

投資信託説明書 (請求目論見書)

使用開始日 2024.5.3

国内債券セレクション(ラップ向け)

追加型投信／内外／債券

この目論見書により行う「国内債券セレクション(ラップ向け)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年5月2日に関東財務局長に提出しており、2024年5月3日に効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

発行者名	: 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 取締役社長 横川 直
本店の所在の場所	: 東京都港区東新橋一丁目9番1号
縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	1
(8)【申込取扱場所】	1
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	45
第3【ファンドの経理状況】	51
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	120
第三部【委託会社等の情報】	121
第1【委託会社等の概況】	121
約款	165

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

国内債券セレクション（ラップ向け）（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

(7)【申込期間】

2024年5月3日から2025年5月2日まで

※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約*に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

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】

当ファンドは、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。信託金の限度額は、5,000億円です。

*委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	MR F	
追加型		その他資産 ()	E T F	特殊型 ()
	内外	資産複合		

属性区分表

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

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

※ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMMF をいいます。
	MR F（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMR F をいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成 12 年政令 480 号）第 12 条第 1 号および第 2 号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和 32 年法律第 26 号）第 9 条の 4 の 2 に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。

		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
債券	一般		次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	公債		信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債		信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券		信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性		目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回		信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回		信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回		信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）		信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の

		資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 ／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

ファンドの目的

日本を含む世界の債券を実質的な主要投資対象とし、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色

1

投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2024年5月3日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<日本債券インデックスマザーファンド>

日本の公社債への投資を行います。

- ・NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・NOMURA-BPI総合をベンチマークとします。
- ・対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の実質投資比率が100%を超える場合があります。

<先進国高格付国債マザーファンド>

日本を含む先進国の国債等への投資を行います。

- ・投資する国債等(日本国債を除きます。)は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限りま。
- ・債券等(為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。)の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託します。
- ・三菱UFJアセット・マネジメント(UK)は、英国ロンドンに籍を置く三菱UFJフィナンシャル・グループの欧州における運用拠点です。国内・海外の年金基金・機関投資家中心の資産運用サービスを展開しています。

! 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

世界主要国(日本を除く)の公社債への投資を行います。

- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>

日本を含む先進国の債券等への投資を行います。

- ・組入債券等は、原則として取得時においてBBB一格相当以上の格付けを有しているものに限りま。
- ・組入債券等の平均格付けは、原則としてA-格以上とします。
- ・ポートフォリオのデュレーションは、原則として0~3年程度とします。
- ・デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。

! デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

<格付けとは>

	S&P	Moody's	Fitch	
低い ↑	AAA	Aaa	AAA	投資適格 格付け
	AA	Aa	AA	
	A	A	A	
	BBB	Baa	BBB	投機的 格付け
	BB	Ba	BB	
	B	B	B	
	CCC	Caa	CCC	
	CC	Ca	CC	
	C	C	C	
高い ↓	D	-	D	

主要投資対象

S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティングス(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+、-」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1、2、3」という付加記号が付されることがあります。左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>


日本の公社債を主要投資対象とします。

- ・日本の公社債を主要投資対象とします。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格(S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの)相当以上の格付を有する債券を対象とします。
- ・NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。

<日本短期債券マザーファンド>

日本の公社債・金融商品を主要投資対象とします。

- ・NOMURA-BPI短期インデックス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。
- ・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。
- ・銘柄選定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。

 デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。

<マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)>

マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンドへの投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券等への投資を行います。

- ・インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なサービスを提供する企業をいい、当該企業が発行する米ドル建て債券等をインフラ債券といたします。
- ・マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンドにおける債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。

 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。

マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド

- マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドは、マッコーリー・グループの資産運用部門であるマッコーリー・アセット・マネジメントを形成する1社です。
- マッコーリー・グループは、1969年設立のオーストラリアのシドニーに本拠を構え、銀行業務、証券業務、投資銀行業務、資産運用業務など各種金融サービスをグローバルに提供する金融グループです。

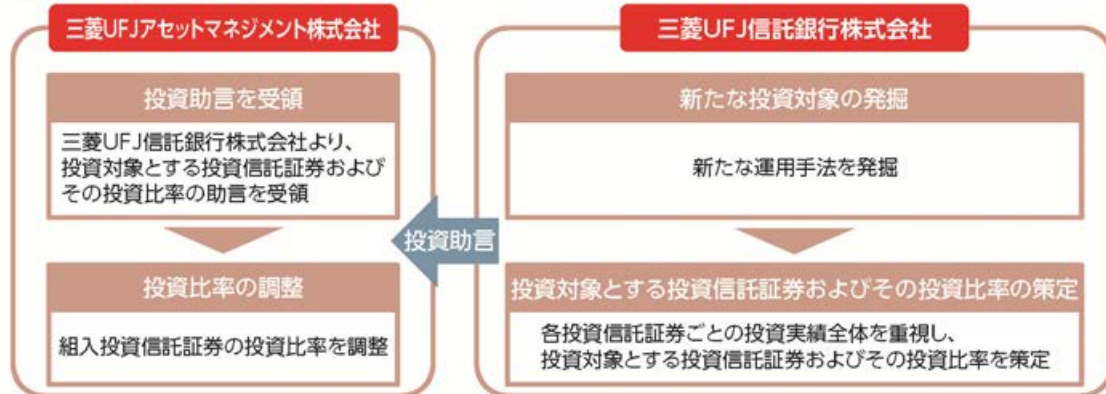
 ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

特色 2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
 - ！ 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。
 - ！ 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。

<運用プロセスのイメージ>



- ！ 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をご覧ください。
(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)

特色 3

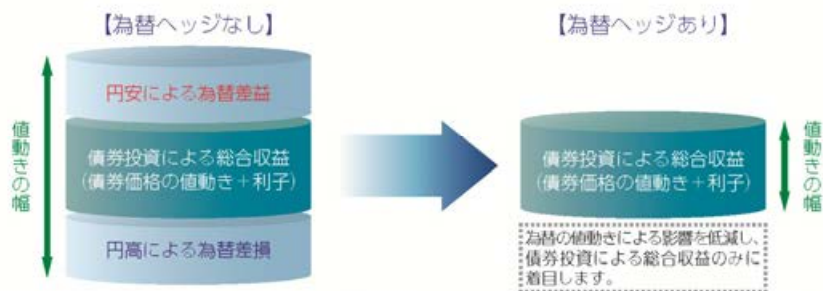
実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。

- ！ 為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<投資リターンのイメージ図>



- ！ 上記は為替ヘッジを理解して頂くためのイメージ図であり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色4

年1回の決算時(2月5日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

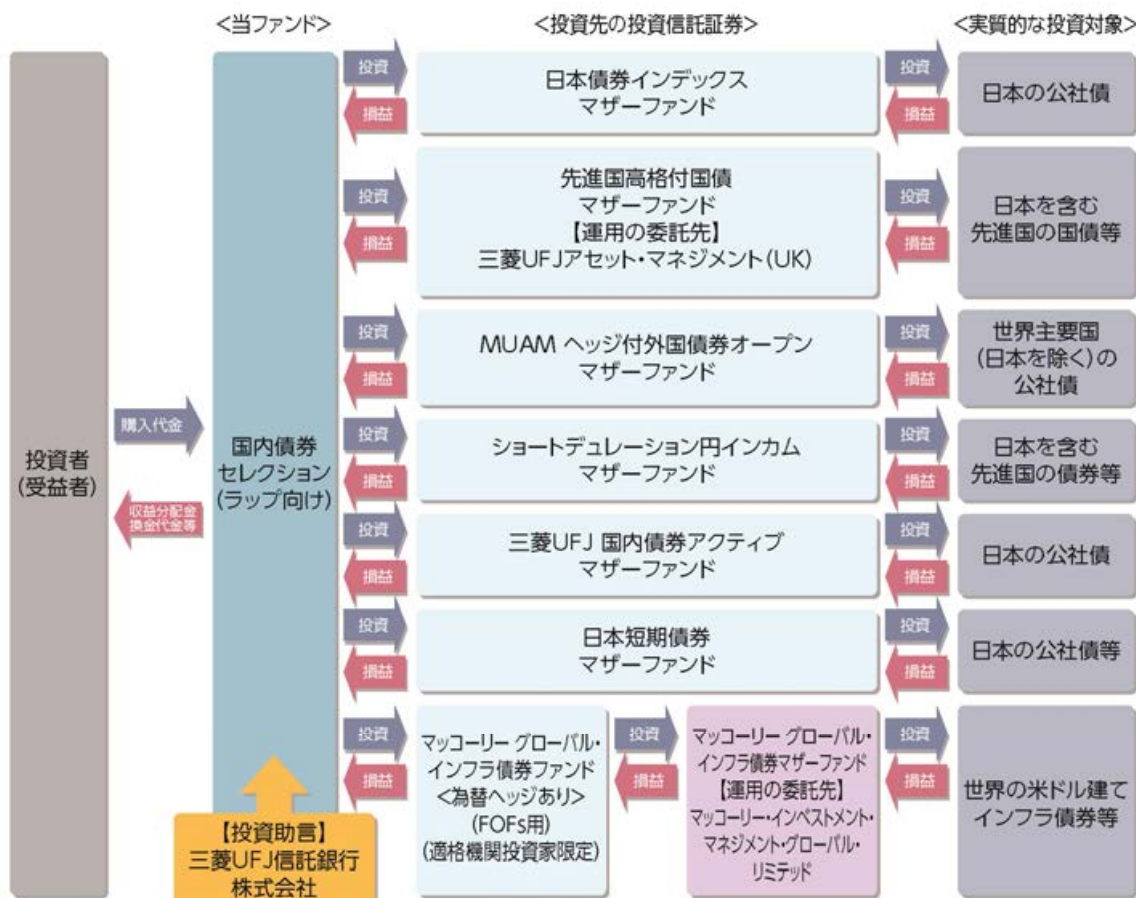
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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。

■ 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。



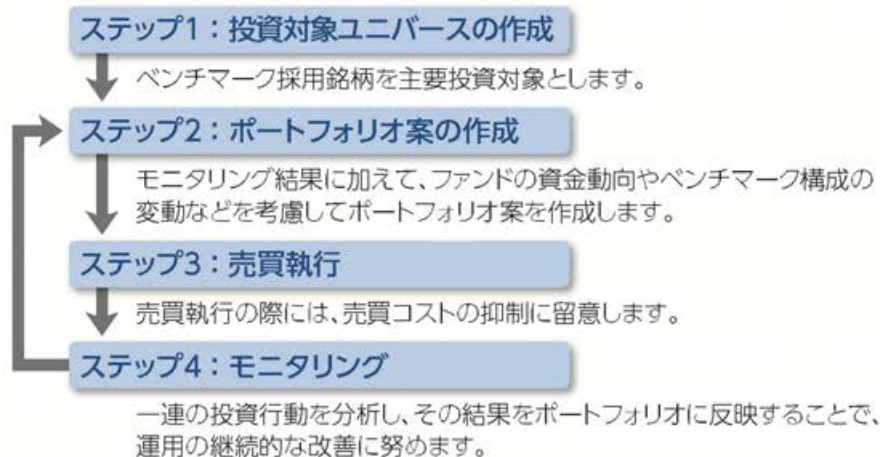
- ❗ 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- ❗ 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■ 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	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■ 各投資信託証券の運用プロセス

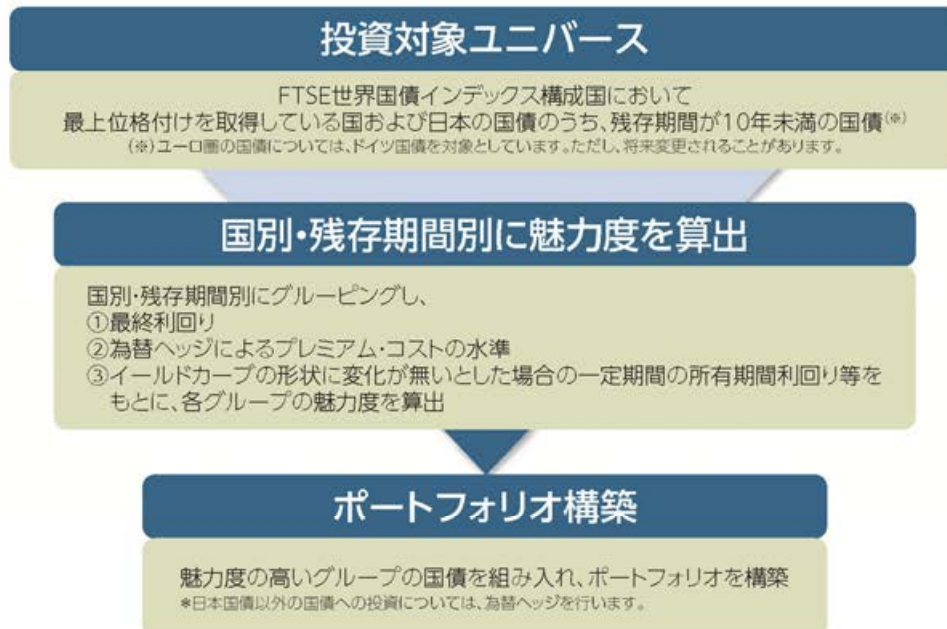
<日本債券インデックスマザーファンド>



❗ 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。

<先進国高格付国債マザーファンド>

- 銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。
- イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。



- ❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ❗ 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。

<MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド>

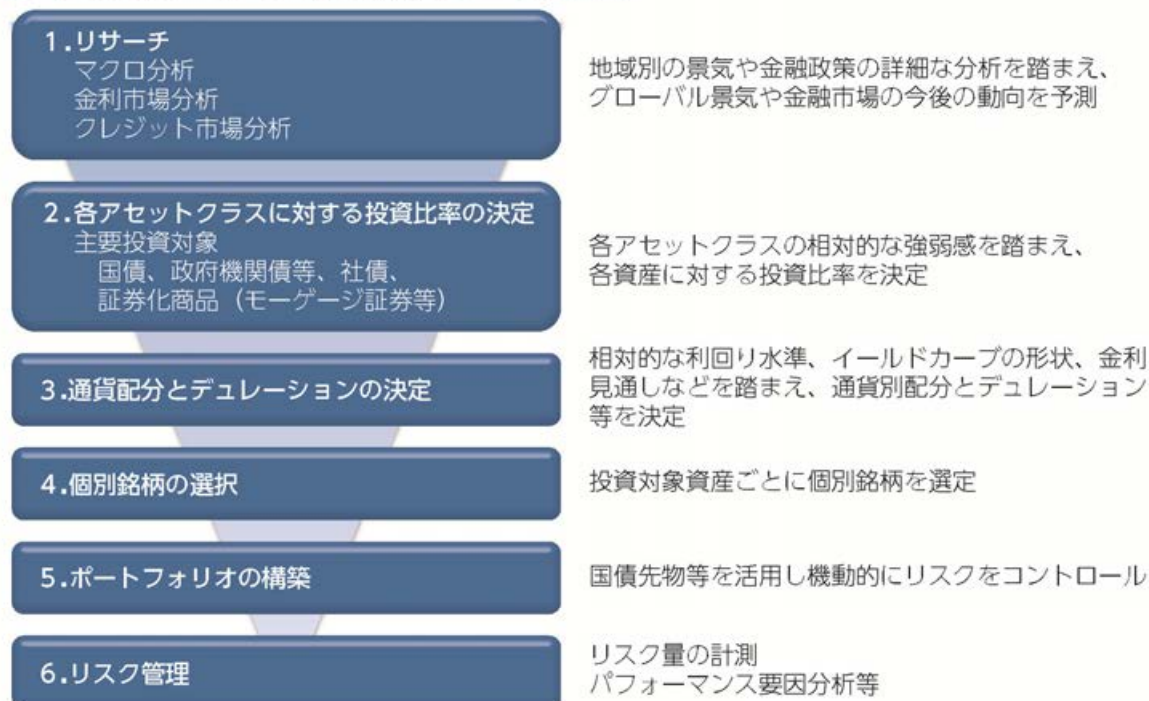
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

・運用にあたっては、クオンツモデルを活用します。



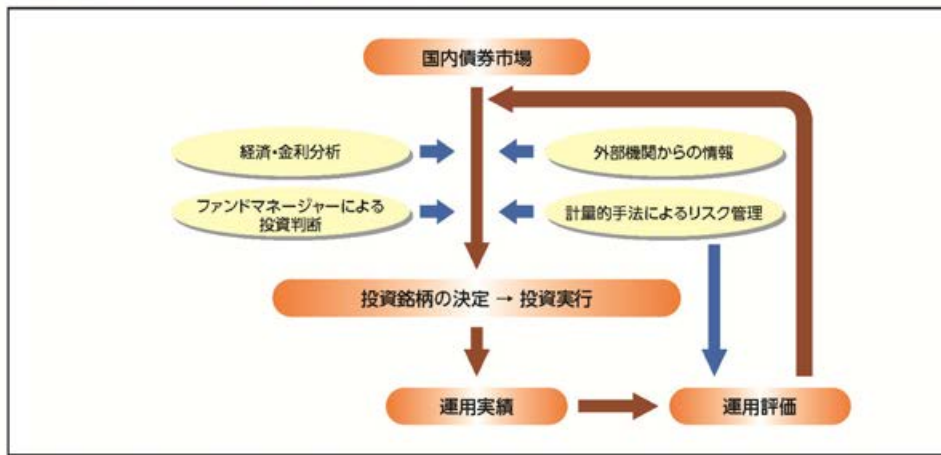
- ! 上図はポートフォリオ構築プロセスのイメージであり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

<ショートデュレーション円インカムマザーファンド>



- イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線のことです。
- ! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記のプロセスは、今後変更されることがあります。

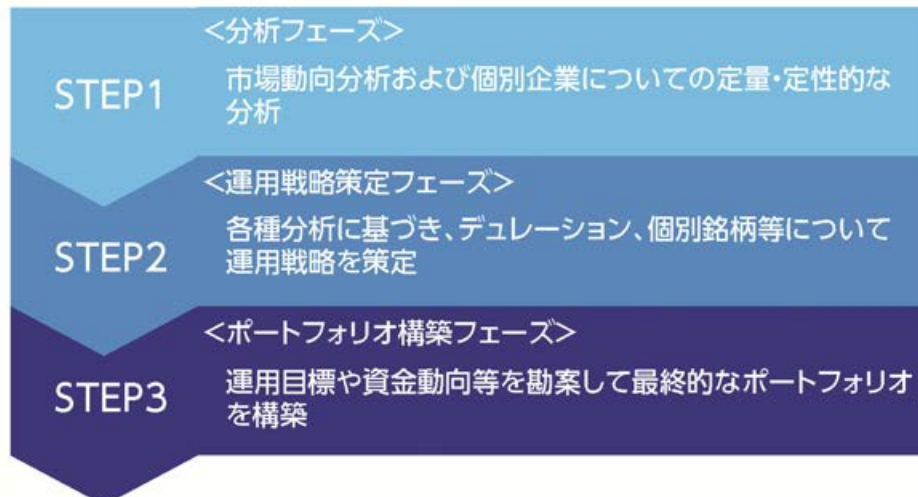
<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>



! 上記の運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。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。なお、今後、変更される場合があります。

<日本短期債券マザーファンド>

- NOMURA-BPI短期インデックス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。



! 上記の運用プロセスは銘柄選定等の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。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。なお、今後、変更される場合があります。

<マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用)(適格機関投資家限定)>

● 債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。

- ・投資する債券は、原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付けを取得しているものに限りません。
- ・デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国国債等に投資する場合があります。

■ デュレーションとは、債券の投資元本の回収に要する平均残存期間や金利感応度を意味する指標です。この値が大きいほど、金利変動に対する債券価格の変動率が大きくなります。



! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

! 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。

<格付けとは>

低い	高い	S&P	Moody's	Fitch	
↑	↑	AAA	Aaa	AAA	投資適格格付け
↑	↑	AA	Aa	AA	
↑	↑	A	A	A	投資適格格付け
↑	↑	BBB	Baa	BBB	
↓	↓	BB	Ba	BB	投資的格付け
↓	↓	B	B	B	
↓	↓	CCC	Caa	CCC	
↓	↓	CC	Ca	CC	
↓	↓	C	C	C	
↓	↓	D	-	D	

S&Pグローバル・レーティング(S&P)のAAからCCCまでおよびフィッチ・レーティング(Fitch)のAAからBまでの格付けには「+,-」、ムーディーズ・インベスターズ・サービス(Moody's)のAaからCaaまでの格付けには「1,2,3」という付加記号が付されることがあります。左記は格付けと利回りの間の一般的な関係を示したイメージ図であり、利回りは格付け以外の要因によっても変動するため、この関係通りの利回りが成立しない場合があります。

指数について

・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。

・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)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。

・NOMURA-BPI短期インデックスとは、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残存期間1年から3年の債券で構成されている債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI総合のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

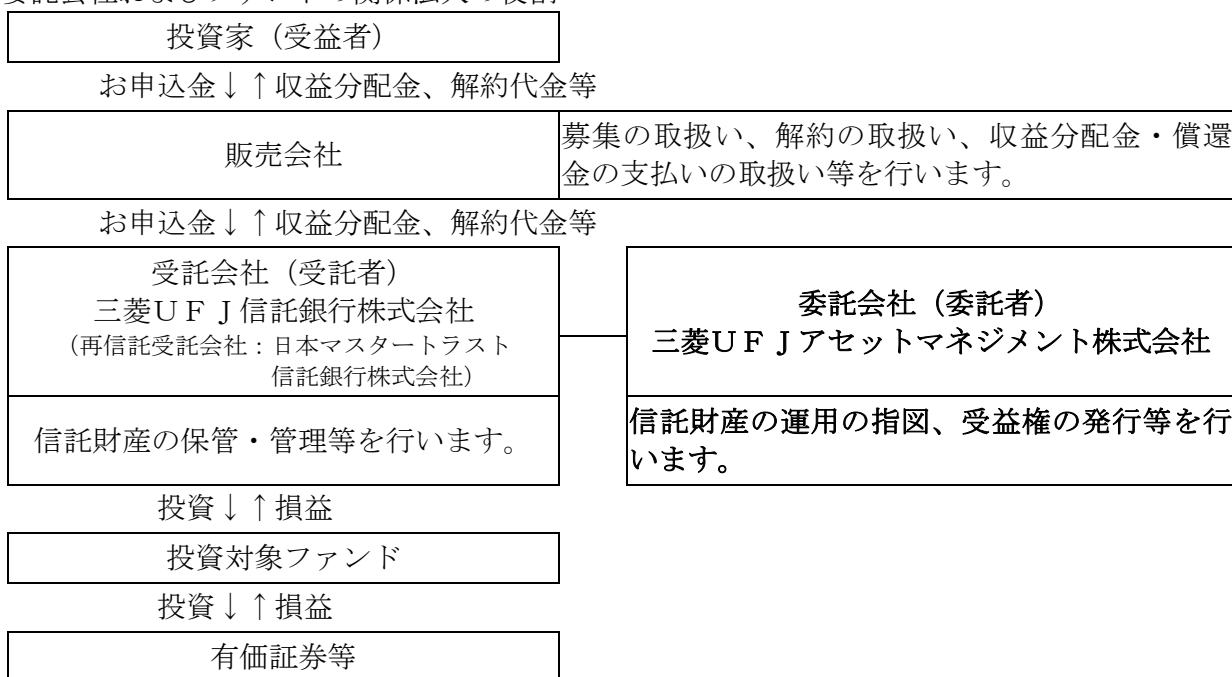
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年3月13日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（2024年4月1日現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。

