

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成27年10月28日

【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 金上 孝

【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【事務連絡者氏名】 伊藤 晃

連絡場所 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資 マルチストラテジー・ファンド（ラップ向け）
信託受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資 当初自己設定額 5億500万円
信託受益証券の金額】 継続募集額 上限1兆円

【縦覧に供する場所】 該当ありません

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で半期報告書を提出致しましたので、平成27年1月14日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新等するため、提出するものです。

【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、原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とし、原届出書に追加される内容を記載する場合は<追加>とします。

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】****[ファンドの目的・特色]**

<更新後>

ファンドの目的

世界の株式、債券およびデリバティブ等の幅広い資産を実質的な主要投資対象とし、特定の市場に左右されることなく収益の獲得をめざします。

ファンドの特色

投資対象

世界の株式、債券およびデリバティブ等を実質的な主要投資対象とします。

- ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。
- 主として円建外国投資法人への投資を通じて、複数の運用戦略を活用することで、世界の株式、債券およびデリバティブ等の幅広い資産に投資を行います。なお、証券投資信託であるマネー・マーケット・マザーファンドへの投資も行います。
 - デリバティブとは、金融派生商品と呼ばれ、為替・金利・株式など現物の金融商品、あるいは取引から派生して生まれた金融商品のことです。

運用方法／運用プロセス

投資対象とする円建外国投資法人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法人は、信託財産を、非伝統的またはオルタナティブな投資戦略で運用する様々な投資サブアドバイザーに配分することにより、信託財産の成長をめざします。
 - オルタナティブとは「～の代わりに、代替」と訳され、投資の世界で「オルタナティブ」というと、株式や債券といった伝統的資産とは異なる値動きが想定される投資対象資産もしくは運用手法のことをいいます。

<投資戦略の主な例>

ファンダメンタル	個別の企業や証券の分析に基づき、割安な銘柄の買い持ち（ロングポジション）や割高な銘柄の売り持ち（ショートポジション）を行う戦略。
グローバル・マクロ	世界の経済や市場要因等の分析に基づき、様々な市場において機動的にポジションを持つ戦略。
イベント・ドリブン	企業のイベント（買収、清算、事業再編、経営の交代等）に伴う証券価格の動きを捉える戦略。
オポチュニスティック・トレーディング	需給の不均衡や企業の収益状況や市場価格の急変等を捉えて、短期的な収益機会を狙う戦略。
クオンツ	投資評価用データや経済統計データ等の定量データをモデルを用いて分析し、市場の動きを予想して収益を狙う戦略。
マネージド・フューチャーズ	定量データの分析等に基づき、金融商品、商品（コモディティ）、為替の先物等を用いて多様化されたポジションを構築し、個別の株式市場の動向に左右されない収益の獲得をめざす戦略。
マルチストラテジー	経済情勢等に基づき上記の各運用戦略の一部または全部を組み合わせることで収益獲得を狙う戦略。但し、各運用戦略毎に異なる運用チームを持つ場合に限る。

■ 上記投資戦略の全てが採用されるとは限りません。また、将来変更される場合があります。

- 円建外国投資法人の投資運用会社であるブラックストーン・オルタナティブ・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーは、投資ストラテジー別に運用能力の高い投資サブアドバイザーを選定し、選定した投資サブアドバイザーへの資金配分を決定し、運用を委託します。

❗ 投資運用会社が直接運用を行う場合があります。

- 円建外国投資法人における運用プロセスは以下の通りです。



❏ ヘッジファンドとは、裁定取引や先物取引といったデリバティブ等の活用により、市場動向に左右されないリターンの獲得をめざすファンドのことをいいます。投資対象は、株式、債券、為替、商品など多岐にわたります。

❗ 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(<http://www.am.mufj.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

<ブラックストーン・オルタナティブ・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーについて>

・ブラックストーン・オルタナティブ・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシーは、世界トップクラスの投資アドバイザー企業であるブラックストーン・グループ・エル・ピーの子会社で、世界最大級のヘッジファンドの組成会社であるブラックストーン・オルタナティブ・アセット・マネジメント(運用資産残高:約8兆円*)の関連会社です。

