

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	2023年12月19日
<b>【発行者（受託者）名称】</b>	三菱UFJ信託銀行株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 長 島 巖
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	三菱UFJ信託銀行株式会社 オルタナティブアセット運用部 金融商品運用課 課長 立 花 真 吾
<b>【電話番号】</b>	03(3212)1211(大代表)
<b>【発行者（委託者）氏名又は名称】</b>	該当事項はありません。
<b>【代表者の役職氏名】</b>	該当事項はありません。
<b>【住所又は本店の所在の場所】</b>	該当事項はありません。
<b>【事務連絡者氏名】</b>	該当事項はありません。
<b>【電話番号】</b>	該当事項はありません。
<b>【届出の対象とした募集（売出）有価証券の名称】</b>	実績配当型合同運用指定金銭信託（個人用）ベビーファンド 対面型受益権 / 愛称：投資の一步 実績配当型合同運用指定金銭信託（個人用）ベビーファンド 非対面型受益権 / 愛称：クエスト
<b>【届出の対象とした募集（売出）有価証券の金額】</b>	実績配当型合同運用指定金銭信託（個人用）ベビーファンド 対面型受益権 / 愛称：投資の一步および実績配当型合同運用指定金銭信託（個人用）ベビーファンド 非対面型受益権 / 愛称：クエストを合わせて2兆円を上限とします。 ただし、一時期に想定を超えるお申込みがあった場合や信託財産の運用状況等によっては、募集の制限や停止をさせていただくことがあります。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

2023年6月19日付で提出した有価証券届出書(同年9月19日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原有価証券届出書」といいます。)の記載事項について、有価証券報告書の提出ならびにマザーファンドの信託約款の変更に伴う訂正等を行うため、有価証券届出書の訂正届出書を提出するものであります。

## 2【訂正事項】

### 第一部 証券情報

#### 第1 内国信託受益権の募集(売出)要項

##### 1 内国信託受益権の形態等

### 第二部 信託財産情報

#### 第1 信託財産の状況

##### 1 概況

##### (4) 信託財産の管理体制等

信託財産の運用(管理及び処分)に関する基本的態度

##### 3 信託の仕組み

##### (1) 信託の概要

信託の基本的仕組み

(a) 仕組みの概要

(b) ファンド信用格付について

信託財産の運用(管理及び処分)に関する事項

(b) 運用対象および方法

##### 4 信託財産を構成する資産の状況

##### 5 投資リスク

#### 第2 信託財産の経理

#### 第4 その他

### 第三部 受託者、委託者及び関係法人の情報

## 3【訂正箇所】

### 第一部【証券情報】

#### 第1【内国信託受益権の募集(売出)要項】

##### 1【内国信託受益権の形態等】

(訂正前)

(前略)

当信託は、2023年9月19日現在において、信用格付業者である株式会社格付投資情報センター(以下「R&I」といいます。)より、ファンド信用格付「AAfc(ダブルエーエフシー)」を取得しています。ファンド信用格付については、R&Iが2010年9月30日付けで金融庁に登録し、信用格付業者となっているため、信用格付業者から取得する格付となります。なお、ファンド信用格付は、市場環境の変化等により、変更される可能性があります。

(後略)

(訂正後)

(前略)

当信託は、2023年12月19日現在において、信用格付業者である株式会社格付投資情報センター(以下「R&I」といいます。)より、ファンド信用格付「AAfc(ダブルエーエフシー)」を取得しています。ファンド信用格付については、R&Iが2010年9月30日付けで金融庁に登録し、信用格付業者となっているため、信用格付業者から取得する格付となります。なお、ファンド信用格付は、市場環境の変化等により、変更される可能性があります。

(後略)

## 第二部【信託財産情報】

### 第1【信託財産の状況】

#### 1【概況】

##### (4)【信託財産の管理体制等】

【信託財産の運用(管理及び処分)に関する基本的態度】

(訂正前)

(前略)

(b) 当信託の運用資産の平均的な信用力を示す目安として、2023年9月19日現在において、R&Iから、「AAfc(ダブルエーエフシー)」のファンド信用格付を取得しています。

(後略)

(訂正後)

(前略)

(b) 当信託の運用資産の平均的な信用力を示す目安として、2023年12月19日現在において、R&Iから、「AAfc(ダブルエーエフシー)」のファンド信用格付を取得しています。

(後略)

#### 3【信託の仕組み】

##### (1)【信託の概要】

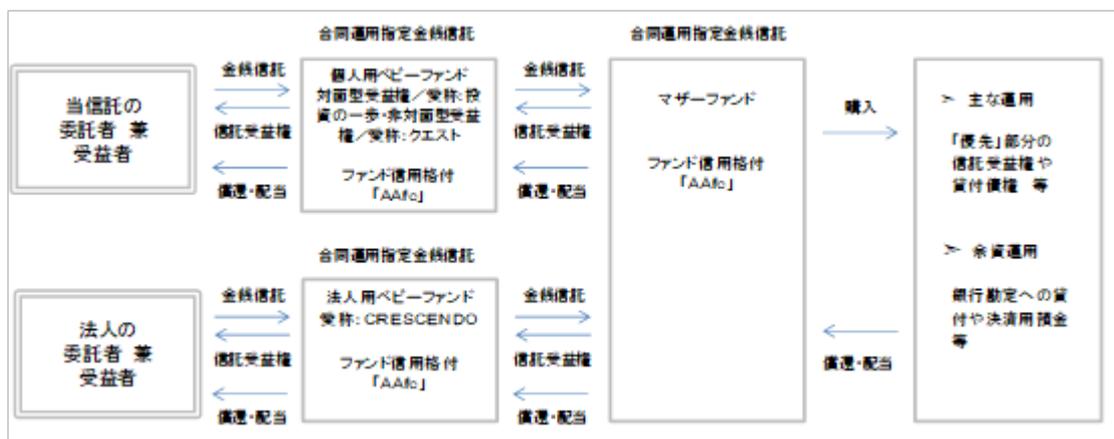
【信託の基本的仕組み】

(a) 仕組みの概要

(訂正前)

(前略)

