

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券	
信託期間	無期限（2001年12月7日設定）	
運用方針	NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざします。主としてマザーファンドを通じて、わが国の公社債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。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。）	

運用報告書（全体版）

三菱UFJ
＜DC＞日本債券ファンド

第23期（決算日：2024年2月27日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、お手持ちの「三菱UFJ＜DC＞日本債券ファンド」は、去る2月27日に第23期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額			NOMURA-BPI総合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額	
		税 分	込 配	み 金	期 騰	落 中 率				期 騰
	円	円	円	%		%	%	%	百万円	
19期(2020年2月27日)	12,459		0		1.4	392.87	1.7	98.2	—	2,031
20期(2021年3月1日)	12,088		0		△3.0	383.73	△2.3	96.4	—	2,012
21期(2022年2月28日)	11,973		0		△1.0	382.13	△0.4	98.0	—	2,011
22期(2023年2月27日)	11,433		0		△4.5	367.73	△3.8	97.2	—	1,902
23期(2024年2月27日)	11,376		0		△0.5	367.85	0.0	96.5	—	1,736

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023年2月27日	11,433	—	367.73	—	97.2	—
2月末	11,492	0.5	369.57	0.5	95.9	—
3月末	11,635	1.8	374.74	1.9	97.3	—
4月末	11,668	2.1	375.61	2.1	98.2	—
5月末	11,652	1.9	375.27	2.0	98.5	—
6月末	11,674	2.1	376.29	2.3	97.3	—
7月末	11,485	0.5	370.43	0.7	97.2	—
8月末	11,398	△0.3	367.76	0.0	97.2	—
9月末	11,317	△1.0	365.13	△0.7	96.8	—
10月末	11,145	△2.5	359.31	△2.3	97.5	—
11月末	11,354	△0.7	366.88	△0.2	98.3	—
12月末	11,395	△0.3	368.38	0.2	97.4	—
2024年1月末	11,309	△1.1	365.75	△0.5	96.9	—
(期 末) 2024年2月27日	11,376	△0.5	367.85	0.0	96.5	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第23期：2023年2月28日～2024年2月27日

当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第23期首	11,433円
第23期末	11,376円
既払分配金	0円
騰落率	-0.5%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.5%の下落となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.0%）を0.5%下回りました。

基準価額の主な変動要因

下落要因

信託報酬等のコストなどが基準価額の下落要因となりました。

第23期：2023年2月28日～2024年2月27日

投資環境について

▶ 国内債券市況

国内金利は上昇しました。

国内金利は、米国金利が上昇したことや

日銀による2度にわたるイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化などから上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ <DC>日本債券ファンド

主要投資対象である日本債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を高位に組み入れた運用を行いました。

ウェイト、その他の期間については中期ゾーンのアンダーウェイト・超長期ゾーンのオーバーウェイトを基本に調整しました。

▶ 日本債券マザーファンド

ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は、2023年8月から11月末にかけては短め、その他の期間については中立を基本に調整しました。年限別構成については、8月から11月末にかけては短期ゾーンのオーバーウェイト・中期および超長期ゾーンのアンダー

債券種別構成については、日銀による社債買入オペや投資家の資金余剰感を背景とした需給関係から、一般債のスプレッド（利回り格差）は横ばい圏で推移すると判断し、相対的にスプレッド妙味のある事業債、円建外債および資産担保証券（ABS）のオーバーウェイト、スプレッド妙味の乏しい地方債および政府保証債のアンダーウェイトを維持しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ▶ **三菱UFJ <DC>日本債券ファンド**
 ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率 (0.0%)
 を0.5%下回りました。

マザーファンド保有以外の要因

マイナス要因

信託報酬等コストがマイナスに影響しました。

マザーファンド保有による要因

プラス要因

デュレーション (平均回収期間や金利感応度)