三菱UFJ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。

投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

2. コマーシャル・ペーパー

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2. の証券の性質を有するもの

4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、1. の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<投資信託証券の概要>

ファンド名	日本債券インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として対象インデックスに採用されている公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 ・投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ・公社債の実質投資比率(組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 ・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	NOMURA-BPI総合に採用されている公社債
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
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アセットマネジメント株式会社
設定日	2001年12月5日
決算日	原則として毎年5月12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。

ファンド名	先進国高格付国債マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を含む先進国の国債等に投資を行い、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。 ・投資する国債等(日本国債を除きます。)は、原則として取得時において最上位格付けを取得しているものに限りま。 ・銘柄選定にあたっては、最終利回り、イールドカーブおよび為替ヘッジコスト等を勘案して決定します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかりま。 ・債券等(為替ヘッジのために行う外国為替予約取引等を含みます。)の運用にあたっては、三菱UFJアセット・マネジメント(UK)に運用の指図に関する権限を委託しま。 ・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	日本を含む先進国の国債等
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下としま。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下としま。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下としま。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下としま。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下としま。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下としま。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため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ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避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アセットマネジメント株式会社 (運用委託先:三菱UFJアセット・マネジメント(UK))
設定日	2012年12月20日
決算日	原則として毎年12月6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。

ファンド名	MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・世界主要国の公社債(日本を除く)を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。 ・運用にあたっては、クオンツモデルを活用することにより主要国の各債券市場を分析し、債券の残存期間構成戦略を超過収益の源泉とします。また、為替変動リスクを回避するため、原則としてフルヘッジを行います。 ・株式への投資は、転換社債および転換社債型新株予約権付社債の転換等により取得したものに限り、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
主な投資対象	世界主要国の公社債(日本を除く)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
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アセットマネジメント株式会社
設定日	2000年7月19日
決算日	原則として毎年6月15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。

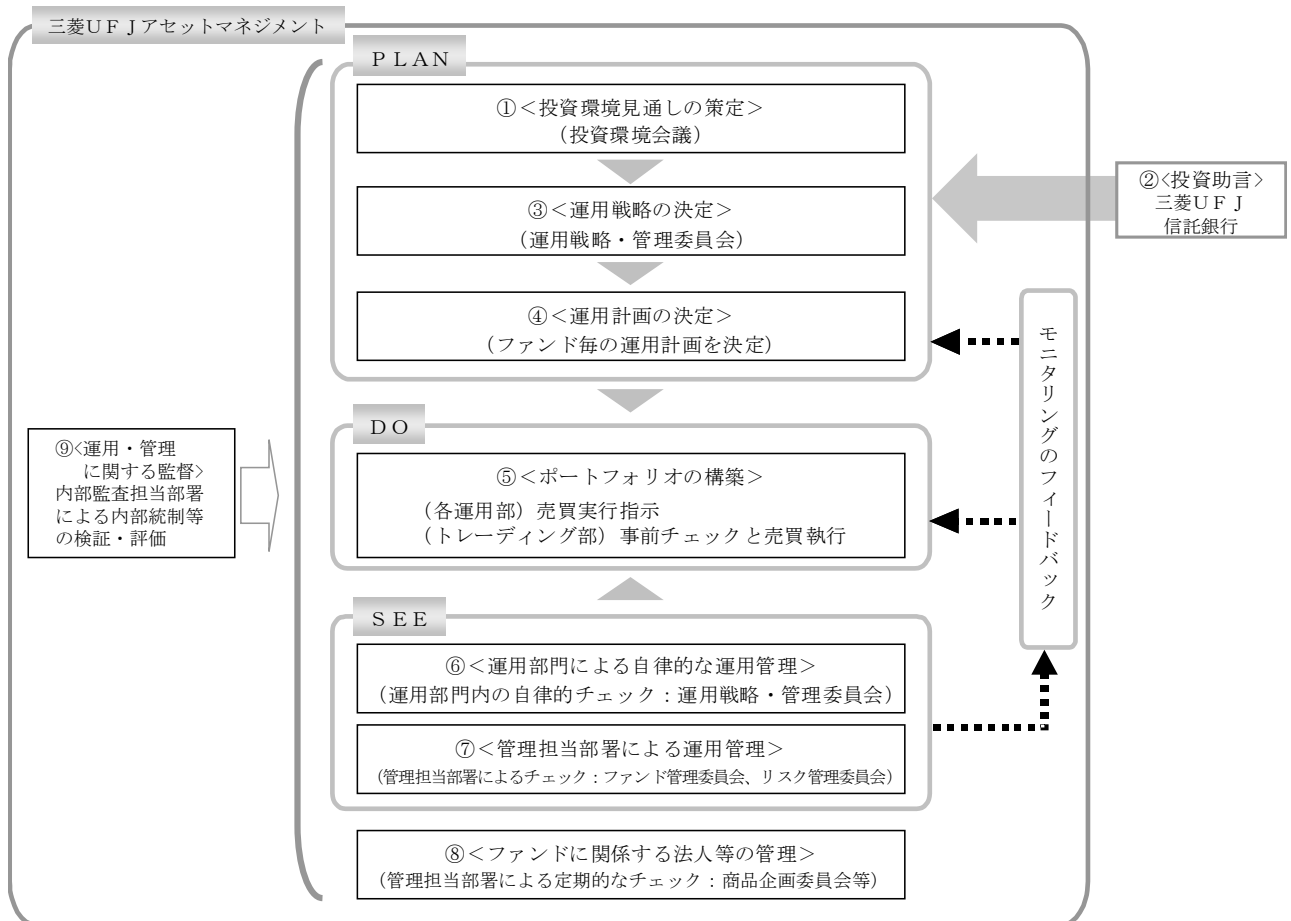
ファンド名	ショートデュレーション円インカムマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を含む先進国の債券等に投資を行います。 ・債券等への投資にあたっては、信用リスクおよび金利変動リスクに配慮しながら銘柄選定を行います。 ・組入債券等は、原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付を有しているものに限りします。 ・ポートフォリオのデュレーションは、原則として0～3年程度とします。 ・デュレーション調整等のため、先物取引等を利用する場合があります。 ・債券等の組入比率は市況動向等に基づき変動します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・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	日本を含む先進国の債券等
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・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。 ・金利先渡取引および為替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。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避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アセットマネジメント株式会社
設定日	2017年7月24日
決算日	原則として毎年2月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。

ファンド名	三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国の公社債を主要投資対象とします。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格(S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの)相当以上の格付を有する債券を対象とします。 ・NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ・経済や金利の分析をベースに、デュレーション・残存構成・債券種別等をコントロールするアクティブ運用を行います。具体的には、次のプロセスによります。 <ul style="list-style-type: none"> 1) 経済分析や市場分析等を踏まえて金利の方向性等を予測し、デュレーションに関する戦略を策定します。 2) また、同様の分析を行い金利の期間構造等を予測し、上記のデュレーション戦略を加味して、残存構成に関する戦略を策定します。 3) さらに、各債券種別間の利回り較差動向等を予測し、債券種別構成に関する戦略を策定します。 4) 以上の戦略を総合して、ポートフォリオを構築します。 ・市況動向、資金動向等によっては、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
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は約款の範囲で行います。 ・スワップ取引は約款の範囲で行います。 ・金利先渡取引は約款の範囲で行います。
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アセットマネジメント株式会社
設定日	2000年4月28日
決算日	原則として毎年2月15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。

ファンド名	日本短期債券マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・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短期インデックス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。 ・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・金融商品
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。
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アセットマネジメント株式会社
設定日	1998年12月2日
決算日	原則として7月22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。

ファンド名	マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用) (適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券に実質的な投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なサービスを提供する企業をいいます。 ・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。 ・実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減をはかります。 ・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。
マザーファンドの投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・世界のインフラ関連企業が発行する米ドル建て債券を主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり利益の獲得をめざします。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要なサービスを提供する企業をいいます。 ・債券への投資にあたっては、マクロ要因分析、業種分析、個別企業の財務・業務分析等の信用リスク分析に基づき、銘柄選定を行います。 ・組入公社債の格付けは、原則として取得時においてBBB-格相当以上の格付を有しているものに限り、かつ、デュレーション調整等のため、債券先物取引等を利用する場合があります。また、ファンドの流動性等を勘案して、一部、米国国債等に投資する場合があります。 ・債券等の運用にあたっては、マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド受益証券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 ・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。 ・金利先渡取引および為替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。 ・外国為替予約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)	純資産総額の年0.3696%(税込)
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アセットマネジメント株式会社 (マザーファンドの運用委託先:マッコーリー・インベストメント・マネジメント・グローバル・リミテッド)
設定日	2015年2月20日
決算日	原則として毎年5月10日、11月10日
分配方針	<p>毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <ol style="list-style-type: none"> ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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。 ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(3) 【運用体制】



①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。

②投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

③運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。

④運用計画の決定

③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。

⑤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。

⑥運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑦管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) 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、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑧ファンドに関係する法人等の管理

助言元、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、商品企画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。

⑨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。

なお、委託会社に関する「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でご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、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。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①株式

株式への直接投資は行いません。

②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。

③信用取引

信用取引の指図は行いません。

④外国為替予約取引

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

⑤公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑥資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度

とします。

- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑦特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

⑧信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動 リスク

一般に、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、ファンドはその影響を受け組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

為替変動 リスク

組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

信用リスク

組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。

流動性 リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①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、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

②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。

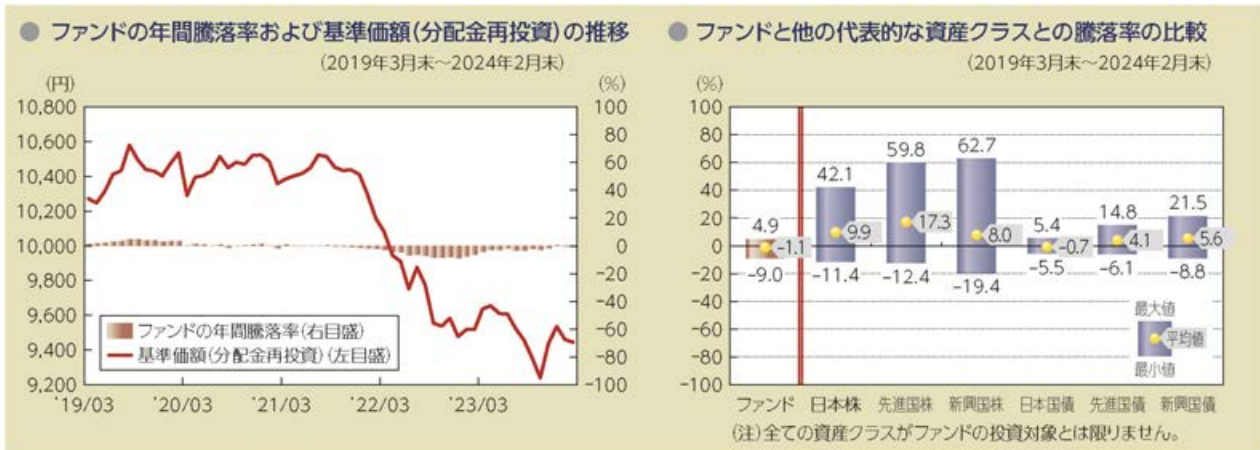
③内部監査担当部署

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

*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。))の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村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国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

※申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

※換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 0.385%（税抜 0.35%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1 万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.28%	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
販売会社	0.04%	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
受託会社	0.03%	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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（概算値）は、次の通りとなります。

実質的な信託報酬率（概算値）	うち投資信託証券に係る率
年 0.385%～0.455%（税込）程度	年 0%～0.07%（税込）程度*

*ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬は最大年率 0.3696%（税込）

(注) 上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（2024 年 5 月 3 日現在）。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

< 投資信託証券の信託報酬率 >

投資信託証券の名称	信託報酬率（税抜）
日本債券インデックスマザーファンド	—
先進国高格付国債マザーファンド	— 外部委託報酬：純資産総額の年 0.125%以内
MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	—
ショートデュレーション円インカムマザーファンド	—
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	—
日本短期債券マザーファンド	—
マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>	年 0.336%

(FOFs用) (適格機関投資家限定)	外部委託報酬：マザーファンドの純資産総額の年0.33%
マッコーリー グローバル・インフラ債券マザーファンド	—

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかる場合があります。

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。申込手数料はかかりません。

(4) 【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとしします。

※売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

(注) 手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として 15.315%（所得税 15%、復興特別所得税 0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

◇個別元本について

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。
- ③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は2024年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

【参考情報】ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間（以下「当期間」といいます。）（2023年2月7日～2024年2月5日）における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.45%	0.44%	0.01%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を当期間の平均受益権口数に平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除しています。

※①の運用管理費用には投資先ファンドの運用管理費用を含みます。

※投資先ファンドの費用は対象期間が異なる場合があります。

※入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

詳細につきましては、当期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5 【運用状況】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

2024年2月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	7,891,634,016	11.65
親投資信託受益証券	日本	58,307,124,720	86.07
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	1,544,509,087	2.28
純資産総額		67,743,267,823	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】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年2月29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	三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	16,682,202,659	1.3898	23,184,925,255	1.3930	23,238,308,303	34.30
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	15,387,172,529	0.9573	14,730,140,262	0.9574	14,731,678,979	21.75
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	10,386,091,705	1.2755	13,247,459,969	1.2775	13,268,232,153	19.59
日本	投資信託受益証券	マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)	8,496,591,318	0.948	8,054,768,569	0.9288	7,891,634,016	11.65
日本	親投資信託受益証券	MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	4,175,314,181	1.4107	5,890,115,715	1.3937	5,819,135,374	8.59
日本	親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	1,256,808,037	0.9987	1,255,174,186	0.9944	1,249,769,911	1.84

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	11.65
親投資信託受益証券	86.07
合計	97.72

(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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【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】

① 【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024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 (2018年2月5日)	11,105,960,848	11,105,960,848	10,075	10,075
第2計算期間末日 (2019年2月5日)	16,779,646,867	16,779,646,867	10,153	10,153
第3計算期間末日 (2020年2月5日)	19,288,687,531	19,288,687,531	10,452	10,452
第4計算期間末日 (2021年2月5日)	24,115,146,293	24,115,146,293	10,473	10,473
第5計算期間末日 (2022年2月7日)	38,319,603,528	38,319,603,528	10,219	10,219
第6計算期間末日 (2023年2月6日)	56,336,569,300	56,336,569,300	9,567	9,567
第7計算期間末日 (2024年2月5日)	68,123,896,953	68,123,896,953	9,470	9,470
2023年2月末日	56,216,307,287	—	9,518	—
3月末日	57,447,546,193	—	9,638	—
4月末日	58,343,172,710	—	9,655	—
5月末日	60,358,096,440	—	9,610	—
6月末日	60,577,968,648	—	9,608	—
7月末日	63,263,642,035	—	9,524	—
8月末日	63,719,206,869	—	9,459	—
9月末日	63,537,251,907	—	9,357	—
10月末日	64,188,986,668	—	9,240	—
11月末日	66,291,779,522	—	9,439	—
12月末日	67,282,248,144	—	9,535	—
2024年1月末日	67,904,222,583	—	9,461	—
2月末日	67,743,267,823	—	9,445	—

② 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 1 計算期間	0.75
第 2 計算期間	0.77
第 3 計算期間	2.94
第 4 計算期間	0.20
第 5 計算期間	△2.42
第 6 計算期間	△6.38
第 7 計算期間	△1.01

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配の額）を控除した額を当該基準価額（分配の額）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	12,571,701,220	1,548,474,323	11,023,226,897
第 2 計算期間	8,904,288,458	3,400,559,093	16,526,956,262
第 3 計算期間	5,442,609,493	3,515,542,243	18,454,023,512
第 4 計算期間	11,312,543,909	6,741,276,409	23,025,291,012
第 5 計算期間	19,050,884,403	4,578,823,747	37,497,351,668
第 6 計算期間	28,586,239,813	7,198,036,975	58,885,554,506
第 7 計算期間	25,562,430,860	12,513,419,255	71,934,566,111

(参考)

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年2月29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	日本	676,010,398,600	84.91
地方債証券	日本	41,283,654,652	5.19
特殊債証券	日本	35,497,227,988	4.46
社債証券	日本	46,986,422,000	5.90
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	△3,612,200,516	△0.46
純資産総額		796,165,502,724	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。

その他の資産の投資状況

2024年2月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	585,040,000	0.07

(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

2024年2月29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 (%)
日本	国債証券	第163回利付国債 (5年)	11,950,000,000	100.73	12,038,291,000	100.24	11,979,397,000	0.400000	2028/9/20	1.50
日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	8,980,000,000	97.96	8,797,206,000	96.70	8,684,019,200	0.100000	2031/12/20	1.09
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	8,550,000,000	99.36	8,495,788,000	98.15	8,392,252,500	0.100000	2030/6/20	1.05
日本	国債証券	第149回利付国債 (5年)	8,050,000,000	99.89	8,041,875,000	99.54	8,013,131,000	0.005000	2026/9/20	1.01
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	8,160,000,000	98.54	8,041,619,000	97.75	7,976,644,800	0.100000	2030/12/20	1.00
日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	7,920,000,000	98.45	7,797,404,400	97.24	7,702,120,800	0.100000	2031/6/20	0.97
日本	国債証券	第356回利付国債 (10年)	7,740,000,000	99.65	7,713,526,400	98.50	7,624,132,200	0.100000	2029/9/20	0.96
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	7,480,000,000	97.99	7,330,224,000	96.74	7,236,451,200	0.200000	2032/9/20	0.91
日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	7,370,000,000	98.36	7,249,523,600	96.94	7,144,920,200	0.100000	2031/9/20	0.90
日本	国債証券	第369回利付国債 (10年)	6,970,000,000	100.57	7,010,278,500	99.03	6,903,018,300	0.500000	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	第371回利付国債 (10年)	7,010,000,000	97.46	6,832,244,700	97.72	6,850,172,000	0.400000	2033/6/20	0.86
日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	6,790,000,000	99.55	6,760,056,100	98.28	6,673,551,500	0.100000	2030/3/20	0.84
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	6,530,000,000	100.02	6,531,567,200	99.21	6,479,000,700	0.100000	2028/3/20	0.81
日本	国債証券	第145回利付国債 (5年)	6,410,000,000	100.38	6,434,942,800	99.96	6,407,500,100	0.100000	2025/9/20	0.80
日本	国債証券	第144回利付国債 (5年)	6,380,000,000	100.34	6,402,074,800	100.01	6,380,829,400	0.100000	2025/6/20	0.80
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	6,340,000,000	100.43	6,367,388,800	99.74	6,324,023,200	0.100000	2026/12/20	0.79
日本	国債証券	第370回利付国債 (10年)	6,370,000,000	100.86	6,424,931,800	98.84	6,296,362,800	0.500000	2033/3/20	0.79
日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	6,340,000,000	98.87	6,268,383,400	97.95	6,210,537,200	0.100000	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第354回利付国債 (10年)	6,220,000,000	99.79	6,206,938,000	98.66	6,136,652,000	0.100000	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	6,130,000,000	100.40	6,154,703,900	99.71	6,112,284,300	0.100000	2027/3/20	0.77
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	6,150,000,000	99.44	6,116,034,000	98.40	6,052,153,500	0.100000	2029/12/20	0.76
日本	国債証券	第349回利付国債	6,090,000,000	100.16	6,099,744,000	99.37	6,052,120,200	0.100000	2027/12/20	0.76

		債(10年)								
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	6,140,000,000	98.74	6,062,636,000	97.54	5,989,017,400	0.100000	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,930,000,000	100.18	5,940,683,000	99.50	5,900,705,800	0.100000	2027/9/20	0.74
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,900,000,000	98.93	5,837,106,000	98.99	5,840,469,000	0.600000	2033/12/20	0.73
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,830,000,000	100.08	5,834,969,000	99.65	5,809,711,600	0.005000	2026/3/20	0.73
日本	国債証券	第451回利付国債(2年)	5,800,000,000	99.92	5,795,503,500	99.86	5,792,170,000	0.005000	2025/8/1	0.73
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,890,000,000	98.24	5,786,361,800	97.02	5,714,890,300	0.200000	2032/6/20	0.72
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	5,700,000,000	100.34	5,719,836,000	99.62	5,678,454,000	0.100000	2027/6/20	0.71
日本	国債証券	第156回利付国債(5年)	5,650,000,000	100.46	5,676,255,000	99.75	5,636,157,500	0.200000	2027/12/20	0.71

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.91
地方債証券	5.19
特殊債券	4.46
社債券	5.90
合計	100.45

(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

2024年2月29日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額(円)	評価金額(円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物24年03月限	買建	4	円	584,523,740	585,040,000	0.07

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

先進国高格付国債マザーファンド

投資状況

2024年2月29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	日本	60,153,194,800	78.27
	オーストラリア	16,227,741,029	21.11

小計		76,380,935,829	99.38
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	475,898,881	0.62
純資産総額		76,856,834,710	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

2024年2月29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 (%)
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	8,700,000,000	98.09	8,534,470,000	97.95	8,522,346,000	0.100000	2030/9/20	11.09
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	8,800,000,000	96.86	8,523,944,000	96.74	8,513,472,000	0.200000	2032/9/20	11.08
オーストラリア	国債証券	1 AUST GOVT 311121	104,000,000	7,618.91	7,923,671,285	7,820.30	8,133,115,927	1.000000	2031/11/21	10.58
オーストラリア	国債証券	1.75 AUST GOVT 321121	100,000,000	7,893.25	7,893,250,216	8,094.62	8,094,625,102	1.750000	2032/11/21	10.53
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	8,000,000,000	99.90	7,992,400,000	99.50	7,960,480,000	0.100000	2027/9/20	10.36
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	7,800,000,000	100.17	7,813,884,000	99.96	7,796,958,000	0.100000	2025/9/20	10.14
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	7,150,000,000	100.16	7,161,869,000	99.78	7,134,484,500	0.100000	2026/9/20	9.28
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	7,110,000,000	98.92	7,033,437,300	98.92	7,033,425,300	0.100000	2028/9/20	9.15
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	6,700,000,000	98.97	6,631,325,000	98.50	6,599,701,000	0.100000	2029/9/20	8.59
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	6,800,000,000	96.37	6,553,443,500	96.94	6,592,328,000	0.100000	2031/9/20	8.58

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.38
合計	99.38

(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。

投資状況

2024年2月29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	アメリカ	24,900,597,213	44.94
	中国	4,840,949,673	8.74
	イタリア	3,978,987,922	7.18
	フランス	3,639,723,877	6.57
	オーストラリア	3,333,691,160	6.02
	スウェーデン	2,907,207,613	5.25
	ドイツ	2,773,053,474	5.00
	イギリス	2,468,585,930	4.46
	スペイン	2,406,286,609	4.34
	ベルギー	1,061,213,172	1.92
	オランダ	687,222,942	1.24
	オーストリア	632,017,350	1.14
	アイルランド	559,105,673	1.01
	フィンランド	355,573,463	0.64
	ポーランド	298,943,133	0.54
	小計	54,843,159,204	98.98
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	564,560,953	1.02
純資産総額		55,407,720,157	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