<運用概要図>

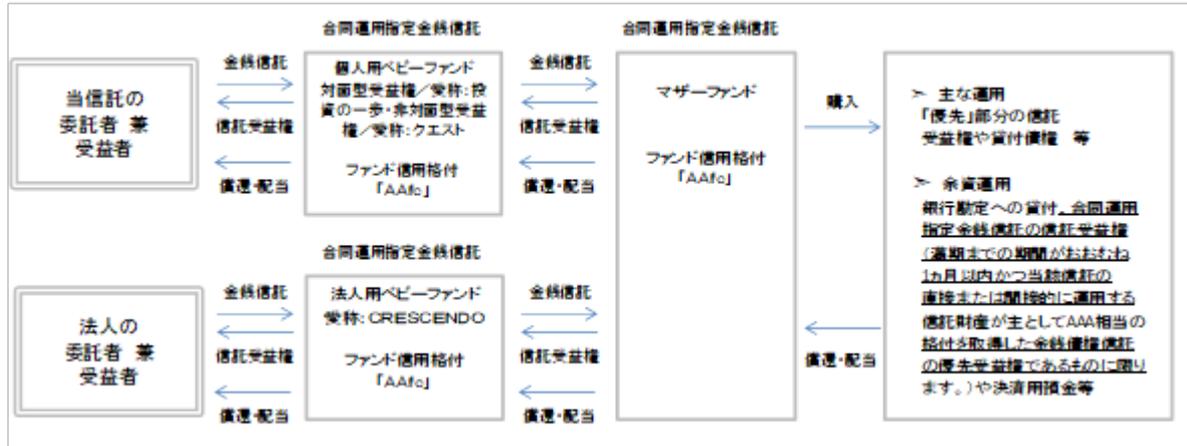


(後略)

(訂正後)

(前略)

&lt;運用概要図&gt;



(後略)

(b) ファンド信用格付について

(訂正前)

当信託は、2023年9月19日現在において、R&Iよりファンド信用格付「AAfc(ダブルエーエフシー)」を取得しています。なお、ファンド信用格付は、市場環境の変化等により、変更される可能性があります。

(後略)

(訂正後)

当信託は、2023年12月19日現在において、R&Iよりファンド信用格付「AAfc(ダブルエーエフシー)」を取得しています。なお、ファンド信用格付は、市場環境の変化等により、変更される可能性があります。

(後略)

## 【信託財産の運用（管理及び処分）に関する事項】

(b) 運用対象および方法

(訂正前)

(前略)

《参考：マザーファンドの運用方針および運用対象について》

&lt;マザーファンドの運用の基本方針について&gt;

マザーファンドは、マザーファンドの委託者から信託された信託金を、マザーファンドの信託約款にもとづく信託契約により信託された他の信託金と合同して運用します。マザーファンドの委託者から信託された信託金は、主に自動車ローン債権やクレジットカード債権等を裏付けとした信託受益権および貸付債権等に運用を行います。なお、マザーファンドの合同運用財産の一部は、満期償還や中途解約に伴う支払準備等のため、決済用預金（無利息普通預金）またはマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付で管理または運用することがあります。また、マザーファンドの合同運用財産について流動性を補完する必要があると認めるときは、金融機関からマザーファンドの合同運用財産のみを責任財産とする借入れを行うことができ、また、マザーファンドの合同運用財産に属する資産の価格変動等のヘッジのため、有価証券・金利に係る先物取引等を行うことがあります。

(中略)

&lt;マザーファンドの運用対象および方法&gt;

(中略)

3) マザーファンドの受託者は、支払準備の必要がある場合、マザーファンドの合同運用財産に生じた余裕金を運用する場合、その他必要と認めた場合には、マザーファンドの合同運用財産を決済用預金（無利息普通預金）にて

管理することができます。マザーファンドの受託者は、マザーファンドの合同運用財産の効率的な運用に資するものであり、かつ受益者の保護に支障を生ずることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項第2号ニに定める場合に該当するときは、マザーファンドの合同運用財産をマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付で運用することができます。なお、マザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付で運用した場合の運用利率は、マザーファンドの受託者の店頭に表示する普通預金利率とします。

(後略)

(訂正後)

(前略)

《参考：マザーファンドの運用方針および運用対象について》

<マザーファンドの運用の基本方針について>

マザーファンドは、マザーファンドの委託者から信託された信託金を、マザーファンドの信託約款にもとづく信託契約により信託された他の信託金と合同して運用します。マザーファンドの委託者から信託された信託金は、主に自動車ローン債権やクレジットカード債権等を裏付けとした信託受益権および貸付債権等に運用を行います。なお、マザーファンドの合同運用財産の一部は、満期償還や中途解約に伴う支払準備等のため、決済用預金(無利息普通預金)またはマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付もしくはマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付と同等以上の安全性を有するとマザーファンドの受託者が認める実績配当型の合同運用指定金銭信託の信託受益権(満期までの期間がおおむね1カ月以内かつ当該信託の直接または間接的に運用する信託財産が主としてAAA相当の格付を取得した金銭債権信託の優先受益権であるものに限りま)で管理または運用することがあります。また、マザーファンドの合同運用財産について流動性を補完する必要があると認めるときは、金融機関からマザーファンドの合同運用財産のみを責任財産とする借入れを行うことができ、また、マザーファンドの合同運用財産に属する資産の価格変動等のヘッジのため、有価証券・金利に係る先物取引等を行うことがあります。

(中略)

<マザーファンドの運用対象および方法>

(中略)

3) マザーファンドの受託者は、支払準備の必要がある場合、マザーファンドの合同運用財産に生じた余裕金を運用する場合、その他必要と認めた場合には、マザーファンドの合同運用財産を決済用預金(無利息普通預金)にて管理することができます。マザーファンドの受託者は、マザーファンドの合同運用財産の効率的な運用に資するものであり、かつ受益者の保護に支障を生ずることがないものとして兼営法施行規則第23条第3項第2号ニに定める場合に該当するときは、マザーファンドの合同運用財産をマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付またはマザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付と同等以上の安全性を有するとマザーファンドの受託者が認める実績配当型の合同運用指定金銭信託の信託受益権(満期までの期間がおおむね1カ月以内かつ当該信託の直接または間接的に運用する信託財産が主としてAAA相当の格付を取得した金銭債権信託の優先受益権であるものに限りま)で運用することができます。なお、マザーファンドの受託者の銀行勘定に対する貸付で運用した場合の運用利率は、マザーファンドの受託者の店頭に表示する普通預金利率とします。

(後略)

#### 4【信託財産を構成する資産の状況】

原有価証券届出書の「第二部 信託財産情報 第1 信託財産の状況 4 信託財産を構成する資産の状況」を次の内容に更新・訂正します。

(更新・訂正後)

(1)【信託財産を構成する資産の運用(管理)の概況】

当信託の運用状況

(2023年9月19日現在)

資産の種類	残高(百万円)	投資比率(%) <sup>2</sup>
主たる運用	70,952	100.00
銀行勘定貸	0	0.00
合同運用口信託受益権 <sup>1</sup>	70,952	100.00
資産合計	70,952	100.00