・本拠地であるニューヨークの他、ロンドン、香港に拠点を構えています。

*2015年6月末現在、為替レートは1米ドル=122.50円

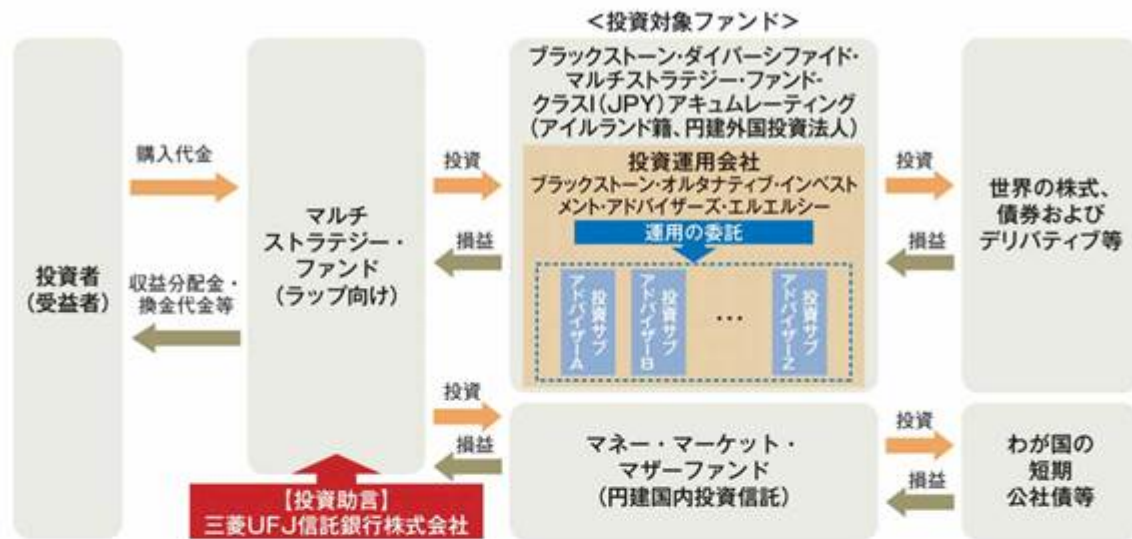
📌 為替対応方針

原則として、投資する円建外国投資法人においては、当該円建外国投資法人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はかります。

- 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。

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。



- 三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言に基づき、三菱UFJ国際投信株式会社が投資対象ファンドを選定します。

❗ 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

分配方針

- 年1回の決算時(2月2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、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。

(初回決算日は、2016年2月2日です。)

主な投資制限

株式	株式への直接投資は行いません。
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。

(略)

(2) 【ファンドの沿革】

<更新後>

平成27年1月30日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金
2,000百万円(平成27年8月末現在)
(略)
- ・大株主の状況(平成27年8月末現在)
(略)

2【投資方針】

(2)【投資対象】

<投資信託証券の概要>

<更新後>

ファンド名	ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド・クラスI(JPY)アキュムレーティング
形態	アイルランド籍・円建外国投資法人
投資態度	信託財産を、非伝統的またはオルタナティブな投資ストラテジーで運用する様々な投資サブアドバイザーに配分することにより、信託財産の成長をめざします。
主な投資対象	世界の株式、債券およびデリバティブ等の幅広い資産に投資を行います。
主な投資制限	・同一の発行体が発行する流動性証券への投資比率は、原則として純資産総額の10%以内とします。 ・店頭デリバティブ取引のカウンターパーティーへのリスク・エクスポージャーは、原則として純資産総額の10%以内とします。
運用管理費用 (信託報酬)	純資産総額の年1.52%以内 また、管理事務代行会社に対し固定報酬として年額125,000米ドルがかかります。 ・毎年12月末の純資産が年初に見直される基準値を超えた場合に当該超過分に対し15%の成功報酬がかかる等、成功報酬の総額が毎年12月末における純資産の4.95%を超えない範囲でかかる場合があります。
その他の費用・ 手数料	税金、法律関係の費用、監査費用、有価証券等の売買に係る手数料、設立費用、保管費用、借入金・立替金の利息等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	Blackstone Alternative Investment Advisors L.L.C. 選定した投資サブアドバイザーに運用を委託します。
設定日	2014年12月19日
決算日	毎年12月31日
分配方針	通常のファンド運営過程において分配は宣言されません。

ファンド名	マネー・マーケット・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。 なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の公社債等
主な投資制限	・株式への投資は行いません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2005年3月4日
決算日	原則として毎年5月・11月の20日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