2023年9月から10月末にかけての金利上昇局面においてファンド全体のデュレーションを短めとしたこと。

債券種別構成

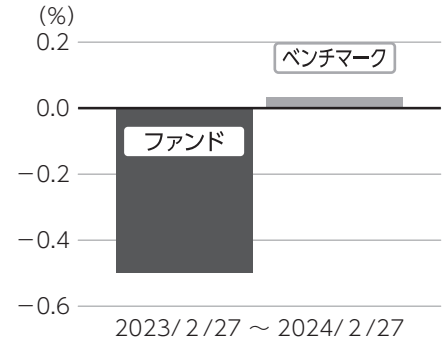
期間の初めから期間末にかけてスプレッド (利回り格差) の縮小した円建外債をオーバーウェイトとしたこと。

マイナス要因

デュレーション

2023年11月の金利低下局面においてファンド全体のデュレーションを短めとしたこと。

基準価額 (ベビーファンド) と ベンチマークの対比 (騰落率)



▶ 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第23期 2023年2月28日～2024年2月27日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	2,611

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 （作成対象期間末での見解です。）

▶ 三菱UFJ <DC>日本債券ファンド

日本債券マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保ち、マザーファンドのポートフォリオの構成に近づけた状態を維持する方針です。

市場分析や景気分析の精緻化を図りマーケット見通しの確度を高めることでベンチマーク対比のリスク水準を引き上げ運用改善に努めてまいります。

▶ 日本債券マザーファンド

安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位を維持する方針です。

ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）は、当面ベンチマーク対比中立を基本に機動的にリスク度合いを調整する方針です。

債券種別構成は、事業債、円建外債および資産担保証券（ABS）について、ベンチマーク対比多めの保有を維持する方針です。

2023年2月28日～2024年2月27日

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	78	0.682	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)
(投 信 会 社)	(33)	(0.286)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(39)	(0.341)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(6)	(0.055)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.003	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(0)	(0.000)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.003)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	78	0.685	

期中の平均基準価額は、11,461円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

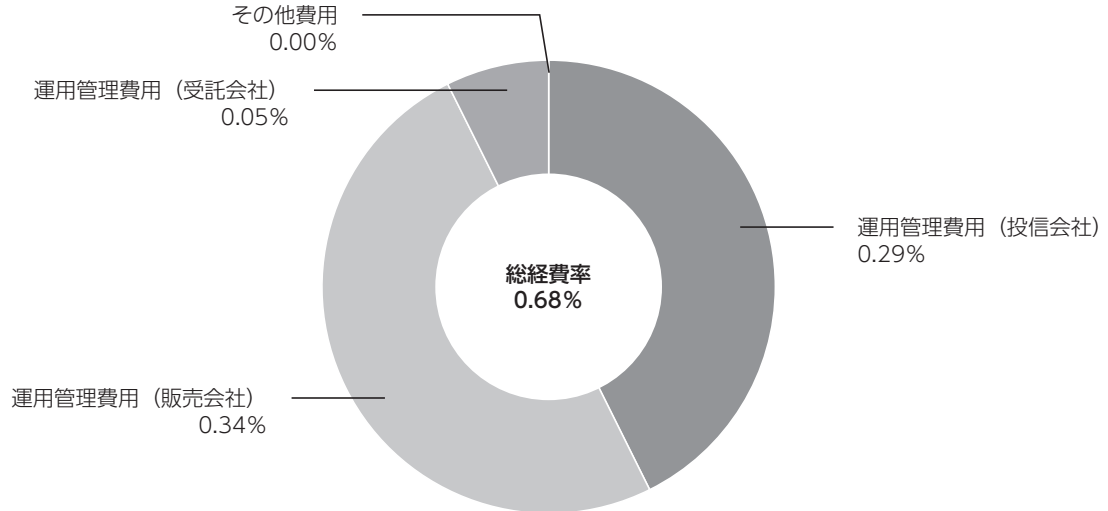
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.68%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2023年2月28日～2024年2月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
日本債券マザーファンド	千口 122,537	千円 174,875	千口 239,943	千円 341,478

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月28日～2024年2月27日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ <DC>日本債券ファンド>

該当事項はございません。

<日本債券マザーファンド>

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
			%			%
公社債	百万円 5,152	百万円 1,051	% 20.4	百万円 5,323	百万円 1,028	% 19.3