1 マザーファンドの受益権のことで、以下同じ。

2 投資比率とは、資産合計に対する当該資産の残高の割合を指します。

## &lt;ご参考&gt;

## マザーファンドの運用状況

(2023年9月19日現在)

資産の種類	残高(百万円)	投資比率(%) 4
主たる運用	798,726	78.00
金銭債権信託受益権	259,893	25.38
貸付債権	538,833	52.62
余資運用	225,155	21.98
銀行勘定貸 3	225,155	21.98
その他	79	0.00
未収収益	79	0.00
資産合計	1,023,960	100.00

3 余資運用として、当社銀行勘定に貸し付けている金額です。

4 投資比率とは、資産合計に対する当該資産の残高の割合を指します。

## マザーファンドの主たる運用資産の格付別の運用資産構成

(2023年9月19日現在)

格付	残高(百万円)	投資比率(%) 5
AAA格	798,726	100.00

5 投資比率とは、マザーファンドの主たる運用資産の資産合計に対する当該資産の残高の割合を指します。

## マザーファンドの主たる運用資産の裏付資産別の運用資産の構成

(2023年9月19日現在)

裏付資産	残高(百万円)	投資比率(%) 6
自動車ローン債権	491,448	61.52
リフォームローン等	168,950	21.15
クレジットカード債権	46,368	5.80
リース料債権	47,852	5.99
その他割賦債権	44,106	5.52
合計	798,726	100.00

6 投資比率とは、マザーファンドの主たる運用資産の資産合計に対する当該資産の残高の割合を指します。

## マザーファンドの運用資産および元本の加重平均年限(2023年9月19日現在)

(単位:年)

運用資産の加重平均年限	元本の加重平均年限
1.48	0.54

(記載上の注意)上記の各記載金額は百万円未満を切り捨てて表示しており、また、上記の各記載比率は小数第三位を切り捨てて表示しております。そのため、各項目の数値の合計と合計欄の数値が一致しないことがあります。

## (2) 【損失及び延滞の状況】

本有価証券届出書の訂正届出書提出日前5年以内に終了した計算期間について、当信託の信託財産を構成する資産に、損失および延滞は発生していません。

## (3) 【収益状況の推移】

本有価証券届出書の訂正届出書提出日前5年以内に終了した計算期間について、当信託の信託財産を構成する資産の運用利回りの推移は以下のとおりです。

(2023年9月19日現在)

計算期間	運用利回り(%)
2019年4月1日～2019年9月19日	0.18
2019年9月20日～2020年3月19日	0.19
2020年3月20日～2020年9月19日	0.22
2020年9月20日～2021年3月19日	0.22
2021年3月20日～2021年9月19日	0.22
2021年9月20日～2022年3月19日	0.23
2022年3月20日～2022年9月19日	0.26
2022年9月20日～2023年3月19日	0.28
2023年3月20日～2023年9月19日	0.32

7 運用利回りとは、当信託の信託財産を構成する資産から生じる総収益額を各計算期間における当該資産の平均残高で除して年率に換算した数値を指します。

## 5 【投資リスク】

(訂正前)

(前略)

その他のリスク

(中略)

・当信託はマザーファンドを通じて証券化商品(信託受益権等)の優先部分(2023年5月25日時点では、全てAAA格の格付を付与されたもの)を主な運用対象としており、かかる証券化商品の裏付資産は自動車ローン債権を中心として様々な資産で構成されております。格付機関は、裏付資産ごとの特性(例えば、法人向け・個人向け、大口与信先の有無等)を考慮しつつ、深刻な景気後退局面でも優先部分の元本毀損が起これない水準として劣後水準を決定した上で、優先部分にAAA格の格付を付与しております。当信託およびマザーファンドの受託者は、今後の状況の進展と、主な運用対象である証券化商品および当信託の財務状況への影響を継続的に監視しつつ、運用を実施していきます。

マザーファンドを通じた当信託の主な運用対象は、取得時点において格付機関から「長期AA格以上」またはこれらと同等とマザーファンドの受託者が認めた格付を取得している信託受益権等であり、今後AAA格以外の格付を取得している信託受益権等に投資することを妨げるものではありません。

(後略)

(訂正後)

(前略)

その他のリスク

(中略)

・当信託はマザーファンドを通じて証券化商品(信託受益権等)の優先部分(2023年11月22日時点では、全てAAA格の格付を付与されたもの)を主な運用対象としており、かかる証券化商品の裏付資産は自動車ローン債権を中心として様々な資産で構成されております。格付機関は、裏付資産ごとの特性(例えば、法人向け・個人向け、大口与信先の有無等)を考慮しつつ、深刻な景気後退局面でも優先部分の元本毀損が起らない水準として劣後水準を決定した上で、優先部分にAAA格の格付を付与しております。当信託およびマザーファンドの受託者は、今後の状況の進展と、主な運用対象である証券化商品および当信託の財務状況への影響を継続的に監視しつつ、運用を実施していきます。

マザーファンドを通じた当信託の主な運用対象は、取得時点において格付機関から「長期AA格以上」またはこれらと同等とマザーファンドの受託者が認めた格付を取得している信託受益権等であり、今後AAA格以外の格付を取得している信託受益権等に投資することを妨げるものではありません。

(後略)

## 第2【信託財産の経理状況】

原有価証券届出書の「第二部 信託財産情報 第2 信託財産の経理状況」を次の内容に更新・訂正します。

(更新・訂正後)

### 1 財務諸表の作成方法について

当信託の財務諸表は、「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」といいます。)にもとづいて作成しております。

また、財務諸表に記載している金額については、百万円未満を切り捨てて表示しております。

### 2 監査証明について

当信託は、当特定期間(自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)の財務諸表について、金融商品取引法第193条の2第1項の規定にもとづき、PwCあらた有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

	前特定期間 ( 2023年 3月19日現在 )	当特定期間 ( 2023年 9月19日現在 )
資産の部		
流動資産		
銀行勘定貸	0	0
合同運用口信託受益権	48,998	42,081
流動資産合計	48,998	42,081
固定資産		
投資その他の資産		
合同運用口信託受益権	28,025	28,870
固定資産合計	28,025	28,870
資産合計	77,023	70,952
負債の部		
流動負債		
未払費用	0	0
流動負債合計	0	0
負債合計	0	0
純資産の部		
元本等		
元本	1、 2 77,062	1、 2 70,981
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	-	-
利益剰余金合計	3 -	3 -
元本等合計	77,062	70,981
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4 38	4 28
評価・換算差額等合計	38	28
純資産合計	77,023	70,952
負債純資産合計	77,023	70,952