2024年2月29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 (%)
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 270115	11,400,000	14,979.30	1,707,640,810	14,886.31	1,697,039,758	4.000000	2027/1/15	3.06
アメリカ	国債証券	4.625 T-NOTE 260915	11,200,000	14,930.45	1,672,210,995	15,105.25	1,691,788,674	4.625000	2026/9/15	3.05
オーストラリア	国債証券	1 AUST GOVT 301221	20,680,000	8,049.55	1,664,647,627	8,069.71	1,668,816,279	1.000000	2030/12/21	3.01
オーストラリア	国債証券	1.5 AUST GOVT 310621	20,200,000	8,233.17	1,663,101,592	8,241.95	1,664,874,881	1.500000	2031/6/21	3.00
スウェーデン	国債証券	1 SWD GOVT 261112	117,180,000	1,395.45	1,635,190,419	1,391.19	1,630,205,933	1.000000	2026/11/12	2.94
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 261215	9,520,000	15,128.20	1,440,205,563	15,031.68	1,431,016,576	4.375000	2026/12/15	2.58

スウェーデン	国債証券	1.75 SWD GOVT 331111	84,700,000	1,375.50	1,165,053,887	1,365.39	1,156,492,639	1.750000	2033/11/11	2.09
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 280531	8,040,000	13,181.56	1,059,797,829	13,280.14	1,067,723,897	1.250000	2028/5/31	1.93
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 251215	7,170,000	14,897.20	1,068,129,381	14,880.72	1,066,947,800	4.000000	2025/12/15	1.93
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	8,380,000	12,567.91	1,053,191,423	12,633.32	1,058,672,746	1.875000	2032/2/15	1.91
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 271031	6,660,000	14,886.31	991,428,493	14,936.92	994,799,501	4.125000	2027/10/31	1.80
アメリカ	国債証券	4.75 T-BOND 431115	5,950,000	15,921.58	947,334,093	15,444.85	918,968,695	4.750000	2043/11/15	1.66
中国	国債証券	2.75 CHINA GOVT 290615	41,000,000	2,113.12	866,382,223	2,138.28	876,697,707	2.750000	2029/6/15	1.58
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 250331	5,570,000	14,803.11	824,533,627	14,891.61	829,462,719	3.875000	2025/3/31	1.50
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 290731	5,920,000	13,699.03	810,983,140	13,868.11	820,992,356	2.625000	2029/7/31	1.48
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 291130	5,560,000	14,987.14	833,285,257	14,750.65	820,136,245	3.875000	2029/11/30	1.48
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 250731	5,650,000	13,747.75	776,748,141	14,126.48	798,146,657	0.250000	2025/7/31	1.44
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 250615	5,300,000	14,549.23	771,109,225	14,687.67	778,446,855	2.875000	2025/6/15	1.40
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 280831	5,030,000	14,783.31	743,600,827	15,106.13	759,838,787	4.375000	2028/8/31	1.37
イタリア	国債証券	3.85 ITALY GOVT 260915	4,580,000	16,557.16	758,318,322	16,556.61	758,293,155	3.850000	2026/9/15	1.37
中国	国債証券	2.4 CHINA GOVT 280715	33,000,000	2,089.88	689,660,770	2,105.72	694,889,626	2.400000	2028/7/15	1.25
中国	国債証券	2.55 CHINA GOVT 281015	30,000,000	2,090.37	627,113,153	2,119.61	635,885,879	2.550000	2028/10/15	1.15
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 271231	4,710,000	12,919.06	608,488,182	13,098.87	616,956,924	0.625000	2027/12/31	1.11
アメリカ	国債証券	3.625 T-BOND 530515	4,600,000	14,373.68	661,189,401	13,098.87	602,548,164	3.625000	2053/5/15	1.09
アメリカ	国債証券	4 T-NOTE 280229	4,000,000	15,030.80	601,232,157	14,873.07	594,922,851	4.000000	2028/2/29	1.07
アメリカ	国債証券	3.25 T-BOND 420515	4,590,000	13,407.57	615,407,464	12,623.02	579,396,924	3.250000	2042/5/15	1.05
イタリア	国債証券	0.9 ITALY GOVT 310401	4,220,000	13,379.62	564,620,352	13,637.75	575,513,391	0.900000	2031/4/1	1.04
中国	国債証券	2.6 CHINA GOVT 300915	25,000,000	2,084.33	521,083,593	2,125.57	531,392,638	2.600000	2030/9/15	0.96
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	3,900,000	12,217.83	476,495,382	12,181.90	475,094,288	1.250000	2031/8/15	0.86
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 250831	3,340,000	13,707.43	457,828,449	14,079.69	470,261,965	0.250000	2025/8/31	0.85

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.98
合計	98.98

(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。

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

2024年2月29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	日本	3,200,185,600	21.11
特殊債券	オーストラリア	241,139,601	1.59
社債券	オーストラリア	2,788,211,802	18.39
	アメリカ	1,264,876,201	8.34
	日本	1,259,686,958	8.31
	カナダ	214,199,476	1.41
	イギリス	142,536,024	0.94
	オランダ	140,280,725	0.93
	小計		5,809,791,186
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	5,911,522,719	38.98
純資産総額		15,162,639,106	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。

その他の資産の投資状況

2024年2月29日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
債券先物取引	売建	アメリカ	99,752,956	△0.66
	売建	ドイツ	694,259,805	△4.58
	売建	オーストラリア	641,162,450	△4.23

(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

2024年2月29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 (%)
日本	国債証券	第1197回国庫短	800,000,000	100.00	800,041,600	100.00	800,007,200	—	2024/3/4	5.28

		期証券									
アメリカ	社債券	FRN JP MORGAN 311113	3,000,000	17,041.63	511,249,045	16,916.53	507,496,140	4.457000	2031/11/13	3.35	
日本	社債券	第24回ルノー	500,000,000	100.28	501,440,000	100.27	501,350,000	1.540000	2024/7/5	3.31	
日本	国債証券	第1212回国庫短期証券	500,000,000	100.03	500,161,000	100.02	500,126,000	—	2024/5/20	3.30	
日本	国債証券	第1209回国庫短期証券	500,000,000	100.02	500,119,500	100.02	500,105,500	—	2024/5/7	3.30	
日本	国債証券	第446回利付国債 (2年)	500,000,000	100.00	500,000,000	99.96	499,800,000	0.005000	2025/3/1	3.30	
オーストラリア	社債券	3.25 SUNCORP-MET 260824	5,000,000	9,430.25	471,512,602	9,454.04	472,702,387	3.250000	2026/8/24	3.12	
日本	国債証券	第1210回国庫短期証券	400,000,000	100.02	400,103,200	100.02	400,092,000	—	2024/5/13	2.64	
オーストラリア	社債券	5.805 MITSUBISHI 261207	4,000,000	9,915.15	396,606,392	9,925.07	397,002,806	5.805000	2026/12/7	2.62	
オーストラリア	社債券	3.25 COMMONWEAL 261117	4,000,000	9,415.66	376,626,474	9,424.32	376,973,083	3.250000	2026/11/17	2.49	
日本	国債証券	第1208回国庫短期証券	300,000,000	100.01	300,057,600	100.01	300,048,900	—	2024/4/22	1.98	
アメリカ	社債券	3.522 NISSAN MOTO 250917	2,000,000	14,487.03	289,740,734	14,492.96	289,859,374	3.522000	2025/9/17	1.91	
オーストラリア	社債券	5.35 VOLKSWAGEN F 260915	2,500,000	9,784.25	244,606,480	9,793.49	244,837,325	5.350000	2026/9/15	1.61	
オーストラリア	社債券	4.95 VOLKSWAGEN F 260413	2,500,000	9,707.19	242,679,757	9,710.02	242,750,609	4.950000	2026/4/13	1.60	
日本	社債券	第497回関西電力	200,000,000	100.85	201,710,000	100.77	201,552,000	1.002000	2025/6/20	1.33	
日本	国債証券	第1180回国庫短期証券	200,000,000	100.00	200,016,600	100.00	200,006,000	—	2024/3/11	1.32	
オーストラリア	社債券	3.8 WESTPAC BAN 250520	2,000,000	9,684.11	193,682,230	9,689.77	193,795,511	3.800000	2025/5/20	1.28	
アメリカ	社債券	2.5 DIGITAL EURO 260116	1,000,000	15,823.93	158,239,358	15,841.40	158,414,045	2.500000	2026/1/16	1.04	
日本	社債券	3.201 NISSAN MOTO 280917	1,000,000	15,599.51	155,995,151	15,695.29	156,952,958	3.201000	2028/9/17	1.04	
オーストラリア	特殊債券	4 KFW 250227	1,500,000	9,746.50	146,197,568	9,747.71	146,215,701	4.000000	2025/2/27	0.96	
オーストラリア	社債券	1.45 SCENTRE GRO 290328	1,000,000	14,534.65	145,346,536	14,559.14	145,591,411	1.450000	2029/3/28	0.96	
アメリカ	社債券	FRN MORGAN STA 300123	1,000,000	14,507.32	145,073,207	14,508.07	145,080,724	4.431000	2030/1/23	0.96	
イギリス	社債券	0.163 NATIONAL GR 280120	1,000,000	14,285.40	142,854,035	14,253.60	142,536,024	0.163000	2028/1/20	0.94	
オーストラリア	社債券	0.375 WOOLWORTHS 281115	1,000,000	14,013.31	140,133,147	14,050.48	140,504,867	0.375000	2028/11/15	0.93	
オランダ	社債券	1.5 DIGITAL DUTCH 300315	1,000,000	14,010.47	140,104,741	14,028.07	140,280,725	1.500000	2030/3/15	0.93	
オーストラリア	社債券	1.125 VICINITY CE 291107	1,000,000	13,831.51	138,315,194	13,864.46	138,644,633	1.125000	2029/11/7	0.91	
アメリカ	社債券	FRN MORGAN STA 310207	1,000,000	13,464.74	134,647,458	13,392.68	133,926,872	0.497000	2031/2/7	0.88	
カナダ	社債券	3.8 TRANSCANADA P 270405	1,000,000	10,748.25	107,482,522	10,794.14	107,941,477	3.800000	2027/4/5	0.71	
カナダ	社債券	2.975 WELLS FARGO 260519	1,000,000	10,593.30	105,933,036	10,625.79	106,257,999	2.975000	2026/5/19	0.70	
日本	社債券	第34回東京電力パ ワーグリッド	100,000,000	100.28	100,288,000	100.28	100,285,000	0.750000	2025/4/23	0.66	

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	21.11
特殊債券	1.59
社債券	38.32
合計	61.01

(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

2024年2月29日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	NOTE10Y 2406	売建	6	アメリカドル	662,805.06	99,864,838	662,062.5	99,752,956	△0.66
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EU BOBL 2403	売建	15	ユーロ	1,748,250	285,401,813	1,740,750	284,177,438	△1.87
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-B 2403	売建	19	ユーロ	2,524,150	412,067,487	2,511,990	410,082,367	△2.70
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST10Y 2403	売建	20	オーストラリアドル	2,294,146.2	224,551,030	2,295,027.4	224,637,282	△1.48
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUST3Y 2403	売建	40	オーストラリアドル	4,253,131.2	416,296,481	4,255,467.6	416,525,168	△2.75

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

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

投資状況

2024年2月29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	日本	17,288,927,600	59.40
特殊債券	日本	595,223,000	2.04
社債券	日本	10,547,018,000	36.23
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	676,472,878	2.33
純資産総額		29,107,641,478	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

2024年2月29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(%)
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	1,190,000,000	97.27	1,157,524,900	97.24	1,157,263,100	0.100000	2031/6/20	3.98
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	890,000,000	100.47	894,227,500	100.24	892,189,400	0.400000	2028/9/20	3.07
日本	国債証券	第186回利付国債(20年)	880,000,000	100.30	882,666,400	101.22	890,771,200	1.500000	2043/9/20	3.06
日本	社債券	第1回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	800,000,000	99.87	798,984,000	99.94	799,536,000	1.352000	2029/5/25	2.75
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	790,000,000	97.06	766,827,300	96.94	765,873,400	0.100000	2031/9/20	2.63
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	720,000,000	97.77	703,972,800	97.75	703,821,600	0.100000	2030/12/20	2.42
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	650,000,000	98.71	641,628,000	98.84	642,486,000	0.500000	2033/3/20	2.21
日本	国債証券	第183回利付国債(20年)	630,000,000	99.40	626,264,100	100.29	631,877,400	1.400000	2042/12/20	2.17
日本	国債証券	第77回利付国債(30年)	630,000,000	96.56	608,384,700	97.50	614,250,000	1.600000	2052/12/20	2.11
日本	国債証券	第160回利付国債(20年)	590,000,000	96.24	567,869,100	96.70	570,547,700	0.700000	2037/3/20	1.96
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	520,000,000	97.56	507,322,400	97.54	507,213,200	0.100000	2031/3/20	1.74
日本	社債券	第34回SBIホールディングス	500,000,000	99.65	498,255,000	99.50	497,510,000	0.950000	2026/6/5	1.71
日本	国債証券	第166回利付国債(20年)	520,000,000	94.14	489,533,200	94.74	492,663,600	0.700000	2038/9/20	1.69
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	450,000,000	104.04	468,189,000	104.23	469,066,500	1.200000	2034/12/20	1.61
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	420,000,000	103.58	435,048,600	103.84	436,153,200	1.200000	2035/9/20	1.50
日本	国債証券	第180回利付国債(20年)	450,000,000	90.49	407,209,500	91.28	410,796,000	0.800000	2042/3/20	1.41
日本	社債券	第142回三菱地所(サステナビリティ)	400,000,000	99.49	397,992,000	99.34	397,388,000	0.430000	2028/5/2	1.37
日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	340,000,000	106.22	361,151,400	106.35	361,617,200	1.400000	2034/9/20	1.24
日本	国債証券	第160回利付国債(5年)	360,000,000	99.74	359,064,000	99.51	358,239,600	0.200000	2028/6/20	1.23
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	330,000,000	108.33	357,508,800	108.45	357,908,100	1.600000	2033/12/20	1.23
日本	国債証券	第80回利付国債(30年)	330,000,000	100.87	332,890,800	101.76	335,827,800	1.800000	2053/9/20	1.15
日本	国債証券	第155回利付国債(20年)	310,000,000	101.17	313,651,800	101.44	314,482,600	1.000000	2035/12/20	1.08
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	300,000,000	103.91	311,742,000	104.11	312,342,000	1.200000	2035/3/20	1.07
日本	特殊債券	第863号商工債券	300,000,000	99.32	297,981,000	99.12	297,384,000	0.220000	2027/4/27	1.02
日本	国債証券	第58回利付国債(30年)	350,000,000	83.40	291,924,500	84.34	295,214,500	0.800000	2048/3/20	1.01
日本	国債証券	第148回利付国債	250,000,000	107.33	268,337,500	107.41	268,530,000	1.500000	2034/3/20	0.92

		債(20年)								
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	250,000,000	104.81	262,040,000	105.07	262,685,000	1.300000	2035/6/20	0.90
日本	国債証券	第149回利付国債(20年)	210,000,000	107.29	225,327,900	107.37	225,495,900	1.500000	2034/6/20	0.77
日本	国債証券	第54回利付国債(30年)	260,000,000	84.44	219,562,200	85.37	221,980,200	0.800000	2047/3/20	0.76
日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	200,000,000	109.33	218,664,000	109.44	218,894,000	1.700000	2033/9/20	0.75

(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

2024年2月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	59.40
特殊債券	2.04
社債券	36.23
合計	97.68

(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。

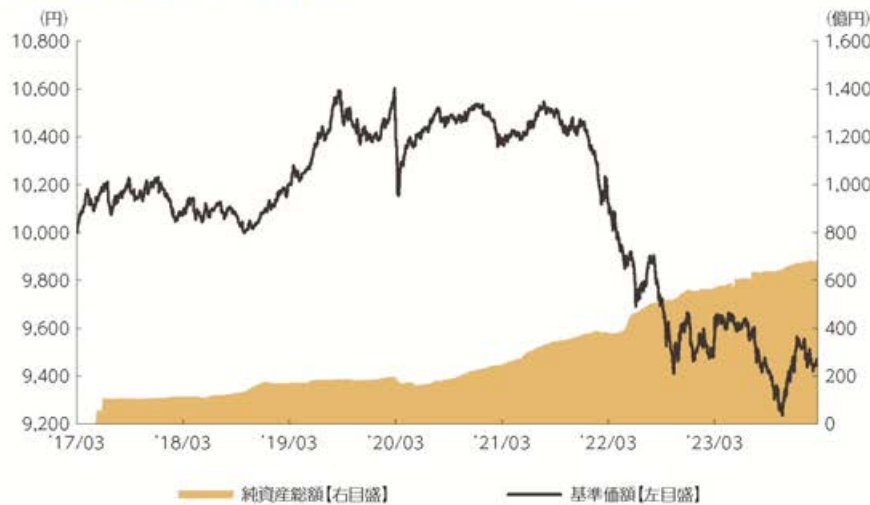
《参考情報》



運用実績

2024年2月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月13日(設定日)～2024年2月29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	9,445円
純資産総額	677.4億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年2月	0円
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
2019年2月	0円
設定来累計	0円

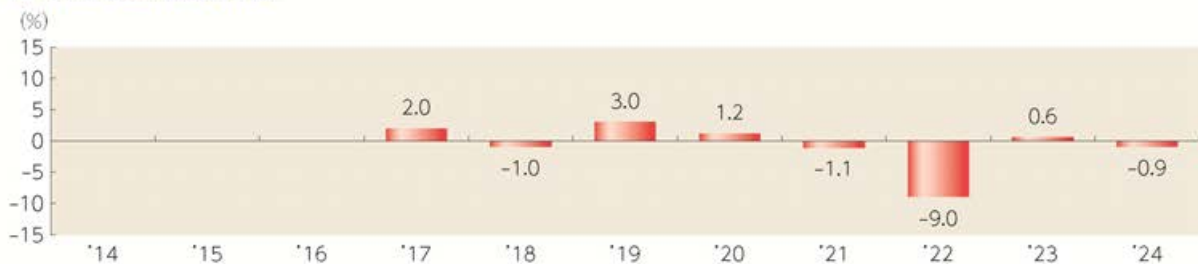
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	34.3%
2 ショートデュレーション円インカムマザーファンド	21.7%
3 日本債券インデックスマザーファンド	19.6%
4 マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>(FOFs用) (適格機関投資家限定)	11.6%
5 MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	8.6%
6 先進国高格付国債マザーファンド	1.8%

•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、2024年は年初から2月29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】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みできません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の取得の制限等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得の申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されません。

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

ただし、2024年11月5日以降は、以下の通りとなります。

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売

会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとし、また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

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)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2027年2月5日まで(2017年3月13日設定)

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年2月6日から翌年2月5日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還)

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

②信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還(信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている

場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。)、信託約款の変更または併合(変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。)をしようとする場合には、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

④ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

⑤ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱いに関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥ 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑧ 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

⑨ 信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑩ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 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（2023 年 2 月 7 日から 2024 年 2 月 5 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年4月10日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内債券セクション（ラップ向け）の2023年2月7日から2024年2月5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。

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、国内債券セクション（ラップ向け）の2024年2月5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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三菱UFJアセットマネジメント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) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 [2023年2月6日現在]	第7期 [2024年2月5日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,792,392,764	2,084,437,148
投資信託受益証券	7,759,238,459	8,054,768,569
親投資信託受益証券	46,941,729,461	58,307,815,387
流動資産合計	56,493,360,684	68,447,021,104
資産合計	56,493,360,684	68,447,021,104
負債の部		
流動負債		
未払解約金	52,867,078	195,974,092
未払受託者報酬	8,817,030	10,787,606
未払委託者報酬	94,048,285	115,067,694
未払利息	1,010	302
その他未払費用	1,057,981	1,294,457
流動負債合計	156,791,384	323,124,151
負債合計	156,791,384	323,124,151
純資産の部		
元本等		
元本	58,885,554,506	71,934,566,111
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,548,985,206	△3,810,669,158
（分配準備積立金）	652,718,892	819,421,627
元本等合計	56,336,569,300	68,123,896,953
純資産合計	56,336,569,300	68,123,896,953
負債純資産合計	56,493,360,684	68,447,021,104

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 2022年2月8日 至 2023年2月6日	第7期 自 2023年2月7日 至 2024年2月5日
営業収益		
受取利息	6,498	13,900
有価証券売買等損益	△2,699,892,799	△375,081,631
営業収益合計	△2,699,886,301	△375,067,731
営業費用		
支払利息	458,811	661,213
受託者報酬	15,719,211	20,412,861

委託者報酬	167,671,523	217,737,073
その他費用	1,886,181	2,449,433
営業費用合計	185,735,726	241,260,580
営業利益又は営業損失(△)	△2,885,622,027	△616,328,311
経常利益又は経常損失(△)	△2,885,622,027	△616,328,311
当期純利益又は当期純損失(△)	△2,885,622,027	△616,328,311
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(△)	△281,944,448	△38,221,035
期首剰余金又は期首欠損金(△)	822,251,860	△2,548,985,206
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	544,405,779
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	544,405,779
剰余金減少額又は欠損金増加額	767,559,487	1,227,982,455
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	72,597,752	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	694,961,735	1,227,982,455
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,548,985,206	△3,810,669,158

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月5日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は2023年2月7日から2024年2月5日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第6期 [2023年2月6日現在]	第7期 [2024年2月5日現在]
1. 期首元本額	37,497,351,668円	58,885,554,506円
期中追加設定元本額	28,586,239,813円	25,562,430,860円
期中一部解約元本額	7,198,036,975円	12,513,419,255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。	2,548,985,206円	3,810,669,158円
3. 受益権の総数	58,885,554,506口	71,934,566,111口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自2022年2月8日 至2023年2月6日	第7期 自2023年2月7日 至2024年2月5日
1. 運用に係る権限を委託するための費用 「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費	1. 運用に係る権限を委託するための費用 「先進国高格付国債マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費

用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年 10,000 分の 12.5 以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

2. 分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	197,690,334 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	2,109,174,010 円
分配準備積立金額	D	455,028,558 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,761,892,902 円
当ファンドの期末残存口数	F	58,885,554,506 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	469 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

用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年 10,000 分の 12.5 以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

2. 分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	281,267,755 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	2,850,166,658 円
分配準備積立金額	D	538,153,872 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,669,588,285 円
当ファンドの期末残存口数	F	71,934,566,111 口
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	510 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 6 期 自 2022 年 2 月 8 日 至 2023 年 2 月 6 日	第 7 期 自 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号) 第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
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。	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、この結果はリスク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 6 期 [2023 年 2 月 6 日現在]	第 7 期 [2024 年 2 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(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	(1) 有価証券 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。	(2) デリバティブ取引 同左
	(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) 上記以外の金融商品 同左
	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 [2023年2月6日現在]	第7期 [2024年2月5日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	△623,092,288	△143,797,933
親投資信託受益証券	△1,948,645,638	△436,896,756
合計	△2,571,737,926	△580,694,689