3【投資リスク】

<更新後>

(3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

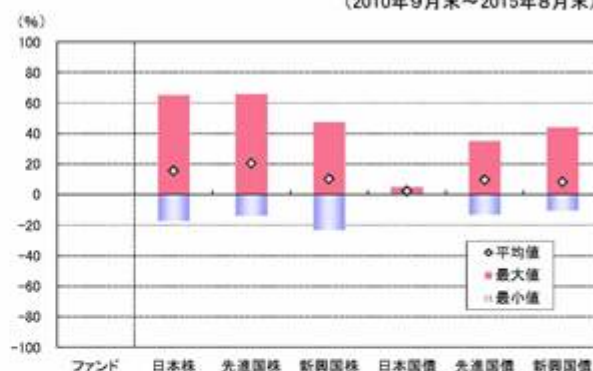


・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。

なお、ファンドを設定してから1年を経過していないため、ファンドの年間騰落率は記載していません。

●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2010年9月末～2015年8月末)



・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。

ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大・最小騰落率(%)

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	—	+15.5	+20.5	+10.3	+2.3	+9.6	+8.3
最大値	—	+65.0	+65.7	+47.4	+4.5	+34.9	+43.7
最小値	—	-17.0	-13.6	-22.8	+0.4	-12.7	-10.1

(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

・2010年9月～2015年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

(略)

上記は平成27年8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。

(略)

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

平成27年8月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資証券	アイルランド	1,534,252,073	95.12
親投資信託受益証券	日本	500,049	0.03
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		78,267,507	4.85
純資産総額		1,613,019,629	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成27年8月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アイル ランド	ブラックストーン・ダイバー シファイド・マルチストラテ ジー・ファンド クラスI (JPY)アキュムレーティ ング	投資証券		1,476,008.7680	1,019.30 1,039.46	1,504,502,931 1,534,252,073		95.12
日本	マネー・マーケット・マザー ファンド	親投資信託 受益証券		491,015	1.0182 1.0184	500,000 500,049		0.03

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成27年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資証券	95.12
親投資信託受益証券	0.03
合計	95.15

(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】

平成27年8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)
平成27年 1月末日	504,994,172	10,000
2月末日	511,543,879	10,130
3月末日	516,798,597	10,234
4月末日	603,202,259	10,190
5月末日	1,352,094,422	10,313
6月末日	1,392,284,535	10,307
7月末日	1,504,975,005	10,381
8月末日	1,613,019,629	10,353

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

	収益率（％）
平成27年1月30日（設定日）から 平成27年8月末日までの期間	3.53

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。ただし、平成27年1月30日から平成27年8月末日までの期間については平成27年8月末日の基準価額から当初元本（1万口当たり1万円）を控除した額を当初元本（1万口当たり1万円）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
平成27年1月30日（設定日）から 平成27年8月31日までの期間	1,683,939,035	125,903,637	1,558,035,398

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」

（1）投資状況

平成27年8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	8,510,046,900	95.33
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		417,231,677	4.67
純資産総額		8,927,278,577	100.00

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

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成27年8月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第541回国庫短期証券	国債証券		2,800,000	99.99 100.0001	2,799,997,200 2,800,002,800	2015/09/28	31.36
日本	第538回国庫短期証券	国債証券		2,000,000	99.99 100.0000	1,999,998,000 2,000,000,000	2015/09/14	22.40
日本	第540回国庫短期証券	国債証券		1,560,000	99.99 100.0000	1,559,998,440 1,560,000,000	2015/09/24	17.47
日本	第544回国庫短期証券	国債証券		1,300,000	99.99 100.0026	1,299,997,400 1,300,033,800	2015/10/13	14.56
日本	第548回国庫短期証券	国債証券		800,000	100.00 100.0011	800,000,000 800,008,800	2015/11/02	8.96
日本	第332回利付国債(2年)	国債証券		50,000	100.03 100.0030	50,015,000 50,001,500	0.100000 2015/09/15	0.56

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成27年8月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
国債証券	95.33
合計	95.33

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2015年8月31日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したものとして計算

2 分配の推移

- ・第1回目の決算日は2016年2月2日のため、該当事項はありません。

3 主要な資産の状況(2015年8月31日現在)