## (2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	前特定期間 (自 2022年9月20日 至 2023年3月19日)	当特定期間 (自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)
営業収益		
受取配当金	42	46
その他営業収益	2	0
営業収益合計	45	47
営業費用		
受託者報酬	0	0
その他営業費用	2	0
営業費用合計	2	0
営業利益又は営業損失( )	42	46
営業外収益		
その他収益	0	0
営業外収益合計	0	0
経常利益又は経常損失( )	42	46
税引前当期純利益又は税引前当期 純損失( )	42	46
当期純利益又は当期純損失( )	42	46

## 【注記表】

## (重要な会計方針)

1 信託受益権の評価基準及び評価方法	信託受益権の評価は、その他有価証券で時価のあるものについて、決算日時点の合理的に算定された価格にもとづく時価法により行っております。なお、その他有価証券の評価差額については、全部純資産直入法により処理しております。
2 その他	本財務諸表に係る特定期間(信託の計算期間)は、2023年3月20日から2023年9月19日までとなっております。

## (重要な会計上の見積り)

当信託が保有する合同運用口信託受益権は、マザーファンドの評価額に基づいて評価されており、マザーファンドは、金融商品に関する会計基準に従い一定の前提条件のもと、運用資産の性質、特性およびリスクを最も適切に反映できる評価技法により運用資産を評価しております。当該評価に関する会計上の見積りおよびその他の会計上の見積りについて、金額的影響およびその発生可能性を勘案した結果、翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表関係)

前特定期間 (2023年3月19日現在)	当特定期間 (2023年9月19日現在)
1 元本は、財務諸表等規則第61条に定める資本金に相当します。	1 元本は、財務諸表等規則第61条に定める資本金に相当します。

## 2、 3、 4 純資産の変動

前特定期間（自 2022年9月20日 至 2023年3月19日）

（単位：百万円）

	元本等			元本等 合計	評価・換算 差額等	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	元本	利益剰余金			その他 有価証券 評価差額金		
		その他 利益剰 余金	利益 剰余金 合計				
当期首残高	85,325	0	0	85,325	0	0	85,325
当期変動額							
当期新規信託に伴う元本増加額	19,603	-	-	19,603	-	-	19,603
剰余金の配当に伴う元本組入額	22	-	-	22	-	-	22
当期解約・終了に伴う元本減少額	27,889	-	-	27,889	-	-	27,889
当期解約・終了に伴う当期利益の配当	-	6	6	6	-	-	6
剰余金の配当	-	36	36	36	-	-	36
当期純利益又は当期純損失（ ）	-	42	42	42	-	-	42
元本等以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	38	38	38
当期変動額合計	8,263	0	0	8,263	38	38	8,301
当期末残高	77,062	0	0	77,062	38	38	77,023

## 2、 3、 4 純資産の変動

当特定期間（自 2023年3月20日 至 2023年9月19日）

（単位：百万円）

	元本等			元本等 合計	評価・換算 差額等	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	元本	利益剰余金			その他 有価証券 評価差額金		
		その他 利益剰 余金	利益 剰余金 合計				
当期首残高	77,062	0	0	77,062	38	38	77,023
当期変動額							
当期新規信託に伴う元本増加額	20,761	-	-	20,761	-	-	20,761
剰余金の配当に伴う元本組入額	24	-	-	24	-	-	24
当期解約・終了に伴う元本減少額	26,866	-	-	26,866	-	-	26,866
当期解約・終了に伴う当期利益の配当	-	7	7	7	-	-	7
剰余金の配当	-	39	39	39	-	-	39
当期純利益又は当期純損失（ ）	-	46	46	46	-	-	46
元本等以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	10	10	10
当期変動額合計	6,080	0	0	6,080	10	10	6,070
当期末残高	70,981	0	0	70,981	28	28	70,952

## (金融商品関係)

## (1) 金融商品の状況に関する事項

## 金融商品に対する取組み方針

当信託は、委託者から信託された信託金を、当信託の信託約款にもとづく信託契約(対面型契約か非対面型契約かを問いません。)により信託された他の信託金と合同して運用します。また、当信託は、安全性に配慮しながら、円定期預金(店頭表示金利)を上回る収益を目指して、マザーファンドを通じて、主に自動車ローン債権やクレジットカード債権等を裏付けとした信託受益権および貸付債権等に運用を行います。マザーファンドの主な運用資産は、取得時点において格付機関から「長期A格以上、短期a-2格以上」またはこれらと同等とマザーファンドの受託者が認めた格付を取得している信託受益権および貸付債権等の資産および当該資産を裏付けとした特別目的会社等向け貸付債権に限りです。なお、合同運用財産の一部は、満期償還や中途解約に伴う支払準備等のため、決済用預金(無利息普通預金)または当信託受託者の銀行勘定に対する貸付で管理または運用することがあります。

## 金融商品の内容およびリスク

当信託は、合同運用財産を、主として、マザーファンドの受益権で運用します。

マザーファンドの受益権に関する主なリスクは、以下のとおりです。

## (a) 金利変動リスク

以下の場合には、当初予定されていたとおりの配当が受け取れない、または元本に損失が生じるおそれがあります。

- ・市場金利が上昇した結果、マザーファンドを通じて運用対象とする固定金利型の資産(信託受益権等)の価格が下落した場合
- ・市場金利が低下した結果、マザーファンドを通じて運用対象とする変動金利型の資産(信託受益権等)から生じる収益が低下した場合

## (b) 信用リスク

以下の場合には、当初予定されていたとおりの配当が受け取れない、または元本に損失が生じるおそれがあります。

- ・マザーファンドを通じて運用対象とする信託受益権等の裏付けとなる自動車ローン債権等金銭債権に当初の予想を超えた債務不履行(貸し倒れ)が発生した場合
- ・マザーファンドを通じて運用対象とする資産の発行体等の信用状況等に問題が生じた場合
- ・マザーファンドについてその合同運用財産を運用する決済用預金(無利息普通預金)等における運用先の信用状況等に問題が生じた場合

## (c) 流動性リスク

マザーファンドの合同運用財産の流動性が悪化した場合に、マザーファンドの受益権の元本償還が行われぬおそれがあります。

## (d) 管理委託先にかかるリスク

マザーファンドを通じて運用対象とする信託受益権等の裏付けとなる自動車ローン債権等金銭債権の回収業務等の委託先の信用状況等に問題が生じた場合、当初予定されていたとおりの配当が受け取れない、または元本に損失が生じるおそれがあります。

## 金融商品に係るリスク管理体制

金融商品に係るリスク管理体制については、以下の体制で運営します。

## (a) 運用方針、リスク管理の運営要領等の策定

- ・経営会議では、「信託業務の管理に関する規則」等の社内規程に基づき、信託財産運用に係る重要事項や適正な管理体制の整備・確立に向けた方針等を定めた「信託財産管理に係る管理および信託財産運用管理に関する規則」を制定します。
- ・信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部は、受託財産部門で定める「受託財産運用における業務運営細則」等の規程等にもとづき、信託財産の運用に係る方針やリスク管理の方法を定めた運用ガイドライン等を制定します。

## (b) 運用執行

- ・信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部は、信託約款、運用ガイドライン等にもとづき信託財産を運用します。また、運用ガイドライン等に従い、信託財産の運用状況やリスク管理の状況を信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等へ報告します。運用において問題が生じた場合には、信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等に速やかに報告の上、問題点の分析・改善を行います。

## (c) リスクモニタリング

- ・運用部門から独立した信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等は、運用方針・法令等の遵守状況および運用状況等をモニタリングし、必要に応じて信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部に改善を求めます。また適正な運用を行うための「受託財産部門における運用リスク管理業務規程」等の内部規程等を制定し、問題点の原因分析にもとづいて、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部を管理・指導します。加えて、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等から独立した業務監査部署である監査部が、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部の信託財産の運用状況やリスク管理の状況、および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等によるモニタリングの適切性等について監査を行い、必要に応じて、同所管部署に改善を求めます。

## 1) 金利変動リスク

信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部において、調達と運用の金利または期間が一致していないために生じる金利変動リスクに対し、当信託およびマザーファンドでは以下2点をモニタリングしています。これらのモニタリング結果は、新たな運用資産選定プロセスに反映され、金利変動リスクの最適化を図っております。

- ・調達側の加重平均配当率に対し、運用側の加重平均運用利回りが常に一定以上上回る
- ・調達側および運用側それぞれの加重平均残存期間の差が、内部規程等で定める年限内に収まる

## 2) 信用リスク

当信託では、内部規程等に従い、マザーファンドで運用する信託受益権等を、取得時点において格付機関から「長期A格以上、短期a-2格以上」またはこれらと同等とマザーファンドの受託者が認めた格付を取得しているものに限定しています。また、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等は、格付の変動をモニタリングしています。

## 3) 流動性リスク

当信託およびマザーファンドでは、内部規程等に従い、満期償還や中途解約に伴う支払準備等のため、総資産残高に占める余資比率を計測し、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等にてモニタリングしています。

## 4) 管理委託先にかかるリスク

当信託およびマザーファンドでは、内部規程等に従い、管理委託先の信用状況等を、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部、信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等にて定期的にモニタリングしています。

## 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、市場価格にもとづく価格のほか、市場価格が無い場合には合理的に算定された価格が含まれております。当該価格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、異なる前提条件等で算定した場合、当該価格が異なることもあります。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

## 貸借対照表計上額の時価との差額

合同運用口信託受益権
------------

(3) 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項の(3) に記載しております。
---

## 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

前特定期間（2023年3月19日現在）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超2年以内	2年超
合同運用口信託受益権	48,998	22,131	5,893
合計	48,998	22,131	5,893

当特定期間（2023年9月19日現在）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超2年以内	2年超
合同運用口信託受益権	42,081	22,954	5,916
合計	42,081	22,954	5,916

## (3) 金融商品の時価等及び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、時価の算定に用いた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：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価
--

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接又は間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価
---

レベル3の時価：重要な観察できない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。
--

## 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産

前特定期間（2023年3月19日現在）

（単位：百万円）

区分	時価				貸借 対照表計上額	差額
	レベル1	レベル2	レベル3	合計		
合同運用口信託受益権						
其他有価証券	-	77,023	-	77,023	77,023	-
資産計	-	77,023	-	77,023	77,023	-

当特定期間（2023年9月19日現在）

（単位：百万円）

区分	時価				貸借 対照表計上額	差額
	レベル1	レベル2	レベル3	合計		
合同運用口信託受益権 その他有価証券	-	70,952	-	70,952	70,952	-
資産計	-	70,952	-	70,952	70,952	-

## 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 合同運用口信託受益権

当信託が投資する合同運用口信託受益権は、マザーファンドの純資産額をマザーファンドの元本で除したものを、当信託が保有する単位に乗じることで時価を算定しており、レベル2の時価に分類しております。

なお、上記のマザーファンドの純資産額に関連する、マザーファンドが運用する信託受益権および貸付債権については、公表された相場価格が存在しないため、当信託受託者が算定した相場価格を用いて評価しております。価格の算出の基礎となる評価技法、インプット等は当信託受託者独自のものであり、すべての情報が開示されているわけではありません。

信託受益権については、自動車ローン債権・クレジットカード債権等の裏付資産の貸倒率・期限前償還率等を加味した将来キャッシュ・フローを見積り、利回りにより割り引いて時価を算定しております。評価技法で用いる主なインプットは、将来キャッシュ・フローおよび市場金利に信用リスクを加味した利回りであり、時価の算定に重要な観察できないインプットは使用していないため、レベル2の時価に分類しております。

貸付債権については、信用リスクの低いA格以上の格付を取得している優先部分への投資であり、内部格付、優先劣後構造に基づく区分を行い、信用状態が実行後大きく異なっていない場合には時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。評価技法で用いる主なインプットは、将来キャッシュ・フローおよび格付や信用状態の継続的なモニタリング結果を踏まえて信用リスクを加味した金利であり、時価の算定に重要な観察できないインプットは使用していないため、レベル2の時価に分類しております。

## （有価証券関係）

## (1) 合同運用口信託受益権（その他有価証券）

前特定期間（2023年3月19日現在）

（単位：百万円）

		貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	信託受益権	-	-	-
	小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	信託受益権	77,023	77,062	38
	小計	77,023	77,062	38
合計		77,023	77,062	38

当特定期間（2023年9月19日現在）

（単位：百万円）

		貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	信託受益権	-	-	-
	小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	信託受益権	70,952	70,981	28
	小計	70,952	70,981	28
合計		70,952	70,981	28

## (2) 特定期間中に売却した合同運用口信託受益権(その他有価証券)

前特定期間(自 2022年9月20日 至 2023年3月19日)

(単位:百万円)

	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
合同運用口信託受益権	-	-	-

当特定期間(自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)

(単位:百万円)

	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
合同運用口信託受益権	-	-	-

## (関連当事者との取引)

前特定期間 (自 2022年9月20日 至 2023年3月19日)	当特定期間 (自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(一単位当たり情報)「1単位=1円」

(単位:円)

	前特定期間 (自 2022年9月20日 至 2023年3月19日)	当特定期間 (自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)
一単位当たり純資産額	0.9994	0.9995
一単位当たり当期純利益額	0.0005	0.0006

(重要な後発事象)

前特定期間 (自 2022年9月20日 至 2023年3月19日)	当特定期間 (自 2023年3月20日 至 2023年9月19日)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## 第4【その他】

（訂正前）

・本有価証券届出書に記載されている信託財産の管理体制および運用の意思決定機構は、2023年6月19日現在におけるものであり、今後組織変更等により変更になることがございます。

（後略）

（訂正後）

・本有価証券届出書に記載されている信託財産の管理体制および運用の意思決定機構は、2023年12月19日現在におけるものであり、今後組織変更等により変更になることがございます。

（後略）

## 第三部【受託者、委託者及び関係法人の情報】

原有価証券届出書の「第三部 受託者、委託者及び関係法人の情報」を次の内容に更新・訂正します。

（更新・訂正後）

### 第1【受託者の状況】

#### 1【受託者の概況】

（1）資本金の額等

2023年9月末現在、資本金は324,279百万円です。また、発行可能株式総数は、4,580,000,000株であり、3,497,754,710株を発行済です（詳細は、下表のとおりです。）。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

株式の総数

種類	発行可能株式総数（株）
普通株式	4,500,000,000
第一回第四種優先株式	80,000,000（注）
第二回第四種優先株式	80,000,000（注）
第三回第四種優先株式	80,000,000（注）
第四回第四種優先株式	80,000,000（注）
第一回第五種優先株式	80,000,000（注）
第二回第五種優先株式	80,000,000（注）
第三回第五種優先株式	80,000,000（注）
第四回第五種優先株式	80,000,000（注）
第一回第六種優先株式	80,000,000（注）
第二回第六種優先株式	80,000,000（注）
第三回第六種優先株式	80,000,000（注）
第四回第六種優先株式	80,000,000（注）
計	4,580,000,000

（注） 第一回ないし第四回第四種優先株式、第一回ないし第四回第五種優先株式および第一回ないし第四回第六種優先株式の発行可能種類株式総数は併せて80,000,000株を超えないものとする。

## 発行済株式

種類	中間会計期間末 現在発行数（株） （2023年9月30日）	半期報告書 提出日現在 発行数（株） （2023年11月29日）	上場金融商品取引所 名又は登録認可金融 商品取引業協会名	内容
普通株式	3,497,754,710	同左	非上場・非登録	（注）
計	3,497,754,710	同左	-	-

（注）単元株式数は1,000株であり、議決権を有しております。

## （2）受託者の機構

## 当社の機構内容

当社は、監査等委員会設置会社の機関設計を選択し、重要な業務執行の決定を取締役会から取締役社長へ大幅に委任することで業務執行の機動性を高めるとともに、取締役監査等委員が取締役会決議に参加することで実効性のある経営監督態勢の構築を図っております。なお、以下の記載は、2023年6月27日現在の情報です。

## 1) 法律にもとづく機関の設置等

## a) 取締役会および取締役

- ・取締役会は、経営の基本方針を決定するとともに、経営監督機能を担っており、法令で定められた専決事項以外の重要な業務執行の決定は、原則として取締役社長へ委任しております。ただし、特に重要な業務執行の決定については、取締役会が行います。
- ・取締役会は、当社グループの事業に関する深い知見を備えるとともに、金融、財務会計、リスク管理および法令遵守等に関する多様な知見・専門性を備えた、全体として適切なバランスの取れた取締役20名（うち社外取締役5名）にて構成しております。

## b) 監査等委員会

- ・監査等委員会は、取締役の職務執行の監査、監督を行います。また、監査報告の作成を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選解任および会計監査人を再任しないことに関する議案の内容の決定、実査を含めた当社または子会社の業務・財産の状況の調査等を行います。なお、監査等委員会は、監査等委員以外の取締役の選解任等および報酬等に関する意見を決定し、監査等委員会が選定する監査等委員は、株主総会において当該意見を述べる権限を有しております。
- ・監査等委員会は、社外の監査等委員を委員長とし、監査等委員8名（うち社外の監査等委員5名、財務および会計に関する相当程度の知見を有する監査等委員1名）にて構成しております。また、監査の実効性を確保するため、監査等委員の中から常勤の監査等委員3名を選定しております。
- ・監査等委員会は、日常的に内部統制システムを利用して監査を行います。また実効的な監査を行うため、必要に応じて、内部監査部署である監査部に対して具体的な指示を行います。また、監査等委員会と監査部は、相互の連携体制を確保するため、適切な情報共有等を行います。

## 2) その他の機関の設置等

- ・当社は、独立社外取締役による実効性の高い監督が行われる体制を構築するため、独立社外取締役のみを構成員とした「独立社外取締役会議」を設置しており、独立した客観的な立場にもとづく情報共有および意見交換を行っております。
- ・当社は、運用機関としての一層のガバナンス強化を目的に、取締役会傘下の第三者機関として、社外役員および社外の有識者が構成員の過半を占める「スチュワードシップ委員会」を設置しており、受託財産運用における議決権行使等が投資家の利益を確保するために十分かつ正当であるかを検証しております。
- ・当社は、取締役会の傘下に、取締役社長、取締役副社長執行役員、取締役専務執行役員、部門長、コーポレートセンターの担当常務役員および経営企画部グローバル企画室担当常務役員で構成される「経営会議」を設置し、取締役会で決定した基本方針にもとづき、経営全般に関する執行方針等を協議決定しております。また、取締役会から取締役社長に委任された重要な業務執行の決定に関する事項についても協議決定しております。
- ・当社は、業務執行態勢の強化の観点から、執行役員制度を導入しており、取締役社長の指揮命令の下、副社長執行役員1名(うち取締役兼務者1名)、専務執行役員6名(うち取締役兼務者4名)、常務執行役員18名(うち取締役兼務者4名)および執行役員36名が、業務執行に従事しております。



## 運用の意思決定機構

### 1) 運用方針、リスク管理の運営要領等の策定

- ・ 経営会議では、「信託業務の管理に関する規則」等の社内規程にもとづき、信託財産運用に係る重要事項や適正な管理体制の整備・確立に向けた方針等を定めた「信託財産管理に係る管理および信託財産運用管理に関する規則」を制定します。
- ・ 信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部は、受託財産部門で定める「受託財産運用における業務運営細則」等の規程等にもとづき、信託財産の運用に係る方針やリスク管理の方法を定めた運用ガイドライン等を制定します。

### 2) 運用執行

- ・ 信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部は、信託約款、運用ガイドライン等にもとづき信託財産を運用します。また、運用ガイドライン等に従い、信託財産の運用状況やリスク管理の状況を信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等へ報告します。運用において問題が生じた場合には、信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等に速やかに報告の上、問題点の分析・改善を行います。