(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6期 [2023年2月6日現在]	第7期 [2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	0.9567円	0.9470円
(1万口当たり純資産額)	(9,567円)	(9,470円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり> (FOFs用) (適格機関投資家限定)	8,496,591,318	8,054,768,569	

投資信託受益証券 合計		8,496,591,318	8,054,768,569
親投資信託受益証券	先進国高格付国債マザーファンド	1,256,808,037	1,255,174,186
	ショートデュレーション円インカムマザーファンド	15,387,172,529	14,730,140,262
	三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	16,682,202,659	23,184,925,255
	MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド	4,175,314,181	5,890,115,715
	日本債券インデックスマザーファンド	10,386,091,705	13,247,459,969
親投資信託受益証券 合計		47,887,589,111	58,307,815,387
合計		56,384,180,429	66,362,583,956

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。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,161,054,840
国債証券	662,487,672,780
地方債証券	41,894,157,294
特殊債券	35,807,259,821
社債券	46,855,286,000
派生商品評価勘定	1,137,195
未収入金	619,220,100
未収利息	1,506,718,275
前払費用	76,634,122
差入委託証拠金	9,165,496
流動資産合計	791,418,305,923
資産合計	791,418,305,923
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	521,870

前受金	3,570,000
未払解約金	544,869,971
未払利息	313
流動負債合計	548,962,154
負債合計	548,962,154
純資産の部	
元本等	
元本	620,030,654,293
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	170,838,689,476
元本等合計	790,869,343,769
純資産合計	790,869,343,769
負債純資産合計	791,418,305,923

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	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	539,249,400,798円
期中追加設定元本額	151,621,910,696円
期中一部解約元本額	70,840,657,201円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,601,295,253円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	11,230,716,606円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	2,923,082,341円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	57,532,453,607円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	105,888,689,911円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	34,277,287,170円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	208,435,716円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	189,283,325円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド	1,824,890,709円
eMAXIS 国内債券インデックス	6,339,780,831円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	4,346,535,039円
eMAXIS バランス(波乗り型)	284,558,403円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	17,443,001,947円
三菱UFJ 国内債券インデックスファンド(確定拠出年金)	42,083,418,898円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	11,085,021,801円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	5,198,477,218円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	2,379,302,420円

金)	
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	17,709,580,521 円
国内債券セレクション (ラップ向け)	10,386,091,705 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	21,779,059,585 円
つみたて8資産均等バランス	10,781,246,662 円
つみたて4資産均等バランス	4,088,625,193 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	18,608,274 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	14,158,337 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	379,493 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	6,256,739,694 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	2,774,823,929 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	1,111,359,718 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	7,195,971,753 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	6,996,280,842 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	4,319,265,759 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	812,439,904 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	1,357,486,517 円
国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	1,424,823,222 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	378,063,296 円
ラップ向けインデックスf 国内債券	6,176,556,200 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,320,158,395 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,481,706,998 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	9,079,387 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	2,226,128 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	128,465,862 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	177,956,270 円
eMAXIS 債券バランス (2資産均等型)	77,787,891 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	1,618,755,469 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,900,778,178 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	1,117,291,750 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,008,423,633 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	121,859,857 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	48,952,144 円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA (適格機関投資家限定)	5,927,305,516 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	1,793 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	27,482,961 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	9,049,069,757 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	636,207,659 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4,543,722,367 円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	118,372,408,170 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	463,021,975 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,557,836 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	299,579 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,384,463,255 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2,490,934,429 円

MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	2,980,339,781 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	532,148,971 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	13,094,408,181 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	1,911,787,835 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,054,382 円
日本債券インデックスファンドS	4,769,996,354 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429,832,474 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424,280,144 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424,729,389 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421,626,267 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419,477,595 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420,955,442 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413,671,752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416,234,104 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418,690,273 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416,840,490 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462,440,331 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469,323,041 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477,586,919 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478,244,702 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476,937,873 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490,248,647 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	476,919,903 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	477,769,455 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	18,488,581 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	23,077,472 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,255,280 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9,500,244 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17,898,475 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	44,928,726 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	9,053,017 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	28,894,927 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,310,335,269 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,228,666,647 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,698,680,185 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド	2,954,688,837 円

(成長型) 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	2,048,933,270 円
合計	620,030,654,293 円
2. 受益権の総数	620,030,654,293 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)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 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、この結果はリスク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	[2024 年 2 月 5 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	[2024 年 2 月 5 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△21,352,102,220
地方債証券	△389,801,016
特殊債券	△490,776,264
社債券	△152,899,000

合計	△22,385,578,500
----	-----------------

(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

債券関連

[2024年2月5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	債券先物取引				
	買建	731,130,000	—	731,750,000	620,000
合計		731,130,000	—	731,750,000	620,000

(注) 時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※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)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	1.2755円
(1万口当たり純資産額)	(12,755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

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第446回利付国債(2年)	5,100,000,000	5,100,510,000	
	第447回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,020,051,000	
	第448回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,799,874,000	
	第449回利付国債(2年)	2,220,000,000	2,219,556,000	
	第450回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,299,545,000	
	第451回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,698,785,000	
	第452回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,098,047,000	

第453回利付国債（2年）	1,300,000,000	1,298,921,000	
第454回利付国債（2年）	1,800,000,000	1,801,242,000	
第455回利付国債（2年）	1,850,000,000	1,847,650,500	
第456回利付国債（2年）	5,100,000,000	5,100,918,000	
第143回利付国債（5年）	5,380,000,000	5,386,563,600	
第144回利付国債（5年）	6,380,000,000	6,386,954,200	
第145回利付国債（5年）	6,410,000,000	6,416,217,700	
第146回利付国債（5年）	5,150,000,000	5,152,832,500	
第147回利付国債（5年）	4,730,000,000	4,722,479,300	
第148回利付国債（5年）	5,100,000,000	5,090,361,000	
第149回利付国債（5年）	6,050,000,000	6,036,508,500	
第150回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,924,750,400	
第151回利付国債（5年）	750,000,000	747,435,000	
第152回利付国債（5年）	3,480,000,000	3,478,364,400	
第153回利付国債（5年）	5,620,000,000	5,594,541,400	
第154回利付国債（5年）	5,930,000,000	5,916,123,800	
第155回利付国債（5年）	2,850,000,000	2,862,027,000	
第156回利付国債（5年）	4,650,000,000	4,651,767,000	
第157回利付国債（5年）	2,020,000,000	2,018,343,600	
第158回利付国債（5年）	5,330,000,000	5,303,883,000	
第159回利付国債（5年）	1,980,000,000	1,967,169,600	
第160回利付国債（5年）	2,850,000,000	2,843,844,000	
第161回利付国債（5年）	120,000,000	120,258,000	
第162回利付国債（5年）	190,000,000	190,129,200	
第163回利付国債（5年）	11,950,000,000	12,012,618,000	
第164回利付国債（5年）	2,800,000,000	2,784,544,000	
第1回利付国債（40年）	1,105,000,000	1,273,225,200	
第2回利付国債（40年）	1,335,000,000	1,479,820,800	
第3回利付国債（40年）	1,168,000,000	1,291,130,560	
第4回利付国債（40年）	1,218,000,000	1,343,490,540	
第5回利付国債（40年）	775,000,000	819,221,500	
第6回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,272,939,300	
第7回利付国債（40年）	1,540,000,000	1,517,331,200	
第8回利付国債（40年）	1,510,000,000	1,377,165,300	
第9回利付国債（40年）	2,880,000,000	1,911,600,000	
第10回利付国債（40年）	2,720,000,000	2,119,723,200	

第1 1 回利付国債（4 0年）	2, 100, 000, 000	1, 569, 855, 000	
第1 2 回利付国債（4 0年）	2, 490, 000, 000	1, 648, 131, 000	
第1 3 回利付国債（4 0年）	2, 800, 000, 000	1, 829, 156, 000	
第1 4 回利付国債（4 0年）	3, 070, 000, 000	2, 140, 035, 600	
第1 5 回利付国債（4 0年）	3, 500, 000, 000	2, 690, 625, 000	
第1 6 回利付国債（4 0年）	2, 800, 000, 000	2, 356, 900, 000	
第3 3 8 回利付国債（1 0年）	3, 330, 000, 000	3, 345, 218, 100	
第3 3 9 回利付国債（1 0年）	4, 020, 000, 000	4, 040, 863, 800	
第3 4 0 回利付国債（1 0年）	3, 470, 000, 000	3, 490, 195, 400	
第3 4 1 回利付国債（1 0年）	3, 320, 000, 000	3, 334, 242, 800	
第3 4 2 回利付国債（1 0年）	2, 570, 000, 000	2, 571, 079, 400	
第3 4 3 回利付国債（1 0年）	4, 870, 000, 000	4, 871, 704, 500	
第3 4 4 回利付国債（1 0年）	4, 620, 000, 000	4, 621, 201, 200	
第3 4 5 回利付国債（1 0年）	6, 340, 000, 000	6, 340, 000, 000	
第3 4 6 回利付国債（1 0年）	6, 130, 000, 000	6, 127, 118, 900	
第3 4 7 回利付国債（1 0年）	5, 700, 000, 000	5, 692, 305, 000	
第3 4 8 回利付国債（1 0年）	4, 970, 000, 000	4, 958, 370, 200	
第3 4 9 回利付国債（1 0年）	6, 090, 000, 000	6, 068, 928, 600	
第3 5 0 回利付国債（1 0年）	6, 530, 000, 000	6, 498, 003, 000	
第3 5 1 回利付国債（1 0年）	4, 870, 000, 000	4, 838, 442, 400	
第3 5 2 回利付国債（1 0年）	4, 110, 000, 000	4, 075, 311, 600	
第3 5 3 回利付国債（1 0年）	4, 630, 000, 000	4, 585, 552, 000	
第3 5 4 回利付国債（1 0年）	6, 220, 000, 000	6, 152, 637, 400	
第3 5 5 回利付国債（1 0年）	2, 740, 000, 000	2, 708, 188, 600	
第3 5 6 回利付国債（1 0年）	7, 740, 000, 000	7, 643, 869, 200	
第3 5 7 回利付国債（1 0年）	6, 150, 000, 000	6, 066, 790, 500	
第3 5 8 回利付国債（1 0年）	6, 790, 000, 000	6, 688, 353, 700	
第3 5 9 回利付国債（1 0年）	8, 550, 000, 000	8, 406, 360, 000	
第3 6 0 回利付国債（1 0年）	6, 340, 000, 000	6, 221, 315, 200	
第3 6 1 回利付国債（1 0年）	7, 010, 000, 000	6, 862, 509, 600	
第3 6 2 回利付国債（1 0年）	6, 140, 000, 000	5, 993, 868, 000	
第3 6 3 回利付国債（1 0年）	7, 920, 000, 000	7, 708, 536, 000	
第3 6 4 回利付国債（1 0年）	7, 370, 000, 000	7, 150, 963, 600	
第3 6 5 回利付国債（1 0年）	7, 980, 000, 000	7, 720, 729, 800	
第3 6 6 回利付国債（1 0年）	4, 740, 000, 000	4, 611, 119, 400	
第3 6 7 回利付国債（1 0年）	5, 540, 000, 000	5, 374, 132, 400	

第368回利付国債（10年）	7,480,000,000	7,234,730,800	
第369回利付国債（10年）	6,070,000,000	6,011,242,400	
第370回利付国債（10年）	6,370,000,000	6,293,177,800	
第371回利付国債（10年）	5,010,000,000	4,892,916,300	
第372回利付国債（10年）	6,620,000,000	6,691,694,600	
第373回利付国債（10年）	2,650,000,000	2,621,883,500	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	223,014,680	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	300,931,840	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	344,008,850	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	294,109,200	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	267,650,040	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	387,853,290	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	386,605,770	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	332,819,100	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	219,968,860	
第10回利付国債（30年）	398,000,000	414,302,080	
第11回利付国債（30年）	237,000,000	259,429,680	
第12回利付国債（30年）	325,000,000	367,828,500	
第13回利付国債（30年）	595,000,000	667,941,050	
第14回利付国債（30年）	683,000,000	793,427,440	
第15回利付国債（30年）	686,000,000	804,568,240	
第16回利付国債（30年）	547,000,000	642,413,210	
第17回利付国債（30年）	577,000,000	672,672,370	
第18回利付国債（30年）	687,000,000	794,213,220	
第19回利付国債（30年）	593,000,000	686,035,770	
第20回利付国債（30年）	655,000,000	772,552,850	
第21回利付国債（30年）	529,000,000	612,682,510	
第22回利付国債（30年）	975,000,000	1,152,333,000	
第23回利付国債（30年）	194,000,000	229,436,040	
第24回利付国債（30年）	981,000,000	1,160,836,920	
第25回利付国債（30年）	1,287,000,000	1,492,212,150	
第26回利付国債（30年）	1,014,000,000	1,188,235,620	
第27回利付国債（30年）	760,000,000	900,425,200	
第28回利付国債（30年）	1,426,000,000	1,689,524,800	
第29回利付国債（30年）	830,000,000	972,004,700	
第30回利付国債（30年）	1,721,000,000	1,989,940,670	

第3 1 回利付国債（3 0年）	2, 223, 000, 000	2, 535, 398, 190	
第3 2 回利付国債（3 0年）	1, 989, 000, 000	2, 292, 183, 270	
第3 3 回利付国債（3 0年）	1, 227, 000, 000	1, 356, 423, 960	
第3 4 回利付国債（3 0年）	2, 231, 000, 000	2, 528, 013, 030	
第3 5 回利付国債（3 0年）	2, 379, 000, 000	2, 617, 708, 860	
第3 6 回利付国債（3 0年）	1, 929, 000, 000	2, 117, 656, 200	
第3 7 回利付国債（3 0年）	2, 717, 000, 000	2, 932, 784, 140	
第3 8 回利付国債（3 0年）	1, 590, 000, 000	1, 685, 892, 900	
第3 9 回利付国債（3 0年）	1, 360, 000, 000	1, 462, 489, 600	
第4 0 回利付国債（3 0年）	1, 720, 000, 000	1, 816, 096, 400	
第4 1 回利付国債（3 0年）	1, 210, 000, 000	1, 254, 721, 600	
第4 2 回利付国債（3 0年）	1, 920, 000, 000	1, 988, 544, 000	
第4 3 回利付国債（3 0年）	1, 690, 000, 000	1, 748, 169, 800	
第4 4 回利付国債（3 0年）	1, 630, 000, 000	1, 683, 985, 600	
第4 5 回利付国債（3 0年）	1, 580, 000, 000	1, 573, 743, 200	
第4 6 回利付国債（3 0年）	2, 380, 000, 000	2, 366, 695, 800	
第4 7 回利付国債（3 0年）	1, 900, 000, 000	1, 919, 855, 000	
第4 8 回利付国債（3 0年）	2, 100, 000, 000	2, 042, 376, 000	
第4 9 回利付国債（3 0年）	2, 160, 000, 000	2, 096, 798, 400	
第5 0 回利付国債（3 0年）	2, 210, 000, 000	1, 894, 876, 100	
第5 1 回利付国債（3 0年）	2, 460, 000, 000	1, 871, 543, 400	
第5 2 回利付国債（3 0年）	2, 020, 000, 000	1, 605, 617, 200	
第5 3 回利付国債（3 0年）	1, 950, 000, 000	1, 579, 870, 500	
第5 4 回利付国債（3 0年）	1, 870, 000, 000	1, 581, 515, 100	
第5 5 回利付国債（3 0年）	1, 940, 000, 000	1, 634, 333, 600	
第5 6 回利付国債（3 0年）	1, 840, 000, 000	1, 545, 287, 200	
第5 7 回利付国債（3 0年）	2, 040, 000, 000	1, 707, 949, 200	
第5 8 回利付国債（3 0年）	2, 280, 000, 000	1, 902, 979, 200	
第5 9 回利付国債（3 0年）	1, 960, 000, 000	1, 590, 775, 200	
第6 0 回利付国債（3 0年）	1, 730, 000, 000	1, 468, 129, 900	
第6 1 回利付国債（3 0年）	1, 740, 000, 000	1, 401, 552, 600	
第6 2 回利付国債（3 0年）	1, 370, 000, 000	1, 043, 008, 400	
第6 3 回利付国債（3 0年）	1, 960, 000, 000	1, 445, 617, 600	
第6 4 回利付国債（3 0年）	2, 430, 000, 000	1, 783, 449, 900	
第6 5 回利付国債（3 0年）	1, 510, 000, 000	1, 103, 749, 600	
第6 6 回利付国債（3 0年）	1, 900, 000, 000	1, 382, 041, 000	

第67回利付国債（30年）	2,340,000,000	1,793,001,600	
第68回利付国債（30年）	2,060,000,000	1,572,665,800	
第69回利付国債（30年）	1,890,000,000	1,478,679,300	
第70回利付国債（30年）	1,990,000,000	1,551,543,300	
第71回利付国債（30年）	2,610,000,000	2,027,813,400	
第72回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,478,760,200	
第73回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,567,566,000	
第74回利付国債（30年）	3,040,000,000	2,540,923,200	
第75回利付国債（30年）	2,370,000,000	2,135,441,100	
第76回利付国債（30年）	2,070,000,000	1,909,989,000	
第77回利付国債（30年）	2,040,000,000	1,971,843,600	
第78回利付国債（30年）	2,360,000,000	2,173,418,400	
第79回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,775,519,200	
第80回利付国債（30年）	2,200,000,000	2,223,606,000	
第81回利付国債（30年）	970,000,000	934,129,400	
第75回利付国債（20年）	705,000,000	721,588,650	
第76回利付国債（20年）	410,000,000	418,733,000	
第77回利付国債（20年）	370,000,000	378,291,700	
第78回利付国債（20年）	310,000,000	317,963,900	
第79回利付国債（20年）	150,000,000	154,059,000	
第80回利付国債（20年）	585,000,000	601,625,700	
第81回利付国債（20年）	250,000,000	257,927,500	
第82回利付国債（20年）	1,082,000,000	1,118,063,060	
第83回利付国債（20年）	395,000,000	409,962,600	
第84回利付国債（20年）	880,000,000	911,688,800	
第85回利付国債（20年）	520,000,000	542,178,000	
第86回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,096,072,890	
第87回利付国債（20年）	420,000,000	438,799,200	
第88回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,330,132,480	
第89回利付国債（20年）	340,000,000	356,986,400	
第90回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,340,015,100	
第91回利付国債（20年）	548,000,000	579,641,520	
第92回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,355,330,400	
第93回利付国債（20年）	190,000,000	201,115,000	
第94回利付国債（20年）	875,000,000	928,908,750	
第95回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,187,323,920	

第96回利付国債（20年）	340,000,000	362,392,400	
第97回利付国債（20年）	573,000,000	615,058,200	
第98回利付国債（20年）	610,000,000	652,578,000	
第99回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,588,854,000	
第100回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,113,615,400	
第101回利付国債（20年）	723,000,000	787,592,820	
第102回利付国債（20年）	520,000,000	568,542,000	
第103回利付国債（20年）	760,000,000	827,655,200	
第104回利付国債（20年）	610,000,000	659,031,800	
第105回利付国債（20年）	920,000,000	996,580,800	
第106回利付国債（20年）	571,000,000	621,133,800	
第107回利付国債（20年）	607,000,000	659,584,410	
第108回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,077,030,000	
第109回利付国債（20年）	560,000,000	604,984,800	
第110回利付国債（20年）	876,000,000	955,190,400	
第111回利付国債（20年）	861,000,000	947,151,660	
第112回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,149,519,000	
第113回利付国債（20年）	922,000,000	1,013,148,920	
第114回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,764,048,000	
第115回利付国債（20年）	944,000,000	1,046,225,760	
第116回利付国債（20年）	461,000,000	512,668,880	
第117回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,460,038,800	
第118回利付国債（20年）	520,000,000	573,258,400	
第119回利付国債（20年）	400,000,000	435,988,000	
第120回利付国債（20年）	780,000,000	840,457,800	
第121回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,427,406,150	
第122回利付国債（20年）	100,000,000	109,239,000	
第123回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,468,752,840	
第124回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,373,535,600	
第125回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,071,475,840	
第126回利付国債（20年）	200,000,000	221,830,000	
第127回利付国債（20年）	440,000,000	484,985,600	
第128回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,178,091,860	
第129回利付国債（20年）	280,000,000	306,952,800	
第130回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,042,651,240	
第131回利付国債（20年）	420,000,000	457,661,400	

第132回利付国債（20年）	187,000,000	203,987,080	
第133回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,548,311,200	
第134回利付国債（20年）	4,545,000,000	4,997,954,700	
第135回利付国債（20年）	50,000,000	54,594,000	
第136回利付国債（20年）	190,000,000	205,977,100	
第137回利付国債（20年）	4,342,000,000	4,743,287,640	
第138回利付国債（20年）	160,000,000	172,158,400	
第139回利付国債（20年）	310,000,000	336,170,200	
第140回利付国債（20年）	2,817,000,000	3,078,502,110	
第141回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,224,764,800	
第142回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,406,508,700	
第143回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,887,917,400	
第144回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,636,097,600	
第145回利付国債（20年）	3,100,000,000	3,393,384,000	
第146回利付国債（20年）	3,420,000,000	3,743,395,200	
第147回利付国債（20年）	3,450,000,000	3,741,766,500	
第148回利付国債（20年）	3,360,000,000	3,608,774,400	
第149回利付国債（20年）	3,440,000,000	3,693,493,600	
第150回利付国債（20年）	3,750,000,000	3,985,800,000	
第151回利付国債（20年）	3,780,000,000	3,935,093,400	
第152回利付国債（20年）	3,110,000,000	3,233,653,600	
第153回利付国債（20年）	3,980,000,000	4,174,263,800	
第154回利付国債（20年）	3,510,000,000	3,637,974,600	
第155回利付国債（20年）	3,600,000,000	3,644,460,000	
第156回利付国債（20年）	3,100,000,000	2,919,487,000	
第157回利付国債（20年）	3,630,000,000	3,321,341,100	
第158回利付国債（20年）	2,960,000,000	2,800,426,400	
第159回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,720,011,500	
第160回利付国債（20年）	3,630,000,000	3,497,650,200	
第161回利付国債（20年）	3,120,000,000	2,957,136,000	
第162回利付国債（20年）	3,580,000,000	3,379,985,400	
第163回利付国債（20年）	3,330,000,000	3,131,532,000	
第164回利付国債（20年）	3,890,000,000	3,593,815,400	
第165回利付国債（20年）	3,160,000,000	2,906,726,000	
第166回利付国債（20年）	4,360,000,000	4,109,300,000	
第167回利付国債（20年）	2,910,000,000	2,652,959,700	

