

【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30年5月18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 松田 通

【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【事務連絡者氏名】 伊藤 晃

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 ショートデュレーション円インカムオープン（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 1,100万円  
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<sup>訂正</sup>有価証券報告書を提出致しましたので、平成29年7月7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。）の関係情報の更新等を行うため、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。

**第一部【証券情報】****(4) 【発行（売出）価格】**

<更新後>

(略)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(略)

**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>

(略)



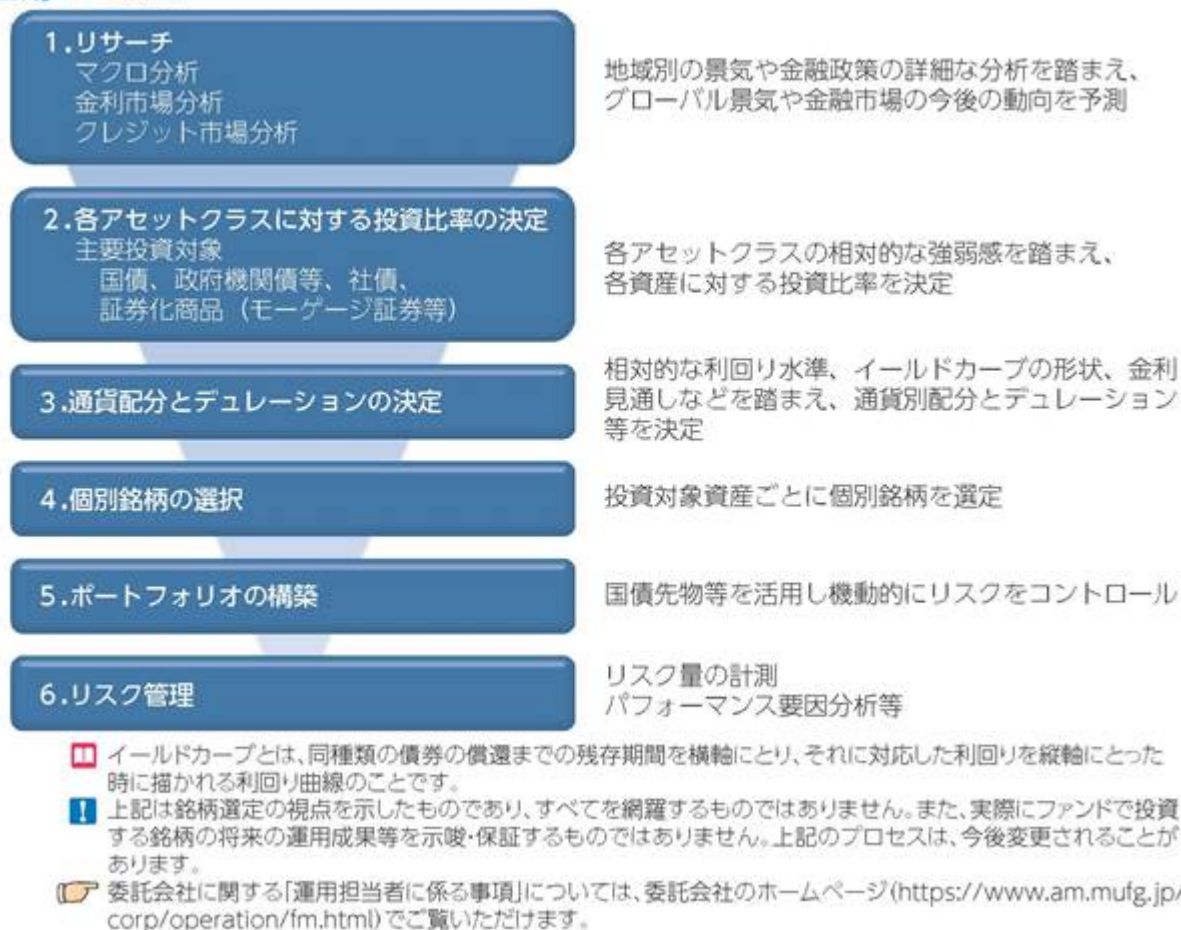
年1回の決算時(2月20日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■運用プロセス



