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。

た。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。

この結果、収益認識会計基準等の適用を行う前と比べて、当中間会計期間の中間貸借対照表は、流動負債のその他は588,191千円減少、繰延税金資産は180,104千円減少、繰越利益剰余金は408,087千円増加しております。

当中間会計期間の中間損益計算書は、委託者報酬、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ97,433千円減少しております。

当中間会計期間の期首の純資産に累積的影響額が反映されたことにより、中間株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の期首残高は475,687千円増加しております。

1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準（企業会計基準第10号 令和元年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準等の適用による、中間財務諸表への影響はありません。また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	第37期中間会計期間 （令和3年9月30日現在）
建物	661,109千円
器具備品	1,743,773千円
投資不動産	154,845千円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

	第37期中間会計期間 （自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日）
有形固定資産	241,452千円
無形固定資産	728,222千円
投資不動産	3,012千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

令和3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	10,576,511千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	49,988円
基準日	令和3年3月31日
効力発生日	令和3年6月29日

（リース取引関係）

第37期中間会計期間(令和3年9月30日現在)

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

1年内	709,808千円
1年超	354,904千円
合 計	1,064,712千円

（金融商品関係）

第37期中間会計期間(令和3年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

令和3年9月30日における中間貸借対照表計上額、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、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 有価証券	1,291,000	1,291,000	-
(2) 金銭の信託	5,301,000	5,301,000	-
(3) 投資有価証券	14,912,098	14,912,098	-
資産計	21,504,098	21,504,098	-

（注1）「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）市場価格のない株式等

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がないため、「(3) 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（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

（注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もあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

なお、中間財務諸表等規則附則（令和3年9月24日内閣府令第9号）に基づく経過措置を適用した投資信託（中間貸借対照表計上額 有価証券 1,291,000千円、投資有価証券14,912,098千円）は、次表には含めておりません。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,301,000	-	5,301,000
資産計	-	5,301,000	-	5,301,000

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

第37期中間会計期間（令和3年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	18,010,889	15,246,038	2,764,851
	小計	18,010,889	15,246,038	2,764,851
中間貸借対照表 計上額が取得原 価を超えないも の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,493,209	3,588,600	95,390
	小計	3,493,209	3,588,600	95,390
合計		21,504,098	18,834,638	2,669,460

（注）「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額5,301,000千円、取得価額5,300,000千円）を含めております。
非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がないため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について36,558千円（その他有価証券のその他36,558千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間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。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30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37期中間会計期間（自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30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中間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。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (令和3年9月30日現在)
1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	374,587.58円
純資産の部の合計額(千円)	79,255,616
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	79,255,616
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (自 令和3年4月1日 至 令和3年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	30,624.88円
中間純利益金額(千円)	6,479,644
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	6,479,644
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(注1)潜在株式調整後1株当たり中間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。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 令和2年3月31日)等を適用し、「収益認識に関する会計基準」第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額は2,248.25円増加し、1株当たり中間純利益金額は319.49円減少しております。

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】

<更新後>

(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(2021年9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 (2021年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円 (2022年3月31日現在)	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。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円 (2021年12月31日現在)	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。
株式会社SBI証券	48,323 百万円 (2021年12月30日現在)	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。
楽天証券株式会社	17,495 百万円 (2021年12月10日現在)	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。
松井証券株式会社	11,945 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。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 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：ピムコジャパンリミテッド

資本金の額：13,411,674.44米ドル（2021年10月末現在）

事業の内容：投資運用業務を営んでいます。

3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年9月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581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。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2022年3月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581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。

独立監査人の監査報告書

令和4年4月13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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

監査意見

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ノビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）の令和3年9月9日から令和4年3月8日までの特定期間の財務諸表、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。

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ノビムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>（毎月決算型）の令和4年3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特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況

により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和4年4月13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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉

監査意見

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ノビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）の令和3年9月9日から令和4年3月8日までの特定期間の財務諸表、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。

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ノビムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>（毎月決算型）の令和4年3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特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況

により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

令和3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 東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青	木	裕	晃	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊	藤	鉄	也	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

監査意見

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令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36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。

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令和3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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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。

独立監査人の中間監査報告書

令和3年12月3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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 青木裕晃 印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤鉄也 印

中間監査意見

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令和3年4月1日から令和4年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（令和3年4月1日から令和3年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

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、三菱UFJ国際投信株式会社の令和3年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（令和3年4月1日から令和3年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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。