第168回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,377,082,400	
第169回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,380,734,400	
第170回利付国債(20年)	2,150,000,000	1,872,069,500	
第171回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,355,982,400	
第172回利付国債(20年)	2,790,000,000	2,444,040,000	
第173回利付国債(20年)	3,150,000,000	2,745,162,000	
第174回利付国債(20年)	4,670,000,000	4,048,563,100	
第175回利付国債(20年)	2,920,000,000	2,563,117,600	
第176回利付国債(20年)	2,930,000,000	2,560,585,600	
第177回利付国債(20年)	3,140,000,000	2,682,564,800	
第178回利付国債(20年)	3,420,000,000	2,961,959,400	
第179回利付国債(20年)	3,240,000,000	2,793,268,800	
第180回利付国債(20年)	3,780,000,000	3,425,020,200	
第181回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,620,717,500	
第182回利付国債(20年)	3,080,000,000	2,924,090,400	
第183回利付国債(20年)	2,870,000,000	2,859,323,600	
第184回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,586,779,200	
第185回利付国債(20年)	3,880,000,000	3,649,799,600	
第186回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,774,710,800	
第187回利付国債(20年)	1,030,000,000	997,699,200	
第1回大韓民国	100,000,000	100,293,000	
第2回大韓民国	100,000,000	100,700,000	
国債証券 合計	677,509,000,000	662,487,672,780	
地方債証券			
第5回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,227,000	
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,246,000	
第7回東京都公募公債(30年)	80,000,000	93,334,400	
第10回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,529,000	
第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,268,000	
第20回東京都公募公債(20年)	80,000,000	87,320,000	
第21回東京都公募公債(20年)	80,000,000	88,045,600	
第28回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,278,000	
第33回東京都公募公債(20年)	100,000,000	89,871,000	
第747回東京都公募公債	500,000,000	502,580,000	
第750回東京都公募公債	200,000,000	200,964,000	
第751回東京都公募公債	500,000,000	501,720,000	
第757回東京都公募公債	150,000,000	149,398,500	

第758回東京都公募公債	150,000,000	149,398,500	
第782回東京都公募公債	100,000,000	99,417,000	
第783回東京都公募公債	400,000,000	397,496,000	
第807回東京都公募公債	200,000,000	195,238,000	
第809回東京都公募公債	100,000,000	97,434,000	
平成27年度第1回北海道公募公債	300,000,000	301,104,000	
平成27年度第5回北海道公募公債	100,000,000	100,610,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	98,921,000	
令和3年度第14回北海道公募公債（5年）	400,000,000	397,288,000	
第36回2号宮城県公募公債	342,000,000	333,504,720	
第2回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	217,461,600	
第3回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	513,535,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	118,164,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	541,140,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	104,879,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,922,000	
第234回神奈川県公募公債	100,000,000	99,521,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	97,877,000	
第256回神奈川県公募公債	350,000,000	339,325,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	239,789,000	
第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,054,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,613,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,401,200	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	298,401,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	158,915,200	
第400回大阪府公募公債	136,000,000	136,816,000	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	199,490,000	
第410回大阪府公募公債	200,000,000	198,970,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	99,761,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	300,162,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	99,724,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	99,501,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	128,866,400	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	98,912,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	144,770,640	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	189,068,520	

第464回大阪府公募公債	800,000,000	774,024,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	484,885,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	194,150,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	93,194,690	
第483回大阪府公募公債	200,000,000	200,956,000	
平成26年度第2回京都府公募公債(15年)	200,000,000	206,428,000	
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	105,427,000	
第1回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	414,292,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	300,000,000	322,332,000	
第2回兵庫県公募公債(30年)	90,000,000	102,464,100	
第4回兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	303,876,000	
第5回兵庫県公募公債(12年)	400,000,000	405,716,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	200,000,000	207,974,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,227,000	
第9回兵庫県公募公債(15年)	800,000,000	824,408,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	200,000,000	220,446,000	
第27回兵庫県公募公債(20年)	200,000,000	184,582,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	100,023,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債(グリーン)	100,000,000	98,916,000	
令和5年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,036,000	
第1回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,988,000	
第6回静岡県公募公債(15年)	300,000,000	309,897,000	
第11回静岡県公募公債(20年)	550,000,000	597,844,500	
第14回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,510,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	400,000,000	401,976,000	
令和2年度第15回静岡県公募公債(5年)	120,000,000	119,532,000	
令和2年度第13回静岡県公募公債(5年)	120,000,000	119,532,000	
平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	200,000,000	215,640,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	700,000,000	768,236,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	500,000,000	518,090,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	300,000,000	311,538,000	
平成27年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	100,600,000	
平成27年度第16回愛知県公募公債	100,000,000	100,504,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債	600,000,000	598,884,000	
平成30年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	99,261,000	
平成30年度第8回愛知県公募公債	200,000,000	198,838,000	

令和3年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	96,941,000	
令和5年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,696,000	
平成23年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	108,949,000	
平成26年度第7回広島県公募公債	260,000,000	261,011,400	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,736,000	
平成28年度第4回広島県公募公債	100,000,000	99,581,000	
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	92,114,000	
平成30年度第4回広島県公募公債	200,000,000	198,674,000	
令和3年度第7回広島県公募公債	100,000,000	96,751,000	
第2回埼玉県公募公債(サステナビリティ)	100,000,000	99,834,000	
第3回埼玉県公募公債	200,000,000	201,160,000	
第9回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	220,668,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	109,391,000	
第14回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	212,918,000	
第16回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	102,431,000	
平成29年度第3回埼玉県公募公債	200,000,000	199,550,000	
平成30年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,306,000	
令和2年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	97,952,000	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	110,000,000	109,555,600	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	82,708,500	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	90,861,600	
平成21年度第2回福岡県公募公債(20年)	200,000,000	221,050,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	800,000,000	886,040,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,562,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,523,000	
令和2年度第4回福岡県公募公債	200,000,000	195,318,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン)	100,000,000	99,183,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,918,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	86,936,800	
第13回千葉県公募公債(20年)	300,000,000	324,795,000	
第14回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	103,248,000	
平成27年度第3回千葉県公募公債	200,000,000	201,074,000	
平成27年度第6回千葉県公募公債	500,000,000	502,660,000	
平成28年度第3回千葉県公募公債	400,000,000	398,528,000	
平成30年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,677,000	
令和元年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,165,000	

令和5年度第7回千葉県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	99,427,000	
令和5年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	100,536,000	
平成27年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,033,000	
令和4年度第1回長野県公募公債	300,000,000	291,222,000	
令和5年度第2回長野県公募公債	100,000,000	99,607,000	
第2回群馬県公募公債（20年）	100,000,000	110,252,000	
第7回群馬県公募公債（20年）	100,000,000	91,434,000	
平成27年度第1回岐阜県公募公債	300,000,000	301,776,000	
令和2年度第2回岐阜県公募公債（5年）	100,000,000	99,721,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	204,490,224	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,802,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,347,000	
第148回共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,020,000	
第150回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,158,000	
第151回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,028,000	
第152回共同発行市場公募地方債	700,000,000	704,032,000	
第153回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,064,000	
第158回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,472,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,880,000	
第173回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,232,000	
第185回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,200,000	
第193回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,305,000	
第198回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,876,000	
第232回共同発行市場公募地方債	450,000,000	438,097,500	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,022,000	
平成27年度第1回長崎県公募公債	300,000,000	301,776,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	500,000,000	502,715,000	
平成29年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	99,606,000	
平成30年度第1回福島県公募公債	100,000,000	99,335,000	
第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	99,858,000	
令和元年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,010,000	
令和2年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	97,413,000	
令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）	200,000,000	199,036,000	
令和5年度第2回奈良県公募公債	200,000,000	199,600,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	109,430,000	

第15回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	110,671,000	
令和2年度第3回大阪市公募公債（5年）	500,000,000	498,880,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	116,565,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	107,964,000	
第9回名古屋市公募公債（30年）	90,000,000	98,120,700	
第28回名古屋市公募公債（5年）	500,000,000	498,370,000	
第491回名古屋市公募公債	400,000,000	402,492,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	97,670,000	
第1回京都市公募公債（15年）	100,000,000	101,607,000	
第3回京都市公募公債（20年）	100,000,000	103,537,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	53,040,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	110,000,000	116,064,300	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	216,022,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	109,002,000	
平成23年度第4回神戸市公募公債（20年）	150,000,000	164,343,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	102,789,000	
第7回横浜市公募公債（20年）	450,000,000	465,754,500	
第19回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	219,324,000	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,188,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	402,316,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	301,662,000	
第27回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	107,344,000	
第33回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	91,720,000	
第35回横浜市公募公債（20年）	500,000,000	461,430,000	
第54回横浜市公募公債（5年）	300,000,000	299,163,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	80,000,000	90,098,400	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	109,754,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債	600,000,000	622,908,000	
令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	194,436,000	
令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,552,000	
令和3年度第9回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,518,000	
第7回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,813,000	
第12回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	110,378,000	
第62回川崎市公募公債（5年）	490,000,000	487,638,200	
第3回北九州市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	99,383,000	
第17回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	106,212,000	

	令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	96,137,000	
	令和5年度第4回千葉市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	100,063,000	
	平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,369,000	
	令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	97,413,000	
	平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	199,210,000	
	平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	99,507,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	682,591,000	
	第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	108,399,000	
地方債証券 合計		41,170,400,000	41,894,157,294	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	904,000,000	908,800,240	
	第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	600,000,000	599,208,000	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	97,993,000	
	第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	31,887,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	121,655,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	140,000,000	146,526,800	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	316,338,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	35,898,300	
	第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	234,788,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	212,586,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	127,455,900	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	321,213,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	214,604,000	
	第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	117,755,000	
	第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	356,595,000	
	第42回道路債券（財投機関債）	200,000,000	204,608,000	
	第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	163,542,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,079,000	
	第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,620,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,986,000	

第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,959,000	
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,305,000	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	97,103,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,012,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	300,000,000	303,036,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	100,776,000	
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,031,000	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券 (財投機関債)	100,000,000	102,303,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,686,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,331,000	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,133,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,860,000	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,250,000,000	1,256,937,500	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	101,547,420	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,676,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,451,000	
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,878,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,341,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,984,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,097,000	
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,067,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,258,000	
第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,711,000	
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	54,683,000	
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	100,000,000	119,279,000	

第11回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	108,336,000	
第12回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	306,321,000	
第13回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,284,000	
第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	88,623,200	
第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	86,843,200	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	156,814,500	
第22回公営企業債券（20年）（財投機関債）	1,000,000,000	1,066,770,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	107,473,000	
第24回公営企業債券（20年）（財投機関債）	300,000,000	323,562,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	200,000,000	215,408,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,192,000	
第27回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	100,000,000	99,810,000	
第44回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	102,615,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	303,603,620	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	402,012,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,448,000	
第77回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	301,500,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,669,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,993,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	672,099,320	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	101,698,080	
F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,893,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	299,274,000	
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,891,000	
第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	323,319,750	
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,728,000	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	130,537,570	
F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,269,000	
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	221,410,010	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,046,000	
F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	74,428,200	

F 1 5 1 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,735,000	
F 2 0 3 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	205,518,000	
F 2 3 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,996,000	
第 2 7 回首都高速道路	100,000,000	99,618,000	
第 2 4 回阪神高速道路	200,000,000	199,698,000	
第 1 0 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	87,795,200	
第 1 5 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	86,869,600	
第 4 8 回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	398,972,000	
第 5 4 回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,140,000	
第 4 回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	199,788,000	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	31,247,000	31,001,711	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	32,560,000	32,363,337	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	37,664,000	37,292,256	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	53,950,000	53,323,640	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,078,000	10,109,241	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,448,000	19,296,054	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,522,000	19,324,928	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,736,000	19,506,611	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,095,000	18,854,085	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,738,000	36,075,413	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,074,000	37,422,446	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,594,000	20,289,587	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,000,000	38,999,020	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,535,000	23,370,823	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,728,000	89,301,143	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,277,000	55,217,881	
第 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,495,000	16,033,296	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,022,000	34,234,567	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,676,000	34,839,169	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,834,000	35,981,431	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,714,000	37,928,499	
第 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,424,000	40,632,739	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,400,000	42,670,566	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,335,000	24,046,250	

第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,497,000	24,231,281	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,844,000	51,439,506	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,630,000	52,060,297	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,146,000	52,432,833	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,773,000	29,430,463	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,441,000	28,969,718	
第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,424,000	201,252,051	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,557,000	96,292,120	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,585,000	30,319,299	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,273,000	34,184,014	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,102,000	28,757,338	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	31,056,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,317,000	29,827,408	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,077,000	33,591,347	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,831,000	36,288,920	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,996,000	141,636,753	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,010,000	73,851,075	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,605,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,105,000	39,354,098	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,276,000	120,486,483	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,546,000	42,237,541	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	207,380,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,567,000	53,227,385	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,168,000	50,589,801	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,446,000	52,254,572	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	218,010,000	
第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,602,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,636,000	55,164,763	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,682,000	113,229,379	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,300,000	116,105,139	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,772,000	245,446,484	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	324,355,000	308,990,303	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	526,648,000	500,194,470	

第1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,376,000	131,169,164	
第1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	473,879,000	456,449,730	
第1 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	143,403,000	
第1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	211,116,000	202,342,019	
第1 2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,306,000	
第1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,126,000	67,046,066	
第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,253,000	68,873,004	
第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,825,000	67,664,788	
第1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,994,000	138,711,409	
第1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,020,000	138,401,287	
第1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,412,000	68,931,155	
第1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,801,000	68,377,528	
第1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	219,015,000	208,758,527	
第1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,567,000	69,895,271	
第1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,625,000	71,125,087	
第1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,166,000	143,387,506	
第1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,558,000	142,210,116	
第1 4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,397,000	
第1 4 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,710,000	147,056,689	
第1 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	239,442,000	222,039,355	
第1 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,128,000	227,227,018	
第1 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,062,000	154,080,425	
第1 5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,134,000	77,132,860	
第1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,820,000	154,739,608	
第1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,320,000	80,165,818	
第1 6 1 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,342,000	
第1 6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,712,000	161,971,040	
第1 6 4 回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,504,000	
第1 6 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,948,000	81,530,270	
第1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,657,000	245,918,331	
第1 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,266,000	166,349,959	
第1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,230,000	166,107,045	
第1 7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,958,000	167,836,029	

第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,362,000	83,313,086	
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	180,612,000	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,299,000	85,439,430	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,346,000	169,853,475	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,816,000	171,426,563	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,469,000	86,429,058	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,508,000	172,884,721	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,885,000	87,027,958	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,641,000	87,649,502	
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,978,000	176,755,912	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,356,000	177,461,729	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,992,000	177,577,243	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,021,000	91,865,352	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,236,000	189,233,759	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,157,000	95,688,715	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,576,000	95,617,966	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	387,396,000	386,415,888	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,289,000	96,337,513	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,029,000	96,899,705	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,529,000	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,982,000	194,440,932	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,349,000	294,997,648	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,828,000	197,859,652	
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,926,000	200,684,505	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	399,576,000	400,742,761	
第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,727,000	
第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,320,000	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,876,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	51,277,500	
い第843号商工債券	200,000,000	199,534,000	
い第848号商工債券	100,000,000	99,554,000	
い第850号商工債券	300,000,000	298,440,000	
い第852号商工債券	100,000,000	99,394,000	
い第854号商工債券	500,000,000	496,565,000	

	い第857号商工債券	100,000,000	99,217,000	
	い第871号商工債券	200,000,000	198,894,000	
	い第872号商工債券	400,000,000	399,112,000	
	第376回信金中金債	100,000,000	99,542,000	
	第280号商工債券（3年）	200,000,000	199,382,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,481,000	
	第7回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	76,570,200	
	第83回東日本高速道路	400,000,000	397,832,000	
	第29回西日本高速道路	200,000,000	200,168,000	
	第56回西日本高速道路	900,000,000	897,741,000	
	第61回西日本高速道路	700,000,000	696,045,000	
	第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,198,000	
特殊債券 合計		35,542,287,000	35,807,259,821	
社債券	第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,645,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,752,000	
	第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	493,965,000	
	第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	300,942,000	
	第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,170,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,082,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	197,582,000	
	第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	400,000,000	399,676,000	
	第1回サントンドール銀行（2019）	500,000,000	498,760,000	
	第12回新関西国際空港	100,000,000	102,679,000	
	第27回新関西国際空港	100,000,000	99,526,000	
	第32回成田国際空港	100,000,000	98,318,000	
	第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,321,000	
	第48回鹿島建設（サステナビリティ）	100,000,000	100,006,000	
	第10回明治ホールディングス（サステナビリティ）	200,000,000	198,636,000	
	第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,396,000	
	第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	399,384,000	
	第21回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	300,000,000	298,107,000	
	第22回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	100,000,000	100,240,000	
	第9回サントリーホールディングス	500,000,000	497,825,000	
	第22回味の素	100,000,000	99,991,000	
	第3回 キューピー	100,000,000	99,771,000	

第13回日本たばこ産業	400,000,000	395,708,000	
第16回日本たばこ産業	300,000,000	297,210,000	
第6回ヒューリック	400,000,000	394,792,000	
第24回森ヒルズリート投資法人(グリーン)	300,000,000	299,316,000	
第27回東急不動産ホールディングス(グリーン)	300,000,000	299,484,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,487,000	
第22回旭化成	100,000,000	100,027,000	
第42回王子ホールディングス	300,000,000	297,972,000	
第56回住友化学	200,000,000	198,138,000	
第59回住友化学	200,000,000	196,960,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	98,763,000	
第12回野村総合研究所	200,000,000	199,696,000	
第6回花王	200,000,000	199,360,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	399,300,000	
第17回Zホールディングス	100,000,000	99,538,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	198,504,000	
第7回住友三井オートサービス(サステナビリティ)	100,000,000	98,980,000	
第8回住友三井オートサービス(サステナビリティ)	100,000,000	99,831,000	
第11回ブリヂストン	500,000,000	497,140,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	98,605,000	
第4回新日本製鐵	200,000,000	199,084,000	
第36回ジェイエフイーホールディングス	400,000,000	397,344,000	
第1回住友生命2023基金	400,000,000	396,884,000	
第14回LIXIL	200,000,000	198,860,000	
第1回日本郵政(グリーン)	100,000,000	99,179,000	
第4回日本郵政	500,000,000	500,975,000	
第30回ダイキン工業	200,000,000	197,108,000	
第55回日本精工	100,000,000	99,784,000	
第19回日立製作所	100,000,000	99,129,000	
第17回パナソニック	500,000,000	499,930,000	
第22回パナソニック	100,000,000	98,594,000	
第24回パナソニックホールディングス	300,000,000	299,718,000	
第25回パナソニックホールディングス	400,000,000	403,848,000	
第18回デンソー	300,000,000	297,582,000	
第40回三菱重工業	300,000,000	297,627,000	

第27回J A三井リース	100,000,000	99,753,000	
第26回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	800,000,000	795,216,000	
第27回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	100,000,000	96,438,000	
第31回トヨタ自動車 (サステナビリティ)	200,000,000	196,054,000	
第4回ヤマハ発動機	100,000,000	99,767,000	
第1回明治安田生命2019基金	200,000,000	199,922,000	
第7回アシックス	100,000,000	100,284,000	
第63回三井物産	400,000,000	424,424,000	
第51回住友商事	100,000,000	102,605,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,146,000	
第43回丸井グループ	100,000,000	99,725,000	
第44回丸井グループ	100,000,000	99,506,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	299,847,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	488,475,000	
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	219,520,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	203,882,000	
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	205,054,000	
第30回三菱東京UFJ銀行 (劣後特約付)	100,000,000	107,650,000	
第88回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	105,962,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	97,536,000	
第18回みずほ銀行 (劣後特約付)	100,000,000	102,951,000	
第38回芙蓉総合リース (サステナビリティ)	400,000,000	401,228,000	
第7回みずほリース	200,000,000	197,594,000	
第21回みずほリース	300,000,000	298,386,000	
第22回みずほリース (サステナビリティ)	300,000,000	299,241,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,195,284,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	297,141,000	
第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	300,000,000	298,299,000	
第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	200,000,000	196,274,000	
第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	300,000,000	300,186,000	
第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	300,000,000	301,956,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	200,000,000	202,298,000	
第53回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	296,970,000	

第56回日産フィナンシャルサービス	500,000,000	496,655,000	
第57回日産フィナンシャルサービス	400,000,000	394,420,000	
第30回東京センチュリー	100,000,000	98,712,000	
第34回東京センチュリー	300,000,000	294,099,000	
第96回トヨタファイナンス	800,000,000	795,040,000	
第22回ポケットカード	100,000,000	99,503,000	
第24回ポケットカード	300,000,000	300,300,000	
第42回リコーリース	400,000,000	398,016,000	
第79回アコム	300,000,000	299,775,000	
第189回オリックス	200,000,000	199,758,000	
第220回オリックス	400,000,000	400,500,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	300,159,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	197,796,000	
第24回野村ホールディングス	100,000,000	102,353,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	102,364,000	
第83回三井不動産(グリーン)	200,000,000	194,980,000	
第142回三菱地所(サステナビリティ)	200,000,000	199,022,000	
第143回三菱地所	100,000,000	98,561,000	
第111回住友不動産(グリーン)	100,000,000	99,678,000	
第13回森トラスト総合リート投資法人	200,000,000	199,990,000	
第20回森トラストリート投資法人	200,000,000	199,756,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	207,472,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	199,082,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	322,977,000	
第71回東日本旅客鉄道	400,000,000	431,040,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	206,244,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	596,406,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	397,584,000	
第42回東海旅客鉄道	100,000,000	108,681,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	107,073,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	296,544,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	197,846,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	199,002,000	
第68回名古屋鉄道(サステナビリティ)	200,000,000	198,062,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	300,705,000	
第31回KDDI(サステナビリティ)	200,000,000	199,016,000	

第9回ソフトバンク	600,000,000	589,566,000	
第13回ソフトバンク	500,000,000	469,180,000	
第16回ソフトバンク	500,000,000	466,365,000	
第21回ソフトバンク	700,000,000	693,483,000	
第22回ソフトバンク	300,000,000	295,494,000	
第548回東京電力	100,000,000	102,983,000	
第567回東京電力	100,000,000	100,645,000	
第508回関西電力	200,000,000	199,828,000	
第510回関西電力	500,000,000	499,320,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,506,000	
第518回関西電力	200,000,000	198,252,000	
第524回関西電力	200,000,000	198,342,000	
第393回中国電力	100,000,000	99,583,000	
第400回中国電力	200,000,000	198,720,000	
第409回中国電力	200,000,000	197,654,000	
第433回中国電力	700,000,000	696,192,000	
第448回中国電力	200,000,000	196,780,000	
第322回北陸電力	100,000,000	99,616,000	
第485回東北電力	100,000,000	99,609,000	
第492回東北電力	300,000,000	299,553,000	
第494回東北電力	200,000,000	199,532,000	
第529回東北電力	500,000,000	496,430,000	
第552回東北電力	400,000,000	403,388,000	
第449回九州電力	300,000,000	299,694,000	
第451回九州電力	300,000,000	299,670,000	
第468回九州電力	100,000,000	98,987,000	
第471回九州電力	300,000,000	296,652,000	
第484回九州電力	400,000,000	390,876,000	
第503回九州電力	600,000,000	598,062,000	
第511回九州電力	600,000,000	601,080,000	
第49回電源開発	500,000,000	498,595,000	
第50回電源開発	200,000,000	199,268,000	
第57回電源開発	100,000,000	98,725,000	
第59回電源開発	300,000,000	296,484,000	
第64回電源開発	600,000,000	590,724,000	
第67回電源開発	200,000,000	194,712,000	