（略）

### （２）【ファンドの沿革】

<更新後>

平成29年7月24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30年2月末現在）

（略）

・大株主の状況（平成30年4月2日現在）

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%

## 2【投資方針】

### （３）【運用体制】

<更新後>

（略）

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。

（略）

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。

（略）

#### 運用・管理に関する監督

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

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。

### 3【投資リスク】

#### （2）投資リスクに対する管理体制

<更新後>

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っています。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

##### トレーディング担当部署

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

##### コンプライアンス担当部署

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

##### リスク管理担当部署

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

##### 内部監査担当部署

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

<流動性リスクに対する管理体制>

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

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

### 代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の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	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】

## (3)【信託報酬等】

&lt;更新後&gt;

(略)

NOMURA-BPI 総合 短期(1-3)の複利利 回り	信託報酬率	内 訳		
		委託会社	販社会社	受託会社
3%以上	年0.378% (税抜年 0.35%)	年0.2916% (税抜年 0.27%)	年0.054% (税抜年 0.05%)	年0.0324% (税抜年 0.03%)
1%以上3%未満	年0.324% (税抜年0.3%)	年0.2376% (税抜年 0.22%)	年0.054% (税抜年 0.05%)	年0.0324% (税抜年 0.03%)
1%未満	年0.27% (税抜年 0.25%)	年0.1836% (税抜年 0.17%)	年0.054% (税抜年 0.05%)	年0.0324% (税抜年 0.03%)

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、上記の通りとなります。

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

(略)

## (5)【課税上の取扱い】

&lt;更新後&gt;

(略)

上記は平成30年2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】

&lt;更新後&gt;

## 【ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）】

## (1)【投資状況】

平成30年 2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,941,484,780	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		9,815,649	0.25
純資産総額		3,951,300,429	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30年 2月28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 (%)
日本	親投資信託受益証券	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	4,148,058,073	0.9501	3,941,069,976	0.9502	3,941,484,780	99.75

(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30年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成30年2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30年 2月20日)	3,969,791,621	3,969,791,621	9,952	9,952
平成29年 7月末日	10,999,343		9,999	
8月末日	7,630,406,819		10,003	
9月末日	5,606,161,201		9,993	
10月末日	7,681,981,496		10,008	
11月末日	7,623,440,710		10,015	
12月末日	7,649,175,746		10,003	
平成30年 1月末日	4,011,979,299		9,977	
2月末日	3,951,300,429		9,952	

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.48



（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	10,756,423,072	6,767,297,781	3,989,125,291

（参考）

ショートデュレーション円インカムマザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
国債証券	オーストラリア	332,068,291	8.40
	フランス	212,526,566	5.38
	スペイン	122,458,286	3.10
	アメリカ	105,927,215	2.68
	イタリア	93,347,773	2.36
	小計	866,328,131	21.92
特殊債券	オーストラリア	455,776,500	11.53
	アメリカ	247,819,279	6.27
	フランス	145,246,288	3.68
	スウェーデン	137,749,304	3.49
	小計	986,591,371	24.97
社債券	アメリカ	828,802,584	20.97
	オーストラリア	300,543,722	7.61
	イギリス	284,373,898	7.20
	スウェーデン	180,830,337	4.58
	ルクセンブルグ	27,093,540	0.69
	小計	1,621,644,081	41.04
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		476,844,041	12.07
純資産総額		3,951,407,624	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