平均保有割合 21.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

<日本債券マザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 -	百万円 -	百万円 199

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日本債券マザーファンド>

種類	買付額
公社債	百万円 900

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年2月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日本債券マザーファンド	千口 1,340,690	千口 1,223,285	千円 1,735,229

○投資信託財産の構成

(2024年2月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券マザーファンド	千円 1,735,229	% 98.8
コール・ローン等、その他	21,689	1.2
投資信託財産総額	1,756,918	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年2月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,756,918,634
コール・ローン等	20,552,326
日本債券マザーファンド(評価額)	1,735,229,897
未収入金	1,136,411
(B) 負債	20,876,638
未払解約金	14,567,651
未払信託報酬	6,282,699
未払利息	1
その他未払費用	26,287
(C) 純資産総額(A-B)	1,736,041,996
元本	1,526,091,914
次期繰越損益金	209,950,082
(D) 受益権総口数	1,526,091,914口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,376円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,663,936,245円
 期中追加設定元本額 209,000,798円
 期中一部解約元本額 346,845,129円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,376円です。

○損益の状況 (2023年2月28日～2024年2月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,644
受取利息	50
支払利息	△ 2,694
(B) 有価証券売買損益	3,572,561
売買益	7,214,807
売買損	△ 3,642,246
(C) 信託報酬等	△ 12,900,340
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 9,330,423
(E) 前期繰越損益金	△ 48,904,920
(F) 追加信託差損益金	268,185,425
(配当等相当額)	(321,396,852)
(売買損益相当額)	(△ 53,211,427)
(G) 計(D+E+F)	209,950,082
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	209,950,082
追加信託差損益金	268,185,425
(配当等相当額)	(321,524,384)
(売買損益相当額)	(△ 53,338,959)
分配準備積立金	77,079,108
繰越損益金	△135,314,451

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

②分配金の計算過程

項 目	2023年2月28日～ 2024年2月27日
費用控除後の配当等収益額	1,581,025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	－円
収益調整金額	321,524,384円
分配準備積立金額	75,498,083円
当ファンドの分配対象収益額	398,603,492円
1万口当たり収益分配対象額	2,611円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)

日本債券マザーファンド

《第25期》決算日2023年7月24日

[計算期間：2022年7月23日～2023年7月24日]

「日本債券マザーファンド」は、7月24日に第25期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第25期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、ポートフォリオのデュレーション調整と銘柄選択による収益獲得をめざして運用を行います。ポートフォリオのデュレーションはベンチマークの平均を中心に調整します。デュレーション調整は主としてファンダメンタルズ分析に基づく中期的な金利見通しに沿って行います。銘柄選択は信用リスクと金利スプレッドを定量的・定性的に分析して行います。NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	債先物比率	純資産額
	期騰	期中落率	期騰	期中落率			
	円	%		%	%	%	百万円
21期(2019年7月22日)	15,071	3.2	392.34	2.9	95.4	—	8,253
22期(2020年7月22日)	14,876	△1.3	387.22	△1.3	96.2	—	8,265
23期(2021年7月26日)	14,983	0.7	388.73	0.4	96.2	—	8,863
24期(2022年7月22日)	14,526	△3.1	377.16	△3.0	98.2	—	8,914
25期(2023年7月24日)	14,447	△0.5	374.97	△0.6	98.2	—	9,247

(注) NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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。

(注) 「債券先物比率」は買建比率ー売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率			
(期 首) 2022年 7 月 22 日	円 14,526	% —	377.16	% —	98.2	% —	—
7 月 末	14,574	0.3	378.55	0.4	97.9	—	—
8 月 末	14,543	0.1	377.67	0.1	97.7	—	—
9 月 末	14,387	△1.0	373.60	△0.9	97.2	—	—
10 月 末	14,366	△1.1	373.25	△1.0	97.8	—	—
11 月 末	14,292	△1.6	371.33	△1.5	97.7	—	—
12 月 末	14,107	△2.9	366.60	△2.8	97.3	—	—
2023年 1 月 末	14,060	△3.2	365.59	△3.1	97.6	—	—
2 月 末	14,232	△2.0	369.57	△2.0	96.2	—	—
3 月 末	14,419	△0.7	374.74	△0.6	97.5	—	—
4 月 末	14,468	△0.4	375.61	△0.4	98.4	—	—
5 月 末	14,457	△0.5	375.27	△0.5	98.7	—	—
6 月 末	14,492	△0.2	376.29	△0.2	97.5	—	—
(期 末) 2023年 7 月 24 日	14,447	△0.5	374.97	△0.6	98.2	—	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