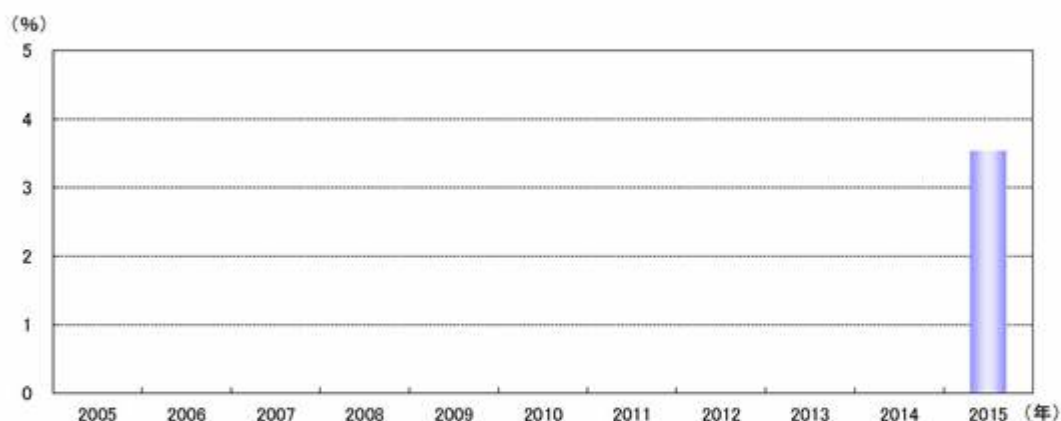
資産別構成	比率
投資信託証券	95.15%
ブラックストーン・ダイバーシファイド・マルチストラテジー・ファンド・クラスI(JPY)アキュムレーティング	95.12%
マネー・マーケット・マザーファンド	0.03%
コールローン他	4.85%
合計	100.00%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第三位四捨五入)

戦略別構成	比率(現地月末営業日基準)
株式系戦略	48.67%
クレジット戦略	33.26%
マルチアセット戦略	18.07%
合計	100.00%

・比率は実質的な投資を行う外国投資信託の純資産総額に対する投資比率(小数点第三位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2015年は設定日から8月31日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

【中間財務諸表】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの第1期計算期間は、約款第29条により、平成27年1月30日から平成28年2月2日までとしております。ただし、第1期中間計算期間は、平成27年1月30日から平成27年7月29日までとしております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（平成27年1月30日から平成27年7月29日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた監査法人により中間監査を受けております。

マルチストラテジー・ファンド（ラップ向け）

（１）【中間貸借対照表】

	第 1 期中間計算期間末 [平成27年7月29日現在]	
	金 額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		52,811,109
投資証券		1,460,511,066
親投資信託受益証券		500,000
未収利息		85
流動資産合計		1,513,822,260
資産合計		1,513,822,260
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,692,024
未払受託者報酬		140,255
未払委託者報酬		1,916,760
その他未払費用		12,091
流動負債合計		7,761,130
負債合計		7,761,130
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,451,114,643
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		54,946,487
元本等合計		1,506,061,130
純資産合計		1,506,061,130
負債純資産合計		1,513,822,260

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

	第 1 期中間計算期間 自 平成27年 1月30日 至 平成27年 7月29日	
	金 額（円）	
営業収益		
受取利息		14,978
有価証券売買等損益		33,324,748
営業収益合計		33,339,726
営業費用		
受託者報酬		140,255
委託者報酬		1,916,760
その他費用		12,091
営業費用合計		2,069,106
営業利益		31,270,620
経常利益		31,270,620
中間純利益		31,270,620
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		1,231,496
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		
剰余金増加額又は欠損金減少額		26,467,587
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		26,467,587
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,560,224
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,560,224
分配金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		54,946,487

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
-------------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期中間計算期間末 [平成27年7月29日現在]
1 期首元本額	505,000,000円
期中追加設定元本額	1,051,292,946円
期中一部解約元本額	105,178,303円
2 受益権の総数	1,451,114,643口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0379円 (10,379円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期中間計算期間末 [平成27年7月29日現在]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドは投資証券および親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

[次へ](#)

「マネー・マーケット・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

		[平成27年7月29日現在]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		30,940,341
国債証券		1,650,010,000
未収利息		18,545
流動資産合計		1,680,968,886
資産合計		1,680,968,886
負債の部		
流動負債		
未払解約金		42,899
流動負債合計		42,899
負債合計		42,899
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,650,689,542
剰余金		
剰余金又は欠損金()		30,236,445
元本等合計		1,680,925,987
純資産合計		1,680,925,987
負債純資産合計		1,680,968,886

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月21日から11月20日まで、および11月21日から翌年5月20日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		[平成27年7月29日現在]
1 期首		平成27年1月30日
期首元本額		2,279,078,117円
期首からの追加設定元本額		2,495,222,283円
期首からの一部解約元本額		3,123,610,858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		299,088,350円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)		5,226,135円
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)		14,525,380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)		2,727,794円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>(毎月分配型)		101,543円
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)		81,714,442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)		152,186,197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)		429,650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)		7,467,710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>		369,818,160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)		128,906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)		1,799,230円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド		2,017,345円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)		248,106円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)		712,999円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)		862,076円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<新興国バスケット通貨コース>(毎月分配型)		299,514円