第86回電源開発	100,000,000	98,431,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,334,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	299,109,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,899,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,358,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	401,060,000	
第31回東京電力パワーグリッド	300,000,000	299,928,000	
第33回東京電力パワーグリッド	200,000,000	200,062,000	
第35回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,899,000	
第39回東京電力パワーグリッド	400,000,000	400,320,000	
第47回東京電力パワーグリッド	200,000,000	192,518,000	
第49回東京電力パワーグリッド	400,000,000	398,724,000	
第16回JERA	200,000,000	199,810,000	
第17回JERA	200,000,000	200,582,000	
第21回JERA	200,000,000	199,748,000	
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	401,276,000	
第51回大阪ガス	100,000,000	98,286,000	
第13回広島ガス	200,000,000	197,234,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	99,182,000	
社債券 合計	47,000,000,000	46,855,286,000	
合計	801,221,687,000	787,044,375,895	

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。

先進国高格付国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	60
コール・ローン	695,738,688
国債証券	76,466,227,746
派生商品評価勘定	2,354,196
未収利息	78,926,222

前払費用	3,570,041
流動資産合計	77,246,816,953
資産合計	77,246,816,953
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	215,726,119
未払利息	100
流動負債合計	215,726,219
負債合計	215,726,219
純資産の部	
元本等	
元本	77,134,511,277
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△103,420,543
元本等合計	77,031,090,734
純資産合計	77,031,090,734
負債純資産合計	77,246,816,953

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礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	84,279,715,638円
期中追加設定元本額	180,047,165円
期中一部解約元本額	7,325,251,526円
元本の内訳※	
国内債券セレクション(ラップ向け)	1,256,808,037円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	14,274,738円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	18,569,426円
MUAM 先進国高格付国債ファンド(適格機関投資家転売制限付)	44,814,863,270円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-09(適格機関投資家転売制限付)	582,436,164円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-10(適格機関投資家転売制限付)	248,836,841円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-11(適格機関投資家転売制限付)	595,682,073円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2016-12(適格機関	1,157,935,398円

投資家転売制限付)	
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-03 (適格機関投資家転売制限付)	853,843,524 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-05 (適格機関投資家転売制限付)	4,367,264,083 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-07 (適格機関投資家転売制限付)	2,844,425,743 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-09 (適格機関投資家転売制限付)	2,035,807,384 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2017-11 (適格機関投資家転売制限付)	3,747,537,151 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-01 (適格機関投資家転売制限付)	4,115,581,291 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-03 (適格機関投資家転売制限付)	3,297,321,283 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-06 (適格機関投資家転売制限付)	1,880,888,627 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-07 (適格機関投資家転売制限付)	424,153,035 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-09 (適格機関投資家転売制限付)	3,161,648,684 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-10 (適格機関投資家転売制限付)	1,035,664,490 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2018-11 (適格機関投資家転売制限付)	428,936,006 円
MUKAM 先進国高格付国債ファンド2019-03 (適格機関投資家転売制限付)	252,034,029 円
合計	77,134,511,277 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。	103,420,543 円
3. 受益権の総数	77,134,511,277 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 2023 年 2 月 7 日 至 2024 年 2 月 5 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、この結果はリスク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。

当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年2月5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	[2024年2月5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	619,454,835
合計	619,454,835

(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

[2024年2月5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 買建 オーストラリアドル	258,921,658	—	257,923,770	△997,888
	売建 オーストラリアドル	16,000,950,161	—	16,213,324,196	△212,374,035
合計		16,259,871,819	—	16,471,247,966	△213,371,923

(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。

① 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。

② 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ではありません。

(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)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	0.9987円
(1万口当たり純資産額)	(9,987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

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
円	国債証券	第145回利付国債(5年)	7,800,000,000	7,807,566,000	
		第344回利付国債(10年)	7,150,000,000	7,151,859,000	
		第348回利付国債(10年)	8,000,000,000	7,981,280,000	
		第352回利付国債(10年)	7,110,000,000	7,049,991,600	
		第356回利付国債(10年)	6,700,000,000	6,616,786,000	
		第360回利付国債(10年)	8,700,000,000	8,537,136,000	
		第364回利付国債(10年)	6,800,000,000	6,597,904,000	
		第368回利付国債(10年)	8,800,000,000	8,511,448,000	
円合計			61,060,000,000	60,253,970,600	
オーストラリアドル	国債証券	1 AUST GOVT 311121	104,000,000.00	84,087,842.80	
		1.75 AUST GOVT 321121	100,000,000.00	83,827,819.00	
オーストラリアドル合計			204,000,000.00	167,915,661.80	
				(16,212,257,146)	
合計				76,466,227,746	
				(16,212,257,146)	

(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
オーストラリアドル	国債証券 2 銘柄	100.00%	21.20%

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。

MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	40,089,331
コール・ローン	1,755,055,707
国債証券	54,571,827,053
派生商品評価勘定	61,326
未収利息	329,424,088
前払費用	79,195,951
流動資産合計	56,775,653,456
資産合計	56,775,653,456
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,381,970,342
未払金	38,096,593
未払解約金	22,700,880
未払利息	254
流動負債合計	1,442,768,069
負債合計	1,442,768,069
純資産の部	
元本等	
元本	39,224,598,927
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	16,108,286,460
元本等合計	55,332,885,387
純資産合計	55,332,885,387
負債純資産合計	56,775,653,456

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礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	38,659,250,747円
期中追加設定元本額	6,066,516,440円
期中一部解約元本額	5,501,168,260円
元本の内訳※	
国内債券セレクション(ラップ向け)	4,175,314,181円
三菱UFJ ヘッジ付外国債券オープン	4,628,730,954円
MUAM ヘッジ付外国債券オープンII(適格機関投資家限定)	4,294,759,419円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	22,075,673,221円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	577,910,956円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,054,768,095円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	849,795,536円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	828,232円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	442,049,133円
アドバンスト・バランスI(FOFs用)(適格機関投資家限定)	52,559,963円
アドバンスト・バランスII(FOFs用)(適格機関投資家限定)	72,209,237円
合計	39,224,598,927円
2. 受益権の総数	39,224,598,927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2023年2月7日 至2024年2月5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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>
-------------------	---

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年2月5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年2月5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	855,435,990
合計	855,435,990

(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

[2024年2月5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	23,309,026,065	—	24,181,568,541	△872,542,476
	オーストラリアドル	3,276,341,550	—	3,276,280,224	61,326
	イギリスポンド	3,004,225,500	—	3,080,233,966	△76,008,466
	スウェーデンクローネ	2,835,475,827	—	2,839,953,104	△4,477,277
	ポーランドズロチ	295,713,440	—	295,862,612	△149,172
	中国元	4,384,836,248	—	4,524,550,992	△139,714,744
ユーロ	15,762,772,472	—	16,051,850,679	△289,078,207	

合計	52,868,391,102	—	54,250,300,118	△1,381,909,016
----	----------------	---	----------------	----------------

(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。

①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。

②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ではありません。

(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)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	1.4107円
(1万口当たり純資産額)	(14,107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

(単位：円)

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	0.25 T-NOTE 250731	5,650,000.00	5,304,268.53	
		0.25 T-NOTE 250831	3,340,000.00	3,125,509.37	
		0.5 T-NOTE 260228	200,000.00	184,960.93	
		0.5 T-NOTE 270531	150,000.00	133,382.81	
		0.5 T-NOTE 271031	380,000.00	333,464.84	
		0.625 T-NOTE 271231	4,710,000.00	4,132,105.08	
		0.625 T-NOTE 300515	1,230,000.00	1,000,432.03	
		0.75 T-NOTE 260831	3,420,000.00	3,135,178.12	
		0.875 T-NOTE 260630	240,000.00	221,901.56	
		0.875 T-NOTE 301115	1,760,000.00	1,437,768.74	
		1.125 T-NOTE 250115	1,450,000.00	1,400,673.65	
		1.125 T-NOTE 310215	2,390,000.00	1,981,319.34	
		1.25 T-BOND 500515	3,610,000.00	1,877,200.00	

1. 25 T-NOTE 261130	2, 230, 000. 00	2, 059, 091. 41	
1. 25 T-NOTE 280331	160, 000. 00	143, 071. 87	
1. 25 T-NOTE 280531	8, 040, 000. 00	7, 160, 625. 00	
1. 25 T-NOTE 310815	3, 900, 000. 00	3, 207, 216. 79	
1. 375 T-BOND 401115	180, 000. 00	117, 112. 50	
1. 375 T-NOTE 250131	350, 000. 00	338, 408. 81	
1. 375 T-NOTE 311115	1, 450, 000. 00	1, 196, 448. 24	
1. 5 T-NOTE 270131	2, 000, 000. 00	1, 852, 968. 76	
1. 75 T-NOTE 291115	600, 000. 00	533, 003. 90	
1. 875 T-BOND 511115	2, 790, 000. 00	1, 702, 553. 92	
1. 875 T-NOTE 290228	3, 000, 000. 00	2, 709, 843. 75	
1. 875 T-NOTE 320215	8, 380, 000. 00	7, 154, 752. 32	
2 T-BOND 411115	550, 000. 00	391, 004. 88	
2. 25 T-BOND 520215	2, 210, 000. 00	1, 480, 656. 83	
2. 375 T-BOND 420215	1, 300, 000. 00	980, 103. 51	
2. 5 T-BOND 460215	6, 980, 000. 00	5, 133, 026. 52	
2. 625 T-NOTE 290731	5, 920, 000. 00	5, 518, 550. 00	
2. 75 T-NOTE 270430	3, 190, 000. 00	3, 058, 973. 23	
2. 75 T-NOTE 320815	230, 000. 00	208, 841. 79	
2. 875 T-BOND 520515	2, 930, 000. 00	2, 258, 961. 32	
2. 875 T-NOTE 250615	5, 300, 000. 00	5, 180, 853. 50	
2. 875 T-NOTE 290430	110, 000. 00	104, 156. 25	
2. 875 T-NOTE 320515	2, 140, 000. 00	1, 967, 378. 91	
3 T-BOND 470515	3, 860, 000. 00	3, 083, 778. 12	
3. 125 T-NOTE 270831	230, 000. 00	222, 686. 71	
3. 25 T-BOND 420515	4, 590, 000. 00	3, 957, 978. 52	
3. 375 T-BOND 481115	1, 220, 000. 00	1, 037, 047. 65	
3. 5 T-NOTE 250915	1, 100, 000. 00	1, 082, 876. 94	
3. 5 T-NOTE 330215	2, 360, 000. 00	2, 265, 415. 63	
3. 625 T-BOND 530215	400, 000. 00	358, 304. 68	
3. 625 T-BOND 530515	4, 600, 000. 00	4, 125, 265. 64	
3. 625 T-NOTE 280331	800, 000. 00	787, 406. 24	
3. 75 T-NOTE 260415	1, 200, 000. 00	1, 186, 312. 50	
3. 875 T-BOND 430515	620, 000. 00	581, 443. 75	
3. 875 T-NOTE 250331	5, 570, 000. 00	5, 516, 584. 59	
3. 875 T-NOTE 291130	5, 560, 000. 00	5, 518, 517. 17	

		4 T-BOND 421115	2,540,000.00	2,430,462.50	
		4 T-NOTE 251215	7,170,000.00	7,116,785.12	
		4 T-NOTE 280229	4,000,000.00	3,992,187.52	
		4 T-NOTE 300731	1,090,000.00	1,088,509.76	
		4.125 T-NOTE 271031	6,660,000.00	6,669,365.62	
		4.375 T-BOND 430815	6,840,000.00	6,867,787.50	
		4.375 T-NOTE 280831	5,030,000.00	5,105,450.00	
		4.5 T-NOTE 331115	1,470,000.00	1,525,699.21	
		4.625 T-NOTE 260915	11,200,000.00	11,313,531.26	
		4.75 T-BOND 431115	5,950,000.00	6,279,574.18	
		4.75 T-BOND 531115	1,720,000.00	1,873,321.86	
アメリカドル合計			178,250,000.00	162,712,061.68 (24,205,046,295)	
オーストラリアドル	国債証券	1 AUST GOVT 301221	20,680,000.00	17,219,636.28	
		1.5 AUST GOVT 310621	20,200,000.00	17,200,803.38	
オーストラリアドル合計			40,880,000.00	34,420,439.66 (3,323,293,449)	
イギリスポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	270,000.00	249,655.50	
		0.125 GILT 280131	860,000.00	743,426.31	
		0.25 GILT 310731	1,240,000.00	954,669.80	
		0.375 GILT 301022	490,000.00	392,328.30	
		0.5 GILT 290131	640,000.00	545,011.20	
		0.625 GILT 250607	520,000.00	494,531.23	
		0.625 GILT 350731	650,000.00	445,120.00	
		0.875 GILT 460131	5,460,000.00	2,717,442.00	
		1 GILT 320131	640,000.00	515,616.00	
		1.125 GILT 390131	4,360,000.00	2,827,460.00	
		1.25 GILT 270722	90,000.00	82,421.10	
		1.25 GILT 411022	2,400,000.00	1,474,560.00	
		1.5 GILT 260722	760,000.00	715,996.00	
		1.5 GILT 530731	180,000.00	92,262.60	
		1.625 GILT 281022	310,000.00	281,697.00	
		2 GILT 250907	800,000.00	770,878.40	
		3.25 GILT 330131	910,000.00	865,050.73	
		4 GILT 631022	700,000.00	639,100.00	
4.125 GILT 270129	590,000.00	591,660.26			

		4.75 GILT 431022	1,020,000.00	1,054,782.00	
		6 GILT 281207	80,000.00	87,714.04	
イギリスポンド合計			22,970,000.00	16,541,382.47 (3,102,501,696)	
スウェーデン クローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 291112	9,090,000.00	8,421,191.97	
		1 SWD GOVT 261112	117,180,000.00	112,836,805.32	
		1.75 SWD GOVT 331111	84,700,000.00	81,491,253.15	
スウェーデンクローネ合計			210,970,000.00	202,749,250.44 (2,864,846,908)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	1,600,000.00	1,414,337.60	
		0.75 POLAND 250425	810,000.00	770,626.71	
		1.25 POLAND 301025	2,770,000.00	2,186,308.37	
		3.75 POLAND 270525	2,140,000.00	2,063,689.74	
		7.5 POLAND 280725	1,370,000.00	1,502,837.66	
ポーランドズロチ合計			8,690,000.00	7,937,800.08 (294,482,857)	
中国元	国債証券	2.24 CHINA GOVT 250525	13,000,000.00	13,027,911.00	
		2.4 CHINA GOVT 280715	33,000,000.00	33,066,564.30	
		2.52 CHINA GOVT 330825	5,000,000.00	5,027,408.50	
		2.55 CHINA GOVT 281015	30,000,000.00	30,318,180.00	
		2.6 CHINA GOVT 300915	25,000,000.00	25,273,752.50	
		2.62 CHINA GOVT 280415	15,000,000.00	15,204,174.00	
		2.67 CHINA GOVT 330525	15,000,000.00	15,238,224.00	
		2.67 CHINA GOVT 331125	5,000,000.00	5,106,409.00	
		2.75 CHINA GOVT 290615	41,000,000.00	41,775,162.40	
		2.76 CHINA GOVT 320515	15,000,000.00	15,317,518.50	
		2.8 CHINA GOVT 300325	3,000,000.00	3,061,881.00	
		2.8 CHINA GOVT 321115	15,000,000.00	15,363,478.50	
		3.12 CHINA GOVT 521025	2,000,000.00	2,168,421.80	
中国元合計			217,000,000.00	219,949,085.50 (4,546,655,526)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	840,000.00	810,388.32	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	1,780,000.00	1,484,546.70	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	640,000.00	390,658.56	
		0 BEL GOVT 271022	1,340,000.00	1,223,164.06	
		0 BEL GOVT 311022	3,040,000.00	2,485,629.40	

0 BUND 271115	150,000.00	138,162.60	
0 BUND 281115	230,000.00	207,954.96	
0 BUND 290815	180,000.00	160,362.72	
0 BUND 300215	390,000.00	343,791.63	
0 BUND 300815	120,000.00	104,837.52	
0 BUND 310215	1,730,000.00	1,493,266.80	
0 BUND 350515	3,650,000.00	2,824,176.55	
0 BUND 360515	710,000.00	534,178.44	
0 BUND 500815	1,260,000.00	672,867.72	
0 BUND 520815	710,000.00	360,042.42	
0 FINNISH GOVT 260915	400,000.00	374,207.20	
0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	633,519.15	
0 IRISH GOVT 311018	550,000.00	456,061.32	
0 ITALY GOVT 260401	970,000.00	909,465.21	
0 ITALY GOVT 260801	130,000.00	120,754.12	
0 NETH GOVT 290115	1,120,000.00	997,762.19	
0 NETH GOVT 300715	730,000.00	627,065.83	
0 NETH GOVT 310715	270,000.00	226,157.90	
0 NETH GOVT 380115	170,000.00	117,109.09	
0 NETH GOVT 520115	1,170,000.00	574,624.44	
0 O. A. T 250225	2,580,000.00	2,496,431.22	
0 O. A. T 250325	1,190,000.00	1,149,349.60	
0 O. A. T 260225	620,000.00	587,676.30	
0 O. A. T 270225	880,000.00	815,755.60	
0 O. A. T 291125	120,000.00	104,068.15	
0 O. A. T 301125	160,000.00	134,955.20	
0 O. A. T 311125	1,520,000.00	1,245,717.52	
0 O. A. T 320525	120,000.00	96,814.68	
0 OBL 250411	260,000.00	251,001.66	
0 OBL 251010	160,000.00	153,037.33	
0 OBL 251010	70,000.00	67,071.17	
0 OBL 260410	100,000.00	94,818.05	
0 OBL 261009	140,000.00	131,520.06	
0 OBL 270416	870,000.00	809,782.08	
0 SPAIN GOVT 250131	820,000.00	793,857.17	
0 SPAIN GOVT 250531	310,000.00	297,752.85	

0 SPAIN GOVT 280131	1, 400, 000. 00	1, 257, 097. 80	
0. 1 BEL GOVT 300622	1, 000, 000. 00	857, 649. 50	
0. 1 SPAIN GOVT 310430	260, 000. 00	212, 621. 50	
0. 2 IRISH GOVT 270515	40, 000. 00	37, 266. 60	
0. 2 IRISH GOVT 301018	190, 000. 00	164, 108. 85	
0. 25 AUSTRIA GOVT 361020	960, 000. 00	689, 834. 88	
0. 25 FINNISH GOVT 400915	710, 000. 00	456, 893. 52	
0. 25 ITALY GOVT 280315	230, 000. 00	205, 148. 27	
0. 25 NETH GOVT 290715	100, 000. 00	89, 353. 80	
0. 35 BEL GOVT 320622	400, 000. 00	330, 140. 00	
0. 4 BEL GOVT 400622	820, 000. 00	533, 263. 22	
0. 4 IRISH GOVT 350515	520, 000. 00	406, 293. 68	
0. 5 BUND 250215	310, 000. 00	301, 785. 57	
0. 5 BUND 270815	740, 000. 00	697, 549. 16	
0. 5 BUND 280215	350, 000. 00	327, 731. 25	
0. 5 FINNISH GOVT 280915	140, 000. 00	127, 896. 95	
0. 5 ITALY GOVT 260201	100, 000. 00	95, 113. 52	
0. 5 NETH GOVT 260715	70, 000. 00	66, 691. 66	
0. 5 NETH GOVT 320715	1, 300, 000. 00	1, 107, 431. 61	
0. 5 O. A. T 250525	1, 180, 000. 00	1, 143, 050. 66	
0. 5 O. A. T 260525	100, 000. 00	95, 354. 20	
0. 5 O. A. T 290525	120, 000. 00	108, 312. 60	
0. 5 O. A. T 400525	1, 010, 000. 00	678, 264. 49	
0. 5 O. A. T 440625	4, 130, 000. 00	2, 502, 090. 29	
0. 5 O. A. T 720525	1, 260, 000. 00	492, 694. 02	
0. 55 IRISH GOVT 410422	230, 000. 00	157, 347. 14	
0. 6 ITALY GOVT 310801	1, 490, 000. 00	1, 210, 097. 33	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	410, 000. 00	186, 937. 04	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	120, 000. 00	99, 984. 00	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	1, 260, 000. 00	1, 200, 727. 08	
0. 75 NETH GOVT 280715	480, 000. 00	447, 650. 88	
0. 75 O. A. T 280525	1, 410, 000. 00	1, 312, 000. 77	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	780, 000. 00	730, 270. 32	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	1, 680, 000. 00	1, 509, 672. 70	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	260, 000. 00	187, 732. 74	
0. 875 FINNISH GOV 250915	560, 000. 00	543, 353. 44	

0. 9 BEL GOVT 290622	70,000.00	64,479.80	
0. 9 IRISH GOVT 280515	810,000.00	762,744.19	
0. 9 ITALY GOVT 310401	1,950,000.00	1,638,782.92	
0. 95 ITALY GOVT 320601	410,000.00	333,712.12	
0. 95 ITALY GOVT 370301	390,000.00	270,621.78	
1 BEL GOVT 260622	940,000.00	905,735.12	
1 BUND 250815	1,160,000.00	1,129,178.99	
1 BUND 380515	2,750,000.00	2,284,062.00	
1 O. A. T 251125	190,000.00	184,222.86	
1 O. A. T 270525	1,250,000.00	1,191,346.25	
1. 1 IRISH GOVT 290515	310,000.00	290,289.70	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	810,000.00	567,109.35	
1. 25 O. A. T 340525	1,530,000.00	1,322,995.59	
1. 25 O. A. T 380525	3,960,000.00	3,151,320.48	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	760,000.00	684,129.96	
1. 3 OBL 271015	1,990,000.00	1,926,280.20	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	120,000.00	115,499.21	
1. 35 ITALY GOVT 300401	110,000.00	97,976.01	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	250,000.00	236,760.44	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	100,000.00	94,406.40	
1. 45 BEL GOVT 370622	300,000.00	248,423.40	
1. 45 ITALY GOVT 250515	300,000.00	293,466.15	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	750,000.00	365,392.50	
1. 5 ITALY GOVT 450430	800,000.00	498,532.80	
1. 5 O. A. T 500525	1,570,000.00	1,095,844.30	
1. 6 BEL GOVT 470622	260,000.00	189,397.26	
1. 7 BEL GOVT 500622	250,000.00	179,848.62	
1. 7 BUND 320815	220,000.00	212,265.90	
1. 8 ITALY GOVT 410301	570,000.00	405,840.00	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	100,000.00	79,126.00	
1. 85 ITALY GOVT 250701	280,000.00	274,916.32	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	4,250,000.00	3,672,042.50	
2 ITALY GOVT 251201	50,000.00	49,082.27	
2. 2 ITALY GOVT 270601	350,000.00	341,257.00	
2. 2 OBL 280413	1,090,000.00	1,090,207.10	
2. 4 BUND 301115	130,000.00	131,945.84	