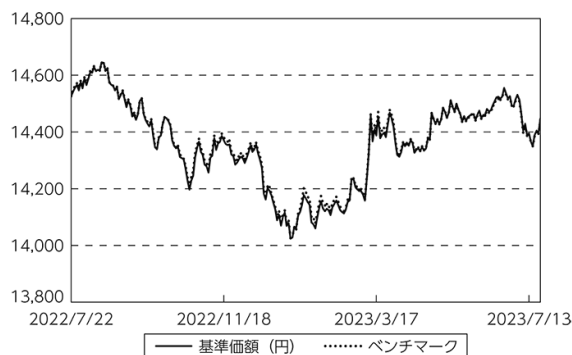
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ0.5%の下落となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.6%)を0.1%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

国内金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について**◎ 国内債券市況**

- ・ 国内金利は上昇しました。
- ・ 国内金利は、日銀が2022年12月の金融政策決定会合において長期金利の許容変動幅を拡大したことや、その後も政策修正懸念が台頭したことなどから上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ ベンチマークを上回る投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）については中立を基本に調整しました。年限別構成については、中期ゾーンのアンダーウェイト・超長期ゾーンのオーバーウェイトを基本に調整しました。
- ・ 債券種別構成については、日銀による社債買入オペや投資家の資金余剰感を背景とした需給関係から、一般債のспレッド（国債に対する金利差）は横ばい圏で推移すると判断し、相対的にспレッド妙味のある事業債、円建外債およびABSのオーバーウェイト、спレッド妙味の乏しい地方債および政府保証債のアンダーウェイトを維持しました。

**● 当該投資信託のベンチマークとの差異について
(プラス要因)****◎ 年限別構成**

- ・ 2023年1月末から期間末にかけてパフォーマンスの優れた超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

◎ 債券種別構成

- ・ 2023年3月下旬から期間末にかけてспレッドの縮小した事業債および円建外債をオーバーウェイトとしたこと。

(マイナス要因)

◎ 年限別構成

- ・ 期間の初めから2023年1月末にかけてパフォーマンスの劣化した超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

○ 今後の運用方針

- ・ 国内景気は既往の資源高の影響などを受けつつも持ち直しています。輸出や生産は、供給制約の影響の緩和に支えられて横ばい圏内の動きとなっています。また、個人消費は、物価上昇の影響を受けつつも緩やかに増加しています。しかしながら、海外の経済・物価動向など懸念材料も多く、ウクライナ情勢の展開や資源価格の問題もあり景気先行きの不確実性は依然として高いものと思われます。国内債券相場は、海外金利動向や為替動向など懸念材料はあるものの、本邦金融政策修正観測の後退などから底堅い展開を予想します。国内事業債のспレッドについてはもみ合いでの推移になるものと思われます。
- ・ 以上の見通しの下、デュレーションは当面ベンチマーク対比中立を基本にリスク度合いを調整し、国債以外の一般債は事業債および円建外債を中心にベンチマーク対比多めの保有を維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年7月23日～2023年7月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,360円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年7月23日～2023年7月24日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 3,567,805	千円 3,119,537
	社債券	901,294	496,914 (400,000)

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年7月23日～2023年7月24日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 4,469	百万円 806	% 18.0	百万円 3,616	百万円 976	% 27.0

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
公社債	百万円 99	百万円 —	百万円 199

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
公社債	百万円 100

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年7月24日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	5,580,000	5,688,425	61.5	—	57.2	4.3	—	
普通社債券	3,400,000	3,397,077	36.7	—	1.0	21.7	14.0	
	(3,300,000)	(3,297,059)	(35.7)	(—)	(1.0)	(21.7)	(12.9)	
合 計	8,980,000	9,085,502	98.2	—	58.2	26.0	14.0	
	(3,300,000)	(3,297,059)	(35.7)	(—)	(1.0)	(21.7)	(12.9)	

(注) ()内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当期			末
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第5回利付国債(40年)	2.0	70,000	81,678	2052/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	40,000	43,891	2054/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	70,000	61,501	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	70,000	59,232	2058/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	60,000	47,817	2061/3/20
第15回利付国債(40年)	1.0	70,000	61,361	2062/3/20
第350回利付国債(10年)	0.1	300,000	300,486	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	100,000	100,024	2028/6/20
第355回利付国債(10年)	0.1	170,000	169,452	2029/6/20
第359回利付国債(10年)	0.1	150,000	148,725	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	280,000	277,046	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	140,000	138,220	2030/12/20
第363回利付国債(10年)	0.1	170,000	167,115	2031/6/20
第370回利付国債(10年)	0.5	110,000	110,662	2033/3/20
第371回利付国債(10年)	0.4	20,000	19,895	2033/6/20
第23回利付国債(30年)	2.5	50,000	61,341	2036/6/20
第26回利付国債(30年)	2.4	30,000	36,560	2037/3/20
第28回利付国債(30年)	2.5	30,000	37,151	2038/3/20
第30回利付国債(30年)	2.3	50,000	60,685	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	20,000	24,005	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	40,000	48,638	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	40,000	46,782	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	50,000	60,083	2041/3/20
第36回利付国債(30年)	2.0	30,000	35,074	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	40,000	46,083	2042/9/20
第39回利付国債(30年)	1.9	50,000	57,565	2043/6/20
第41回利付国債(30年)	1.7	30,000	33,445	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	30,000	33,422	2044/3/20
第44回利付国債(30年)	1.7	30,000	33,404	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	10,000	10,748	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	50,000	53,732	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	20,000	21,861	2045/6/20
第49回利付国債(30年)	1.4	30,000	31,589	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	50,000	46,603	2046/3/20
第53回利付国債(30年)	0.6	20,000	17,694	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	110,000	101,612	2047/3/20
第58回利付国債(30年)	0.8	100,000	91,433	2048/3/20
第60回利付国債(30年)	0.9	90,000	83,730	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	30,000	26,511	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	10,000	8,364	2049/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	140,000	118,227	2050/6/20
第69回利付国債(30年)	0.7	50,000	43,153	2050/12/20
第72回利付国債(30年)	0.7	40,000	34,380	2051/9/20
第74回利付国債(30年)	1.0	10,000	9,286	2052/3/20
第75回利付国債(30年)	1.3	20,000	20,000	2052/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第76回利付国債 (30年)	1.4	70,000	71,707	2052/9/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	20,000	21,458	2052/12/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	30,000	33,515	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,694	2030/12/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	130,000	145,119	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	20,000	22,356	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	140,000	155,395	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	110,000	123,270	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	60,000	67,316	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	60,000	66,759	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	130,000	143,364	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	100,000	110,283	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	100,000	109,221	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	50,000	53,487	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	90,000	96,247	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	110,000	118,818	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	90,000	96,117	2035/9/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	90,000	89,831	2037/3/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	90,000	88,215	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	120,000	117,354	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	90,000	86,571	2038/3/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	120,000	118,137	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	60,000	57,178	2038/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	100,000	92,291	2040/3/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	130,000	120,337	2041/3/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	60,000	57,931	2042/3/20
第182回利付国債 (20年)	1.1	130,000	131,665	2042/9/20
第183回利付国債 (20年)	1.4	50,000	53,207	2042/12/20
第184回利付国債 (20年)	1.1	30,000	30,293	2043/3/20
小 計		5,580,000	5,688,425	
普通社債券				
第447回中国電力	0.455	100,000	100,048	2028/5/25
第459回九州電力	0.445	100,000	99,965	2028/1/25
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	99,891	2025/12/19
第16回Zホールディングス	0.6	100,000	100,122	2025/6/11
第19回Zホールディングス	0.35	100,000	99,067	2026/7/28
第15回楽天グループ	0.5	100,000	94,535	2024/12/2
第43回IHI	0.2	100,000	99,862	2024/10/17
第15回JA三井リース	0.22	100,000	99,936	2025/1/24
第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.22	100,000	99,732	2025/10/10
第25回トヨタ自動車	0.1	100,000	99,744	2026/3/27
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	99,917	2024/8/2
第1回日本生命2021基金劣後特約付	0.28	100,000	99,623	2026/8/3
第13回住友信託銀行 (劣後特約付)	2.341	100,000	104,307	2026/6/15
第14回住友信託銀行劣後特約付	2.159	100,000	104,133	2026/9/28
第1回みずほフィナンシャルグループ	0.95	100,000	100,270	2024/7/16