米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボール ファンド>	981,915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)	389,070円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	42,384,248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)	3,558,532円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (毎月分配型)	23,960,741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)	938,449円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ< 円コース>(毎月分配型)	358,088円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ< 豪ドルコース>(毎月分配型)	2,100,667円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ< ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,836,590円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ< 資源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	923,745円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ< マネーボールファンド>	5,428,092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)	23,152,810円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<米ド ルコース>(毎月分配型)	5,011,602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)	4,071,402円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<ブラ ジルリアルコース>(毎月分配型)	43,682,881円
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)	374,779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)	780,306円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーボールファンド>	41,630,927円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円 コース>(毎月分配型)	2,221,253円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ< ユーロコース>(毎月分配型)	1,784,459円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪 ドルコース>(毎月分配型)	2,576,702円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブ ラジルリアルコース>(毎月分配型)	3,148,614円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資 源国バスケット通貨コース>(毎月分配型)	67,305円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーボールファンド>	3,492,409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)	78,483,503円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	2,069,498円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	1,147,224円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	1,068円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	20,706円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり>(毎月決算 型)	491,836円
三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし>(毎月決算 型)	98,368円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11(円 ヘッジ)(限定追加型)	10,816,126円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコ ース>(毎月分配型)	31,229,335円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回分配型)	168,137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)	276,237円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース> (年2回分配型)	20,660円
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)	89,380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)	1,554,984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)	2,668,957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)	688,506円

ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	19,658円
ビクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	19,658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	19,255,183円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	554,804円
パリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	1,936,118円
パリュール・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,829円
パリュール・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	9,829円
パリュール・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)	15,049,666円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	20,551,717円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	5,059,469円
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)	3,653,886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)	252,058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)	6,618,213円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(年2回分配型)	3,737,703円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(年2回分配型)	6,435,081円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(年2回分配型)	686,803円
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)	627,788円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(年2回分配型)	608,110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(年2回分配型)	46,726円
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)	895,906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>	10,941,412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>	980,054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)	1,423,307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)	3,270,787円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(年1回決算型)	1,168,184円
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)	983円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Dコース(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	983円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2013-11(円ヘッジ)(限定追加型)	982,608円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(毎月分配型)	2,827,156円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	9,387,547円
三菱UFJ/ピムコ トータル・リターン・ファンド2014	256,356円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	3,545,187円
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
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)	151,268円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(年2回分配型)	168,922円

PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	1,674,507円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	658,018円
PIMCO インカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	9,991,470円
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)	25,537,767円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム(毎月分配型)	42,906,570円
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)	8,585,548円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(毎月分配型)	10,804円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(年2回分配型)	10,804円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	1,375,824円
PIMCO 米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド(ラップ向け)	491,015円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	918,198円
PIMCO 米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	138,468円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	983円
三菱UFJ 債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	983円
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
Navigo インド債券ファンド	885,566円
Navigo マネーパールファンド	1,715,161円
三菱UFJ インド債券オープン(毎月決算型)	39,351円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	40,626,564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
バンクローンファンドUSA(為替ヘッジあり)2014-08	11,276,260円
マネーパールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	102,820円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,963,686円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース(為替ヘッジなし)	16,982,851円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース(為替ヘッジあり)	21,620,196円
(合計)	1,650,689,542円
2 受益権の総数	1,650,689,542口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0183円 (10,183円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年7月29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>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)に記載してあります。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載してあります。</p>

（有価証券関係に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

【ファンドの現況】

<更新後>

【純資産額計算書】

平成27年8月31日現在

(単位：円)

資産総額	1,615,271,734
負債総額	2,252,105
純資産総額(-)	1,613,019,629
発行済口数	1,558,035,398 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0353 (1万口当たり 10,353)

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成27年8月31日現在

(単位：円)

資産総額	14,487,273,134
負債総額	5,559,994,557
純資産総額(-)	8,927,278,577
発行済口数	8,766,050,356 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0184 (1万口当たり 10,184)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

<更新後>

平成27年8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【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」に定める投資助言業務を行っています。

平成27年8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	754	10,021,358
追加型公社債投資信託	21	1,633,922
単位型株式投資信託	55	592,479
単位型公社債投資信託	4	131,125
合計	834	12,378,883

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。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

<更新後>

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成27年3月末現在)

(略)

(2) 販売会社

<更新後>

名称	資本金の額 (平成27年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

3【資本関係】

<更新後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成27年8月末現在)

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成27年9月2日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているマルチストラテジー・ファンド（ラップ向け）の平成27年1月30日から平成27年7月29日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、マルチストラテジー・ファンド（ラップ向け）の平成27年7月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成27年1月30日から平成27年7月29日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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