平成30年 2月28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)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
オーストラリア	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	4,000,000	8,284.02	331,360,862	8,301.70	332,068,291	1.750000	2020/11/21	8.40
アメリカ	特殊債券	3.5 G2SF TBA 480301	2,300,000	10,805.78	248,532,967	10,774.75	247,819,279	3.500000	2048/3/1	6.27
フランス	国債証券	1 O.A.T 181125	1,600,000	13,287.57	212,601,133	13,282.91	212,526,566	1.000000	2018/11/25	5.38
オーストラリア	特殊債券	2.7 LANDWIRTSCH 200120	2,000,000	8,439.64	168,792,918	8,445.46	168,909,205	2.700000	2020/1/20	4.27
オーストラリア	特殊債券	2.5 EUROPEAN INVE 200430	1,900,000	8,412.15	159,830,949	8,421.17	160,002,301	2.500000	2020/4/30	4.05
イギリス	社債券	1.3 AMERICAN HOND 220321	1,000,000	14,755.09	147,550,972	14,729.69	147,296,932	1.300000	2022/3/21	3.73
フランス	特殊債券	0.05 CAISSE D'AMO 201125	1,100,000	13,198.03	145,178,416	13,204.20	145,246,288	0.050000	2020/11/25	3.68
スウェーデン	特殊債券	2.5 KOMMUNINVEST 201201	9,900,000	1,394.27	138,033,315	1,391.40	137,749,304	2.500000	2020/12/1	3.49
イギリス	社債券	3 RCI BANQUE SA 190509	900,000	15,257.40	137,316,618	15,230.77	137,076,966	3.000000	2019/5/9	3.47
アメリカ	社債券	FRN BANK OF AM 230504	1,000,000	13,347.89	133,478,939	13,337.08	133,370,896	0.452000	2023/5/4	3.38
アメリカ	社債券	FRN CENTRAL NIPPO 220303	1,200,000	10,856.50	130,278,034	10,850.97	130,211,679	2.297380	2022/3/3	3.30
オーストラリア	特殊債券	2.75 KFW 200416	1,500,000	8,447.66	126,715,033	8,457.66	126,864,994	2.750000	2020/4/16	3.21
オーストラリア	社債券	2.95 VOLKSWAGEN F 200622	1,500,000	8,370.05	125,550,862	8,381.67	125,725,168	2.950000	2020/6/22	3.18
スペイン	国債証券	2.75 SPAIN GOVT 190430	900,000	13,618.33	122,564,978	13,606.47	122,458,286	2.750000	2019/4/30	3.10
アメリカ	社債券	FRN CITIGROUP 240517	1,000,000	10,941.58	109,415,838	10,948.17	109,481,785	2.984940	2024/5/17	2.77
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 230131	1,000,000	10,612.85	106,128,534	10,592.72	105,927,215	2.375000	2023/1/31	2.68
アメリカ	社債券	2.45 TAKEDA PHARM 220118	1,000,000	10,535.57	105,355,739	10,521.26	105,212,615	2.450000	2022/1/18	2.66

アメリカ	社債券	2.55 SUNTORY HOLD 220628	1,000,000	10,386.71	103,867,161	10,332.92	103,329,237	2.550000	2022/6/28	2.61
スウェーデン	社債券	1 SWEDBANK HYPOTE 201216	7,000,000	1,336.27	93,539,545	1,339.17	93,742,004	1.000000	2020/12/16	2.37
イタリア	国債証券	0.7 ITALY GOVT 200501	700,000	13,339.15	93,374,055	13,335.39	93,347,773	0.700000	2020/5/1	2.36
オーストラリア	社債券	3.5 VICINITY CENT 240426	1,100,000	8,216.07	90,376,802	8,274.33	91,017,671	3.500000	2024/4/26	2.30
スウェーデン	社債券	3.25 NORDEA HYPOT 200617	6,200,000	1,403.35	87,008,051	1,404.65	87,088,333	3.250000	2020/6/17	2.20
オーストラリア	社債券	FRN VOLKSWAGEN FI 220914	1,000,000	8,380.31	83,803,142	8,380.08	83,800,883	3.065000	2022/9/14	2.12
アメリカ	社債券	FRN MORGAN STA 240508	700,000	11,018.06	77,126,455	11,011.92	77,083,501	3.010700	2024/5/8	1.95
アメリカ	社債券	FRN GOLDMAN SACHS 231129	600,000	11,174.89	67,049,360	11,188.88	67,133,336	3.077250	2023/11/29	1.70
アメリカ	社債券	1.875 PHILIP MORR 210225	400,000	10,409.60	41,638,415	10,399.27	41,597,116	1.875000	2021/2/25	1.05
アメリカ	社債券	2.503 BANK OF AM 221021	400,000	10,412.54	41,650,193	10,367.35	41,469,438	2.503000	2022/10/21	1.05
ルクセンブルグ	社債券	1.375 HOLCIM FINA 230526	200,000	13,525.48	27,050,979	13,546.77	27,093,540	1.375000	2023/5/26	0.69
アメリカ	社債券	2.839 MIZUHO FINA 260913	200,000	9,972.32	19,944,654	9,956.49	19,912,981	2.839000	2026/9/13	0.50