	2. 4 IRISH GOVT 300515	1, 200, 000. 00	1, 198, 438. 39	
	2. 4 OBL 281019	100, 000. 00	100, 985. 30	
	2. 5 BUND 440704	1, 870, 000. 00	1, 877, 036. 81	
	2. 5 ITALY GOVT 321201	2, 500, 000. 00	2, 291, 842. 50	
	2. 5 O. A. T 260924	100, 000. 00	99, 788. 10	
	2. 6 BUND 330815	90, 000. 00	93, 002. 85	
	2. 625 FINNISH GOV 420704	130, 000. 00	123, 054. 98	
	2. 65 ITALY GOVT 271201	200, 000. 00	197, 187. 00	
	2. 75 FINNISH GOVT 280704	290, 000. 00	293, 033. 98	
	2. 75 NETH GOVT 470115	370, 000. 00	375, 147. 81	
	2. 75 O. A. T 271025	1, 140, 000. 00	1, 150, 123. 20	
	2. 75 O. A. T 290225	1, 460, 000. 00	1, 476, 941. 84	
	2. 8 ITALY GOVT 281201	990, 000. 00	975, 262. 86	
	2. 8 ITALY GOVT 290615	500, 000. 00	488, 975. 59	
	2. 8 SPAIN GOVT 260531	370, 000. 00	369, 803. 30	
	2. 9 SPAIN GOVT 461031	130, 000. 00	113, 986. 60	
	3 O. A. T 540525	1, 530, 000. 00	1, 445, 699. 83	
	3. 1 ITALY GOVT 400301	1, 480, 000. 00	1, 294, 628. 52	
	3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	100, 000. 00	101, 340. 80	
	3. 25 BUND 420704	90, 000. 00	100, 208. 16	
	3. 25 ITALY GOVT 380301	1, 720, 000. 00	1, 567, 518. 56	
	3. 25 ITALY GOVT 460901	610, 000. 00	521, 936. 74	
	3. 4 ITALY GOVT 280401	890, 000. 00	900, 435. 78	
	3. 45 SPAIN GOVT 430730	2, 020, 000. 00	1, 948, 374. 84	
	3. 7 ITALY GOVT 300615	1, 360, 000. 00	1, 384, 609. 20	
	3. 85 ITALY GOVT 260915	1, 270, 000. 00	1, 296, 703. 02	
	3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 360, 000. 00	2, 426, 113. 04	
	3. 9 SPAIN GOVT 390730	700, 000. 00	725, 298. 70	
	4. 4 ITALY GOVT 330501	90, 000. 00	95, 115. 78	
	4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 170, 000. 00	1, 193, 173. 02	
	4. 5 BEL GOVT 260328	400, 000. 00	415, 150. 00	
	5 ITALY GOVT 390801	190, 000. 00	207, 879. 00	
	ユーロ合計	117, 620, 000. 00	101, 297, 811. 96 (16, 235, 000, 322)	
	合計		54, 571, 827, 053 (54, 571, 827, 053)	

(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 60 銘柄	100.00%	44.35%
オーストラリアドル	国債証券 2 銘柄	100.00%	6.09%
イギリスポンド	国債証券 21 銘柄	100.00%	5.69%
スウェーデンクローネ	国債証券 3 銘柄	100.00%	5.25%
ポーランドズロチ	国債証券 5 銘柄	100.00%	0.54%
中国元	国債証券 13 銘柄	100.00%	8.33%
ユーロ	国債証券 145 銘柄	100.00%	29.75%

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。

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)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	343,214,973
コール・ローン	5,565,659,133
国債証券	3,200,403,400
特殊債券	238,579,612
社債券	5,999,942,069
派生商品評価勘定	2,193,516
未収入金	151,486,771
未収利息	39,282,057
前払費用	16,885,966
差入委託証拠金	166,111,921
流動資産合計	15,723,759,418
資産合計	15,723,759,418
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,491,013
未払金	500,174,500
未払利息	806

流動負債合計	562,666,319
負債合計	562,666,319
純資産の部	
元本等	
元本	15,837,094,924
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	△676,001,825
元本等合計	15,161,093,099
純資産合計	15,161,093,099
負債純資産合計	15,723,759,418

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	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。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礎となる事項	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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	14,938,071,639円
期中追加設定元本額	2,485,432,172円
期中一部解約元本額	1,586,408,887円
元本の内訳※	
国内債券セレクション(ラップ向け)	15,387,172,529円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	190,039,150円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	259,883,245円
合計	15,837,094,924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。	676,001,825円
3. 受益権の総数	15,837,094,924口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年2月7日 至2024年2月5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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>す。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>
-------------------	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 2月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	[2024年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,831,300
特殊債券	1,009,298
社債券	113,524,805
合計	112,702,803

(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

債券関連

[2024年 2月 5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	債券先物取引				
	売建	1,530,317,968	—	1,545,249,414	△14,931,446
	合計	1,530,317,968	—	1,545,249,414	△14,931,446

(注) 時価の算定方法

- 1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
 - 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 - 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※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。

通貨関連

[2024年2月5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	952,524,144	—	975,011,778	△22,487,634
	カナダドル	259,876,107	—	265,248,108	△5,372,001
	オーストラリアドル	2,564,785,580	—	2,565,434,916	△649,336
	イギリスポンド	78,512,195	—	79,762,850	△1,250,655
	ユーロ	1,944,361,334	—	1,959,967,759	△15,606,425
	合計	5,800,059,360	—	5,845,425,411	△45,366,051

(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。
 - ①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。
 - ②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)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	0.9573円
(1万口当たり純資産額)	(9,573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

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
円	国債証券	第446回利付国債(2年)	500,000,000	500,050,000		
		第447回利付国債(2年)	200,000,000	200,010,000		
		第1139回国庫短期証券	200,000,000	200,008,400		
		第1180回国庫短期証券	200,000,000	200,029,800		
		第1192回国庫短期証券	300,000,000	300,006,300		
		第1196回国庫短期証券	500,000,000	500,030,000		
		第1197回国庫短期証券	800,000,000	800,094,400		
		第1209回国庫短期証券	500,000,000	500,174,500		
	国債証券 小計			3,200,000,000	3,200,403,400	
	社債券	第6回フランス電力	100,000,000	99,450,000		
		第24回ルノー	300,000,000	300,909,000		
		第9回JXホールディングス	100,000,000	100,224,000		
		第497回関西電力	200,000,000	201,832,000		
		第34回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,327,000		
第1回東京電力リニューアブルパワー(グリーン)		100,000,000	99,886,000			
社債券 小計			900,000,000	902,628,000		
円合計			4,100,000,000	4,103,031,400		
アメリカドル	社債券	2.512 SUMITOMO MI 250122	1,000,000.00	972,519.77		
		3.522 NISSAN MOTO 250917	2,000,000.00	1,929,926.82		
		FRN MACQUARIE B 251014	200,000.00	199,091.23		
		FRN MORGAN STA 300123	1,000,000.00	970,888.93		
アメリカドル合計			4,200,000.00	4,072,426.75 (605,814,203)		
カナダドル	社債券	2.975 WELLS FARGO 260519	1,000,000.00	958,006.05		
		3.8 TRANSCANADA P 270405	1,000,000.00	974,284.67		
カナダドル合計			2,000,000.00	1,932,290.72 (213,170,312)		
オーストラリアドル	特殊債券	3.4 ASIAN DEV 270910	1,000,000.00	976,378.23		
		4 KFW 250227	1,500,000.00	1,494,669.03		

	特殊債券 小計		2,500,000.00	2,471,047.26 (238,579,612)
	社債券	1.873 CENTRAL NIP 240926	1,000,000.00	978,216.17
		2.6 VICINITY CENT 250627	1,000,000.00	969,270.24
		3 MCDONALD'S CORP 240308	1,000,000.00	998,604.23
		3.25 COMMONWEALT 261117	4,000,000.00	3,869,332.00
		3.25 SUNCORP-MET 260824	5,000,000.00	4,838,301.60
		3.5 VICINITY CENT 240426	500,000.00	498,494.89
		3.8 WESTPAC BAN 250520	2,000,000.00	1,981,501.96
		4.75 MERCEDES-BEN 260119	1,000,000.00	1,004,146.80
		4.95 VOLKSWAGEN F 260413	2,500,000.00	2,496,036.97
		5.35 VOLKSWAGEN F 260915	2,500,000.00	2,512,596.25
		5.805 MITSUBISHI 261207	4,000,000.00	4,071,525.60
	社債券 小計		24,500,000.00	24,218,026.71 (2,338,250,478)
オーストラリアドル合計			27,000,000.00	26,689,073.97 (2,576,830,090)
ユーロ	社債券	0.163 NATIONAL GR 280120	1,000,000.00	880,110.00
		0.375 WOOLWORTHS 281115	1,000,000.00	856,712.00
		0.625 MACQUARIE B 270203	1,000,000.00	920,011.00
		1.125 VICINITY CE 291107	2,000,000.00	1,706,064.00
		1.45 SCENTRE GRO 290328	1,000,000.00	882,285.00
		1.5 DIGITAL DUTCH 300315	1,000,000.00	865,543.46
		2 AUTOSTRAD PER 281204	1,000,000.00	919,736.00
		2.5 DIGITAL EURO 260116	1,000,000.00	972,125.26
		3.201 NISSAN MOTO 280917	1,000,000.00	959,261.71
		FRN JP MORGAN 311113	3,000,000.00	3,143,218.50
ユーロ合計			13,000,000.00	12,105,066.93 (1,940,079,076)
合計				9,438,925,081 (5,335,893,681)

(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	社債券	4 銘柄	100.00%	6.42%
カナダドル	社債券	2 銘柄	100.00%	2.26%
オーストラリアドル	特殊債券	2 銘柄	9.26%	2.53%
	社債券	11 銘柄	90.74%	24.77%
ユーロ	社債券	10 銘柄	100.00%	20.55%

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。

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年2月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	640,721,564
国債証券	17,638,136,500
特殊債券	596,788,000
社債券	10,048,204,000
未収利息	57,588,657
前払費用	5,841,487
流動資産合計	28,987,280,208
資産合計	28,987,280,208
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,785,901
未払利息	92
流動負債合計	16,785,993
負債合計	16,785,993
純資産の部	
元本等	
元本	20,844,336,243
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	8,126,157,972
元本等合計	28,970,494,215
純資産合計	28,970,494,215
負債純資産合計	28,987,280,208

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。
--------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年2月5日現在]
1. 期首	2023年2月7日
期首元本額	11,584,053,406円
期中追加設定元本額	10,178,206,524円
期中一部解約元本額	917,923,687円
元本の内訳※	
国内債券セレクション(ラップ向け)	16,682,202,659円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	206,806,843円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	284,438,501円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式20型	497,078,713円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式40型	489,379,991円
三菱UFJ ライフプラン 25	504,788,371円
三菱UFJ ライフプラン 50	708,630,942円
三菱UFJ ライフプラン 75	243,030,908円
三菱UFJ ライフプラン 50VA(適格機関投資家限定)	161,088,700円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	20,322,610円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	75,854,634円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	99,746,991円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	52,559,236円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	24,657,805円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	42,952,500円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	15,736,754円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	11,718,010円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	109,605,167円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	168,066,255円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	83,386,744円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	83,806,486円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	142,038,206円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040	136,439,217円
合計	20,844,336,243円
2. 受益権の総数	20,844,336,243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 2023年2月7日 至 2024年2月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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、この結果はリスク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	[2024年2月5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	[2024年2月5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△443,247,300
特殊債券	△3,356,000
社債券	△9,764,000
合計	△456,367,300

(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

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)

	[2024年2月5日現在]
1口当たり純資産額	1.3898円
(1万口当たり純資産額)	(13,898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

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第160回利付国債(5年)	460,000,000	459,006,400	
	第161回利付国債(5年)	150,000,000	150,322,500	
	第163回利付国債(5年)	890,000,000	894,663,600	
	第5回利付国債(40年)	70,000,000	73,994,200	
	第7回利付国債(40年)	130,000,000	128,086,400	
	第10回利付国債(40年)	190,000,000	148,068,900	
	第11回利付国債(40年)	190,000,000	142,034,500	
	第14回利付国債(40年)	170,000,000	118,503,600	
	第15回利付国債(40年)	230,000,000	176,812,500	
	第16回利付国債(40年)	90,000,000	75,757,500	
	第351回利付国債(10年)	400,000,000	397,408,000	
	第352回利付国債(10年)	50,000,000	49,578,000	
	第360回利付国債(10年)	600,000,000	588,768,000	
	第361回利付国債(10年)	720,000,000	704,851,200	
	第362回利付国債(10年)	520,000,000	507,624,000	
	第363回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,158,227,000	
	第364回利付国債(10年)	190,000,000	184,353,200	
	第370回利付国債(10年)	650,000,000	642,161,000	
	第23回利付国債(30年)	40,000,000	47,306,400	
	第26回利付国債(30年)	50,000,000	58,591,500	
	第28回利付国債(30年)	20,000,000	23,696,000	
	第30回利付国債(30年)	60,000,000	69,376,200	
	第31回利付国債(30年)	30,000,000	34,215,900	
	第32回利付国債(30年)	50,000,000	57,621,500	
	第33回利付国債(30年)	50,000,000	55,274,000	
	第34回利付国債(30年)	70,000,000	79,319,100	
	第36回利付国債(30年)	80,000,000	87,824,000	
	第37回利付国債(30年)	60,000,000	64,765,200	
	第39回利付国債(30年)	90,000,000	96,782,400	
	第41回利付国債(30年)	120,000,000	124,435,200	
	第42回利付国債(30年)	100,000,000	103,570,000	
	第44回利付国債(30年)	50,000,000	51,656,000	
	第45回利付国債(30年)	90,000,000	89,643,600	

第46回利付国債（30年）	130,000,000	129,273,300	
第47回利付国債（30年）	80,000,000	80,836,000	
第49回利付国債（30年）	130,000,000	126,196,200	
第50回利付国債（30年）	120,000,000	102,889,200	
第54回利付国債（30年）	260,000,000	219,889,800	
第58回利付国債（30年）	350,000,000	292,124,000	
第60回利付国債（30年）	250,000,000	212,157,500	
第69回利付国債（30年）	100,000,000	78,237,000	
第72回利付国債（30年）	150,000,000	116,133,000	
第74回利付国債（30年）	120,000,000	100,299,600	
第75回利付国債（30年）	80,000,000	72,082,400	
第76回利付国債（30年）	150,000,000	138,405,000	
第77回利付国債（30年）	630,000,000	608,951,700	
第80回利付国債（30年）	330,000,000	333,540,900	
第121回利付国債（20年）	60,000,000	65,931,000	
第123回利付国債（20年）	110,000,000	122,581,800	
第140回利付国債（20年）	160,000,000	174,852,800	
第141回利付国債（20年）	90,000,000	98,418,600	
第143回利付国債（20年）	200,000,000	217,002,000	
第145回利付国債（20年）	190,000,000	207,981,600	
第146回利付国債（20年）	200,000,000	218,912,000	
第147回利付国債（20年）	330,000,000	357,908,100	
第148回利付国債（20年）	250,000,000	268,510,000	
第149回利付国債（20年）	210,000,000	225,474,900	
第150回利付国債（20年）	340,000,000	361,379,200	
第151回利付国債（20年）	450,000,000	468,463,500	
第152回利付国債（20年）	300,000,000	311,928,000	
第153回利付国債（20年）	250,000,000	262,202,500	
第154回利付国債（20年）	420,000,000	435,313,200	
第155回利付国債（20年）	310,000,000	313,828,500	
第160回利付国債（20年）	590,000,000	568,488,600	
第166回利付国債（20年）	520,000,000	490,100,000	
第180回利付国債（20年）	450,000,000	407,740,500	
第182回利付国債（20年）	150,000,000	142,407,000	
第183回利付国債（20年）	630,000,000	627,656,400	
第184回利付国債（20年）	160,000,000	151,052,800	

	第186回利付国債（20年）	880,000,000	884,690,400	
国債証券 合計		17,980,000,000	17,638,136,500	
特殊債券	い第863号商工債券	300,000,000	298,116,000	
	い第871号商工債券	200,000,000	198,894,000	
	い第872号商工債券	100,000,000	99,778,000	
特殊債券 合計		600,000,000	596,788,000	
社債券	第35回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	197,586,000	
	第9回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	100,000,000	96,872,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,953,000	
	第11回クレディ・アグリコル・エス・エー（2022）	200,000,000	200,862,000	
	第3回香港上海銀行	100,000,000	99,812,000	
	第9回マラヤン・バンキング	200,000,000	199,344,000	
	第7回エイチエスビーシー・ホールディングス期限前償還条項付	100,000,000	100,414,000	
	第10回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	200,000,000	198,386,000	
	第11回ロイズ・バンキング・グループ期限前償還条項付	800,000,000	792,168,000	
	第6回フランス電力	200,000,000	198,900,000	
	第11回サントリーホールディングス	200,000,000	198,702,000	
	第9回ヒューリック	100,000,000	97,638,000	
	第14回セブン&アイ・ホールディングス	100,000,000	99,718,000	
	第3回日本酸素ホールディングス	100,000,000	99,848,000	
	第1回武田薬品工業利払繰延・期限前償還条項・劣後特約付	100,000,000	100,549,000	
	第12回ヤフー	100,000,000	98,919,000	
	第16回Zホールディングス	100,000,000	99,973,000	
	第19回Zホールディングス	100,000,000	98,874,000	
	第1回住友生命2023基金	100,000,000	99,221,000	
	第2回パナソニック利払繰延・期限前償還条項・劣後特約付	200,000,000	194,692,000	
	第34回ソニー	100,000,000	99,942,000	
	第43回IHI	100,000,000	99,880,000	
	第47回IHI	100,000,000	99,745,000	
	第25回JA三井リース	100,000,000	99,746,000	
第27回JA三井リース	100,000,000	99,753,000		
第28回JA三井リース	200,000,000	199,250,000		

第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	100,000,000	99,709,000	
第25回トヨタ自動車	100,000,000	99,501,000	
第1回日本生命2019基金	100,000,000	99,993,000	
第1回明治安田生命2019基金	100,000,000	99,961,000	
第1回日本生命2021基金劣後特約付	100,000,000	99,339,000	
第116回丸紅	100,000,000	99,449,000	
第35回丸井グループ	100,000,000	99,914,000	
第24回イオン（サステナビリティ）	100,000,000	99,085,000	
第13回三井住友トラスト・ホールディングス期限前償還条項付	100,000,000	99,920,000	
第18回みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付	100,000,000	99,900,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	99,607,000	
第56回日産フィナンシャルサービス	100,000,000	99,331,000	
第80回ホンダファイナンス	100,000,000	99,700,000	
第34回SBIホールディングス	500,000,000	498,325,000	
第100回トヨタファイナンス	100,000,000	100,039,000	
第42回リコーリース	200,000,000	199,008,000	
第43回リコーリース（サステナビリティ）	100,000,000	100,056,000	
第11回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,843,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス	200,000,000	199,352,000	
第79回アコム	100,000,000	99,925,000	
第81回アコム	100,000,000	98,922,000	
第72回日立キャピタル	100,000,000	99,942,000	
第36回大和証券グループ本社	100,000,000	99,182,000	
第40回大和証券グループ本社	100,000,000	99,979,000	
第2回野村ホールディングス	100,000,000	99,935,000	
第3回野村ホールディングス	100,000,000	98,898,000	
第7回野村ホールディングス	100,000,000	99,911,000	
第8回野村ホールディングス	100,000,000	99,731,000	
第83回三井不動産（グリーン）	200,000,000	194,980,000	
第142回三菱地所（サステナビリティ）	400,000,000	398,044,000	
第37回イオンモール（グリーン）	100,000,000	100,395,000	
第2回ソフトバンク	100,000,000	99,848,000	
第8回ソフトバンク	100,000,000	99,573,000	
第11回ソフトバンク	100,000,000	99,228,000	

第1回関西電力利払繰延・期限前償還条項・劣後特約付	200,000,000	199,496,000	
第500回関西電力	100,000,000	100,073,000	
第540回関西電力	200,000,000	198,368,000	
第447回中国電力	200,000,000	198,750,000	
第84回電源開発	100,000,000	100,619,000	
第27回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,122,000	
第34回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,327,000	
第38回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,098,000	
第68回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,415,000	
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	100,000,000	99,886,000	
第51回大阪ガス	100,000,000	98,286,000	
第4回ファーストリテイリング	200,000,000	201,492,000	
社債券 合計	10,100,000,000	10,048,204,000	
合計	28,680,000,000	28,283,128,500	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2 【ファンドの現況】

【国内債券セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2024年2月29日現在

（単位：円）

I 資産総額	68,012,903,181
II 負債総額	269,635,358
III 純資産総額（I - II）	67,743,267,823
IV 発行済口数	71,723,529,851口
V 1口当たり純資産価額（III/IV）	0.9445
（10,000口当たり）	（9,445）

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	823,586,298,478
II 負債総額	27,420,795,754
III 純資産総額 (I - II)	796,165,502,724
IV 発行済口数	623,197,951,933口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2775
(10,000口当たり)	(12,775)

先進国高格付国債マザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	77,338,816,464
II 負債総額	481,981,754
III 純資産総額 (I - II)	76,856,834,710
IV 発行済口数	77,287,830,971口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9944
(10,000口当たり)	(9,944)

MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	56,536,517,884
II 負債総額	1,128,797,727
III 純資産総額 (I - II)	55,407,720,157
IV 発行済口数	39,757,202,947口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.3937
(10,000口当たり)	(13,937)

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

2024年2月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	15,315,493,732
--------	----------------

II 負債総額	152,854,626
III 純資産総額 (I - II)	15,162,639,106
IV 発行済口数	15,837,094,924口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	0.9574
(10,000口当たり)	(9,574)

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

純資産額計算書

2024年2月29日現在

(単位：円)

I 資産総額	29,229,104,820
II 負債総額	121,463,342
III 純資産総額 (I - II)	29,107,641,478
IV 発行済口数	20,895,701,008口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.3930
(10,000口当たり)	(13,930)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含

みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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

2024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

①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。

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①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。

③運用計画の決定

②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。

④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。

⑤運用部門による自律的な運用管理

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、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正

を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) 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、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦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、商品企画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。

⑧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】

「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。

2024年2月29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	840	32,364,511
追加型公社債投資信託	16	1,593,094
単位型株式投資信託	97	444,511
単位型公社債投資信託	49	94,595
合計	1,002	34,496,710

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】

(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アセットマネジメント株式会社（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 38 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 39 期事業年度に係る中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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。

独立監査人の監査報告書

2023年6月9日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄 也

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行

を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023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（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,593,362	※2	51,733,041
有価証券		293,326		1,579,691
前払費用		645,109		770,747
未収入金		61,092		81,854
未収委託者報酬		15,750,264		16,753,855
未収収益	※2	783,790	※2	688,142
金銭の信託		8,401,300		10,400,000
その他		295,584		745,576
流動資産合計		77,823,830		82,752,908
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	391,042	※1	181,551
器具備品	※1	1,079,023	※1	730,357
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		-		1,111,177
有形固定資産合計		2,098,499		2,651,520
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,381,293		4,183,644
ソフトウェア仮勘定		1,581,652		1,907,739
無形固定資産合計		5,978,768		6,107,206
投資その他の資産				
投資有価証券		16,803,642		12,022,365
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	810,684	※1	807,066
長期差入保証金		524,244		689,492
前払年金費用		189,708		118,832
繰延税金資産		982,406		1,675,132
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		19,491,852		15,494,056
固定資産合計		27,569,120		24,252,782
資産合計		105,392,950		107,005,691