### 3) リスクモニタリング

- ・ 運用部門から独立した信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等は、運用方針・法令等の遵守状況および運用状況等をモニタリングし、必要に応じて信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部に改善を求めます。また適正な運用を行うための「受託財産部門における運用リスク管理業務規程」等の内部規程等を制定し、問題点の原因分析にもとづいて、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部を管理・指導します。加えて、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等から独立した業務監査部署である監査部が、信託財産運用所管部署であるオルタナティブアセット運用部の信託財産の運用状況やリスク管理の状況、および信託財産運用管理所管部署であるアセットマネジメント事業部等によるモニタリングの適切性等について監査を行い、必要に応じて、同所管部署に改善を求めます。

上記の体制等は、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】

### (1) 事業の内容

2023年11月29日現在、当社グループは、親会社である株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループの下、当社、子会社107社(うち連結子会社107社)および関連会社4社(うち持分法適用関連会社4社)で構成され、信託銀行業を中心とした金融サービスに係る事業を行っております。

当社グループの中核である当社は、金銭信託・年金信託等の信託業務、預金・貸付・内国為替等の銀行業務および不動産売買の媒介・証券代行等その他併營業務等を行っておりますが、顧客特性・業務特性に応じて事業部門を設置しており、各事業部門は対象の顧客・業務について、包括的な戦略を立案し、事業活動を展開しております。

当社グループは、「リテール部門」「法人マーケット部門」「受託財産部門」「市場部門」および「その他」を事業の区分としております。

各部門の位置付けは次のとおりであります。

リテール部門	：	個人に対する金融サービスの提供
法人マーケット部門	：	法人に対する不動産、証券代行および資産金融に関する総合的なサービスの提供
受託財産部門	：	国内外の投資家および運用会社等に対する資産運用・資産管理サービスの提供
市場部門	：	国内外の有価証券投資等の市場運用業務・資金繰りの管理
その他	：	上記各部門に属さない管理業務等

## (2) 主要な経営指標等の推移

当連結会計年度の前4連結会計年度及び当連結会計年度に係る主要な経営指標等の推移

		2018年度	2019年度	2020年度	2021年度	2022年度
		(自2018年 4月1日 至2019年 3月31日)	(自2019年 4月1日 至2020年 3月31日)	(自2020年 4月1日 至2021年 3月31日)	(自2021年 4月1日 至2022年 3月31日)	(自2022年 4月1日 至2023年 3月31日)
連結経常収益	百万円	870,361	881,770	797,507	875,804	1,466,227
うち連結信託報酬	百万円	112,636	118,336	128,566	132,557	128,802
連結経常利益	百万円	137,528	161,926	157,394	238,541	205,242
親会社株主に帰属する当期純利益	百万円	103,979	114,227	117,934	164,345	140,072
連結包括利益	百万円	48,424	11,300	334,110	35,772	39,856
連結純資産額	百万円	2,127,323	2,072,227	2,367,613	2,349,563	2,318,032
連結総資産額	百万円	37,345,649	35,669,685	37,151,742	42,830,074	39,881,284
1株当たり純資産額	円	684.43	666.45	761.97	756.04	745.72
1株当たり当期純利益	円	31.03	36.97	38.17	53.19	45.33
潜在株式調整後1株当たり当期純利益	円	-	-	-	-	-
自己資本比率	%	5.66	5.77	6.33	5.45	5.77
連結自己資本利益率	%	4.59	5.47	5.34	7.00	6.03
営業活動によるキャッシュ・フロー	百万円	1,946,337	1,798,496	2,578,321	5,691,687	2,598,622
投資活動によるキャッシュ・フロー	百万円	1,569,631	1,053,721	134,316	1,972,361	1,740,217
財務活動によるキャッシュ・フロー	百万円	497,005	55,557	23,540	140,240	61,514
現金及び現金同等物の期末残高	百万円	14,468,038	13,726,509	16,144,294	19,926,226	19,486,729
従業員数 [外、平均臨時従業員数]	人	12,340 [2,443]	13,425 [2,401]	13,733 [2,286]	13,848 [2,136]	14,084 [2,065]
合算信託財産額	百万円	257,762,911	271,923,551	314,506,923	439,889,942	452,904,363

- (注) 1. 当社および国内連結子会社の消費税および地方消費税の会計処理は、主として税抜方式によっております。  
2. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
3. 自己資本比率は、(期末純資産の部合計 - 期末非支配株主持分)を期末資産の部の合計で除して算出しております。  
4. 連結株価収益率につきましては、株式が非上場であるため、記載しておりません。  
5. 合算信託財産額は、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営む連結会社毎の信託財産額(職務分担型共同受託方式により受託している信託財産を含む)を合算しております。なお、連結会社のうち、該当する信託業務を営む会社は当社および日本マスタートラスト信託銀行株式会社です。

## 当社の当事業年度の前4事業年度及び当事業年度に係る主要な経営指標等の推移

回次		第14期	第15期	第16期	第17期	第18期
決算年月		2019年3月	2020年3月	2021年3月	2022年3月	2023年3月
経常収益	百万円	732,794	704,295	568,370	607,961	1,167,912
うち信託報酬	百万円	99,258	104,361	113,809	116,631	111,924
経常利益	百万円	114,519	150,577	133,035	215,611	171,138
当期純利益	百万円	95,135	113,081	96,403	159,884	124,545
資本金	百万円	324,279	324,279	324,279	324,279	324,279
発行済株式総数	千株	普通株式 3,497,754	普通株式 3,497,754	普通株式 3,497,754	普通株式 3,497,754	普通株式 3,497,754
純資産額	百万円	2,055,140	2,041,608	2,231,913	2,168,132	2,081,353
総資産額	百万円	33,713,809	31,034,919	31,923,946	35,389,633	33,148,018
預金残高	百万円	12,999,578	11,135,484	10,873,215	10,892,403	11,076,351
貸出金残高	百万円	4,643,676	4,081,093	3,289,807	2,735,906	2,272,102
有価証券残高	百万円	13,755,938	12,369,912	13,083,825	15,295,690	14,117,360
1株当たり純資産額	円	665.18	660.80	722.39	701.75	673.66
1株当たり配当額 (うち1株当たり 中間配当額)	円 (円)	普通株式 15.72 (普通株式 4.28)	普通株式 14.54 (普通株式 6.35)	普通株式 11.48 (普通株式 6.20)	普通株式 19.44 (普通株式 6.70)	普通株式 19.22 (普通株式 16.01)
1株当たり 当期純利益	円	28.39	36.60	31.20	51.74	40.31
潜在株式調整後 1株当たり 当期純利益	円	-	-	-	-	-
自己資本比率	%	6.09	6.57	6.99	6.12	6.27
自己資本利益率	%	4.32	5.52	4.51	7.26	5.86
配当性向	%	53.75	39.72	36.79	37.56	47.67
従業員数 [外、平均臨時従業員 数]	人	6,457 [1,574]	6,397 [1,516]	6,373 [1,411]	6,190 [1,306]	6,218 [1,252]
信託財産額 (含 職務分担型共 同受託財産)	百万円	121,133,005 (194,045,337)	133,666,177 (207,484,491)	152,797,583 (227,082,519)	175,525,863 (261,295,295)	179,713,118 (271,967,632)
信託勘定貸出金残高 (含 職務分担型共 同受託財産)	百万円	360,708 (360,708)	359,832 (359,832)	413,435 (413,435)	1,120,418 (1,120,418)	1,277,875 (1,277,875)
信託勘定有価証券残高 (含 職務分担型共 同受託財産)	百万円	515,104 (58,002,805)	678,729 (57,931,822)	588,696 (59,314,971)	591,275 (67,663,477)	481,947 (70,547,100)

(注) 1. 消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

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

3. 第18期中間配当についての取締役会決議は2022年11月14日に行いました。

4. 1株当たり配当額のうち臨時配当を第14期に6.15円、第15期に1.90円、第17期に5.70円、第18期に8.13円含めております。

5. 第15期に現物配当を実施しておりますが、1株当たり配当額に含めておりません。
6. 自己資本比率は、期末純資産の部合計を期末資産の部の合計で除して算出しております。
7. 株価収益率につきましては、株式が非上場であるため、記載しておりません。
8. 株主総利回りの推移につきましては、株式が非上場であるため、記載しておりません。
9. 事業年度別最高・最低株価につきましては、株式が非上場であるため、記載しておりません。
10. 信託財産額、信託勘定貸出金残高および信託勘定有価証券残高には、( )内に職務分担型共同受託方式により受託している信託財産(「職務分担型共同受託財産」という。)を含んだ金額を記載しております。
11. 信託財産額(含 職務分担型共同受託財産)は、自己信託に係る分を除いております。自己信託に係る信託財産額は、第14期15億円、第15期8,507億円、第16期5,024億円、第17期4,850億円、第18期2,803億円であります。
12. 2022年10月20日付の銀行法施行規則の改正に伴い、2023年3月期より「信託勘定暗号資産残高及び履行保証暗号資産残高」を表示することとなりましたが、該当金額がないため記載しておりません。
13. 2020年5月1日付の銀行法施行規則の改正に伴い、2020年9月中間期より「信託勘定有価証券残高」に含まれる「信託勘定電子記録移転有価証券表示権利等残高」を区分することとなりましたが、該当金額がないため記載しておりません。

### 3【経理の状況】

当信託受託者の経理の状況については、以下に掲げる書類をご参照ください。

(1) 受託者が提出した書類

有価証券報告書及びその添付書類

事業年度 第18期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) 2023年6月27日に関東財務局長に提出。

半期報告書

事業年度 第19期中 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日) 2023年11月29日に関東財務局長に提出。

訂正報告書

該当事項はありません。

(2) 上記書類を縦覧に供している場所

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

当信託受託者は、信託法および兼営法において準用する信託業法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為および取引が禁止されています。

(1) 信託法により禁止される行為(信託法に定める例外に該当する場合を除きます。)

信託財産に属する財産(当該財産に係る権利を含みます。)を固有財産に帰属させ、または固有財産に属する財産(当該財産に係る権利を含みます。)を信託財産に帰属させること

信託財産に属する財産(当該財産に係る権利を含みます。)を他の信託の信託財産に帰属させること

第三者との間において信託財産のためにする行為であって、自己が当該第三者の代理人となつて行うもの

信託財産に属する財産につき固有財産に属する財産のみをもって履行する責任を負う債務に係る債権を被担保債権とする担保権を設定することその他第三者との間において信託財産のためにする行為であつて受託者またはその利害関係人と受益者との利益が相反することとなるもの

(2) 兼営法において準用する信託業法により禁止される取引(兼営法において準用する信託業法に定める例外に該当する場合を除きます。)

自己またはその利害関係人と信託財産との間における取引

一の信託の信託財産と他の信託の信託財産との間の取引

第三者との間において信託財産のためにする取引であつて、自己が当該第三者の代理人となつて行うもの

ただし、当信託受託者は、信託法および兼営法において準用する信託業法に定める例外として、当信託の信託約款において、当信託の信託約款に定める要件を充足する場合には以下の取引を行うことができるものとされておりま

合同運用財産を、当社を受託者として設定されるマザーファンドの受益権で運用すること

合同運用財産を当信託受託者の銀行勘定に対する貸付で運用すること

当信託受託者の銀行勘定(第三者との間において合同運用財産のためにする取引であつて、当信託受託者が当該第三者の代理人となつて行う取引を行う場合を含みます。)、当信託受託者の利害関係人、信託業務の委託先または他の信託財産との間で、上記 および に掲げる財産の運用取引のほか、有価証券の売買取引等合同運用財産の運用に必要な取引(当信託の信託約款に従つて行う有価証券等の売買取引を含みます。)を行うこと

なお、当信託受託者は、当該取引をした場合には、兼営法第2条第1項の準用する信託業法第29条第3項および第4項に定める書面を作成し、受益者に交付します。

#### 5【その他】

該当事項はありません。

### 第2【委託者の状況】

委託者が発行者(金融商品取引法第2条第5項に規定する発行者をいいます。)とならないため、該当事項はありません。

### 第3【その他関係法人の概況】

#### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

募集の取扱者

名称	資本金の額 (2023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	銀行法に定める銀行業を営んでいます。

#### 2【関係業務の概要】

当信託受託者との委託契約にもとづき、非対面型契約に関して株式会社三菱UFJ銀行のオンラインサービス（MoneyCanvas）において、募集の取扱いを行います。

#### 3【資本関係】

2023年11月29日現在、当信託受託者の株式100%を保有している株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループは、株式会社三菱UFJ銀行の株式100%を保有しています。

#### 4【役員の兼職関係】

2023年11月29日現在、下記の者は発行会社の役員又は従業員を兼務しています。

取締役常務執行役員 高瀬 英明（三菱UFJ信託銀行株式会社 取締役）

#### 5【その他】

2023年11月29日現在、当信託受託者は、株式会社三菱UFJ銀行について、当信託の信託財産に影響を及ぼす訴訟事件その他重要な影響が予想される事実は認識しておりません。