(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30年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	21.92
特殊債券	24.97
社債券	41.04
合計	87.93

(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。

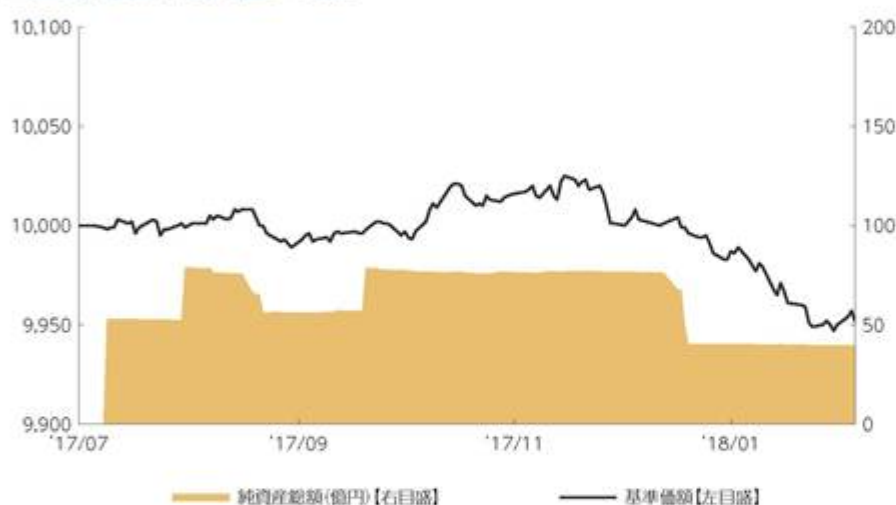
[ 参考情報 ]



## 運用実績

2018年2月28日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2017年7月24日(設定日)～2018年2月28日



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

### ■基準価額・純資産

基準価額	9,952円
純資産総額	39.5億円

### ■分配の推移

2018年2月	0円
設定来累計	0円

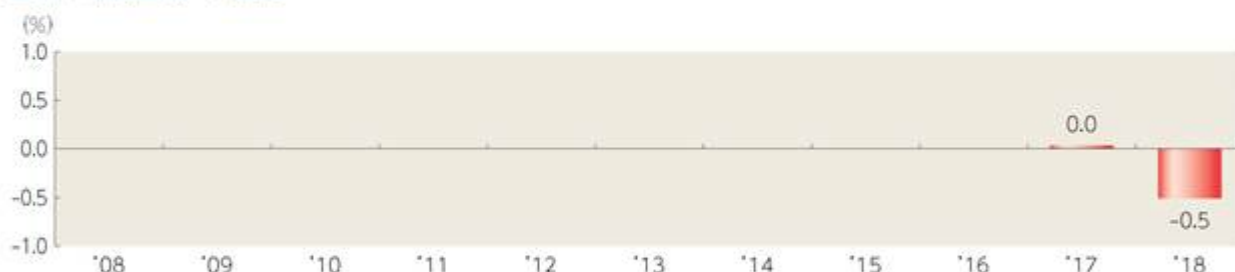
\*分配金は1万円当たり、税引前

### ■主要な資産の状況

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
円	98.8%	1 1.75 AUST GOVT 201121	国債	オーストラリア	8.4%
オーストラリアドル	0.5%	2 3.5 G2SF TBA 480301	特殊債	アメリカ	6.3%
スウェーデンクローネ	0.3%	3 1 O.A.T 181125	国債	フランス	5.4%
イギリス債券	0.2%	4 2.7 LANDWIRTSCH 200120	特殊債	オーストラリア	4.3%
アメリカドル	0.1%	5 2.5 EUROPEAN INVE 200430	特殊債	オーストラリア	4.0%
ユーロ	0.1%	6 1.3 AMERICAN HOND 220321	社債	イギリス	3.7%
		7 0.05 CAISSE D'AMO 201125	特殊債	フランス	3.7%
		8 2.5 KOMMUNINVEST 201201	特殊債	スウェーデン	3.5%
		9 3 RCI BANQUE SA 190509	社債	イギリス	3.5%
		10 FRN BANK OF AM 230504	社債	アメリカ	3.4%
合計	100.0%				

\*各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの、2018年は年初から2月28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】**

&lt;更新後&gt;

**1【申込（販売）手続等】**

(略)

申込単位・ 申込価額の 照会方法	(略) ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
------------------------	---

(略)

**2【換金（解約）手続等】**

(略)

解約価額の 照会方法	(略) ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
---------------	---

(略)

**3【資産管理等の概要】****(1)【資産の評価】**

(略)

基準価額の 照会方法	(略) ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
---------------	---

(略)

**(5)【その他】**

(略)

公告	(略) <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a> (略)
----	---

### 第3【ファンドの経理状況】

#### <更新後>

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、平成29年7月24日から平成30年2月20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、当期（平成29年7月24日から平成30年2月20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】

## 【ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 [平成30年 2月20日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		24,481,532
親投資信託受益証券		3,959,990,474
未収入金		15,610,519
流動資産合計		4,000,082,525
資産合計		4,000,082,525
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		20,563,716
未払受託者報酬		1,150,699
未払委託者報酬		8,438,436
未払利息		35
その他未払費用		138,018
流動負債合計		30,290,904
負債合計		30,290,904
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		3,989,125,291
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		19,333,670
(分配準備積立金)		34,112,135
元本等合計		3,969,791,621
純資産合計		3,969,791,621
負債純資産合計		4,000,082,525

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期 自平成29年 7月24日 至平成30年 2月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息		116
有価証券売買等損益		7,871,997
営業収益合計		7,871,881
<b>営業費用</b>		
支払利息		7,438
受託者報酬		1,150,699
委託者報酬		8,438,436
その他費用		138,018
営業費用合計		9,734,591
営業利益又は営業損失( )		17,606,472
経常利益又は経常損失( )		17,606,472
当期純利益又は当期純損失( )		17,606,472
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( )		1,270,853

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	426,835
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	426,835
剰余金減少額又は欠損金増加額	883,180
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	883,180
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	<u>19,333,670</u>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 [平成30年 2月20日現在]
1. 期首元本額	11,000,000円
期中追加設定元本額	10,745,423,072円
期中一部解約元本額	6,767,297,781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。	19,333,670円
3. 受益権の総数	3,989,125,291口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 7月24日 至 平成30年 2月20日		
1. 分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	34,112,135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	10,640,945円
分配準備積立金額	D	円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,753,080円
当ファンドの期末残存口数	F	3,989,125,291口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	112円
1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	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	第1期 自 平成29年 7月24日 至 平成30年 2月20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、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [平成30年 2月20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	(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。 (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。 (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。
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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期 [平成30年 2月20日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	11,670,324
合計	11,670,324

## （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）

	第1期 [平成30年 2月20日現在]
1口当たり純資産額	0.9952円
(1万口当たり純資産額)	(9,952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
親投資信託受益証券	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	4,167,972,292	3,959,990,474	
合計		4,167,972,292	3,959,990,474	

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。

## ショートデュレーション円インカムマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月20日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	80,568,087
コール・ローン	595,765,802
国債証券	873,341,962
特殊債券	995,715,510
社債券	1,628,042,706
派生商品評価勘定	54,002,063
未収入金	496,154,421
未収利息	16,913,131
前払費用	4,578,134
流動資産合計	4,745,081,816
資産合計	4,745,081,816
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,816,180
未払金	754,690,519
未払解約金	15,615,597
未払利息	865
流動負債合計	775,123,161
負債合計	775,123,161
純資産の部	
元本等	
元本	4,178,396,354
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	208,437,699
元本等合計	3,969,958,655
純資産合計	3,969,958,655
負債純資産合計	4,745,081,816

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成30年 2月20日現在]
1. 期首	平成29年 7月24日
期首元本額	10,972,500円
期中追加設定元本額	10,993,877,472円
期中一部解約元本額	6,826,453,618円
元本の内訳	
ショートデュレーション円インカムオープン(ラップ向け)	4,167,972,292円
MUKAMショートデュレーション円インカム戦略ファンド(適格機関投資家転売制限付)	10,424,062円
合計	4,178,396,354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。	208,437,699円
3. 受益権の総数	4,178,396,354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 平成29年 7月24日 至 平成30年 2月20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、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。



## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月20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	(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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (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。
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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月20日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,430,843
特殊債券	3,628,957
社債券	10,411,802
合計	16,471,602

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

[平成30年 2月20日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	792,758,220		797,574,400	4,816,180
	オーストラリアドル	1,129,724,643		1,110,817,920	18,906,723
	イギリスポンド	288,880,622		283,056,150	5,824,472
	スウェーデンクローネ	326,583,875		317,537,500	9,046,375
	ユーロ	800,885,093		780,660,600	20,224,493
	合計	3,338,832,453		3,289,646,570	49,185,883

## (注) 時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (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)

	[平成30年 2月20日現在]
1口当たり純資産額	0.9501円
(1万口当たり純資産額)	(9,501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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	2.375 T-NOTE 230131	1,000,000.00	988,437.50	
	国債証券 小計		1,000,000.00	988,437.50 (105,565,125)	
	特殊債券	3.5 G2SF TBA 480301	2,300,000.00	2,314,733.80	
	特殊債券 小計		2,300,000.00	2,314,733.80 (247,213,569)	
	社債券	1.875 PHILIP MORR 210225	400,000.00	387,803.06	
		2.45 TAKEDA PHARM 220118	1,000,000.00	981,240.00	
		2.503 BANK OF AM 221021	400,000.00	387,912.76	
		2.55 SUNTORY HOLD 220628	1,000,000.00	967,376.00	
		2.839 MIZUHO FINA 260913	200,000.00	185,756.30	
		FRN CENTRAL NIPPO 220303	1,200,000.00	1,213,356.00	
		FRN CITIGROUP 240517	1,000,000.00	1,019,054.10	
		FRN GOLDMAN SACHS 231129	600,000.00	624,470.15	
		FRN MORGAN STA 240508	700,000.00	718,324.07	
	社債券 小計		6,500,000.00	6,485,292.44 (692,629,232)	
アメリカドル合計			9,800,000.00	9,788,463.74 (1,045,407,926)	
オーストラリアドル	国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	4,000,000.00	3,960,804.00	
	国債証券 小計		4,000,000.00	3,960,804.00 (335,123,626)	
	特殊債券	2.5 EUROPEAN INVE 200430	1,900,000.00	1,910,482.30	
		2.7 LANDWIRTSCH 200120	2,000,000.00	2,017,606.00	
		2.75 KFW 200416	1,500,000.00	1,514,643.00	
	特殊債券 小計		5,400,000.00	5,442,731.30 (460,509,495)	
	社債券	2.95 VOLKSWAGEN F 200622	1,500,000.00	1,500,727.50	
		3.5 VICINITY CENT 240426	1,100,000.00	1,080,286.90	
		FRN VOLKSWAGEN FI 220914	1,000,000.00	1,001,711.00	
社債券 小計		3,600,000.00	3,582,725.40 (303,134,396)		
オーストラリアドル合計			13,000,000.00	12,986,260.70 (1,098,767,517)	

イギリス ポンド	社債券	1.3 AMERICAN HOND 220321	1,000,000.00	988,550.00	
		3 RCI BANQUE SA 190509	900,000.00	919,982.70	
イギリスポンド合計			1,900,000.00	1,908,532.70	(285,230,212)
スウェー デンク ローネ	特殊債券	2.5 KOMMUNINVEST 201201	9,900,000.00	10,585,377.00	
	特殊債券 小計		9,900,000.00	10,585,377.00	(141,420,636)
	社債券	1 SWEDBANK HYPOTE 201216	7,000,000.00	7,173,278.00	
		3.25 NORDEA HYPOT 200617	6,200,000.00	6,672,396.60	
	社債券 小計		13,200,000.00	13,845,674.60	(184,978,212)
スウェーデンクローネ合計			23,100,000.00	24,431,051.60	(326,398,848)
ユーロ	国債証券	0.7 ITALY GOVT 200501	700,000.00	711,258.80	
		1 O.A.T 181125	1,600,000.00	1,619,448.00	
		2.75 SPAIN GOVT 190430	900,000.00	933,615.00	
	国債証券 小計		3,200,000.00	3,264,321.80	(432,653,211)
	特殊債券	0.05 CAISSE D'AMO 201125	1,100,000.00	1,105,868.50	
	特殊債券 小計		1,100,000.00	1,105,868.50	(146,571,810)
	社債券	1.375 HOLCIM FINA 230526	200,000.00	206,055.60	
		FRN BANK OF AM 230504	1,000,000.00	1,016,750.00	
	社債券 小計		1,200,000.00	1,222,805.60	(162,070,654)
ユーロ合計			5,500,000.00	5,592,995.90	(741,295,675)
合計				3,497,100,178	(3,497,100,178)

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

#### 外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	-------------------------

アメリカドル	国債証券	1銘柄	10.10%	3.02%
	特殊債券	1銘柄	23.65%	7.07%
	社債券	9銘柄	66.25%	19.81%
オーストラリアドル	国債証券	1銘柄	30.50%	9.58%
	特殊債券	3銘柄	41.91%	13.17%
	社債券	3銘柄	27.59%	8.67%
イギリスポンド	社債券	2銘柄	100.00%	8.16%
スウェーデンクローネ	特殊債券	1銘柄	43.33%	4.04%
	社債券	2銘柄	56.67%	5.29%
ユーロ	国債証券	3銘柄	58.36%	12.37%
	特殊債券	1銘柄	19.77%	4.19%
	社債券	2銘柄	21.86%	4.63%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

&lt;更新後&gt;

## 【ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）】

## 【純資産額計算書】

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	3,965,132,113
負債総額	13,831,684
純資産総額（ - ）	3,951,300,429
発行済口数	3,970,365,334口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9952
（10,000口当たり）	（9,952）

（参考）

## ショートデュレーション円インカムマザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	4,220,255,567
負債総額	268,847,943
純資産総額（ - ）	3,951,407,624
発行済口数	4,158,481,500口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9502
（10,000口当たり）	（9,502）

## 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

平成30年2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。

平成30年2月28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	844	11,748,864
追加型公社債投資信託	16	1,329,544
単位型株式投資信託	54	320,129
単位型公社債投資信託	1	6,116
合計	915	13,404,653

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32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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。

（第32期事業年度の財務諸表は省略）

&lt;追加&gt;

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)	
(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	46,287,102
有価証券	78,897
前払費用	496,625
未収入金	87,286
未収委託者報酬	9,160,402
未収収益	681,527
繰延税金資産	471,973
金銭の信託	30,000
その他	95,228
流動資産合計	57,389,043
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 780,721
器具備品	1 764,182
土地	1,356,000
有形固定資産合計	2,900,904
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,938,735
ソフトウェア仮勘定	1,212,251
無形固定資産合計	3,166,809
投資その他の資産	
投資有価証券	28,266,735
関係会社株式	320,136
長期差入保証金	640,950
前払年金費用	448,902
繰延税金資産	451,891
その他	45,230
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	30,150,247
固定資産合計	36,217,960
資産合計	93,607,004

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		196,841
未払金		
未払収益分配金		174,797
未払償還金		514,622
未払手数料		3,754,874
その他未払金		2,503,473
未払費用		4,229,858
未払消費税等	2	305,160
未払法人税等		792,896
賞与引当金		863,522
役員賞与引当金		66,649
その他		776,417
流動負債合計		<u>14,179,114</u>

## 固定負債

退職給付引当金		651,492
役員退職慰労引当金		163,557
時効後支払損引当金		252,546
固定負債合計		<u>1,067,596</u>

## 負債合計

15,246,710

## (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		<u>44,732,712</u>

## 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		22,251,535
利益剰余金合計		<u>29,592,124</u>

## 株主資本合計

76,324,968

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券	2,035,325
評価差額金	
評価・換算差額等合計	2,035,325
純資産合計	78,360,294
負債純資産合計	93,607,004

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
<b>営業収益</b>	
委託者報酬	38,184,632
投資顧問料	1,346,730
その他営業収益	26,405
営業収益合計	39,557,767
<b>営業費用</b>	
支払手数料	15,720,488
広告宣伝費	318,084
公告費	500
調査費	
調査費	861,247
委託調査費	6,711,776
事務委託費	436,601
<b>営業雑経費</b>	
通信費	85,593
印刷費	251,837
協会費	24,207
諸会費	7,746
事務機器関連費	821,139
その他営業雑経費	13,599
営業費用合計	25,252,824
<b>一般管理費</b>	
<b>給料</b>	
役員報酬	178,839
給料・手当	2,821,754
賞与引当金繰入	863,522
役員賞与引当金繰入	66,649
福利厚生費	619,913
交際費	6,009
旅費交通費	93,328
租税公課	222,435
不動産賃借料	341,770
退職給付費用	210,625
役員退職慰労引当金繰入	23,884
固定資産減価償却費	1 512,328
諸経費	199,624
一般管理費合計	6,160,685
営業利益	8,144,257

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(自平成29年4月1日  
至平成29年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	134,154
受取利息	277
投資有価証券償還益	29,656
収益分配金等時効完成分	34,222
その他	9,043
営業外収益合計	207,354
営業外費用	
投資有価証券償還損	20,261
時効後支払損引当金繰入	26,116
その他	5,612
営業外費用合計	51,990
経常利益	8,299,622
特別利益	
投資有価証券売却益	196,888
ゴルフ会員権売却益	2,495
特別利益合計	199,383
特別損失	
投資有価証券売却損	60,319
固定資産除却損	0
特別損失合計	60,319
税引前中間純利益	8,438,686
法人税、住民税及び事業税	2,631,045
法人税等調整額	4,911
法人税等合計	2,626,133
中間純利益	5,812,552

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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	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		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	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
中間純利益							5,812,552	5,812,552	5,812,552
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							20,783,178	20,783,178	20,783,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	22,251,535	29,592,124	76,324,968

	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	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当中間期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
中間純利益			5,812,552
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	540,738	540,738	540,738
当中間期変動額合計	540,738	540,738	20,242,440
当中間期末残高	2,035,325	2,035,325	78,360,294



**[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  
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。  
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. 固定資産の減価償却の方法
  - (1) 有形固定資産  
定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。  
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
  - (2) 無形固定資産  
定額法を採用しております。  
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 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。

## 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、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。

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、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。

**[注記事項]**

(中間貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
建物	571,713千円
器具備品	1,115,446千円

## 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33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
有形固定資産	114,767千円
無形固定資産	397,560千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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

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

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

（リース取引関係）

第33期中間会計期間(平成29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	678,116千円
1年超	1,634,641千円
合計	2,312,757千円

（金融商品関係）

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成29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、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）。

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,287,102	46,287,102	-
(2) 有価証券	78,897	78,897	-
(3) 未収委託者報酬	9,160,402	9,160,402	-
(4) 投資有価証券	28,129,575	28,129,575	-
資産計	83,655,978	83,655,978	-
(1) 未払手数料	3,754,874	3,754,874	-
負債計	3,754,874	3,754,874	-

## (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、(3) 未収委託者報酬

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

## (2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (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

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）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、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（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。

## (有価証券関係)

第33期中間会計期間（平成29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

	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	21,493,708	18,316,441	3,177,266
	小 計	21,493,708	18,316,441	3,177,266
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	6,714,765	6,958,415	243,650
	小 計	6,714,765	6,958,415	243,650
合 計		28,208,473	25,274,857	2,933,616

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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。

[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]

該当事項はありません。

[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]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（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33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
1株当たり純資産額	370,356.00円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	78,360,294
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	78,360,294
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33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	27,471.99円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	5,812,552
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)	5,812,552
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(注) 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、記載しておりません。

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

&lt;更新後&gt;

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成29年9月末現在)

(略)

**(2) 販売会社**

&lt;更新後&gt;

名称	資本金の額 (平成29年9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】**

&lt;更新後&gt;

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30年4月2日現在)

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。

(略)

## 独立監査人の監査報告書

平成30年3月28日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）の平成29年7月24日から平成30年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ショートデュレーション円インカムオープン（ラップ向け）の平成30年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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。

## 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な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、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29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（平成29年4月1日から平成29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。



## 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。