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券	%	千円	千円	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	99,891	2025/12/19
第30回SBIホールディングス	1.18	100,000	100,456	2027/7/22
第34回SBIホールディングス	0.95	100,000	100,023	2026/6/5
第16回イオンフィナンシャルサービス	0.27	200,000	199,356	2025/6/24
第79回アコム	0.29	100,000	99,949	2025/2/28
第212回オリックス	0.654	200,000	202,098	2028/3/8
第73回三菱UFJリース	0.28	100,000	99,675	2027/1/29
第38回大和証券グループ本社	0.54	100,000	100,143	2026/2/24
第2回ソフトバンク	0.33	100,000	99,891	2025/3/18
第8回ソフトバンク	0.35	100,000	99,718	2025/12/3
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	98,688	2026/10/21
第9回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	1.1	100,000	96,211	2031/12/16
第1回パークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付	1.232	100,000	100,061	2024/9/25
第10回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	1.247	100,000	99,832	2028/5/26
第6回フランス電力	1.059	100,000	99,906	2028/6/28
第3回ソシエテ ジェネラル円貨社債 (2018)	0.804	100,000	100,009	2023/10/12
UBS GROUP FUNDING (SWITZERLAND)	0.719	100,000	100,018	2024/11/8
小 計		3,400,000	3,397,077	
合 計		8,980,000	9,085,502	

○投資信託財産の構成

(2023年7月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 9,085,502	% 98.2
コール・ローン等、その他	166,245	1.8
投資信託財産総額	9,251,747	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年7月24日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	9,251,747,353	
コール・ローン等	147,370,739	
公社債(評価額)	9,085,502,900	
未収利息	17,574,278	
前払費用	1,299,436	
(B) 負債	3,952,544	
未払解約金	3,952,183	
未払利息	361	
(C) 純資産総額(A-B)	9,247,794,809	
元本	6,401,217,864	
次期繰越損益金	2,846,576,945	
(D) 受益権総口数	6,401,217,864口	
1万口当たり基準価額(C/D)	14,447円	

<注記事項>

- ①期首元本額 6,136,780,370円
 期中追加設定元本額 768,245,604円
 期中一部解約元本額 503,808,110円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,447円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ D C金利連動アロケーション型バランスファンド	3,169,432,866円
三菱UFJ <DC>日本債券ファンド	1,336,154,225円
三菱UFJ 国内バランス20	956,712,033円
三菱UFJ グローバルバランス(安定型)	248,808,123円
三菱UFJ グローバルバランス(積極型)	183,443,001円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 40型	169,028,476円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 20型	152,901,159円
三菱UFJ <DC>グローバルバランス 60型	122,732,177円
三菱UFJ 日本債券ファンドF(適格機関投資家限定)	52,834,945円
三菱UFJ グローバルバランスVA	9,170,859円
合計	6,401,217,864円

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

○損益の状況 (2022年7月23日～2023年7月24日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	70,616,371	
受取利息	70,705,801	
支払利息	△ 89,430	
(B) 有価証券売買損益	△ 116,947,500	
売買益	23,434,100	
売買損	△ 140,381,600	
(C) 保管費用等	△ 29,694	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 46,360,823	
(E) 前期繰越損益金	2,777,238,929	
(F) 追加信託差損益金	335,641,151	
(G) 解約差損益金	△ 219,942,312	
(H) 計(D+E+F+G)	2,846,576,945	
次期繰越損益金(H)	2,846,576,945	

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。