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		565,222		507,559
未払金				
未払収益分配金		197,334		114,094
未払償還金		7,418		7,418
未払手数料	※2	6,423,139	※2	6,139,595
その他未払金	※2	4,565,457	※2	955,697
未払費用	※2	4,328,968	※2	5,778,896
未払消費税等		1,112,923		439,657
未払法人税等		769,692		2,375,281
賞与引当金		942,287		849,840
役員賞与引当金		149,028		154,872
その他		5,517		5,517
流動負債合計		19,066,990		17,328,431
固定負債				
長期未払金		10,800		-
退職給付引当金		1,246,300		1,333,882
役員退職慰労引当金		117,938		75,667
時効後支払損引当金		250,214		254,296
固定負債合計		1,625,252		1,663,846
負債合計		20,692,243		18,992,277
(純資産の部)				
株主資本				
資本金		2,000,131		2,000,131
資本剰余金				
資本準備金		3,572,096		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712		44,732,712
利益剰余金				
利益準備金		342,589		342,589
その他利益剰余金				
別途積立金		6,998,000		6,998,000
繰越利益剰余金		29,000,498		33,267,700
利益剰余金合計		36,341,088		40,608,289
株主資本合計		83,073,932		87,341,133

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,626,775	672,279
評価・換算差額等合計	1,626,775	672,279
純資産合計	84,700,707	88,013,413
負債純資産合計	105,392,950	107,005,691

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	79,977,953	84,121,445
投資顧問料	2,711,169	2,750,601
その他営業収益	13,459	10,412
営業収益合計	82,702,582	86,882,459
営業費用		
支払手数料	※2 31,644,834	※2 31,461,274
広告宣伝費	720,785	798,894
公告費	500	375
調査費		
調査費	2,430,158	2,849,042
委託調査費	14,557,009	19,236,505
事務委託費	1,450,062	1,751,807
営業雑経費		
通信費	138,868	113,480
印刷費	379,428	367,379
協会費	49,590	58,128
諸会費	17,729	18,447
事務機器関連費	2,172,978	2,238,382
その他営業雑経費	649	-
営業費用合計	53,562,596	58,893,717
一般管理費		
給料		
役員報酬	414,260	416,461
給料・手当	6,496,233	6,565,766
賞与引当金繰入	942,287	849,840
役員賞与引当金繰入	149,028	154,872
福利厚生費	1,282,310	1,279,885
交際費	4,874	8,942
旅費交通費	21,698	75,274
租税公課	430,233	403,955
不動産賃借料	724,961	719,707
退職給付費用	494,615	388,176
固定資産減価償却費	2,249,287	2,418,341
諸経費	379,054	444,313
一般管理費合計	13,588,846	13,725,534
営業利益	15,551,139	14,263,207

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)		第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取配当金		243,133		47,353
受取利息	※2	7,408	※2	10,279
投資有価証券償還益		1,089,101		609,102
収益分配金等時効完成分		137,485		94,351
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808
その他		36,211		36,894
営業外収益合計		1,579,148		863,788
営業外費用				
投資有価証券償還損		3,074		32,995
時効後支払損引当金繰入		16,548		31,951
事務過誤費		76,076		2,680
賃貸関連費用		15,780		14,262
その他		7,585		32,394
営業外費用合計		119,066		114,284
経常利益		17,011,221		15,012,711
特別利益				
投資有価証券売却益		605,706		387,113
特別利益合計		605,706		387,113
特別損失				
投資有価証券売却損		28,188		15,828
投資有価証券評価損		36,558		104,554
固定資産除却損	※1	13,094	※1	32,791
減損損失		-	※3	315,350
特別損失合計		77,840		468,524
税引前当期純利益		17,539,087		14,931,300
法人税、住民税及び事業税	※2	5,366,608	※2	4,860,444
法人税等調整額		22,446		△271,471
法人税等合計		5,389,054		4,588,973
当期純利益		12,150,032		10,342,327

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
会計方針の変更による累積的影響額				
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更による累積的影響額			475,687	475,687	475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当期変動額					
剰余金の配当			△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
当期純利益			12,150,032	12,150,032	12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	1,573,521	1,573,521	1,573,521
当期末残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
当期純利益			12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△674,831	△674,831	△674,831
当期変動額合計	△674,831	△674,831	898,690
当期末残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932
当期変動額					
剰余金の配当			△6,075,125	△6,075,125	△6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

	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	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			△6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△954,495	△954,495	△954,495
当期変動額合計	△954,495	△954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998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2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	5年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

①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。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるた

め、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年 2 回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年 4 回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第 31 号 2021 年 6 月 17 日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第 27-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準適用指針の適用による、財務諸表への影響はありません。

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
建物	805,250 千円	1,006,606 千円
器具備品	2,054,366 千円	1,985,072 千円
投資不動産	157,995 千円	163,978 千円

※2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
預金	43,782,913 千円	40,165,058 千円
未収収益	13,741 千円	15,046 千円
未払手数料	836,105 千円	790,279 千円
その他未払金	3,887,520 千円	77,007 千円
未払費用	337,847 千円	277,358 千円

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
建物	2,599 千円	1,047 千円
器具備品	10,495 千円	29,762 千円
ソフトウェア	-	1,981 千円
計	13,094 千円	32,791 千円

※2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
支払手数料	5,153,589 千円	4,893,312 千円
受取利息	7,377 千円	10,236 千円
受取賃貸料	65,808 千円	68,168 千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765 千円	3,947,200 千円

※3. 減損損失

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区 (本社)	ホームページ	ソフトウェア	315,350 千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を 1 つのグルーピングとしております。

翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度増加 株式数(株)	当事業年度減少 株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2021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。

- ① 配当金の総額 10,576,511千円
- ② 1株当たり配当額 49,988円
- ③ 基準日 2021年3月31日
- ④ 効力発生日 2021年6月29日

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

2022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。

- ① 配当金の総額 6,075,125千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 28,713円
- ④ 基準日 2022年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2022年6月29日

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度増加 株式数(株)	当事業年度減少 株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2022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。

- ① 配当金の総額 6,075,125千円
- ② 1株当たり配当額 28,713円
- ③ 基準日 2022年3月31日
- ④ 効力発生日 2022年6月29日

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

2023年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 配当金の総額 5,171,039千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 24,440円
- ④ 基準日 2023年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2023年6月29日

(リース取引関係)

(借主側)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
1 年内	709,808 千円	962,809 千円
1 年超	414,054 千円	1,532,728 千円
合計	1,123,863 千円	2,495,537 千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(注2)参照）。

第 37 期(2022 年 3 月 31 日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	293,326	293,326	—
(2) 金銭の信託	8,401,300	8,401,300	—
(3) 投資有価証券	16,772,282	16,772,282	—
資産計	25,466,909	25,466,909	—

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

(注 2) 市場価格のない株式等

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額 31,360 千円）は、市場価格がないため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。また、関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注 4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第 37 期(2022 年 3 月 31 日現在)

(単位：千円)

	1 年以内	1 年超 5 年以内	5 年超 10 年以内	10 年超
現金及び預金	51,593,362	—	—	—
金銭の信託	8,401,300	—	—	—
未収委託者報酬	15,750,264	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	293,326	6,911,464	3,695,585	—
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	—

第38期(2023年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 有価証券	1,579,691	1,579,691	—
(2) 金銭の信託	10,400,000	10,400,000	—
(3) 投資有価証券	12,022,365	12,022,365	—
資産計	24,002,056	24,002,056	—

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

(注2) 市場価格のない株式等

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 159,536千円)は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	—	—	—
金銭の信託	10,400,000	—	—	—
未収委託者報酬	16,753,855	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	—
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

- レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
第37期(2022年3月31日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	—	8,401,300	—	8,401,300
資産計	—	8,401,300	—	8,401,300

※財務諸表等規則附則(2021年9月24日内閣府令第9号)に基づく経過措置を適用した投資信託(貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券 16,772,282千円)は、表には含めておりません。

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	—	1,579,691	—	1,579,691
金銭の信託	—	10,400,000	—	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	—	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	—	24,002,056

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF(上場投資信託)は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF(上場投資信託)以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

第37期(2022年3月31日現在)及び第38期(2023年3月31日現在)

関連会社株式(貸借対照表計上額は159,536千円)は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第37期(2022年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	19,193,250	16,560,340	2,632,910
	小計	19,193,250	16,560,340	2,632,910
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	6,273,658	6,561,836	△288,177
	小計	6,273,658	6,561,836	△288,177
合計		25,466,909	23,122,176	2,344,732

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は8,401,300千円、取得原価は8,400,000千円)を含めております。

非上場株式(貸借対照表計上額は31,360千円)は、市場価格がないため、含めておりません。

第38期(2023年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
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	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円)を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	17,240	—	14,120
債券	—	—	—
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について 36,558 千円（その他有価証券のその他 36,558 千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について 104,554 千円（その他有価証券のその他 104,554 千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	3,729,235 千円	3,723,521 千円
勤務費用	198,457	196,190
利息費用	21,549	25,925
数理計算上の差異の 発生額	△46,069	△186,130
退職給付の支払額	△179,650	△176,727
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,723,521	3,582,778

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
年金資産の期首残高	2,649,846 千円	2,583,927 千円
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の 発生額	1,824	△103,934
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△115,331	△100,694
年金資産の期末残高	2,583,927	2,425,752

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,675,015 千円	2,468,195 千円
年金資産	△2,583,927	△2,425,752
非積立型制度の退職給付債務	91,087	42,442
未積立退職給付債務	1,048,506	1,114,583
未認識数理計算上の差異	1,139,593	1,157,025
未認識過去勤務費用	205,679	281,343
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	△288,681	△223,319
退職給付引当金	1,056,591	1,215,049
前払年金費用	1,246,300	1,333,882
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	△189,708	△118,832

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
勤務費用	198,457 千円	196,190 千円
利息費用	21,549	25,925
期待運用収益	△47,588	△46,453
数理計算上の差異の 費用処理額	△3,547	△6,532
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	109,013	1,600
確定給付制度に係る 退職給付費用	343,245	236,091

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
債券	62.0 %	63.6 %
株式	36.3	34.2
その他	1.7	2.2
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
割引率	0.078～0.72%	0.066～1.13%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 151,370 千円、当事業年度 152,084 千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
繰延税金資産		
減損損失	410,082千円	499,742千円
投資有価証券評価損	65,490	47,876
未払事業税	165,702	169,997
賞与引当金	288,528	260,221
役員賞与引当金	25,799	29,828
役員退職慰労引当金	36,112	23,169
退職給付引当金	381,617	408,434
減価償却超過額	145,316	227,100
差入保証金	-	52,869
長期差入保証金	52,869	-
時効後支払損引当金	76,615	77,865
連結納税適用による時価評価	35,311	35,311
その他	76,257	177,003
繰延税金資産 小計	1,759,702	2,009,420
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	1,759,702	2,009,420
繰延税金負債		
前払年金費用	△58,088	△36,386
連結納税適用による時価評価	△1,149	△1,098
その他有価証券評価差額金	△717,957	△296,702
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△777,296	△334,288
繰延税金資産の純額	982,406	1,675,132

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
第 37 期（2022 年 3 月 31 日現在）及び第 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) の 6. 収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の 90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注 1)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注 2)	5,153,589 千円	未払手数料	836,105 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	499,388 千円	未払費用	272,264 千円
						役員の兼任				

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等 に伴う支払 (注 4)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注 2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円
						役員の兼任				

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
4. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
5. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,097,951 千円	未払手数料	838,058 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	7,025,984 千円	未払手数料	1,319,958 千円

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注)1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示してまいります。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
1株当たり純資産額	400,322.84円	415,979.76円
1株当たり当期純利益金額	57,424.97円	48,881.17円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株主に帰属しない金額（千円）	—	—
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表
(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		49,727,641
有価証券		1,621,227
前払費用		710,443
未収入金		93,528
未収委託者報酬		19,282,859
未収収益		770,875
金銭の信託		10,401,000
その他		740,886
流動資産合計		83,348,451
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	2,546,133
器具備品	※1	1,676,631
土地		628,433
建設仮勘定		10,560
有形固定資産合計		4,861,758
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,917,655
ソフトウェア仮勘定		1,357,259
無形固定資産合計		6,290,737
投資その他の資産		
投資有価証券		14,016,994
関係会社株式		159,536
投資不動産	※1	1,580,210
長期差入保証金		689,627
前払年金費用		83,203
繰延税金資産		1,274,071
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,825,273
固定資産合計		28,977,769
資産合計		112,326,220

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

(負債の部)	
流動負債	
預り金	492,861
未払金	
未払収益分配金	105,556
未払償還金	44,768
未払手数料	6,929,093
その他未払金	3,313,588
未払費用	6,935,916
未払消費税等	※2 319,737
未払法人税等	2,205,065
賞与引当金	899,167
役員賞与引当金	78,660
その他	5,517
流動負債合計	21,329,934
固定負債	
退職給付引当金	1,375,952
役員退職慰労引当金	32,510
時効後支払損引当金	252,955
資産除去債務	704,072
固定負債合計	2,365,490
負債合計	23,695,424
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	33,502,194
利益剰余金合計	40,842,784
株主資本合計	87,575,628

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,055,167
評価・換算差額等合計	1,055,167
純資産合計	88,630,795
負債純資産合計	112,326,220

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
営業収益	
委託者報酬	47,550,495
投資顧問料	1,407,644
その他営業収益	10,158
営業収益合計	48,968,298
営業費用	
支払手数料	16,737,084
広告宣伝費	208,241
公告費	892
調査費	
調査費	1,594,100
委託調査費	12,907,263
事務委託費	947,553
営業雑経費	
通信費	53,048
印刷費	194,402
協会費	33,149
諸会費	9,640
事務機器関連費	1,212,110
その他営業雑経費	5,384
営業費用合計	33,902,872
一般管理費	
給料	
役員報酬	190,163
給料・手当	2,957,056
賞与引当金繰入	899,167
役員賞与引当金繰入	78,660
福利厚生費	645,394
交際費	4,144
旅費交通費	46,547
租税公課	204,887
不動産賃借料	390,491
退職給付費用	188,933
固定資産減価償却費	※1 1,169,259
諸経費	275,931
一般管理費合計	7,050,636
営業利益	8,014,788

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(自 2023 年 4 月 1 日
至 2023 年 9 月 30 日)

営業外収益	
受取配当金	27,966
受取利息	6,353
投資有価証券償還益	19,971
収益分配金等時効完成分	15,896
受取賃貸料	36,751
その他	20,823
営業外収益合計	127,762
営業外費用	
投資有価証券償却損	53,716
時効後支払損引当金繰入	1,347
事務過誤費	10,736
賃貸関連費用	※1 16,188
その他	3,902
営業外費用合計	85,890
経常利益	8,056,659
特別利益	
投資有価証券売却益	132,206
固定資産売却益	1,021
特別利益合計	133,228
特別損失	
投資有価証券売却損	30,309
投資有価証券評価損	28,130
固定資産除却損	20,162
固定資産売却損	65,427
その他特別損失	289,389
特別損失合計	433,419
税引前中間純利益	7,756,468
法人税、住民税及び事業税	2,118,856
法人税等調整額	232,077
法人税等合計	2,350,934
中間純利益	5,405,533

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
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	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当中間期変動額					
剰余金の配当			△5,171,039	△5,171,039	△5,171,039
中間純利益			5,405,533	5,405,533	5,405,533
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	—	—	234,494	234,494	234,494
当中間期末残高	342,589	6,998,000	33,502,194	40,842,784	87,575,628

	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	672,279	672,279	88,013,413
当中間期変動額			
剰余金の配当			△5,171,039
中間純利益			5,405,533
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	382,887	382,887	382,887
当中間期変動額合計	382,887	382,887	617,382
当中間期末残高	1,055,167	1,055,167	88,630,795

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法
 - (1) 子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法を採用しております。
 - (2) その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産及び投資不動産
定率法を採用しております。ただし、1998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2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～50年
 - (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
 - (2) 賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (3) 役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (4) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
 - ① 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。
 - ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
 - (5) 役員退職慰労引当金
役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。
 - (6) 時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算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 減価償却累計額

第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)	
建物	407,329 千円
器具備品	1,336,738 千円
投資不動産	170,993 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 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
有形固定資産	225,710 千円
無形固定資産	943,548 千円
投資不動産	7,015 千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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

2023 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。

① 配当金の総額	5,171,039 千円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1 株当たり配当額	24,440 円
④ 基準日	2023 年 3 月 31 日
⑤ 効力発生日	2023 年 6 月 29 日

(リース取引関係)

第 39 期中間会計期間(2023 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	740,363 千円
1 年超	1,192,121 千円
合 計	1,932,485 千円

(金融商品関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023 年 9 月 30 日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません ((注 2) 参照)。

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 有価証券	1,621,227	1,621,227	—
(2) 金銭の信託	10,401,000	10,401,000	—
(3) 投資有価証券	14,016,994	14,016,994	—
資産計	26,039,221	26,039,221	

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

(注 2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載していません。

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価 (千円)			合計
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	
有価証券	—	1,621,227	—	1,621,227
金銭の信託	—	10,401,000	—	10,401,000
投資有価証券	2,257,164	11,759,829	—	14,016,994
資産計	2,257,164	23,782,057	—	26,039,221

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETF は活発な市場で取引されているため、レベル 1 の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル 2 の時価に分類しております。

金銭の信託

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

(有価証券関係)

第 39 期中間会計期間（2023 年 9 月 30 日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載していません。

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	15,250,611	13,190,791	2,059,819
	小計	15,250,611	13,190,791	2,059,819
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	10,788,610	11,327,577	△538,966
	小計	10,788,610	11,327,577	△538,966
合計		26,039,221	24,518,369	1,520,852

(注)「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」(中間貸借対照表計上額 10,401,000 千円、取得価額 10,400,000 千円)を含めております。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について 28,130 千円(その他有価証券のその他 28,130 千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの
当該資産除去債務の総額の増減

	第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
期首残高	—
有形固定資産の取得に伴う増加	704,072 千円
時の経過による調整額	—
中間期末残高	704,072 千円

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の 90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)
1 株当たり純資産額	418,897.70 円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額 (千円)	88,630,795
普通株式に係る中間期末の純資産額 (千円)	88,630,795
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 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 株当たり中間純利益金額	25,548.29 円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額 (千円)	5,405,533
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)	5,405,533
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。

(重要な後発事象)

共通支配下の取引等

当社は 2023 年 7 月 31 日開催の取締役会において、三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU 投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を 2023 年 10 月 1 日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社は、2023 年 10 月 1 日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023 年 10 月 1 日付で当社は「三菱UFJ アセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

(1) 取引の概要

①被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

②企業結合日

2023 年 10 月 1 日

③企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

④結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ 不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱UFJ アセットマネジメント株式会社

⑤企業結合を行う主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱UFJ アセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

(2) 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準 (企業会計基準第 21 号 2019 年 1 月 16 日)」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針 (企業会計基準適用指針第 10 号 2019 年 1 月 16 日)」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 【その他】

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

国内債券セレクション（ラップ向け）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

国内債券セレクション（ラップ向け）

運用の基本方針

約款第19条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ①投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の債券に実質的な投資を行います。
- ②投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。
また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。
- ③投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。
- ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。
- ⑤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。

(3) 投資制限

- ①株式への直接投資は行いません。
- ②投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ③外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ④外国為替予約取引は為替変動リスクを回避するため行うことができます。

3. 収益分配方針

毎計算期末に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、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。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

追加型証券投資信託
『国内債券セレクション（ラップ向け）』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第18条第1項および第2項ならびに第23条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的および金額)

第3条 委託者は、金1,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2027年2月5日まで、または第39条第8項、第40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託期間終了日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第7条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第20条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額（以下「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総

口数で除して得た金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

- ③ 第22条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託のすべての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、第3条の規定による受益権については信託契約締結日に、また、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の定める単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、取得申込者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と別に定める累積投資契約約款に基づく契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結している場合に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、別に定める日には、前項による受益権の取得申込みに応じないものとします。

- ③ 委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の取得の制限等）があるときは、第1項による受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

- ④ 委託者は、前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金

を再投資する場合の追加信託金の申込みについては、これを受け付けるものとします。

- ⑤ 第1項の場合の受益権の価額は、取得申込みを受け付けた日の翌々営業日の基準価額に、手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき1円とします。
- ⑥ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑦ 第5項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑧ 第1項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（受益権の譲渡の対抗要件）

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類等）

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- イ. 有価証券
- ロ. 約束手形
- ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ. 為替手形

- ② 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（投資の対象とする有価証券等）

第17条 この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとし

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
2. コマーシャル・ペーパー
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第1号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

（利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第23条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条第1項および前条に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、第16条第1項および前条に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第22条および第26条から第28条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

(公社債の借入れ)

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は、信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

(外国為替予約取引の指図)

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(信託業務の委託等)

第23条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第24条 金融機関または第一種金融商品取引業者等(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれに類する者をいいます。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できます。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第25条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（有価証券売却等の指図）

第26条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第27条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第29条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金立替え）

第30条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第31条 この信託の計算期間は、毎年2月6日から翌年2月5日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から2018年2月5日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告等）

第32条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、こ

れを委託者に提出します。

- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。
- ⑤ 受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできないものとします。
 1. 他の受益者の氏名または名称および住所
 2. 他の受益者が有する受益権の内容

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第33条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額は、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信託財産中から支弁します。

(信託報酬等)

第34条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第31条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の35の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、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信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第35条 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(「配当等収益」といいます。)は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責)

第36条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除して得た額をいいます。以下同じ。)については第37条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第39条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)については第37条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第37条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じることにより増加した受益権は第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

④ 一部解約金は、第39条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金および償還金の時効）

第38条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第39条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができます。

② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌々営業日の基準価額とします。

④ 受益者が第1項の一部解約の実行の請求をするときは、委託者の指定する第一種金融商

品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。

- ⑤ 委託者は別に定める日には、第1項に規定する一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限等）があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第3項の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ⑨ 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約しようとするときは、第40条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（信託契約の解約）

第40条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができるものとし、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行うことが困難な場合も同じく適用しません。

（信託契約に関する監督官庁の命令）

第41条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信

託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第45条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

② 委託者は、前項の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④ 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

(反対者の買取請求権)

第46条 第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することがで

きます。

- ② 前項の規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託者が第39条の規定に基づいて信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

(信託期間の延長)

第47条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第49条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第50条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第51条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(附則)

第1条 この約款において「累積投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関が締結する「累積投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第37条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

信託契約締結日 2017年3月13日

(付表)

1. 約款第13条第2項および第39条第5項に規定する「別に定める日」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

2. 約款第17条第1項に規定する「別に定める投資信託証券」とは、日本を含む世界の債券に実質的な投資を行う次に掲げる投資信託証券をいいます。

親投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

親投資信託 先進国高格付国債マザーファンド

親投資信託 MUAM ヘッジ付外国債券オープンマザーファンド

親投資信託 ショートデュレーション円インカムマザーファンド

親投資信託 三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

親投資信託 日本短期債券マザーファンド

追加型証券投資信託 マッコーリー グローバル・インフラ債券ファンド<為替ヘッジあり>
(FOFs用) (適格機関投資家限定)

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント