

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月23日提出
【計算期間】	第6期(自 2020年1月28日至 2021年1月26日)
【ファンド名】	e M A X I S 債券バランス（２資産均等型）
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川 直
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目１２番１号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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、NOMURA - B P I 総合およびF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果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	M M F	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	M R F	特殊型 ()
追加型		その他資産 ()	E T F	
	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	日本 北米 欧州 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	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	T O P I X	条件付運用型
債券	年４回				その他 (合成ベンチ マーク)	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
一般	年６回					
公債	(隔月)					
社債	年12回					
その他債券	日々					その他 ()
クレジット	その他					
属性 ()	()					
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（<http://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の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「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（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「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRF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。

有価証券報告書（内国投資信託）

	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・特色〕

ファンドの目的

日本を含む先進国の債券市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

特色1

国内債券、日本を除く先進国債券の指数を均等比率で組み合わせた合成ベンチマークに連動する成果をめざして運用を行います。

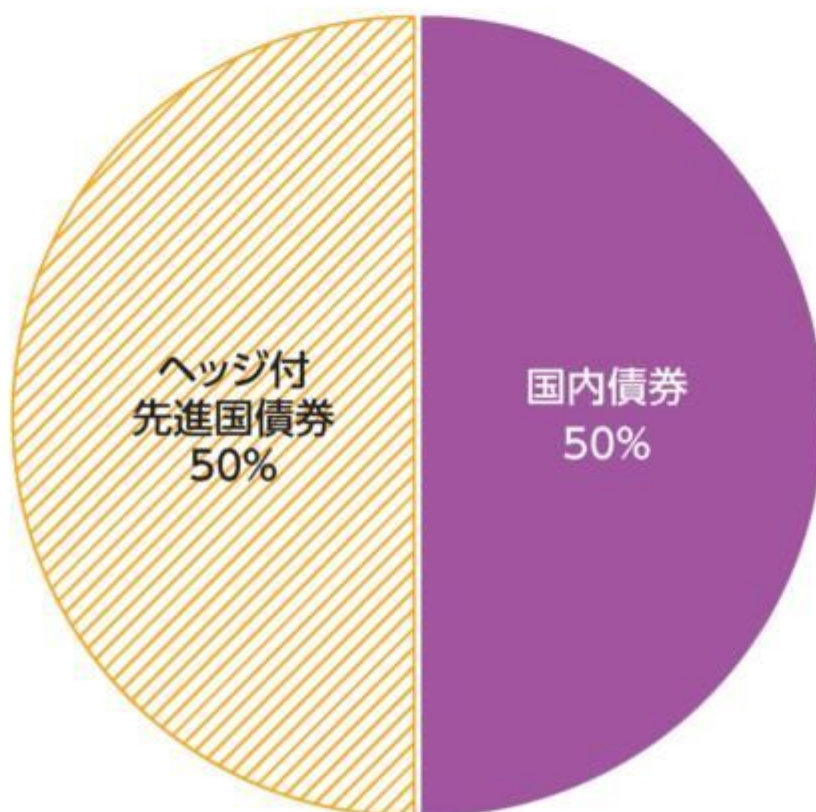
 NOMURA-BPI総合およびFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)を50%ずつ組み合わせた合成指数をいいます。

特色2

日本債券インデックスマザーファンドならびにヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド等を通じて、日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行います。

- 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。

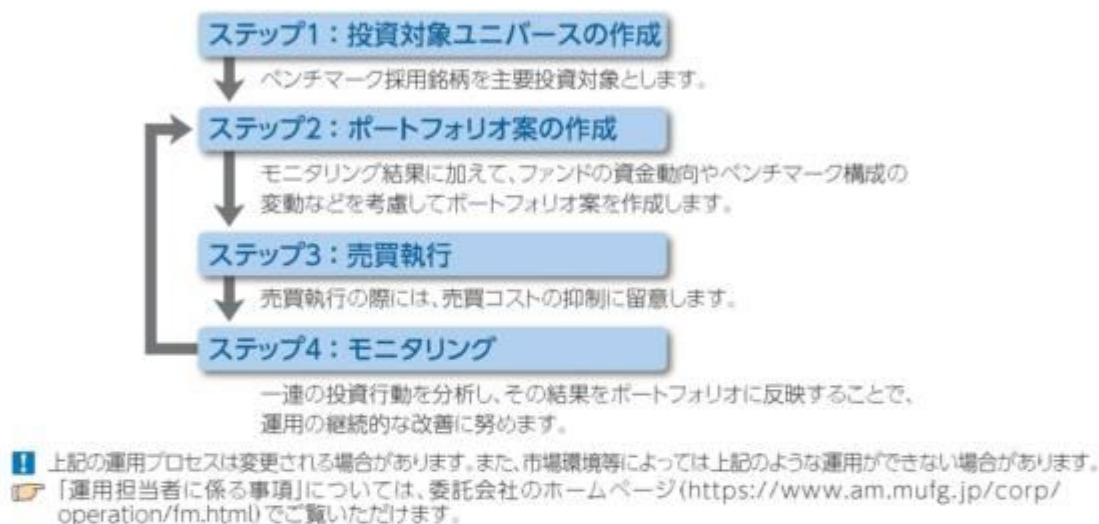
<基本投資割合>



<各マザーファンドの主要投資対象と運用目標および基本投資割合>

	主要投資対象	運用目標	基本投資割合
日本債券インデックス マザーファンド	国内債券	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。	50%
ヘッジ付 外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。	50%

<各マザーファンドの運用プロセス>



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。

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。

■ファンドの仕組み

運用は主に日本債券インデックスマザーファンドならびにヘッジ付外国債券インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国の公社債へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年1回の決算時(1月26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。



指数について

・NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。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(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。

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。

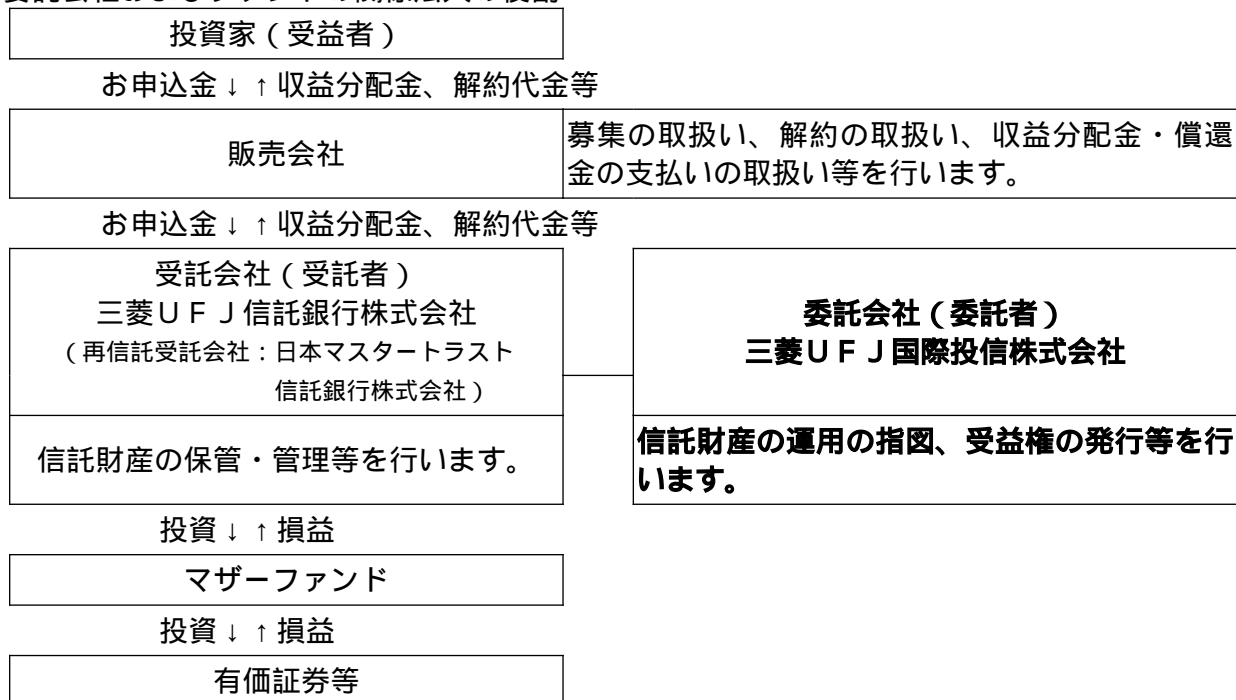
(2) 【ファンドの沿革】

2015年8月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



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。

委託会社の概況（2021年1月末現在）

- 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
- 大株主の状況

株 主 名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、日本を含む先進国の公社債に直接投資することがあります。

日本債券インデックスマザーファンド受益証券およびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド受益証券等への投資を通じて、主として日本を含む先進国の公社債に実質的な投資を行い、NOMURA - BPI総合およびFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）を50%ずつ組み合わせた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。国内債券および先進国債券への実質的な基本投資割合は、純資産総額に対してそれぞれ50%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。

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。

（２）【投資対象】

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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とする日本債券インデックスマザーファンドおよびヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証券

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．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（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）

９．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引

法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または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。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（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。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
16. 投資法人債券（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。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの

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

< マザーファンドの概要 >

日本債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

NOMURA - B P I 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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。

（投資制限）

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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として対象インデックスとの連動を維持するため為替ヘッジを行います。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、為替ヘッジ比率を引き下げる、あるいは為替ヘッジ比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

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。

（投資制限）

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（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。

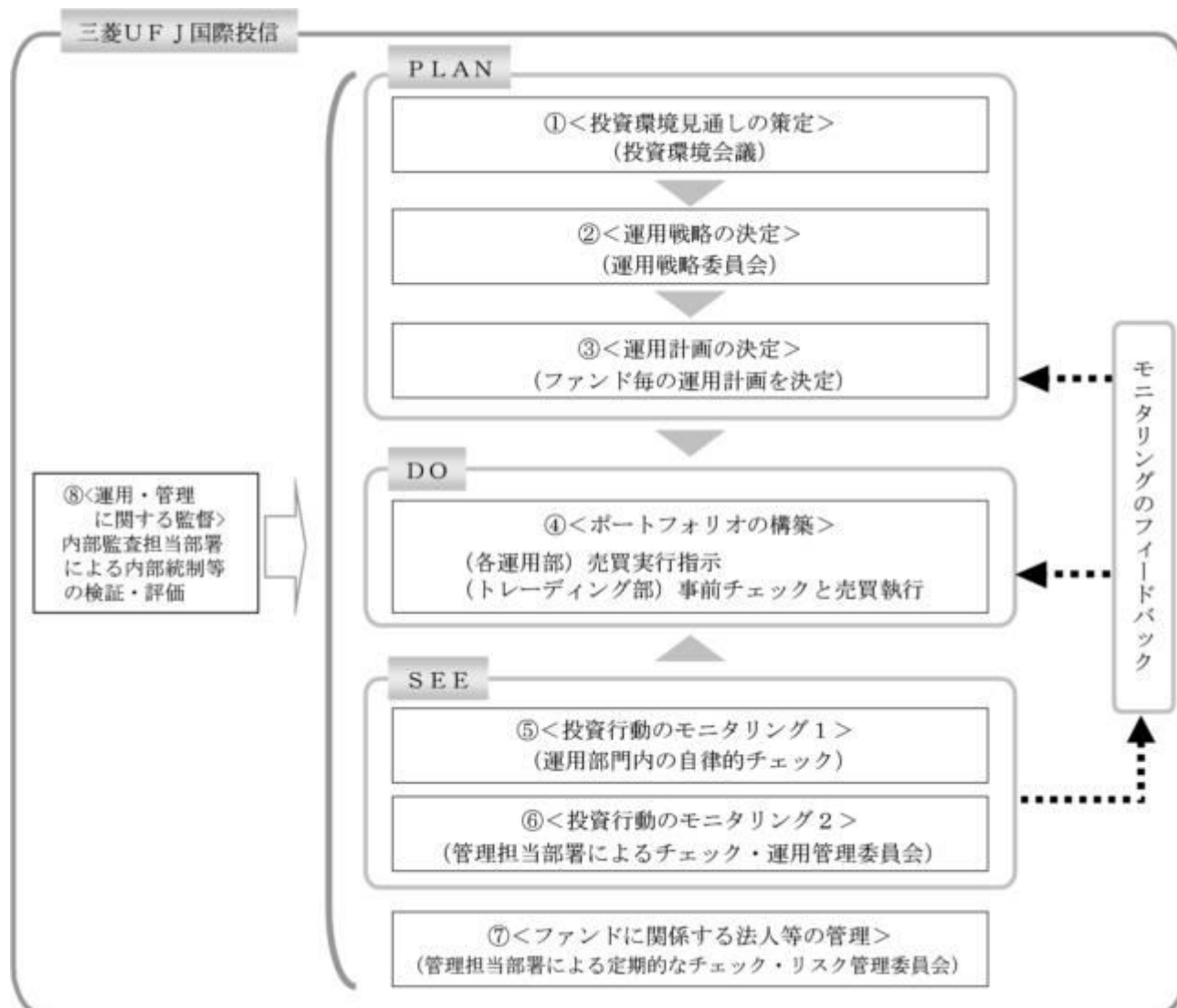
有価証券先物取引等を行うことができます。

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。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（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。

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。

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。

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 >

株式

a．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

新株引受権証券および新株予約権証券

a．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a．およびb．において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

a．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属

する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. c. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する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（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、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（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2. 株式分割により取得する株券
 - 3. 有償増資により取得する株券
 - 4. 売出しにより取得する株券
 - 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
 - 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産

に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- c．b．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d．b．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

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。

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償還金の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。

投資する株式等の範囲

- a．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b．a．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 - 1．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の

時価合計額を超えないものとします。

２．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ｂ．ａ．に規定する限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

ｃ．委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

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。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

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。

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

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、当ファンドはその影響を受け公社債の価格が下落した場合には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。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の公社債は外貨建資産ですが、当ファンドでは原則として為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図ります。しかし、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。そのため、為替相場の変動によっては、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。

なお、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がヘッジコストとなります。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

信用リスクとは、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、当該有価証券等

の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、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。

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、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている公社債の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、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。

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。
- ・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率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。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、合成ベンチマークの動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因によりカイ離を生じることがあります。

（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っています。

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

< 流動性リスクに対する管理体制 >

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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。

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、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村証券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0.44%（税抜0.4%）以内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。
- ・信託報酬率（税抜）の合計ならびに配分（委託会社および販売会社、受託会社）は、ファンドの純資産総額に応じて以下の通りとなります。

ファンドの純資産総額に応じて	信託報酬率（年率）		
	合計	委託会社および 販売会社	受託会社
500億円未満の部分	0.4%	0.35%	0.05%
500億円以上1,000億円未満の部分	0.38%	0.34%	0.04%
1,000億円以上の部分	0.36%	0.33%	0.03%

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

各販売会社における取扱純資産総額に応じて	委託会社	販売会社
50億円未満の部分	信託報酬率から 販売会社および 受託会社の配分率を 差し引いた率	0.175%
50億円以上100億円未満の部分		0.185%
100億円以上の部分		0.195%

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	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	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	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

（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。

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。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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。

- （＊）確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

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

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。

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。

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、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、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2021年1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。

5【運用状況】

【eMAXIS 債券バランス（2資産均等型）】

（１）【投資状況】

令和 3年 1月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	186,579,243	99.50
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	944,565	0.50
純資産総額		187,523,808	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

令和 3年 1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	ヘッジ付外国債券インデックスマ ザーファンド	66,757,226	1.4059	93,853,985	1.4050	93,793,902	50.02
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	69,052,126	1.3459	92,937,257	1.3437	92,785,341	49.48

（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

令和 3年 1月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和3年1月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日（平成28年 1月26日）	537,658,065	537,658,065	10,141	10,141
第2計算期間末日（平成29年 1月26日）	167,084,455	167,084,455	10,150	10,150
第3計算期間末日（平成30年 1月26日）	153,756,420	153,756,420	10,188	10,188
第4計算期間末日（平成31年 1月28日）	259,324,063	259,324,063	10,246	10,246
第5計算期間末日（令和 2年 1月27日）	199,296,825	199,296,825	10,601	10,601
第6計算期間末日（令和 3年 1月26日）	188,058,344	188,058,344	10,706	10,706
令和 2年 1月末日	200,789,201	—	10,646	—
2月末日	285,365,807	—	10,745	—
3月末日	199,284,771	—	10,733	—
4月末日	187,308,207	—	10,740	—
5月末日	190,456,974	—	10,709	—

6月末日	182,672,498	—	10,722	—
7月末日	183,584,682	—	10,789	—
8月末日	184,506,302	—	10,693	—
9月末日	186,788,073	—	10,764	—
10月末日	187,751,900	—	10,741	—
11月末日	184,425,167	—	10,751	—
12月末日	188,019,136	—	10,743	—
令和 3年 1月末日	187,523,808	—	10,693	—

【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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.41
第2計算期間	0.08
第3計算期間	0.37
第4計算期間	0.56
第5計算期間	3.46
第6計算期間	0.99

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	547,580,518	17,414,531	530,165,987
第2計算期間	304,481,927	670,031,254	164,616,660
第3計算期間	64,539,714	78,231,849	150,924,525
第4計算期間	215,119,621	112,938,018	253,106,128
第5計算期間	625,679,444	690,779,198	188,006,374
第6計算期間	143,380,594	155,734,310	175,652,658

（参考）

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 1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	268,986,465,640	83.46
地方債証券	日本	16,108,048,345	5.00
特殊債券	日本	19,621,034,442	6.09
社債券	日本	16,142,423,500	5.01
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,416,767,864	0.44
純資産総額		322,274,739,791	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

令和 3年 1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	455,460,000	0.14

（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

令和 3年 1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144回利付国債（5年）	4,690,000,000	100.95	4,734,722,000	100.99	4,736,477,900	0.100000	2025/6/20	1.47
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	4,140,000,000	100.71	4,169,764,200	100.74	4,171,008,600	0.100000	2030/6/20	1.29
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	4,140,000,000	100.69	4,168,566,000	100.43	4,157,926,200	0.100000	2022/12/20	1.29
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	3,550,000,000	102.92	3,653,660,000	102.27	3,630,833,500	0.600000	2024/3/20	1.13

日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	3,340,000,000	100.73	3,364,678,000	100.62	3,360,841,600	0.100000	2030/9/20	1.04
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	3,250,000,000	101.33	3,293,542,900	101.10	3,285,750,000	0.100000	2029/3/20	1.02
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	3,160,000,000	103.01	3,255,116,000	102.20	3,229,772,800	0.800000	2023/6/20	1.00
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	3,000,000,000	101.21	3,036,516,000	100.99	3,029,820,000	0.100000	2029/9/20	0.94
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	2,920,000,000	100.70	2,940,550,000	100.66	2,939,418,000	0.100000	2023/12/20	0.91
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	2,830,000,000	103.09	2,917,447,000	102.46	2,899,646,300	0.600000	2024/6/20	0.90
日本	国債証券	第１３１回利付国債（５年）	2,710,000,000	100.51	2,723,821,000	100.24	2,716,585,300	0.100000	2022/3/20	0.84
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	2,660,000,000	101.55	2,701,230,000	101.22	2,692,531,800	0.100000	2028/6/20	0.84
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	2,620,000,000	101.33	2,654,846,000	101.13	2,649,763,200	0.100000	2026/6/20	0.82
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	2,610,000,000	101.51	2,649,439,600	101.25	2,642,729,400	0.100000	2028/3/20	0.82
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	2,520,000,000	100.67	2,536,902,000	100.54	2,533,834,800	0.100000	2023/6/20	0.79
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	2,470,000,000	102.82	2,539,654,000	102.28	2,526,316,000	0.500000	2024/9/20	0.78
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	2,450,000,000	101.42	2,484,790,000	101.21	2,479,718,500	0.100000	2026/12/20	0.77
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	2,420,000,000	101.04	2,445,298,000	100.89	2,441,707,400	0.100000	2024/12/20	0.76
日本	国債証券	第３３６回利付国債（１０年）	2,380,000,000	102.94	2,449,972,000	102.43	2,438,024,400	0.500000	2024/12/20	0.76
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	2,380,000,000	101.59	2,417,842,000	101.26	2,410,154,600	0.100000	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	2,380,000,000	101.02	2,404,316,400	101.02	2,404,371,200	0.100000	2025/9/20	0.75
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	2,370,000,000	101.36	2,402,445,500	101.23	2,399,222,100	0.100000	2027/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	2,370,000,000	100.74	2,387,690,600	100.82	2,389,434,000	0.100000	2030/3/20	0.74
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	2,360,000,000	100.97	2,383,102,000	100.78	2,378,431,600	0.100000	2024/6/20	0.74
日本	国債証券	第４１８回利付国債（２年）	2,360,000,000	100.48	2,371,402,600	100.43	2,370,336,800	0.100000	2022/11/1	0.74
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,335,000,000	102.30	2,388,705,000	101.51	2,370,328,550	0.800000	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	2,340,000,000	101.40	2,372,965,500	101.14	2,366,816,400	0.100000	2028/12/20	0.73
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	2,300,000,000	100.65	2,314,950,000	100.37	2,308,648,000	0.100000	2022/9/20	0.72
日本	国債証券	第１３２回利付国債（５年）	2,150,000,000	100.58	2,162,470,000	100.31	2,156,686,500	0.100000	2022/6/20	0.67
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	2,080,000,000	102.58	2,133,664,000	102.17	2,125,302,400	0.400000	2025/3/20	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

令和 3年 1月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	83.46

地方債証券	5.00
特殊債券	6.09
社債券	5.01
合計	99.56

（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

令和 3年 1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 2 1 年 0 3 月限	買建	3	円	455,723,300	455,460,000	0.14

（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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

令和 3年 1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	108,446,319,283	43.02
	フランス	26,502,980,122	10.51
	イタリア	23,656,362,414	9.38
	ドイツ	19,459,368,926	7.72
	イギリス	17,247,842,864	6.84
	スペイン	15,195,235,003	6.03
	オーストラリア	6,929,865,926	2.75
	ベルギー	6,130,830,149	2.43
	カナダ	4,853,676,519	1.93
	オランダ	4,747,034,666	1.88
	オーストリア	3,964,184,554	1.57
	アイルランド	2,052,032,140	0.81
	メキシコ	1,986,289,600	0.79
	フィンランド	1,626,633,777	0.65
	シンガポール	1,626,434,240	0.65
	ポーランド	1,581,201,779	0.63
	デンマーク	1,237,878,204	0.49
	イスラエル	1,119,908,957	0.44

	スウェーデン	825,811,953	0.33
	ノルウェー	559,415,538	0.22
	小計	249,749,306,614	99.08
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	2,327,101,580	0.92
純資産総額		252,076,408,194	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

令和 3年 1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	3 T-NOTE 250930	12,000,000	11,722.98	1,406,757,900	11,713.18	1,405,582,500	3.000000	2025/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 250731	11,900,000	11,629.93	1,383,961,670	11,625.03	1,383,378,867	2.875000	2025/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	12,150,000	11,224.25	1,363,746,830	11,220.98	1,363,350,132	2.000000	2025/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 280215	11,400,000	11,900.92	1,356,705,450	11,890.31	1,355,495,767	2.750000	2028/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 250515	12,000,000	11,251.19	1,350,142,800	11,247.10	1,349,653,050	2.125000	2025/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300815	13,200,000	10,072.52	1,329,573,300	10,057.01	1,327,526,144	0.625000	2030/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 221115	12,150,000	10,730.83	1,303,795,920	10,730.83	1,303,795,920	1.625000	2022/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 270815	11,300,000	11,518.92	1,301,637,960	11,508.30	1,300,438,888	2.250000	2027/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	3.125 T-NOTE 281115	10,600,000	12,268.23	1,300,433,175	12,254.36	1,298,962,292	3.125000	2028/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220430	12,000,000	10,682.26	1,281,871,650	10,678.99	1,281,479,850	1.875000	2022/4/30	0.51
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 270515	10,500,000	11,589.11	1,216,857,337	11,576.87	1,215,571,743	2.375000	2027/5/15	0.48
イタリア	国債証券	5.25 ITALY GOVT 291101	6,680,000	17,766.08	1,186,774,752	17,812.84	1,189,898,297	5.250000	2029/11/1	0.47
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250215	10,500,000	11,167.93	1,172,632,912	11,163.85	1,172,204,381	2.000000	2025/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	9,400,000	12,018.46	1,129,735,710	12,006.22	1,128,584,797	2.875000	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 240331	10,100,000	11,085.49	1,119,634,616	11,080.59	1,119,139,968	2.125000	2024/3/31	0.44
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	6,800,000	16,106.41	1,095,236,461	16,093.12	1,094,332,533	2.500000	2030/5/25	0.43
アメリカ	国債証券	1.75 T-NOTE 230515	10,000,000	10,835.71	1,083,571,875	10,832.45	1,083,245,375	1.750000	2023/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 221130	10,000,000	10,811.23	1,081,123,125	10,809.59	1,080,959,875	2.000000	2022/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	9,500,000	11,376.07	1,080,727,243	11,367.91	1,079,951,805	2.250000	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 220930	10,000,000	10,756.54	1,075,654,250	10,754.91	1,075,491,000	1.875000	2022/9/30	0.43
フランス	国債証券	5.5 O.A.T 290425	5,640,000	19,003.87	1,071,818,435	18,996.19	1,071,385,433	5.500000	2029/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	8,900,000	12,046.21	1,072,113,357	12,033.15	1,070,951,017	2.875000	2028/8/15	0.42

アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 241115	9,500,000	11,234.86	1,067,312,175	11,226.70	1,066,536,737	2.250000	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	2.625 T-NOTE 290215	8,800,000	11,891.13	1,046,419,440	11,877.25	1,045,198,330	2.625000	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 240815	9,200,000	11,240.57	1,034,133,245	11,239.76	1,034,058,150	2.375000	2024/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.375 T-NOTE 290515	8,800,000	11,701.34	1,029,718,790	11,684.61	1,028,246,449	2.375000	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 240515	9,100,000	11,239.76	1,022,818,387	11,234.04	1,022,298,436	2.500000	2024/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 260515	9,200,000	11,078.14	1,019,189,340	11,074.06	1,018,813,865	1.625000	2026/5/15	0.40
フランス	国債証券	4.5 O.A.T 410425	4,260,000	23,877.90	1,017,198,807	23,781.75	1,013,102,812	4.500000	2041/4/25	0.40
フランス	国債証券	4.25 O.A.T 231025	7,000,000	14,390.51	1,007,336,047	14,391.26	1,007,388,283	4.250000	2023/10/25	0.40

（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

令和 3年 1月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.08
合計	99.08

（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。

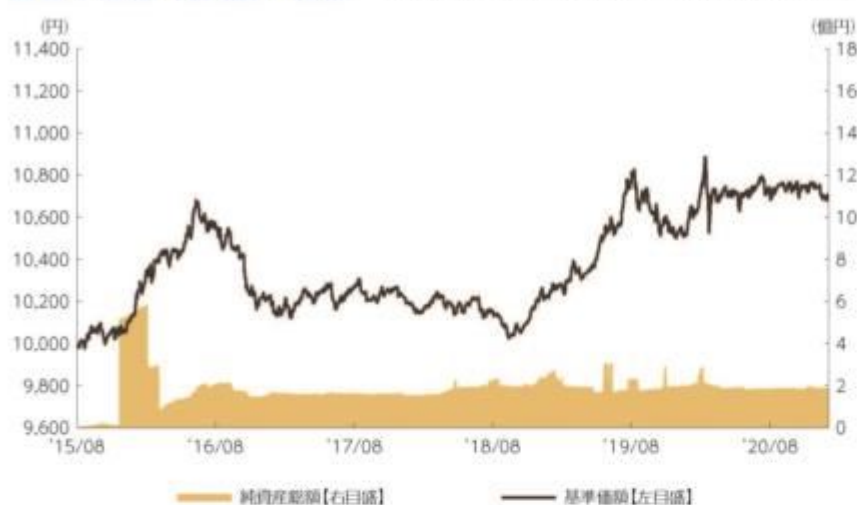
参考情報



運用実績

2021年1月29日現在

■基準価額・純資産の推移 2015年8月27日(設定日)～2021年1月29日



■基準価額・純資産

基準価額	10,693円
純資産総額	1.8億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2021年1月	0円
2020年1月	0円
2019年1月	0円
2018年1月	0円
2017年1月	0円
2016年1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

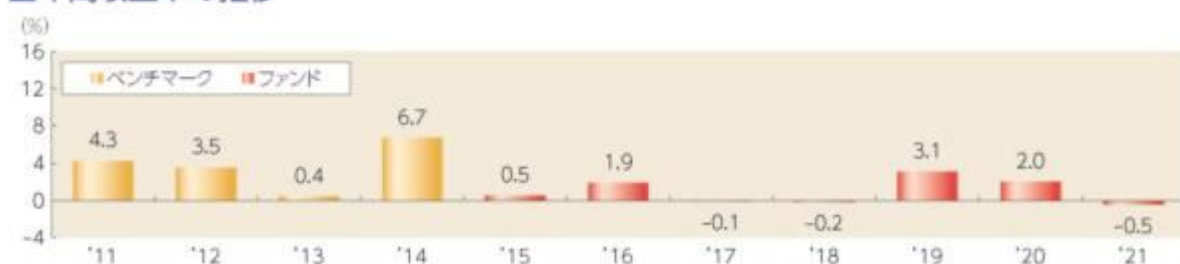
資産別構成	比率
国内債券	49.3%
外国債券	49.6%
コールローン他 (負債控除後)	1.1%
合計	100.0%

組入上位銘柄	種別	国・地域	比率
1 第144回利付国債(5年)	国債	日本	0.7%
2 第359回利付国債(10年)	国債	日本	0.6%
3 第134回利付国債(5年)	国債	日本	0.6%
4 第333回利付国債(10年)	国債	日本	0.6%
5 第360回利付国債(10年)	国債	日本	0.5%
6 第354回利付国債(10年)	国債	日本	0.5%
7 第329回利付国債(10年)	国債	日本	0.5%
8 第356回利付国債(10年)	国債	日本	0.5%
9 第138回利付国債(5年)	国債	日本	0.5%
10 第334回利付国債(10年)	国債	日本	0.4%

その他資産の状況	比率
債券先物取引 (買建)	0.1%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■年間収益率の推移



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。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
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。

1【申込（販売）手続等】

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、以下の日は申込みができません。

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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。

申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、１円以上１円単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

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。

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国際投信株式会社

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

申込手数料

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社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には販売会社により異なる場合があります。

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。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があります。

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。

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】

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。

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日

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す。

解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、１口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

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。

解約価額の照会方法

解約価額は、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国際投信株式会社

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/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

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５営業日目から販売会社において支払います。

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。確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

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す。

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】

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。

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。

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国際投信株式会社

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/>
eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2015年8月27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。

（４）【計算期間】

毎年１月27日から翌年１月26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】

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10億口を下回ることとなった場合
- ・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。

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。

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発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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应じて受領する権利を有します。

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。

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（令和2年1月28日から令和3年1月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【eMAXIS 債券バランス（２資産均等型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,467,702	1,415,968
親投資信託受益証券	198,313,664	187,123,430
未収入金	460,185	250,330
流動資産合計	200,241,551	188,789,728
資産合計	200,241,551	188,789,728
負債の部		
流動負債		
未払解約金	510,522	316,978
未払受託者報酬	53,806	51,350
未払委託者報酬	376,576	359,420
その他未払費用	3,822	3,636
流動負債合計	944,726	731,384
負債合計	944,726	731,384
純資産の部		
元本等		
元本	188,006,374	175,652,658
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,290,451	12,405,686
（分配準備積立金）	2,225,256	2,805,529
元本等合計	199,296,825	188,058,344
純資産合計	199,296,825	188,058,344
負債純資産合計	200,241,551	188,789,728

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日	第6期 自 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26日
営業収益		
受取利息	3	4
有価証券売買等損益	6,946,742	3,622,262
営業収益合計	6,946,745	3,622,266
営業費用		
支払利息	603	271
受託者報酬	109,134	105,908
委託者報酬	763,817	741,246
その他費用	7,746	7,498
営業費用合計	881,300	854,923
営業利益又は営業損失（ ）	6,065,445	2,767,343
経常利益又は経常損失（ ）	6,065,445	2,767,343
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,065,445	2,767,343
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（ ）	5,704,968	1,910,079
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,217,935	11,290,451
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,487,735	10,066,129
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	34,487,735	10,066,129
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,775,696	9,808,158
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	29,775,696	9,808,158
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,290,451	12,405,686

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月26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、当計算期間は令和 2年 1月28日から令和 3年 1月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26日現在]
１．期首元本額	253,106,128円	188,006,374円
期中追加設定元本額	625,679,444円	143,380,594円
期中一部解約元本額	690,779,198円	155,734,310円
２．受益権の総数	188,006,374口	175,652,658口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日	第6期 自 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>2,068,458円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>9,065,195円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>156,798円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>11,290,451円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>188,006,374口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>600円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,068,458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	9,065,195円	分配準備積立金額	D	156,798円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,290,451円	当ファンドの期末残存口数	F	188,006,374口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	600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	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,782,093円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>9,600,157円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,023,436円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>12,405,686円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>175,652,658口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>706円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,782,093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	9,600,157円	分配準備積立金額	D	1,023,436円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,405,686円	当ファンドの期末残存口数	F	175,652,658口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	706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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,068,458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	9,065,195円																																																											
分配準備積立金額	D	156,798円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,290,451円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	188,006,374口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	600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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,782,093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	9,600,157円																																																											
分配準備積立金額	D	1,023,436円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,405,686円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	175,652,658口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	706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5期 自 平成31年 1月29日 至 令和 2年 1月27日	第6期 自 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26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、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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26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。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26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)
親投資信託受益証券	866,986	1,914,812
合計	866,986	1,914,812

（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5期 [令和 2年 1月27日現在]	第6期 [令和 3年 1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.0601円	1.0706円
(1万口当たり純資産額)	(10,601円)	(10,706円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド	66,972,125	94,162,807	
	日本債券インデックスマザーファンド	69,064,356	92,960,623	
合 計		136,036,481	187,123,430	

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）

[令和 3年 1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,729,654,230
国債証券	267,543,477,670
地方債証券	16,223,929,963
特殊債券	19,841,906,002
社債券	15,450,810,500
派生商品評価勘定	138,900
未収入金	1,724,783,700
未収利息	585,623,370
前払費用	17,625,094
差入委託証拠金	720,000
流動資産合計	323,118,669,429
資産合計	323,118,669,429

[令和 3年 1月26日現在]

負債の部	
流動負債	
前受金	40,000
未払金	1,005,225,000
未払解約金	1,731,159,031
未払利息	374
流動負債合計	2,736,424,405
負債合計	2,736,424,405
純資産の部	
元本等	
元本	238,024,505,595
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,357,739,429
元本等合計	320,382,245,024
純資産合計	320,382,245,024
負債純資産合計	323,118,669,429

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。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 1月26日現在]
1. 期首	令和 2年 1月28日
期首元本額	469,427,501,298円
期中追加設定元本額	252,896,356,603円
期中一部解約元本額	484,299,352,306円
元本の内訳	
e M A X I S 国内債券インデックス	8,945,766,609円
e M A X I S バランス（ 8 資産均等型）	2,734,974,890円
e M A X I S バランス（波乗り型）	72,335,888円
コアバランス	2,423,387円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	1,297,420,823円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	658,239,244円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	271,050,809円
e M A X I S S l i m 国内債券インデックス	8,712,915,788円
国内債券セレクション（ラップ向け）	5,215,120,339円
e M A X I S S l i m バランス（ 8 資産均等型）	6,384,044,296円

	[令和 3年 1月26日現在]
つみたて８資産均等バランス	2,938,288,715円
つみたて４資産均等バランス	878,409,934円
eMAXIS マイマネージャー １９７０s	3,038,452円
eMAXIS マイマネージャー １９８０s	798,301円
eMAXIS マイマネージャー １９９０s	64,949円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	533,809,780円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	207,589,982円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	69,593,239円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	68,893,460円
国内債券インデックスファンド（ラップ向け）	11,148,007円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	2,106,912円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	206,323,255円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	237,370,694円
eMAXIS 債券バランス（２資産均等型）	69,064,356円
eMAXIS バランス（４資産均等型）	569,177,036円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	820,233,651円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	437,185,650円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	860,814,366円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	82,166,215円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	16,538,000円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,099,467円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,225,984,560円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,105,800,551円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,961,137,518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）	128,780,148,638円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	533,047,789円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,608,439円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	3,843,177円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,989,970,146円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,262,577,967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）	4,721,520,243円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	273,965,263円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	11,684,152,030円

	[令和 3年 1月26日現在]
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）	4,434,903,509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）	3,123,670,205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）	464,386,656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）	463,972,979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）	464,110,790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）	464,145,255円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	16,184,214円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	28,534,093円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	11,479,781円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	7,860,621円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	77,852,055円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	163,079,657円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	52,728,491円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	98,231,357円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,224,683,932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）	2,126,406,325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）	4,053,951,140円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	2,357,807,200円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	1,452,754,520円
合計	238,024,505,595円
2. 受益権の総数	238,024,505,595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 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26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。

区分	自 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26日
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、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 1月26日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 3年 1月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,850,309,940
地方債証券	63,901,772
特殊債券	109,275,663
社債券	53,181,000

合計	2,970,306,375
----	---------------

(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

[令和 3年 1月26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	151,840,000	—	151,980,000	140,000
合計		151,840,000	—	151,980,000	140,000

（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）

	[令和 3年 1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.3460円
(1万口当たり純資産額)	(13,460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４０９回利付国債（２年）	500,000,000	501,190,000	
	第４１５回利付国債（２年）	1,600,000,000	1,605,680,000	
	第４１７回利付国債（２年）	550,000,000	552,216,500	
	第４１８回利付国債（２年）	2,360,000,000	2,370,620,000	
	第４２０回利付国債（２年）	680,000,000	683,155,200	
	第１３１回利付国債（５年）	2,710,000,000	2,717,127,300	
	第１３２回利付国債（５年）	2,150,000,000	2,157,052,000	
	第１３３回利付国債（５年）	2,300,000,000	2,308,901,000	
	第１３４回利付国債（５年）	4,140,000,000	4,158,464,400	
	第１３６回利付国債（５年）	2,520,000,000	2,534,212,800	
	第１３７回利付国債（５年）	900,000,000	905,616,000	
	第１３８回利付国債（５年）	3,220,000,000	3,241,992,600	
	第１３９回利付国債（５年）	850,000,000	856,298,500	
	第１４０回利付国債（５年）	2,360,000,000	2,378,903,600	
	第１４１回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,028,782,200	
	第１４２回利付国債（５年）	2,420,000,000	2,442,264,000	
	第１４３回利付国債（５年）	1,890,000,000	1,908,484,200	
	第１４４回利付国債（５年）	4,690,000,000	4,738,682,200	
	第１４５回利付国債（５年）	2,680,000,000	2,708,810,000	
	第１回利付国債（４０年）	225,000,000	325,998,000	
	第２回利付国債（４０年）	470,000,000	660,599,100	
	第３回利付国債（４０年）	433,000,000	612,443,860	
	第４回利付国債（４０年）	598,000,000	850,918,120	
	第５回利付国債（４０年）	635,000,000	875,157,000	
	第６回利付国債（４０年）	530,000,000	719,533,300	
	第７回利付国債（４０年）	680,000,000	889,242,800	
	第８回利付国債（４０年）	680,000,000	831,796,400	
	第９回利付国債（４０年）	1,100,000,000	1,006,918,000	
	第１０回利付国債（４０年）	1,160,000,000	1,244,865,600	
	第１１回利付国債（４０年）	830,000,000	863,374,300	
	第１２回利付国債（４０年）	980,000,000	920,994,200	
	第１３回利付国債（４０年）	790,000,000	741,454,500	
	第３２１回利付国債（１０年）	1,415,000,000	1,433,281,800	
	第３２２回利付国債（１０年）	770,000,000	779,070,600	
	第３２３回利付国債（１０年）	975,000,000	989,020,500	
	第３２４回利付国債（１０年）	1,600,000,000	1,620,784,000	
	第３２５回利付国債（１０年）	2,335,000,000	2,370,818,900	
	第３２６回利付国債（１０年）	530,000,000	538,358,100	
	第３２７回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,567,211,800	
	第３２８回利付国債（１０年）	2,000,000,000	2,031,360,000	
	第３２９回利付国債（１０年）	3,160,000,000	3,230,562,800	

第３３０回利付国債（１０年）	1,830,000,000	1,874,944,800	
第３３１回利付国債（１０年）	760,000,000	774,728,800	
第３３２回利付国債（１０年）	1,240,000,000	1,266,300,400	
第３３３回利付国債（１０年）	3,550,000,000	3,631,756,500	
第３３４回利付国債（１０年）	2,830,000,000	2,900,410,400	
第３３５回利付国債（１０年）	2,470,000,000	2,527,007,600	
第３３６回利付国債（１０年）	2,380,000,000	2,438,690,800	
第３３７回利付国債（１０年）	640,000,000	650,771,200	
第３３８回利付国債（１０年）	2,080,000,000	2,125,905,600	
第３３９回利付国債（１０年）	1,960,000,000	2,006,354,000	
第３４０回利付国債（１０年）	1,050,000,000	1,076,008,500	
第３４１回利付国債（１０年）	2,070,000,000	2,113,325,100	
第３４２回利付国債（１０年）	1,890,000,000	1,911,508,200	
第３４３回利付国債（１０年）	2,620,000,000	2,651,282,800	
第３４４回利付国債（１０年）	1,930,000,000	1,953,565,300	
第３４５回利付国債（１０年）	2,680,000,000	2,714,196,800	
第３４６回利付国債（１０年）	2,140,000,000	2,167,777,200	
第３４７回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,864,269,600	
第３４８回利付国債（１０年）	2,380,000,000	2,411,844,400	
第３４９回利付国債（１０年）	1,790,000,000	1,814,218,700	
第３５０回利付国債（１０年）	2,610,000,000	2,645,626,500	
第３５１回利付国債（１０年）	2,660,000,000	2,696,601,600	
第３５２回利付国債（１０年）	1,570,000,000	1,591,116,500	
第３５３回利付国債（１０年）	2,340,000,000	2,370,630,600	
第３５４回利付国債（１０年）	3,250,000,000	3,291,177,500	
第３５５回利付国債（１０年）	1,990,000,000	2,014,297,900	
第３５６回利付国債（１０年）	3,000,000,000	3,035,100,000	
第３５７回利付国債（１０年）	1,840,000,000	1,859,669,600	
第３５８回利付国債（１０年）	2,370,000,000	2,393,842,200	
第３５９回利付国債（１０年）	4,140,000,000	4,178,874,600	
第３６０回利付国債（１０年）	3,340,000,000	3,367,321,200	
第１回利付国債（３０年）	76,000,000	94,604,040	
第２回利付国債（３０年）	98,000,000	119,484,540	
第３回利付国債（３０年）	117,000,000	142,117,560	
第４回利付国債（３０年）	127,000,000	162,824,160	
第５回利付国債（３０年）	58,000,000	70,826,120	
第６回利付国債（３０年）	169,000,000	211,373,370	
第７回利付国債（３０年）	114,000,000	142,365,480	
第８回利付国債（３０年）	142,000,000	170,196,940	
第９回利付国債（３０年）	116,000,000	133,649,400	
第１０回利付国債（３０年）	135,000,000	150,923,250	
第１１回利付国債（３０年）	137,000,000	163,335,510	

第 1 2 回利付国債（ 3 0 年）	120,000,000	149,319,600	
第 1 3 回利付国債（ 3 0 年）	205,000,000	253,138,100	
第 1 4 回利付国債（ 3 0 年）	393,000,000	506,962,140	
第 1 5 回利付国債（ 3 0 年）	246,000,000	321,696,660	
第 1 6 回利付国債（ 3 0 年）	202,000,000	264,949,260	
第 1 7 回利付国債（ 3 0 年）	227,000,000	295,317,920	
第 1 8 回利付国債（ 3 0 年）	327,000,000	422,022,930	
第 1 9 回利付国債（ 3 0 年）	303,000,000	392,027,460	
第 2 0 回利付国債（ 3 0 年）	395,000,000	523,904,300	
第 2 1 回利付国債（ 3 0 年）	279,000,000	362,700,000	
第 2 2 回利付国債（ 3 0 年）	470,000,000	626,575,800	
第 2 3 回利付国債（ 3 0 年）	54,000,000	72,171,540	
第 2 4 回利付国債（ 3 0 年）	311,000,000	416,677,800	
第 2 5 回利付国債（ 3 0 年）	442,000,000	580,080,800	
第 2 6 回利付国債（ 3 0 年）	584,000,000	777,613,520	
第 2 7 回利付国債（ 3 0 年）	60,000,000	81,250,200	
第 2 8 回利付国債（ 3 0 年）	611,000,000	830,831,690	
第 2 9 回利付国債（ 3 0 年）	50,000,000	67,427,500	
第 3 0 回利付国債（ 3 0 年）	996,000,000	1,330,725,720	
第 3 1 回利付国債（ 3 0 年）	858,000,000	1,134,850,860	
第 3 2 回利付国債（ 3 0 年）	739,000,000	995,743,380	
第 3 3 回利付国債（ 3 0 年）	944,000,000	1,223,575,040	
第 3 4 回利付国債（ 3 0 年）	1,016,000,000	1,360,698,320	
第 3 5 回利付国債（ 3 0 年）	1,119,000,000	1,460,451,660	
第 3 6 回利付国債（ 3 0 年）	1,059,000,000	1,386,591,060	
第 3 7 回利付国債（ 3 0 年）	1,317,000,000	1,703,763,390	
第 3 8 回利付国債（ 3 0 年）	535,000,000	682,494,150	
第 3 9 回利付国債（ 3 0 年）	710,000,000	921,317,300	
第 4 0 回利付国債（ 3 0 年）	630,000,000	804,793,500	
第 4 1 回利付国債（ 3 0 年）	570,000,000	716,404,500	
第 4 2 回利付国債（ 3 0 年）	550,000,000	691,922,000	
第 4 3 回利付国債（ 3 0 年）	770,000,000	969,614,800	
第 4 4 回利付国債（ 3 0 年）	620,000,000	781,454,200	
第 4 5 回利付国債（ 3 0 年）	720,000,000	876,492,000	
第 4 6 回利付国債（ 3 0 年）	900,000,000	1,096,236,000	
第 4 7 回利付国債（ 3 0 年）	880,000,000	1,092,836,800	
第 4 8 回利付国債（ 3 0 年）	860,000,000	1,028,706,200	
第 4 9 回利付国債（ 3 0 年）	930,000,000	1,112,847,300	
第 5 0 回利付国債（ 3 0 年）	820,000,000	866,231,600	
第 5 1 回利付国債（ 3 0 年）	980,000,000	918,240,400	
第 5 2 回利付国債（ 3 0 年）	820,000,000	806,248,600	
第 5 3 回利付国債（ 3 0 年）	870,000,000	874,898,100	

第 5 4 回利付国債（ 3 0 年）	580,000,000	610,345,600	
第 5 5 回利付国債（ 3 0 年）	860,000,000	904,341,600	
第 5 6 回利付国債（ 3 0 年）	780,000,000	819,600,600	
第 5 7 回利付国債（ 3 0 年）	770,000,000	808,469,200	
第 5 8 回利付国債（ 3 0 年）	1,470,000,000	1,542,221,100	
第 5 9 回利付国債（ 3 0 年）	560,000,000	573,171,200	
第 6 0 回利付国債（ 3 0 年）	690,000,000	739,962,900	
第 6 1 回利付国債（ 3 0 年）	890,000,000	908,004,700	
第 6 2 回利付国債（ 3 0 年）	490,000,000	474,202,400	
第 6 3 回利付国債（ 3 0 年）	500,000,000	470,035,000	
第 6 4 回利付国債（ 3 0 年）	1,100,000,000	1,032,339,000	
第 6 5 回利付国債（ 3 0 年）	750,000,000	702,675,000	
第 6 6 回利付国債（ 3 0 年）	380,000,000	355,851,000	
第 6 7 回利付国債（ 3 0 年）	1,240,000,000	1,224,698,400	
第 6 8 回利付国債（ 3 0 年）	750,000,000	740,677,500	
第 5 5 回利付国債（ 2 0 年）	241,000,000	246,885,220	
第 5 6 回利付国債（ 2 0 年）	349,000,000	359,382,750	
第 5 8 回利付国債（ 2 0 年）	147,000,000	151,923,030	
第 5 9 回利付国債（ 2 0 年）	489,000,000	506,007,420	
第 6 1 回利付国債（ 2 0 年）	289,000,000	296,014,030	
第 6 3 回利付国債（ 2 0 年）	342,000,000	357,851,700	
第 6 4 回利付国債（ 2 0 年）	341,000,000	359,335,570	
第 6 5 回利付国債（ 2 0 年）	218,000,000	230,829,300	
第 6 6 回利付国債（ 2 0 年）	400,000,000	422,376,000	
第 6 8 回利付国債（ 2 0 年）	646,000,000	693,487,460	
第 7 0 回利付国債（ 2 0 年）	222,000,000	241,149,720	
第 7 1 回利付国債（ 2 0 年）	160,000,000	172,710,400	
第 7 2 回利付国債（ 2 0 年）	434,000,000	469,457,800	
第 7 3 回利付国債（ 2 0 年）	320,000,000	346,688,000	
第 7 4 回利付国債（ 2 0 年）	318,000,000	345,767,760	
第 7 5 回利付国債（ 2 0 年）	475,000,000	519,004,000	
第 7 6 回利付国債（ 2 0 年）	200,000,000	216,864,000	
第 7 7 回利付国債（ 2 0 年）	110,000,000	119,732,800	
第 7 8 回利付国債（ 2 0 年）	310,000,000	337,738,800	
第 7 9 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	54,694,500	
第 8 0 回利付国債（ 2 0 年）	215,000,000	236,136,650	
第 8 1 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	274,827,500	
第 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	462,000,000	510,043,380	
第 8 3 回利付国債（ 2 0 年）	213,000,000	236,287,290	
第 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	470,000,000	519,068,000	
第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	323,228,200	
第 8 6 回利付国債（ 2 0 年）	515,000,000	579,333,800	

第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	279,937,500	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	804,000,000	909,396,360	
第 8 9 回利付国債（ 2 0 年）	210,000,000	236,388,600	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	800,000,000	905,000,000	
第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	468,000,000	532,083,240	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	832,000,000	941,108,480	
第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	190,000,000	214,724,700	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	615,000,000	698,836,800	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	817,000,000	943,487,940	
第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	220,000,000	251,229,000	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	243,000,000	280,300,500	
第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	270,000,000	309,638,700	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	845,000,000	973,744,200	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	660,000,000	768,372,000	
第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	373,000,000	439,606,610	
第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	330,000,000	390,875,100	
第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	440,000,000	517,893,200	
第 1 0 4 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	348,645,000	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	570,000,000	665,087,400	
第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	411,000,000	482,723,610	
第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	367,000,000	429,889,120	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	577,745,000	
第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	500,000,000	579,950,000	
第 1 1 0 回利付国債（ 2 0 年）	596,000,000	701,045,000	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	411,000,000	488,748,870	
第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	840,000,000	991,821,600	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	682,000,000	808,279,120	
第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	1,020,000,000	1,212,698,400	
第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	654,000,000	783,387,360	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	246,000,000	295,748,580	
第 1 1 7 回利付国債（ 2 0 年）	1,090,000,000	1,300,457,200	
第 1 1 8 回利付国債（ 2 0 年）	76,000,000	90,279,640	
第 1 1 9 回利付国債（ 2 0 年）	160,000,000	187,056,000	
第 1 2 0 回利付国債（ 2 0 年）	260,000,000	299,080,600	
第 1 2 1 回利付国債（ 2 0 年）	839,000,000	991,337,230	
第 1 2 2 回利付国債（ 2 0 年）	100,000,000	117,194,000	
第 1 2 3 回利付国債（ 2 0 年）	518,000,000	623,791,140	
第 1 2 4 回利付国債（ 2 0 年）	900,000,000	1,074,933,000	
第 1 2 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,104,000,000	1,344,881,760	
第 1 2 7 回利付国債（ 2 0 年）	350,000,000	415,758,000	
第 1 2 8 回利付国債（ 2 0 年）	1,054,000,000	1,255,630,200	
第 1 3 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,152,000,000	1,364,048,640	

第１３１回利付国債（２０年）	290,000,000	340,312,100	
第１３２回利付国債（２０年）	187,000,000	220,078,430	
第１３３回利付国債（２０年）	970,000,000	1,152,078,700	
第１３４回利付国債（２０年）	1,225,000,000	1,458,497,250	
第１３６回利付国債（２０年）	130,000,000	151,906,300	
第１３７回利付国債（２０年）	732,000,000	865,407,000	
第１３８回利付国債（２０年）	350,000,000	405,888,000	
第１３９回利付国債（２０年）	400,000,000	468,388,000	
第１４０回利付国債（２０年）	1,117,000,000	1,323,510,960	
第１４１回利付国債（２０年）	220,000,000	261,225,800	
第１４２回利付国債（２０年）	1,510,000,000	1,810,701,400	
第１４３回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,248,499,800	
第１４４回利付国債（２０年）	230,000,000	268,145,500	
第１４５回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,907,568,000	
第１４６回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,290,157,200	
第１４７回利付国債（２０年）	1,620,000,000	1,918,387,800	
第１４８回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,443,072,900	
第１４９回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,539,184,500	
第１５０回利付国債（２０年）	1,560,000,000	1,814,701,200	
第１５１回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,807,400,700	
第１５２回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,274,033,600	
第１５３回利付国債（２０年）	1,540,000,000	1,774,526,600	
第１５４回利付国債（２０年）	1,110,000,000	1,264,345,500	
第１５５回利付国債（２０年）	1,420,000,000	1,576,327,800	
第１５６回利付国債（２０年）	900,000,000	919,026,000	
第１５７回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,484,475,000	
第１５８回利付国債（２０年）	850,000,000	878,687,500	
第１５９回利付国債（２０年）	940,000,000	985,768,600	
第１６０回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,350,289,400	
第１６１回利付国債（２０年）	1,250,000,000	1,308,587,500	
第１６２回利付国債（２０年）	1,710,000,000	1,788,489,000	
第１６３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,285,202,400	
第１６４回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,334,762,000	
第１６５回利付国債（２０年）	1,300,000,000	1,333,059,000	
第１６６回利付国債（２０年）	1,980,000,000	2,095,176,600	
第１６７回利付国債（２０年）	1,120,000,000	1,145,390,400	
第１６８回利付国債（２０年）	920,000,000	923,118,800	
第１６９回利付国債（２０年）	890,000,000	875,493,000	
第１７０回利付国債（２０年）	1,010,000,000	991,607,900	
第１７１回利付国債（２０年）	830,000,000	813,981,000	
第１７２回利付国債（２０年）	1,220,000,000	1,216,742,600	
第１７３回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,305,297,100	

	第１７４回利付国債（２０年）	1,310,000,000	1,302,873,600	
国債証券 合計		248,791,000,000	267,543,477,670	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	20,000,000	20,733,400	
	第４回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	216,124,000	
	第７回東京都公募公債（３０年）	10,000,000	13,518,100	
	第２０回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	93,648,800	
	第２１回東京都公募公債（２０年）	80,000,000	94,626,400	
	第２２回東京都公募公債（２０年）	120,000,000	140,132,400	
	第２８回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	116,341,000	
	第３３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	97,379,000	
	第７１１回東京都公募公債	300,000,000	304,008,000	
	第７１９回東京都公募公債	100,000,000	101,823,000	
	第７２２回東京都公募公債	100,000,000	101,893,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	102,136,000	
	第７６８回東京都公募公債	100,000,000	100,763,000	
	平成２４年度第９回北海道公募公債	100,000,000	101,347,000	
	平成２５年度第７回北海道公募公債	150,000,000	153,012,000	
	平成２８年度第１２回北海道公募公債	100,000,000	100,589,000	
	平成２９年度第１５回北海道公募公債	117,000,000	118,227,330	
	第２９回１号宮城県公募公債	100,000,000	101,839,000	
	第２回神奈川県公募公債（２０年）	80,000,000	86,479,200	
	第２回神奈川県公募公債（３０年）	80,000,000	110,078,400	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,856,000	
	第１９１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,145,000	
	第１１回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	117,869,000	
	第３４８回大阪府公募公債	10,000,000	10,022,400	
	第３５８回大阪府公募公債	56,000,000	56,576,800	
	第３５９回大阪府公募公債	56,000,000	56,631,680	
	第３７５回大阪府公募公債	100,000,000	102,096,000	
	第３７６回大阪府公募公債	106,000,000	108,248,260	
	第３７８回大阪府公募公債	300,000,000	305,736,000	
	第３８５回大阪府公募公債	200,000,000	204,266,000	
	第３８８回大阪府公募公債	200,000,000	203,774,000	
	第３９３回大阪府公募公債	110,000,000	111,987,700	
	第４１９回大阪府公募公債	300,000,000	302,256,000	
	第４２９回大阪府公募公債	103,000,000	103,838,420	
	平成２３年度第９回京都府公募公債	140,000,000	141,587,600	
	第１回兵庫県公募公債（１５年）	300,000,000	326,154,000	
	第２回兵庫県公募公債（３０年）	40,000,000	53,727,200	
	第４回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,489,000	
	第５回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	108,959,000	
	第１０回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	119,135,000	

平成２８年度第２回兵庫県公募公債	200,000,000	200,104,000	
平成２８年度第３回兵庫県公募公債	200,000,000	200,104,000	
第１４回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	117,304,000	
平成２５年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	101,271,000	
平成２５年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	102,284,000	
平成２５年度第８回静岡県公募公債	130,000,000	132,454,400	
平成２３年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	108,504,000	
平成２３年度第１７回愛知県公募公債	100,000,000	101,000,000	
平成２４年度第１３回愛知県公募公債	100,000,000	101,405,000	
平成２４年度第１５回愛知県公募公債	250,000,000	253,517,500	
平成３０年度第８回愛知県公募公債	200,000,000	202,718,000	
平成２２年度第８回広島県公募公債	26,650,000	26,706,231	
平成２３年度第７回広島県公募公債	100,000,000	101,141,000	
平成２８年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	100,734,000	
第４回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	228,012,000	
第１６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,693,000	
平成２６年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	101,301,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	94,967,600	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	105,019,200	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	101,685,000	
平成２６年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,198,000	
平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	102,229,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	93,288,800	
平成２３年度第９回千葉県公募公債	20,000,000	20,229,400	
平成２４年度第１回千葉県公募公債	20,000,000	20,258,600	
平成２４年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,464,000	
平成２５年度第１回千葉県公募公債	82,500,000	83,555,175	
平成２５年度第８回千葉県公募公債	100,000,000	101,864,000	
第７回群馬県公募公債（２０年）	100,000,000	99,391,000	
平成２４年度第１回大分県公募公債	100,260,000	101,655,619	
平成２７年度第１回大分県公募公債	203,400,000	207,909,378	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,167,000	
第１１４回共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,360,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,351,000	
第１２３回共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,340,000	
第１２４回共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,976,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,839,000	
第１３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,245,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,895,000	
第１４２回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,674,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,680,000	
第１６２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,765,000	

	第 1 7 8 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,184,000	
	平成 3 0 年度第 1 回福島県公募公債	100,000,000	101,363,000	
	平成 2 5 年度第 1 回栃木県公募公債	100,000,000	101,816,000	
	平成 2 4 年度第 2 回熊本県公募公債	50,000,000	50,690,500	
	平成 2 4 年度第 1 回浜松市公募公債	100,000,000	101,666,000	
	平成 2 5 年度第 1 回浜松市公募公債	161,000,000	164,617,670	
	第 5 回大阪市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	118,260,000	
	平成 2 3 年度第 1 0 回大阪市公募公債	10,000,000	10,094,800	
	第 1 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	130,774,000	
	第 1 0 回名古屋市公募公債（ 2 0 年 ）	80,000,000	94,696,800	
	第 5 回京都市公募公債（ 2 0 年 ）	50,000,000	56,768,500	
	平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	101,371,000	
	平成 2 0 年度第 2 4 回神戸市公募公債（ 2 0 年 ）	300,000,000	346,950,000	
	平成 2 2 年度第 4 回神戸市公募公債	100,000,000	117,006,000	
	第 7 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	200,000,000	220,066,000	
	第 2 0 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	80,000,000	93,804,000	
	平成 2 4 年度第 2 回横浜市公募公債	100,000,000	101,387,000	
	平成 2 4 年度第 3 回横浜市公募公債	100,000,000	101,368,000	
	平成 2 7 年度第 2 回横浜市公募公債	200,000,000	204,892,000	
	平成 2 7 年度第 3 回横浜市公募公債	500,000,000	511,710,000	
	第 2 7 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	60,000,000	69,921,600	
	第 3 3 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	99,612,000	
	第 3 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	300,000,000	303,366,000	
	平成 2 2 年度第 8 回札幌市公募公債（ 3 0 年 ）	80,000,000	106,553,600	
	平成 2 3 年度第 3 回札幌市公募公債	100,000,000	118,431,000	
	平成 2 4 年度第 1 0 回札幌市公募公債	100,000,000	101,499,000	
	第 1 7 回北九州市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	116,360,000	
	平成 2 5 年度第 3 回北九州市公募公債	100,000,000	102,045,000	
	平成 2 4 年度第 4 回福岡市公募公債	200,000,000	202,784,000	
	平成 2 5 年度第 4 回福岡市公募公債	50,000,000	50,918,500	
	平成 2 5 年度第 2 回広島市公募公債	100,000,000	102,068,000	
	平成 2 6 年度第 4 回福井県公募公債	100,000,000	101,759,000	
	平成 3 0 年度第 1 回山梨県公募公債	100,000,000	101,594,000	
	平成 2 8 年度第 1 回岡山県公募公債	300,000,000	302,244,000	
	第 4 回京都市保証京都市土地開発公社債券	200,000,000	199,610,000	
	第 9 6 回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	116,366,000	
地方債証券 合計		15,441,810,000	16,223,929,963	
特殊債券	第 2 2 回政府保証日本政策投資銀行	20,000,000	20,397,600	
	第 1 7 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	112,754,000	
	第 1 8 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	45,093,300	

第１９回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	147,556,000	
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	344,331,000	
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	230,028,000	
第３３回道路債券（財投機関債）	300,000,000	402,132,000	
第７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,885,000	
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	177,606,000	
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	133,526,000	
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	118,055,000	
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	117,564,000	
第１５０回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,773,000	
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	131,091,000	
第１５７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	212,000,000	214,124,240	
第１５９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	119,000,000	120,245,930	
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	113,025,000	
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	117,506,000	
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	126,011,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	659,000,000	667,586,770	
第１６８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	191,000,000	193,467,720	
第１７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	430,000,000	436,140,400	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	306,177,200	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,700,000	173,118,819	
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	154,846,710	
第１９５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	323,000,000	330,348,250	
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	308,000,000	314,557,320	
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	124,000,000	126,570,520	
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	115,146,000	
第２３１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	183,000,000	186,407,460	

第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,974,000	
第318回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,942,000	
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	58,966,000	
第3回公営企業債券（20年）（財投機関債）	20,000,000	20,434,200	
第6回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	105,820,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	117,633,000	
第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,224,500	
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	116,404,000	
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	96,259,200	
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	93,749,600	
第17回公営企業債券（20年）（財投機関債）	150,000,000	167,922,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年）	300,000,000	300,081,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	30,000,000	30,048,600	
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	116,315,000	
F24回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	72,483,600	
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	59,083,500	
第39回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,273,000	
第41回政府保証地方公共団体金融機構債券	352,000,000	356,928,000	
第43回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	405,692,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,710,940	
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	113,164,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,669,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	17,000,000	17,240,890	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	36,000,000	36,497,160	
第55回政府保証地方公共団体金融機構債券	160,000,000	163,180,800	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	315,000,000	321,659,100	
第61回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,142,000	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,049,000	
第64回政府保証地方公共団体金融機構債券	240,000,000	244,651,200	
F67回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	300,000,000	332,496,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	308,263,480	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	152,676,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	174,000,000	174,043,500	
F89回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	219,730,000	
F90回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	110,550,000	

F 1 0 4 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,292,000	
第 1 0 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	116,000,000	117,028,920	
F 1 2 3 回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	113,228,000	
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	117,423,000	
第 1 0 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	94,635,200	
第 1 5 回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	93,543,200	
第 2 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,685,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	100,000,000	100,660,000	
第 4 8 回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	402,224,000	
第 5 4 回福祉医療機構債券（財投機関債）	200,000,000	201,686,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,022,000	12,369,676	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,470,000	12,846,843	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,441,000	13,930,386	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,741,000	13,171,008	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	61,950,000	61,950,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	66,110,000	66,153,632	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,542,000	12,922,900	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	79,641,000	79,478,532	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,930,000	11,053,618	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,362,000	11,590,830	
第 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,511,000	12,856,303	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	13,308,000	13,784,825	
第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,377,000	11,600,785	
第 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,218,000	13,630,005	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	11,958,000	12,274,049	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	14,285,000	14,997,535	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	12,408,000	12,754,307	
第 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,958,000	14,538,094	
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	9,930,000	9,957,108	
第 1 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,383,000	12,533,577	
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	12,432,000	12,594,734	
第 1 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,854,000	10,995,753	
第 2 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,954,000	11,133,316	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,792,000	10,897,329	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,722,000	13,033,689	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,688,000	27,448,398	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,808,000	27,481,906	
第 3 7 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,927,000	13,340,664	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,668,000	29,239,265	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,299,000	12,611,271	

第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,732,000	29,026,807	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,378,000	13,882,885	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,112,000	12,492,074	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,456,000	35,509,863	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,899,000	35,095,008	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,118,000	29,819,420	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,292,000	27,963,382	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,262,000	28,887,360	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,010,000	29,631,779	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,285,000	12,654,655	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,270,000	32,048,665	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,963,000	34,841,891	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,345,000	36,307,816	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,136,000	40,306,319	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,485,000	41,824,091	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,993,000	43,258,683	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,335,000	44,414,918	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,288,000	44,186,308	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,017,000	42,033,456	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,002,000	47,525,712	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,927,000	40,803,281	
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	32,701,200	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,758,000	42,504,480	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,742,000	46,716,911	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,866,000	96,753,370	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,810,000	99,890,547	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,502,000	53,535,298	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,735,000	54,605,510	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,315,000	56,913,050	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,565,000	69,824,373	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,836,000	69,399,828	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,546,000	139,565,911	
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	108,284,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,028,000	72,609,932	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,576,000	79,118,174	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	240,735,000	239,817,799	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	414,355,000	420,015,089	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	171,503,800	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,186,000	171,153,633	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	117,815,000	

	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,350,000	86,205,207	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,048,000	86,899,875	
	第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,307,000	88,389,606	
	第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,084,716	
	第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,286,000	89,149,437	
	第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,754,000	180,080,354	
	第１３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,870,000	90,907,099	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,196,000	91,427,175	
	第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,564,000	91,993,099	
	第１４３回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,279,000	
	第１４７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,762,000	93,138,482	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,110,000	188,720,295	
	第１５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,954,000	191,389,655	
	第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,930,000	99,442,457	
	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	199,490,400	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	54,389,500	
	い第８０６号商工債券	200,000,000	200,194,000	
	い第８１４号商工債券	200,000,000	200,562,000	
	い第８３２号商工債券	100,000,000	99,963,000	
	い第８１８号農林債券	200,000,000	200,200,000	
	第３２７回信金中金債	200,000,000	200,084,000	
	第３３８回信金中金債	200,000,000	200,300,000	
	第１１号商工債券（１０年）	100,000,000	102,147,000	
	第２３０号商工債券（３年）	100,000,000	100,063,000	
	第２３１号商工債券（３年）	100,000,000	100,055,000	
	第２３６号商工債券（３年）	200,000,000	199,948,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	102,211,000	
	第７回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	82,915,700	
	第３３回中日本高速道路	50,000,000	50,344,500	
	第２９回西日本高速道路	200,000,000	202,312,000	
	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	106,775,000	
特殊債券 合計		18,767,590,000	19,841,906,002	
社債券	第１４回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	200,404,000	
	第１９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	103,075,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	99,672,000	
	第８回新韓銀行	100,000,000	100,057,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,930,000	
	第１７回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	100,316,000	
	第１３回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,936,000	
	第３回コカ・コーラウエスト	100,000,000	100,525,000	

第１３回日本たばこ産業	200,000,000	201,118,000	
第６回ヒューリック	200,000,000	200,686,000	
第９回クラレ	100,000,000	100,498,000	
第６４回住友化学	100,000,000	99,936,000	
第４回野村総合研究所	100,000,000	100,189,000	
第２回大塚ホールディングス	100,000,000	100,122,000	
第１５回Ｚホールディングス	400,000,000	399,812,000	
第１１回ブリヂストン	100,000,000	100,343,000	
第１３回ブリヂストン	200,000,000	200,614,000	
第４回新日本製鐵	100,000,000	99,975,000	
第５１回日本精工	100,000,000	99,094,000	
第１９回日立製作所	100,000,000	99,397,000	
第５３回日本電気	100,000,000	100,027,000	
第５６回日本電気	100,000,000	100,088,000	
第２０回セイコーエプソン	100,000,000	99,829,000	
第１７回パナソニック	100,000,000	101,139,000	
第２０回パナソニック	700,000,000	699,713,000	
第１８回デンソー	300,000,000	300,102,000	
第１９回デンソー	300,000,000	299,622,000	
第１回日本生命２０１７基金	100,000,000	100,065,000	
第９回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	200,000,000	199,938,000	
第６４回日産自動車	100,000,000	100,070,000	
第１回明治安田生命２０１８基金	100,000,000	100,173,000	
第１回明治安田生命２０１９基金	100,000,000	100,040,000	
第８３回クレディセゾン	300,000,000	300,207,000	
第３回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	200,000,000	202,144,000	
第１７回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	200,000,000	199,324,000	
第２６回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	100,000,000	107,039,000	
第２９回三菱東京ＵＦＪ銀行劣後特約付	200,000,000	216,564,000	
第３０回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	116,368,000	
第５７回三菱東京ＵＦＪ銀行	100,000,000	103,759,000	
第４回みずほリース	100,000,000	99,900,000	
第１６回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,432,000	
第１７回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	100,866,000	
第４７回日産フィナンシャルサービス	200,000,000	195,364,000	
第２９回東京センチュリー	100,000,000	100,044,000	
第６４回ホンダファイナンス	300,000,000	299,694,000	
第６５回ホンダファイナンス	200,000,000	200,400,000	
第３５回リコーリース	100,000,000	99,854,000	
第３９回リコーリース	400,000,000	398,728,000	
第７回イオンフィナンシャルサービス	100,000,000	99,765,000	
第７９回アコム	200,000,000	198,812,000	

第４７回日立キャピタル	100,000,000	101,591,000	
第７０回日立キャピタル	200,000,000	200,302,000	
第８５回日立キャピタル	100,000,000	100,017,000	
第２１回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	200,230,000	
第３０回三井住友ファイナンス＆リース	200,000,000	199,420,000	
第７７回三菱ＵＦＪリース	300,000,000	301,248,000	
第２７回野村ホールディングス	100,000,000	108,023,000	
第５０回野村ホールディングス	100,000,000	100,045,000	
第１２回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	101,971,000	
第１２回森トラスト総合リート投資法人	100,000,000	99,333,000	
第３６回京王電鉄	100,000,000	100,895,000	
第１９回東日本旅客鉄道	100,000,000	102,537,000	
第１００回東日本旅客鉄道	100,000,000	125,524,000	
第１１回東海旅客鉄道	100,000,000	102,115,000	
第１７回東海旅客鉄道	200,000,000	215,578,000	
第５３回東海旅客鉄道	100,000,000	115,152,000	
第５０回阪急阪神ホールディングス	100,000,000	100,800,000	
第６２回名古屋鉄道	100,000,000	99,744,000	
第２７回ＫＤＤＩ	100,000,000	99,945,000	
第５回ソフトバンク	400,000,000	399,752,000	
第５６７回東京電力	100,000,000	108,550,000	
第４９９回中部電力	50,000,000	51,349,500	
第５００回中部電力	300,000,000	307,851,000	
第５０８回関西電力	100,000,000	101,383,000	
第５１０回関西電力	300,000,000	304,788,000	
第５１８回関西電力	100,000,000	101,086,000	
第５３２回関西電力	100,000,000	100,191,000	
第５３７回関西電力	100,000,000	100,000,000	
第３８１回中国電力	100,000,000	102,774,000	
第３８５回中国電力	100,000,000	102,694,000	
第４０９回中国電力	200,000,000	202,480,000	
第３０４回北陸電力	100,000,000	102,447,000	
第３０７回北陸電力	100,000,000	104,745,000	
第３２２回北陸電力	100,000,000	101,139,000	
第４７５回東北電力	300,000,000	307,593,000	
第５０９回東北電力	100,000,000	100,314,000	
第４２７回九州電力	100,000,000	103,043,000	
第４４９回九州電力	100,000,000	101,354,000	
第４８４回九州電力	200,000,000	201,300,000	
第３８回電源開発	100,000,000	102,540,000	
第３９回電源開発	100,000,000	102,523,000	
第５７回電源開発	100,000,000	100,637,000	

	第６回東京電力パワーグリッド	100,000,000	102,146,000	
	第１３回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,367,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	205,466,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド	200,000,000	204,786,000	
	第３３回東京電力パワーグリッド	200,000,000	202,516,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド	200,000,000	202,228,000	
	第１３回広島ガス	100,000,000	100,759,000	
	第７回ファーストリテイリング	100,000,000	100,770,000	
社債券 合計		15,250,000,000	15,450,810,500	
合計		298,250,400,000	319,060,124,135	

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。

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 3年 1月26日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	171,537,219
コール・ローン	1,981,456,063
国債証券	247,461,971,324
派生商品評価勘定	936,354,286
未収入金	1,037,866,960
未収利息	1,696,203,017
前払費用	126,864,381
流動資産合計	253,412,253,250
資産合計	253,412,253,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	830,632,421
未払金	12,094,553
未払解約金	1,827,268,053
未払利息	428
流動負債合計	2,669,995,455
負債合計	2,669,995,455
純資産の部	
元本等	
元本	178,336,920,306
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,405,337,489
元本等合計	250,742,257,795

[令和 3年 1月26日現在]

純資産合計	250,742,257,795
負債純資産合計	253,412,253,250

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 3年 1月26日現在]
1. 期首	令和 2年 1月28日
期首元本額	176,023,402,374円
期中追加設定元本額	79,600,314,681円
期中一部解約元本額	77,286,796,749円
元本の内訳	
e M A X I S 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	200,062,597円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	4,702,728,353円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）	3,467,512,020円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	37,517,098円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）	2,111,339,447円
三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）	2,722,680,903円
e M A X I S 債券バランス（2資産均等型）	66,972,125円
MUAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド（適格機関投資家転売制限付）	102,265,079,918円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	10,530,785,606円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	9,889,030,256円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	3,772,071,358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）	1,517,209,643円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	9,068,128,127円
MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	559,779,439円

	[令和 3年 1月26日現在]
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	8,910,306,125円
MUKAM ヘッジ付外国債券インデックスオープン（適格機関投資家限定）	7,549,855,078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）	1,001,038,772円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付）	180,782,803円
MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）	2,117,154,370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）	312,015,642円
MUKAM バランスファンド2020-04（適格機関投資家限定）	2,194,160,790円
MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）	2,118,012,165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）	311,241,135円
MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）	2,107,312,096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）	311,484,137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）	312,660,303円
合計	178,336,920,306円
2. 受益権の総数	178,336,920,306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 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26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。

区分	自 令和 2年 1月28日 至 令和 3年 1月26日
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、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[令和 3年 1月26日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	[令和 3年 1月26日現在]
--	-------------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,288,510,272
合計	3,288,510,272

(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

[令和 3年 1月26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				
	アメリカドル	40,469,520	—	40,466,400	3,120
	売建				
	アメリカドル	108,973,937,577	—	109,446,944,900	473,007,323
	カナダドル	4,919,341,150	—	4,955,023,200	35,682,050
	オーストラリアドル	7,012,167,820	—	7,083,742,600	71,574,780
	イギリスポンド	17,219,931,713	—	17,458,522,200	238,590,487
	シンガポールドル	1,650,917,460	—	1,655,428,800	4,511,340
	スウェーデンクローネ	846,887,580	—	838,714,800	8,172,780
	ノルウェークローネ	566,732,293	—	569,988,700	3,256,407
	デンマーククローネ	1,257,923,803	—	1,247,910,300	10,013,503
	メキシコペソ	1,999,489,035	—	1,987,333,500	12,155,535
	イスラエルシェケル	1,155,903,712	—	1,141,747,200	14,156,512
	ポーランドズロチ	1,603,337,260	—	1,587,819,800	15,517,460
	ユーロ	105,030,088,282	—	104,157,756,700	872,331,582
合計		252,277,127,205	—	252,171,399,100	105,721,865

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 3年 1月26日現在]
1口当たり純資産額	1.4060円
(1万口当たり純資産額)	(14,060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	0.125 T-NOTE 230515	5,500,000.00	5,498,925.77	
		0.125 T-NOTE 230815	9,500,000.00	9,494,433.58	
		0.25 T-NOTE 250930	6,200,000.00	6,162,218.75	
		0.5 T-NOTE 270630	8,000,000.00	7,928,750.00	
		0.5 T-NOTE 270831	5,350,000.00	5,292,738.27	
		0.625 T-NOTE 300515	6,500,000.00	6,284,687.50	
		0.625 T-NOTE 300815	13,200,000.00	12,725,625.00	
		1.125 T-BOND 400515	8,400,000.00	7,752,937.50	
		1.375 T-NOTE 221015	8,000,000.00	8,172,812.49	
		1.375 T-NOTE 230215	5,800,000.00	5,948,398.43	
		1.375 T-NOTE 230630	4,100,000.00	4,223,000.00	
		1.375 T-NOTE 230831	7,700,000.00	7,945,437.50	
		1.375 T-NOTE 230930	7,000,000.00	7,230,234.37	
		1.5 T-NOTE 220131	7,800,000.00	7,912,429.68	
		1.5 T-NOTE 220815	5,500,000.00	5,618,808.59	
		1.5 T-NOTE 220915	6,000,000.00	6,135,703.12	
		1.5 T-NOTE 230115	5,000,000.00	5,135,351.56	
		1.5 T-NOTE 230228	6,300,000.00	6,480,632.81	
		1.5 T-NOTE 230331	6,700,000.00	6,899,429.68	

1.5 T-NOTE 241031	6,000,000.00	6,278,906.25	
1.5 T-NOTE 260815	8,300,000.00	8,748,718.75	
1.5 T-NOTE 270131	6,500,000.00	6,856,484.37	
1.5 T-NOTE 300215	7,000,000.00	7,326,484.37	
1.625 T-NOTE 220815	8,400,000.00	8,598,515.62	
1.625 T-NOTE 221115	12,150,000.00	12,478,904.29	
1.625 T-NOTE 221215	6,800,000.00	6,993,109.37	
1.625 T-NOTE 230430	7,850,000.00	8,114,324.21	
1.625 T-NOTE 230531	4,900,000.00	5,070,351.56	
1.625 T-NOTE 231031	6,700,000.00	6,972,710.93	
1.625 T-NOTE 260215	7,100,000.00	7,525,445.31	
1.625 T-NOTE 260515	9,200,000.00	9,754,875.00	
1.625 T-NOTE 260930	4,500,000.00	4,778,789.06	
1.625 T-NOTE 261031	7,400,000.00	7,856,718.75	
1.625 T-NOTE 261130	5,200,000.00	5,522,968.75	
1.625 T-NOTE 290815	7,900,000.00	8,368,445.31	
1.75 T-NOTE 220228	1,750,000.00	1,781,582.03	
1.75 T-NOTE 220331	4,400,000.00	4,485,250.00	
1.75 T-NOTE 220430	3,100,000.00	3,163,937.50	
1.75 T-NOTE 220515	9,200,000.00	9,395,859.37	
1.75 T-NOTE 220531	3,800,000.00	3,883,718.75	
1.75 T-NOTE 220615	3,000,000.00	3,068,320.31	
1.75 T-NOTE 220715	4,000,000.00	4,096,406.24	
1.75 T-NOTE 220930	4,900,000.00	5,035,132.81	
1.75 T-NOTE 230515	10,000,000.00	10,371,093.75	
1.75 T-NOTE 240630	9,000,000.00	9,471,093.75	
1.75 T-NOTE 240731	8,000,000.00	8,426,875.00	
1.75 T-NOTE 261231	6,800,000.00	7,274,937.50	
1.875 T-NOTE 220228	4,000,000.00	4,077,812.50	
1.875 T-NOTE 220430	12,000,000.00	12,269,062.50	
1.875 T-NOTE 220531	3,700,000.00	3,787,585.93	
1.875 T-NOTE 220831	3,750,000.00	3,855,761.71	
1.875 T-NOTE 220930	10,000,000.00	10,295,312.50	
1.875 T-NOTE 221031	6,300,000.00	6,495,398.43	
2 T-BOND 500215	6,150,000.00	6,453,175.78	
2 T-NOTE 221130	10,000,000.00	10,347,656.25	
2 T-NOTE 230215	8,900,000.00	9,241,398.43	
2 T-NOTE 240430	5,700,000.00	6,033,093.75	
2 T-NOTE 240531	5,500,000.00	5,827,851.56	
2 T-NOTE 250215	10,500,000.00	11,223,515.62	
2 T-NOTE 250815	12,150,000.00	13,052,707.03	
2 T-NOTE 261115	8,300,000.00	8,987,992.18	

2.125 T-NOTE 220630	6,350,000.00	6,532,562.50
2.125 T-NOTE 221231	8,500,000.00	8,827,382.81
2.125 T-NOTE 231130	7,700,000.00	8,131,921.87
2.125 T-NOTE 240229	8,700,000.00	9,219,960.93
2.125 T-NOTE 240331	10,100,000.00	10,716,257.81
2.125 T-NOTE 241130	6,300,000.00	6,746,414.06
2.125 T-NOTE 250515	12,000,000.00	12,922,500.00
2.25 T-BOND 460815	5,730,000.00	6,342,393.75
2.25 T-NOTE 231231	8,800,000.00	9,336,250.00
2.25 T-NOTE 241031	4,900,000.00	5,265,585.93
2.25 T-NOTE 241115	9,500,000.00	10,215,468.75
2.25 T-NOTE 241231	5,100,000.00	5,493,656.25
2.25 T-NOTE 251115	9,500,000.00	10,343,867.18
2.25 T-NOTE 260331	7,000,000.00	7,648,046.87
2.25 T-NOTE 270215	6,700,000.00	7,369,476.56
2.25 T-NOTE 270815	11,300,000.00	12,458,250.00
2.25 T-NOTE 271115	7,400,000.00	8,166,593.75
2.375 T-BOND 491115	6,000,000.00	6,818,437.50
2.375 T-NOTE 240229	3,600,000.00	3,842,718.75
2.375 T-NOTE 240815	9,200,000.00	9,897,906.25
2.375 T-NOTE 270515	10,500,000.00	11,646,796.87
2.375 T-NOTE 290515	7,400,000.00	8,285,687.50
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	5,847,347.65
2.5 T-BOND 460215	5,100,000.00	5,911,617.18
2.5 T-BOND 460515	5,250,000.00	6,085,078.12
2.5 T-NOTE 230815	9,050,000.00	9,595,121.09
2.5 T-NOTE 240515	9,100,000.00	9,789,609.37
2.5 T-NOTE 250131	6,000,000.00	6,531,562.50
2.625 T-NOTE 230630	5,600,000.00	5,937,312.50
2.625 T-NOTE 250331	3,300,000.00	3,615,304.68
2.625 T-NOTE 260131	4,600,000.00	5,104,921.87
2.625 T-NOTE 290215	8,800,000.00	10,015,500.00
2.75 T-BOND 420815	2,450,000.00	2,956,078.12
2.75 T-BOND 421115	3,020,000.00	3,639,571.87
2.75 T-BOND 470815	4,950,000.00	6,015,796.87
2.75 T-BOND 471115	4,500,000.00	5,473,828.12
2.75 T-NOTE 230531	3,000,000.00	3,183,281.25
2.75 T-NOTE 231115	8,800,000.00	9,440,750.00
2.75 T-NOTE 240215	6,800,000.00	7,334,968.75
2.75 T-NOTE 250630	7,900,000.00	8,738,140.62
2.75 T-NOTE 250831	7,500,000.00	8,315,039.05
2.75 T-NOTE 280215	11,400,000.00	12,985,312.50
2.875 T-BOND 430515	3,950,000.00	4,858,808.59

2.875 T-BOND 450815	4,050,000.00	5,002,382.81	
2.875 T-BOND 461115	3,760,000.00	4,661,812.50	
2.875 T-BOND 490515	5,500,000.00	6,878,007.80	
2.875 T-NOTE 230930	6,000,000.00	6,437,343.75	
2.875 T-NOTE 231031	8,500,000.00	9,136,171.87	
2.875 T-NOTE 250430	4,900,000.00	5,430,195.31	
2.875 T-NOTE 250731	11,900,000.00	13,246,187.50	
2.875 T-NOTE 251130	4,800,000.00	5,371,125.00	
2.875 T-NOTE 280515	9,400,000.00	10,812,937.50	
2.875 T-NOTE 280815	8,900,000.00	10,261,421.87	
3 T-BOND 420515	1,670,000.00	2,091,805.46	
3 T-BOND 441115	3,850,000.00	4,842,878.90	
3 T-BOND 450515	4,700,000.00	5,925,304.68	
3 T-BOND 451115	3,160,000.00	3,992,215.62	
3 T-BOND 470215	4,910,000.00	6,229,562.50	
3 T-BOND 480215	5,700,000.00	7,253,695.31	
3 T-BOND 480815	5,600,000.00	7,141,750.00	
3 T-BOND 490215	4,430,000.00	5,661,747.63	
3 T-NOTE 250930	12,000,000.00	13,464,375.00	
3.125 T-BOND 411115	2,500,000.00	3,183,398.43	
3.125 T-BOND 420215	3,350,000.00	4,274,128.90	
3.125 T-BOND 430215	3,600,000.00	4,596,187.50	
3.125 T-BOND 440815	3,950,000.00	5,064,023.43	
3.125 T-BOND 480515	4,100,000.00	5,335,125.00	
3.125 T-NOTE 281115	10,600,000.00	12,446,718.75	
3.375 T-BOND 440515	3,700,000.00	4,923,890.62	
3.375 T-BOND 481115	6,000,000.00	8,171,250.00	
3.5 T-BOND 390215	1,700,000.00	2,255,156.25	
3.625 T-BOND 430815	4,150,000.00	5,707,222.65	
3.625 T-BOND 440215	4,950,000.00	6,820,558.59	
3.75 T-BOND 410815	1,650,000.00	2,284,605.46	
3.75 T-BOND 431115	4,410,000.00	6,179,167.96	
3.875 T-BOND 400815	1,300,000.00	1,817,359.37	
4.25 T-BOND 390515	1,800,000.00	2,611,265.61	
4.25 T-BOND 401115	5,100,000.00	7,473,890.62	
4.375 T-BOND 380215	1,390,000.00	2,022,232.81	
4.375 T-BOND 391115	2,500,000.00	3,692,968.75	
4.375 T-BOND 400515	1,950,000.00	2,888,894.53	
4.375 T-BOND 410515	2,230,000.00	3,335,069.53	
4.5 T-BOND 360215	1,400,000.00	2,015,781.25	
4.5 T-BOND 380515	1,300,000.00	1,920,750.00	
4.5 T-BOND 390815	1,600,000.00	2,392,250.00	

		4.625 T-BOND 400215	2,230,000.00	3,394,303.90	
		4.75 T-BOND 410215	2,400,000.00	3,742,125.00	
		5 T-BOND 370515	1,050,000.00	1,611,750.00	
		5.375 T-BOND 310215	1,400,000.00	1,987,781.24	
		6 T-BOND 260215	5,800,000.00	7,422,187.50	
		6.125 T-BOND 271115	4,800,000.00	6,544,500.00	
		6.25 T-BOND 230815	6,500,000.00	7,516,132.80	
		6.25 T-BOND 300515	2,750,000.00	4,056,464.84	
アメリカドル合計			937,640,000.00	1,035,621,986.57 (107,466,493,546)	
カナダドル	国債証券	0.5 CAN GOVT 220301	1,200,000.00	1,205,400.00	
		1 CAN GOVT 220901	6,000,000.00	6,083,280.00	
		1 CAN GOVT 270601	1,500,000.00	1,543,980.00	
		1.25 CAN GOVT 250301	3,850,000.00	3,989,062.00	
		1.25 CAN GOVT 300601	4,900,000.00	5,104,085.00	
		1.5 CAN GOVT 230601	3,250,000.00	3,350,197.50	
		1.5 CAN GOVT 260601	2,850,000.00	3,001,563.00	
		1.75 CAN GOVT 230301	4,000,000.00	4,132,720.00	
		2 CAN GOVT 230901	4,500,000.00	4,709,250.00	
		2 CAN GOVT 280601	1,500,000.00	1,651,680.00	
		2 CAN GOVT 511201	2,320,000.00	2,650,066.40	
		2.25 CAN GOVT 240301	1,200,000.00	1,274,100.00	
		2.25 CAN GOVT 250601	2,400,000.00	2,591,640.00	
		2.5 CAN GOVT 240601	2,200,000.00	2,362,888.00	
		2.75 CAN GOVT 481201	950,000.00	1,244,376.50	
		2.75 CANADA GOVER 641201	800,000.00	1,142,272.00	
		3.5 CAN GOVT 451201	1,920,000.00	2,783,059.20	
		4 CAN GOVT 410601	1,490,000.00	2,222,424.40	
		5 CAN GOVT 370601	1,500,000.00	2,367,720.00	
		5.75 CAN GOVT 290601	1,450,000.00	2,044,137.50	
		5.75 CAN GOVT 330601	1,320,000.00	2,048,402.40	
		8 CAN GOVT 270601	1,550,000.00	2,269,246.50	
カナダドル合計			52,650,000.00	59,771,550.40 (4,865,404,202)	
オーストラリアドル	国債証券	0.5 AUST GOVT 260921	2,800,000.00	2,800,543.20	
		1 AUST GOVT 301221	3,800,000.00	3,775,078.08	
		1.5 AUST GOVT 310621	4,500,000.00	4,671,440.10	
		1.75 AUST GOVT 510621	1,750,000.00	1,597,675.08	
		2.25 AUST GOVT 221121	3,300,000.00	3,430,549.98	
		2.25 AUST GOVT 280521	2,000,000.00	2,214,642.00	
		2.5 AUST GOVT 300521	4,220,000.00	4,783,604.63	
		2.75 AUST GOVT 240421	4,900,000.00	5,317,412.87	
		2.75 AUST GOVT 281121	4,050,000.00	4,647,229.20	

		2.75 AUST GOVT 291121	3,550,000.00	4,094,043.18	
		2.75 AUST GOVT 350621	1,800,000.00	2,105,469.72	
		2.75 AUST GOVT 410521	1,240,000.00	1,418,172.62	
		3 AUST GOVT 470321	1,680,000.00	2,001,995.52	
		3.25 AUST GOVT 250421	9,200,000.00	10,356,980.04	
		3.25 AUST GOVT 290421	4,500,000.00	5,354,776.35	
		3.25 AUST GOVT 390621	900,000.00	1,108,963.80	
		3.75 AUST GOVT 370421	1,600,000.00	2,088,605.12	
		4.25 AUST GOVT 260421	5,050,000.00	6,053,840.01	
		4.5 AUST GOVT 330421	3,800,000.00	5,209,327.28	
		4.75 AUST GOVT 270421	5,800,000.00	7,286,081.22	
		5.5 AUST GOVT 230421	2,600,000.00	2,912,613.60	
		5.75 AUST GOVT 220715	2,900,000.00	3,142,507.57	
オーストラリアドル合計			75,940,000.00	86,371,551.17 (6,907,996,662)	
イギリス ポンド	国債証券	0.375 GILT 301022	4,000,000.00	4,037,470.80	
		0.5 GILT 220722	3,380,000.00	3,412,420.96	
		0.625 GILT 250607	3,450,000.00	3,554,171.37	
		0.625 GILT 501022	2,850,000.00	2,694,079.91	
		0.75 GILT 230722	2,650,000.00	2,707,430.80	
		0.875 GILT 291022	2,100,000.00	2,221,630.32	
		1 GILT 240422	2,600,000.00	2,693,305.68	
		1.25 GILT 270722	2,500,000.00	2,693,640.00	
		1.5 GILT 260722	2,600,000.00	2,816,411.00	
		1.5 GILT 470722	2,400,000.00	2,787,638.40	
		1.625 GILT 281022	900,000.00	1,004,549.94	
		1.625 GILT 711022	940,000.00	1,328,992.29	
		1.75 GILT 220907	5,350,000.00	5,514,068.45	
		1.75 GILT 370907	2,800,000.00	3,280,950.40	
		1.75 GILT 490122	1,490,000.00	1,836,034.02	
		1.75 GILT 570722	2,270,000.00	2,973,336.80	
		2.25 GILT 230907	2,700,000.00	2,866,460.40	
		2.5 GILT 650722	1,900,000.00	3,161,657.00	
		2.75 GILT 240907	1,300,000.00	1,433,733.99	
		3.25 GILT 440122	2,640,000.00	3,998,348.64	
		3.5 GILT 450122	2,670,000.00	4,238,753.16	
		3.5 GILT 680722	1,860,000.00	3,921,992.28	
		3.75 GILT 520722	1,890,000.00	3,436,069.14	
		4 GILT 220307	1,650,000.00	1,726,174.89	
		4 GILT 600122	1,710,000.00	3,580,500.60	
		4.25 GILT 271207	1,930,000.00	2,484,961.46	
		4.25 GILT 320607	2,750,000.00	3,937,576.50	

		4.25 GILT 360307	2,000,000.00	3,065,596.00	
		4.25 GILT 390907	1,680,000.00	2,726,752.89	
		4.25 GILT 401207	1,560,000.00	2,577,199.56	
		4.25 GILT 461207	2,140,000.00	3,853,726.98	
		4.25 GILT 491207	1,580,000.00	2,974,722.88	
		4.25 GILT 551207	2,270,000.00	4,662,239.50	
		4.5 GILT 340907	2,600,000.00	3,974,584.12	
		4.5 GILT 421207	2,300,000.00	4,029,896.24	
		4.75 GILT 301207	2,700,000.00	3,879,634.59	
		4.75 GILT 381207	1,780,000.00	3,014,237.76	
		5 GILT 250307	2,830,000.00	3,423,634.95	
		6 GILT 281207	1,170,000.00	1,704,795.30	
イギリスポンド合計			89,890,000.00	120,229,379.97 (17,058,144,430)	
シンガ ポールド ル	国債証券	1.75 SINGAPORGOVT 220401	650,000.00	660,860.78	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,550,000.00	1,757,483.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,000,000.00	1,082,500.00	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	1,000,000.00	1,126,500.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 230701	1,400,000.00	1,482,040.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	1,050,000.00	1,301,475.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,700,000.00	2,145,400.00	
		2.875 SINGAPORGOV 290701	2,450,000.00	2,833,425.00	
		2.875SINGAPORGOVT 300901	800,000.00	936,496.00	
		3 SINGAPORGOVT 240901	500,000.00	546,350.00	
		3.125SINGAPORGOVT 220901	1,200,000.00	1,254,108.00	
		3.375 SINGAPORGOV 330901	1,500,000.00	1,877,250.00	
		3.5 SINGAPORGOVT 270301	3,120,000.00	3,639,480.00	
シンガポールドル合計			17,920,000.00	20,643,367.78 (1,613,898,493)	
スウェー デンク ローネ	国債証券	0.75 SWD GOVT 280512	3,600,000.00	3,830,166.00	
		0.75 SWD GOVT 291112	7,700,000.00	8,241,348.50	
		1 SWD GOVT 261112	10,150,000.00	10,872,754.09	
		1.5 SWD GOVT 231113	11,800,000.00	12,424,319.12	
		2.5 SWD GOVT 250512	7,200,000.00	8,082,072.00	
		3.5 SWD GOVT 220601	11,550,000.00	12,152,401.80	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,700,000.00	10,454,834.10	
スウェーデンクローネ合計			58,700,000.00	66,057,895.61 (827,044,853)	
ノル ウェー クローネ	国債証券	1.375 NORWE GOVT 300819	4,900,000.00	5,067,604.50	
		1.5 NORWE GOVT 260219	2,850,000.00	2,966,736.00	
		1.75 NORWE GOVT 250313	8,300,000.00	8,690,100.00	
		1.75 NORWE GOVT 270217	4,250,000.00	4,493,890.50	

		1.75 NORWE GOVT 290906	6,200,000.00	6,608,766.00	
		2 NORWE GOVT 230524	7,250,000.00	7,522,745.00	
		2 NORWE GOVT 280426	5,050,000.00	5,451,576.00	
		3 NORWE GOVT 240314	4,950,000.00	5,337,891.90	
ノルウェークローネ合計			43,750,000.00	46,139,309.90 (560,131,222)	
デンマーク クローネ	国債証券	0.25 DMK GOVT 521115	3,000,000.00	3,250,170.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	10,200,000.00	10,937,562.00	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,700,000.00	11,615,813.00	
		1.5 DMK GOVT 231115	8,100,000.00	8,593,954.20	
		1.75 DMK GOVT 251115	10,200,000.00	11,373,807.84	
		4.5 DMK GOVT 391115	14,350,000.00	27,243,974.38	
デンマーククローネ合計			56,550,000.00	73,015,281.42 (1,236,148,714)	
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	44,750,000.00	53,570,225.00	
		10 MEXICAN BONOS 361120	9,000,000.00	12,502,530.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	21,350,000.00	22,373,092.00	
		6.5 MEXICAN BONOS 220609	35,000,000.00	36,062,593.00	
		6.75 MEXICAN BONO 230309	20,000,000.00	21,018,200.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	35,750,000.00	40,762,507.50	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	20,000,000.00	23,389,200.00	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	5,800,000.00	6,792,960.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	24,100,000.00	27,386,999.00	
		8 MEXICAN BONOS 231207	21,500,000.00	23,621,835.00	
		8 MEXICAN BONOS 240905	15,000,000.00	16,801,050.00	
		8 MEXICAN BONOS 471107	22,000,000.00	25,586,660.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	33,400,000.00	40,663,498.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 381118	22,200,000.00	27,196,110.00	
メキシコペソ合計			329,850,000.00	377,727,459.50 (1,949,073,691)	
イスラエル シェケル	国債証券	1.5 ISRAEL FIXED 231130	4,000,000.00	4,166,200.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	4,000,000.00	4,529,800.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 220131	8,000,000.00	8,440,400.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	5,850,000.00	9,942,660.00	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	6,000,000.00	8,110,500.00	
イスラエルシェケル合計			27,850,000.00	35,189,560.00 (1,114,805,260)	
ポーランド ズロチ	国債証券	0.75 POLAND 250425	6,000,000.00	6,094,620.60	
		1.25 POLAND 301025	1,500,000.00	1,507,639.95	
		2.25 POLAND 241025	4,000,000.00	4,305,592.00	
		2.5 POLAND 230125	4,800,000.00	5,037,027.84	
		2.5 POLAND 240425	3,000,000.00	3,230,722.80	

		2.5 POLAND 260725	5,000,000.00	5,535,413.00	
		2.5 POLAND 270725	3,600,000.00	4,011,337.80	
		2.75 POLAND 280425	3,700,000.00	4,222,809.26	
		2.75 POLAND 291025	4,000,000.00	4,581,360.80	
		3.25 POLAND 250725	3,550,000.00	4,003,583.50	
		4 POLAND 231025	4,150,000.00	4,600,835.25	
		5.75 POLAND 220923	2,500,000.00	2,739,725.00	
		5.75 POLAND 290425	1,400,000.00	1,946,840.00	
		POLAND 220725	5,000,000.00	5,002,010.50	
ポーランドズロチ合計			52,200,000.00	56,819,518.30 (1,575,605,242)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 230715	1,400,000.00	1,423,686.18	
		0 BUND 260815	4,050,000.00	4,224,332.25	
		0 BUND 290815	3,100,000.00	3,274,514.50	
		0 BUND 300815	2,800,000.00	2,960,577.20	
		0 BUND 500815	2,720,000.00	2,835,999.84	
		0 FINNISH GOVT 220415	500,000.00	504,195.00	
		0 FINNISH GOVT 230915	650,000.00	662,383.80	
		0 NETH GOVT 520115	690,000.00	705,536.38	
		0 O.A.T 220525	1,300,000.00	1,311,059.10	
		0 O.A.T 230325	4,400,000.00	4,466,616.00	
		0 O.A.T 240325	5,000,000.00	5,110,000.00	
		0 O.A.T 250325	4,700,000.00	4,829,532.94	
		0 OBL 220408	3,700,000.00	3,731,357.50	
		0 OBL 231013	3,500,000.00	3,575,022.50	
		0 OBL 240405	2,300,000.00	2,357,845.00	
		0 OBL 241018	5,000,000.00	5,146,320.50	
		0 SPAIN GOVT 230430	6,100,000.00	6,171,967.80	
		0.1 BEL GOVT 300622	1,470,000.00	1,536,206.44	
		0.125 FINNISH GOV 360415	550,000.00	573,221.55	
		0.2 BEL GOVT 231022	1,900,000.00	1,947,333.37	
		0.25 BUND 270215	4,200,000.00	4,459,912.80	
		0.25 BUND 280815	3,600,000.00	3,863,624.40	
		0.25 BUND 290215	4,200,000.00	4,519,893.00	
		0.25 NETH GOVT 250715	2,250,000.00	2,350,057.50	
		0.25 O.A.T 261125	3,750,000.00	3,936,337.12	
		0.35 ITALY GOVT 250201	3,200,000.00	3,251,529.60	
		0.35 SPAIN GOVT 230730	3,700,000.00	3,780,963.40	
		0.4 BEL GOVT 400622	900,000.00	946,057.50	
		0.4 IRISH GOVT 350515	600,000.00	641,488.80	
		0.4 SPAIN GOVT 220430	3,150,000.00	3,186,895.95	
		0.5 AUSTRIA GOVT 270420	970,000.00	1,038,115.04	

0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,100,000.00	2,270,570.40	
0.5 BEL GOVT 241022	1,800,000.00	1,881,022.32	
0.5 BUND 250215	4,150,000.00	4,369,564.05	
0.5 BUND 260215	3,400,000.00	3,622,499.40	
0.5 BUND 270815	4,640,000.00	5,024,470.40	
0.5 BUND 280215	3,300,000.00	3,590,258.10	
0.5 FINNISH GOVT 260415	700,000.00	743,211.00	
0.5 FINNISH GOVT 270915	800,000.00	858,873.60	
0.5 FINNISH GOVT 280915	700,000.00	756,318.50	
0.5 FINNISH GOVT 290915	800,000.00	868,112.40	
0.5 NETH GOVT 260715	2,000,000.00	2,133,170.00	
0.5 NETH GOVT 400115	950,000.00	1,084,609.87	
0.5 O.A.T 250525	4,100,000.00	4,308,911.40	
0.5 O.A.T 260525	5,300,000.00	5,621,311.44	
0.5 O.A.T 290525	6,180,000.00	6,669,147.00	
0.5 SPAIN GOVT 300430	2,700,000.00	2,820,279.60	
0.65 ITALY GOVT 231015	2,600,000.00	2,662,311.60	
0.75 AUSTRIA GOVT 261020	1,350,000.00	1,458,000.00	
0.75 AUSTRIA GOVT 280220	1,450,000.00	1,586,547.95	
0.75 FINNISH GOVT 310415	450,000.00	503,663.98	
0.75 NETH GOVT 270715	2,500,000.00	2,731,488.00	
0.75 NETH GOVT 280715	3,830,000.00	4,227,010.14	
0.75 O.A.T 280525	6,650,000.00	7,270,910.50	
0.75 O.A.T 281125	6,830,000.00	7,493,876.00	
0.75 O.A.T 520525	1,590,000.00	1,756,558.86	
0.8 BEL GOVT 250622	3,100,000.00	3,304,501.73	
0.8 BEL GOVT 270622	3,200,000.00	3,487,730.56	
0.8 BEL GOVT 280622	2,100,000.00	2,308,698.00	
0.875 FINNISH GOV 250915	900,000.00	966,213.00	
0.9 BEL GOVT 290622	2,300,000.00	2,563,545.50	
0.9 IRISH GOVT 280515	1,200,000.00	1,322,008.80	
0.95 ITALY GOVT 230301	3,000,000.00	3,077,400.00	
0.95 ITALY GOVT 230315	4,900,000.00	5,029,186.54	
1 BEL GOVT 260622	1,300,000.00	1,416,532.00	
1 BEL GOVT 310622	1,500,000.00	1,707,738.00	
1 BUND 240815	3,600,000.00	3,831,876.00	
1 BUND 250815	5,400,000.00	5,844,393.00	
1 IRISH GOVT 260515	2,100,000.00	2,280,083.40	
1 O.A.T 251125	2,600,000.00	2,809,723.80	
1 O.A.T 270525	4,800,000.00	5,283,840.00	
1.1 IRISH GOVT 290515	950,000.00	1,070,763.05	
1.125 FINNISH GOV 340415	900,000.00	1,064,097.90	

1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1,300,000.00	1,417,773.50
1.2 SPAIN GOVT 401031	1,400,000.00	1,542,513.00
1.25 BEL GOVT 330422	1,570,000.00	1,856,399.40
1.25 BUND 480815	2,600,000.00	3,643,791.32
1.25 ITALY GOVT 261201	4,450,000.00	4,723,256.70
1.25 O.A.T 340525	4,250,000.00	5,044,287.60
1.25 O.A.T 360525	4,450,000.00	5,340,272.76
1.25 SPAIN GOVT 301031	3,300,000.00	3,677,615.70
1.3 IRISH GOVT 330515	1,100,000.00	1,302,218.50
1.3 SPAIN GOVT 261031	3,600,000.00	3,940,332.48
1.35 IRISH GOVT 310318	280,000.00	327,727.12
1.35 ITALY GOVT 220415	850,000.00	867,514.25
1.375 FINNISH GOV 470415	580,000.00	788,532.04
1.4 SPAIN GOVT 280730	3,800,000.00	4,242,669.60
1.45 BEL GOVT 370622	250,000.00	309,546.00
1.45 ITALY GOVT 220915	1,950,000.00	2,006,507.10
1.45 ITALY GOVT 241115	1,800,000.00	1,904,713.20
1.45 ITALY GOVT 250515	700,000.00	743,450.40
1.45 ITALY GOVT 360301	1,750,000.00	1,851,823.75
1.45 SPAIN GOVT 271031	3,300,000.00	3,671,566.80
1.45 SPAIN GOVT 290430	3,240,000.00	3,647,919.56
1.5 AUSTRIA GOVT 470220	900,000.00	1,234,944.54
1.5 AUSTRIA GOVT 861102	530,000.00	880,359.15
1.5 BUND 220904	2,800,000.00	2,901,530.80
1.5 BUND 230215	3,300,000.00	3,455,225.73
1.5 BUND 230515	5,500,000.00	5,790,185.50
1.5 BUND 240515	3,000,000.00	3,229,350.00
1.5 FINNISH GOVT 230415	550,000.00	577,326.20
1.5 IRISH GOVT 500515	500,000.00	664,595.00
1.5 ITALY GOVT 250601	2,980,000.00	3,173,366.24
1.5 O.A.T 310525	5,300,000.00	6,303,682.20
1.5 O.A.T 500525	3,550,000.00	4,695,017.00
1.5 SPAIN GOVT 270430	3,350,000.00	3,724,422.80
1.6 BEL GOVT 470622	1,540,000.00	2,039,137.10
1.6 ITALY GOVT 260601	4,300,000.00	4,638,035.90
1.6 SPAIN GOVT 250430	2,350,000.00	2,555,706.31
1.625 FINNISH GOV 220915	550,000.00	571,245.40
1.65 AUSTRIA GOVT 241021	2,100,000.00	2,286,556.23
1.65 ITALY GOVT 320301	2,950,000.00	3,231,937.40
1.7 IRISH GOVT 370515	830,000.00	1,062,371.78
1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1,900,000.00	2,028,250.00
1.75 BUND 220704	5,250,000.00	5,437,472.25
1.75 BUND 240215	1,950,000.00	2,103,080.65

1.75 NETH GOVT 230715	3,100,000.00	3,293,601.20	
1.75 O.A.T 230525	6,400,000.00	6,766,937.60	
1.75 O.A.T 241125	4,400,000.00	4,814,546.00	
1.75 O.A.T 390625	3,920,000.00	5,157,798.80	
1.75 O.A.T 660525	1,660,000.00	2,502,367.00	
1.85 ITALY GOVT 240515	1,200,000.00	1,278,578.40	
1.85 ITALY GOVT 250701	2,200,000.00	2,377,872.20	
1.9 BEL GOVT 380622	1,050,000.00	1,388,306.32	
1.95 SPAIN GOVT 260430	2,500,000.00	2,806,987.50	
1.95 SPAIN GOVT 300730	2,700,000.00	3,191,356.80	
2 BUND 230815	3,100,000.00	3,321,978.91	
2 FINNISH GOVT 240415	1,050,000.00	1,142,845.20	
2 IRISH GOVT 450218	1,000,000.00	1,428,844.00	
2 ITALY GOVT 251201	2,900,000.00	3,171,707.96	
2 ITALY GOVT 280201	3,600,000.00	4,010,482.80	
2 NETH GOVT 240715	2,200,000.00	2,412,493.60	
2 O.A.T 480525	3,220,000.00	4,659,008.34	
2.05 ITALY GOVT 270801	5,000,000.00	5,566,700.00	
2.1 AUSTRIA GOVT 170920	750,000.00	1,647,016.50	
2.15 BEL GOVT 660622	630,000.00	1,043,906.22	
2.15 SPAIN GOVT 251031	3,500,000.00	3,928,985.20	
2.2 ITALY GOVT 270601	2,200,000.00	2,467,841.20	
2.25 BEL GOVT 230622	800,000.00	857,505.60	
2.25 BEL GOVT 570622	930,000.00	1,499,141.76	
2.25 ITALY GOVT 360901	2,150,000.00	2,521,090.00	
2.25 O.A.T 221025	4,500,000.00	4,732,470.00	
2.25 O.A.T 240525	4,450,000.00	4,890,469.90	
2.35 SPAIN GOVT 330730	4,220,000.00	5,300,458.83	
2.4 AUSTRIA GOVT 340523	900,000.00	1,222,099.20	
2.4 IRISH GOVT 300515	1,740,000.00	2,193,738.06	
2.45 ITALY GOVT 330901	2,150,000.00	2,552,308.00	
2.45 ITALY GOVT 500901	2,420,000.00	2,944,777.00	
2.5 BUND 440704	2,980,000.00	4,975,795.40	
2.5 BUND 460815	3,330,000.00	5,714,506.10	
2.5 ITALY GOVT 241201	2,500,000.00	2,745,625.00	
2.5 ITALY GOVT 251115	1,700,000.00	1,898,971.40	
2.5 NETH GOVT 330115	1,920,000.00	2,608,477.05	
2.5 O.A.T 300525	6,800,000.00	8,659,364.80	
2.625 FINNISH GOV 420704	450,000.00	712,058.85	
2.7 ITALY GOVT 470301	2,430,000.00	3,081,361.50	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,000,000.00	2,919,218.00	
2.75 FINNISH GOVT 280704	540,000.00	675,644.76	

2.75 NETH GOVT 470115	1,900,000.00	3,370,138.30
2.75 O.A.T 271025	6,130,000.00	7,522,429.50
2.75 SPAIN GOVT 241031	3,000,000.00	3,366,053.70
2.8 ITALY GOVT 281201	3,960,000.00	4,679,955.72
2.8 ITALY GOVT 670301	1,730,000.00	2,254,787.88
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,380,000.00	3,544,821.98
2.95 ITALY GOVT 380901	2,080,000.00	2,668,889.60
3 BEL GOVT 340622	1,200,000.00	1,712,437.20
3 O.A.T 220425	1,000,000.00	1,045,154.00
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	790,000.00	1,380,113.80
3.25 BUND 420704	2,310,000.00	4,136,274.45
3.25 ITALY GOVT 460901	2,350,000.00	3,254,610.17
3.25 O.A.T 450525	2,970,000.00	5,105,014.20
3.35 ITALY GOVT 350301	1,550,000.00	2,032,688.60
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	1,750,000.00	1,881,554.50
3.4 IRISH GOVT 240318	750,000.00	846,651.60
3.45 ITALY GOVT 480301	2,360,000.00	3,396,271.28
3.45 SPAIN GOVT 660730	1,680,000.00	3,026,467.92
3.5 ITALY GOVT 300301	5,200,000.00	6,554,189.20
3.5 O.A.T 260425	5,800,000.00	7,078,784.00
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,250,000.00	1,316,862.50
3.75 BEL GOVT 450622	1,360,000.00	2,484,562.24
3.75 ITALY GOVT 240901	2,100,000.00	2,389,065.00
3.75 NETH GOVT 230115	1,350,000.00	1,470,456.18
3.75 NETH GOVT 420115	1,830,000.00	3,394,628.04
3.8 AUSTRIA GOVT 620126	640,000.00	1,543,600.00
3.8 SPAIN GOVT 240430	4,800,000.00	5,478,460.80
3.9 IRISH GOVT 230320	1,000,000.00	1,099,168.20
4 BEL GOVT 320328	840,000.00	1,249,004.98
4 BUND 370104	2,430,000.00	4,198,213.80
4 FINNISH GOVT 250704	750,000.00	909,510.75
4 ITALY GOVT 370201	3,500,000.00	4,985,596.00
4 NETH GOVT 370115	1,870,000.00	3,195,863.66
4 O.A.T 381025	3,160,000.00	5,415,231.96
4 O.A.T 550425	2,050,000.00	4,415,206.77
4 O.A.T 600425	2,040,000.00	4,648,788.72
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	2,020,000.00	3,446,507.84
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,330,000.00	3,690,100.90
4.25 BEL GOVT 220928	1,800,000.00	1,950,037.20
4.25 BEL GOVT 410328	2,360,000.00	4,284,411.02
4.25 BUND 390704	2,450,000.00	4,610,356.10
4.25 O.A.T 231025	7,000,000.00	7,964,390.00
4.4 SPAIN GOVT 231031	3,100,000.00	3,525,540.10

4.5 BEL GOVT 260328	980,000.00	1,245,520.22	
4.5 ITALY GOVT 230501	5,100,000.00	5,652,789.00	
4.5 ITALY GOVT 240301	2,900,000.00	3,318,528.00	
4.5 O.A.T 410425	4,260,000.00	8,042,368.80	
4.65 SPAIN GOVT 250730	2,400,000.00	2,953,855.20	
4.7 SPAIN GOVT 410730	2,650,000.00	4,721,937.99	
4.75 BUND 280704	2,100,000.00	2,981,220.90	
4.75 BUND 340704	3,960,000.00	6,853,449.24	
4.75 BUND 400704	2,500,000.00	5,069,527.50	
4.75 ITALY GOVT 230801	3,000,000.00	3,380,667.00	
4.75 ITALY GOVT 280901	3,870,000.00	5,116,534.74	
4.75 ITALY GOVT 440901	2,470,000.00	4,135,187.55	
4.75 O.A.T 350425	3,380,000.00	5,770,484.72	
4.8 SPAIN GOVT 240131	2,400,000.00	2,787,394.32	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	800,000.00	1,031,447.12	
4.9 SPAIN GOVT 400730	2,210,000.00	3,973,564.53	
5 BEL GOVT 350328	1,800,000.00	3,127,230.00	
5 ITALY GOVT 220301	3,650,000.00	3,864,199.15	
5 ITALY GOVT 250301	3,850,000.00	4,645,217.50	
5 ITALY GOVT 340801	3,100,000.00	4,701,580.90	
5 ITALY GOVT 390801	2,190,000.00	3,573,970.50	
5 ITALY GOVT 400901	3,280,000.00	5,400,285.15	
5.15 SPAIN GOVT 281031	2,800,000.00	3,949,842.40	
5.15 SPAIN GOVT 441031	1,950,000.00	3,832,132.20	
5.25 ITALY GOVT 291101	6,680,000.00	9,383,102.08	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,600,000.00	2,004,673.60	
5.5 BEL GOVT 280328	1,290,000.00	1,860,462.89	
5.5 BUND 310104	3,640,000.00	5,925,534.16	
5.5 ITALY GOVT 221101	5,300,000.00	5,840,796.10	
5.5 NETH GOVT 280115	2,600,000.00	3,736,795.40	
5.5 O.A.T 290425	5,640,000.00	8,474,212.80	
5.625 BUND 280104	3,100,000.00	4,510,760.40	
5.75 ITALY GOVT 330201	3,350,000.00	5,236,569.25	
5.75 O.A.T 321025	4,080,000.00	7,014,078.14	
5.75 SPAIN GOVT 320730	3,000,000.00	4,906,350.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	2,500,000.00	3,366,497.50	
6 ITALY GOVT 310501	3,170,000.00	4,838,006.45	
6 O.A.T 251025	5,000,000.00	6,612,915.00	
6 SPAIN GOVT 290131	3,800,000.00	5,664,214.64	
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,400,000.00	2,034,492.88	
6.25 BUND 240104	1,000,000.00	1,210,311.60	
6.25 BUND 300104	1,700,000.00	2,788,253.30	

	6.5 BUND 270704	2,070,000.00	3,065,802.48	
	6.5 ITALY GOVT 271101	4,070,000.00	5,743,807.85	
	7.25 ITALY GOVT 261101	2,400,000.00	3,373,560.00	
	7.5 NETH GOVT 230115	400,000.00	465,624.80	
	8.5 O.A.T 230425	4,150,000.00	5,014,938.85	
	9 ITALY GOVT 231101	2,550,000.00	3,201,545.40	
ユーロ合計		655,770,000.00	812,448,173.23 (102,287,225,009)	
合計			247,461,971,324 (247,461,971,324)	

(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 154銘柄	100.00%	43.43%
カナダドル	国債証券 22銘柄	100.00%	1.97%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	100.00%	2.79%
イギリスポンド	国債証券 39銘柄	100.00%	6.89%
シンガポールドル	国債証券 13銘柄	100.00%	0.65%
スウェーデンクローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.33%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.00%	0.23%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.00%	0.50%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.79%
イスラエルシェケル	国債証券 5銘柄	100.00%	0.45%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.00%	0.64%
ユーロ	国債証券 249銘柄	100.00%	41.33%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

２【ファンドの現況】

【e M A X I S 債券バランス（２資産均等型）】

【純資産額計算書】

令和 3年 1月29日現在

（単位：円）

資産総額	188,208,441
負債総額	684,633
純資産総額（ - ）	187,523,808
発行済口数	175,370,449口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0693
（10,000口当たり）	（10,693）

（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

令和 3年 1月29日現在

（単位：円）

資産総額	326,607,173,142
負債総額	4,332,433,351
純資産総額（ - ）	322,274,739,791
発行済口数	239,832,556,564口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3437
（10,000口当たり）	（13,437）

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 3年 1月29日現在

（単位：円）

資産総額	254,930,397,186
負債総額	2,853,988,992
純資産総額（ - ）	252,076,408,194
発行済口数	179,415,472,846口

1口当たり純資産価額（ / ）	1.4050
（ 10,000口当たり ）	（ 14,050 ）

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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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た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、解約請求の受付け、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。

第二部【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

2021年1月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング２

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

２【事業の内容及び営業の概況】

「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。

2021年 1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	874	15,827,561
追加型公社債投資信託	16	1,523,225
単位型株式投資信託	74	328,992
単位型公社債投資信託	35	182,690
合 計	999	17,862,468

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国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2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36期事業年度に係る中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
------------------------	-----------------------

(資産の部)

流動資産

現金及び預金	2	53,969,686	2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	2	560,483	2	638,994
金銭の信託	2	100,000	2	100,000
その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017

固定資産

有形固定資産

建物	1	617,032	1	584,048
器具備品	1	665,247	1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375

無形固定資産

電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365

投資その他の資産

投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	824,268	1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
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		25,079,767		20,718,993
------------	--	------------	--	------------

固定資産合計		31,213,401		27,563,734
--------	--	------------	--	------------

資産合計		97,912,673		97,802,752
------	--	------------	--	------------

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)		第35期 (令和2年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		293,258		687,565
未払金				
未払収益分配金		170,281		131,478
未払償還金		448,695		395,400
未払手数料	2	3,990,054	2	4,026,078
その他未払金	2	3,961,765	2	3,818,195
未払費用	2	3,803,995	2	4,402,578
未払消費税等		194,852		629,469
未払法人税等		573,657		617,341

賞与引当金	901,135	933,517
役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784
時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(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	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2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	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658

営業費用				
支払手数料	2	28,533,952	2	27,106,451
広告宣伝費		739,643		696,418
公告費		500		1,000
調査費				
調査費		1,794,755		1,857,271
委託調査費		12,194,996		11,579,175
事務委託費		1,016,816		847,769
営業雑経費				
通信費		170,794		153,731
印刷費		427,442		427,118
協会費		48,375		52,053
諸会費		16,175		15,990
事務機器関連費		1,841,631		1,953,926
営業費用合計		46,785,083		44,690,907
一般管理費				
給料				
役員報酬		349,083		331,987
給料・手当		6,453,717		6,611,427
賞与引当金繰入		901,135		933,517
役員賞与引当金繰入		140,100		124,590
福利厚生費		1,234,293		1,276,950
交際費		13,011		11,871
旅費交通費		200,426		165,891
租税公課		373,201		360,165
不動産賃借料		654,886		647,402
退職給付費用		428,912		422,919
役員退職慰労引当金繰入		51,159		48,183
固定資産減価償却費		1,252,321		1,307,555
諸経費		523,213		427,212
一般管理費合計		12,575,461		12,669,674
営業利益		13,539,012		13,008,076

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	181,073	90,965
受取利息	2 1,913	2 4,169
投資有価証券償還益	416,706	585,179
収益分配金等時効完成分	44,392	101,734
受取賃貸料	2 38,388	2 65,808
その他	11,871	19,987
営業外収益合計	694,346	867,845
営業外費用		
投資有価証券償還損	118,173	96,379
時効後支払損引当金繰入	1,166	-
事務過誤費	420	3,483
賃貸関連費用	35,994	20,339
その他	1,481	1,920

営業外費用合計		157,235		122,122
経常利益		14,076,123		13,753,799
特別利益				
投資有価証券売却益		501,778		174,842
特別利益合計		501,778		174,842
特別損失				
投資有価証券売却損		135,399		75,963
投資有価証券評価損		62,310		163,865
固定資産除却損	1	4,848	1	8,832
固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		-
商標使用料		90,000		-
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	2	4,420,179	2	4,146,534
法人税等調整額		100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

（３）【株主資本等変動計算書】

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	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	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,721,316	1,721,316	1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	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	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
		資本剰余金			利益剰余金	
					その他利益剰余金	

	資本金	資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	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	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

[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

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3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。

3. 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。

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計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく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.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「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 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
建物	2,547千円	—
器具備品	2,301千円	8,832千円

計	4,848千円	8,832千円
---	---------	---------

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円
法人税、住民税及び事業税	3,216,517千円	3,030,180千円

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	11,363,380千円
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27日

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2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

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	—
合計	1,351,912千円	675,956千円

(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、譲渡性預金または投資信託に限定しており、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。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

第34期(平成31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) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

第35期(令和2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) 現金及び預金	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(4) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,328,625	85,328,625	-

(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金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34期(平成31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	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
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	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

第35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）

円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第34期(平成31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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

第35期(令和2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の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
貸借対照表計上額が取得原価を超えないものの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,774,369	9,937,087	1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

3. 売却したその他有価証券

第34期(自 平成30年4月1日 至 平成31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	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

第35期(自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）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163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円
勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	15,898	52,430
退職給付の支払額	218,947	162,904
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	4,606	164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	203,077	140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	2,666,937	2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	114,968	203,136
未認識過去勤務費用	484,766	419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	415,234	375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円

利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

（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です。

(5)年金資産に関する事項

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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
合計	100	100

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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035～0.49%	0.095～0.52%
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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

（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 of 主な原因別の内訳

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産 小計	2,122,023	2,029,829

評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	127,144	114,834
連結納税適用による時価評価	1,320	1,260
その他有価証券評価差額金	497,269	801
その他	108	109
繰延税金負債 合計	625,842	117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31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4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	(株)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)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,298,064 千円 695,834 千円	未払手数料 未払費用	671,568 千円 365,510 千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	(株)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)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,234,629 千円 583,270 千円	未払手数料 未払費用	712,210 千円 302,681 千円

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．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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31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4)	科目	期末残高 (注4)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	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)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 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(株)	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2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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4)	科目	期末残高 (注4)
同一の親会社を持つ会社	(株)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2)	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻 (注3)	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注3)	4,126 千円	未収収益	997 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(株)	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2)	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを

(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、

(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。

なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。

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．預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
- ４．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.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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
１株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
１株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80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、記載しておりません。

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,642,064	9,453,186
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）	9,642,064	9,453,186
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36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)		
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		51,757,620
有価証券		47,281
前払費用		533,748
未収入金		22,328
未収委託者報酬		11,205,707
未収収益		1,109,882
金銭の信託		200,000
その他		216,914
流動資産合計		65,093,483
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	561,961
器具備品	1	1,130,570
土地		628,433
有形固定資産合計		2,320,965
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		3,039,396

ソフトウェア仮勘定		2,003,918
無形固定資産合計		5,059,137
投資その他の資産		
投資有価証券		17,150,138
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	817,921
長期差入保証金		552,888
前払年金費用		316,933
繰延税金資産		1,088,156
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		20,267,805
固定資産合計		27,647,907
資産合計		92,741,391

(単位：千円)

第36期中間会計期間

(令和2年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		326,091
未払金		
未払収益分配金		158,732
未払償還金		133,877
未払手数料		4,401,647
その他未払金		2,173,325
未払費用		4,669,476
未払消費税等	2	507,145
未払法人税等		523,722
賞与引当金		895,400
役員賞与引当金		76,200
その他		699,988
流動負債合計		14,565,607
固定負債		
長期未払金		21,600
退職給付引当金		1,075,559
役員退職慰労引当金		133,578
時効後支払損引当金		248,354
固定負債合計		1,479,092
負債合計		16,044,700
(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		20,902,380
利益剰余金合計		28,242,970
株主資本合計		74,975,814

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (令和2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	1,720,876
評価・換算差額等合計	1,720,876
純資産合計	76,696,691
負債純資産合計	92,741,391

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	32,500,161
投資顧問料	1,178,818
その他営業収益	6,615
営業収益合計	33,685,595
営業費用	
支払手数料	12,792,753
広告宣伝費	275,488
公告費	250
調査費	
調査費	1,005,823
委託調査費	5,663,034
事務委託費	344,079
営業雑経費	
通信費	208,539
印刷費	182,427
協会費	26,229
諸会費	8,309
事務機器関連費	917,566
その他営業雑経費	126
営業費用合計	21,424,626
一般管理費	
給料	
役員報酬	171,181
給料・手当	2,786,316
賞与引当金繰入	895,400
役員賞与引当金繰入	76,200
福利厚生費	625,724
交際費	1,235
旅費交通費	10,767
租税公課	186,405
不動産賃借料	327,689
退職給付費用	229,835
役員退職慰労引当金繰入	11,763
固定資産減価償却費	643,956
諸経費	188,448
一般管理費合計	6,154,923
営業利益	6,106,045

(単位：千円)

第36期中間会計期間
（自 令和2年4月1日
至 令和2年9月30日）

営業外収益		
受取配当金		17,539
受取利息		2,089
投資有価証券償還益		24,505
収益分配金等時効完成分		275,165
受取賃貸料		32,904
その他		9,312
営業外収益合計		361,516
営業外費用		
投資有価証券償還損		37,772
時効後支払損引当金繰入		13,892
賃貸関連費用	1	6,562
その他		2,149
営業外費用合計		60,377
経常利益		6,407,184
特別利益		
投資有価証券売却益		157,075
特別利益合計		157,075
特別損失		
投資有価証券売却損		37,339
特別損失合計		37,339
税引前中間純利益		6,526,919
法人税、住民税及び事業税		1,948,492
法人税等調整額		65,981
法人税等合計		2,014,473
中間純利益		4,512,445

(3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

(単位：千円)

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当中間期変動額									
剰余金の配当							9,457,670	9,457,670	9,457,670
中間純利益							4,512,445	4,512,445	4,512,445
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	—	—	—	—	—	—	4,945,224	4,945,224	4,945,224
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	20,902,380	28,242,970	74,975,814

	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	1,815	1,815	79,922,854
当中間期変動額			

剰余金の配当			9,457,670
中間純利益			4,512,445
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	1,719,061	1,719,061	1,719,061
当中間期変動額合計	1,719,061	1,719,061	3,226,163
当中間期末残高	1,720,876	1,720,876	76,696,691

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3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。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

す。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(3) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	第36期中間会計期間 （令和2年9月30日現在）
建物	621,629千円
器具備品	1,475,730千円
投資不動産	148,595千円

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36期中間会計期間 （自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）
有形固定資産	83,458千円
無形固定資産	560,498千円
投資不動産	3,204千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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

令和2年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

（リース取引関係）

第36期中間会計期間(令和2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	337,978千円
1年超	-
合 計	337,978千円

（金融商品関係）

第36期中間会計期間(令和2年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

令和2年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計 上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	51,757,620	51,757,620	-
(2) 有価証券	47,281	47,281	-
(3) 未収委託者報酬	11,205,707	11,205,707	-
(4) 投資有価証券	17,118,778	17,118,778	-
資産計	80,129,387	80,129,387	-
(1) 未払手数料	4,401,647	4,401,647	-
負債計	4,401,647	4,401,647	-

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、

異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第36期中間会計期間（令和2年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	14,690,037	11,992,800	2,697,236
	小 計	14,690,037	11,992,800	2,697,236
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	2,476,022	2,692,895	216,872
	小 計	2,476,022	2,692,895	216,872
合 計		17,166,060	14,685,695	2,480,364

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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36期中間会計期間 （令和2年9月30日現在）
1株当たり純資産額	362,493.28円
（算定上の基礎）	
純資産の部の合計額（千円）	76,696,691
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	76,696,691
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36期中間会計期間 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	21,327.27円
中間純利益金額(千円)	4,512,445
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)	4,512,445
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。

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。

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。)

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。)

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。

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。

上記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】

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。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2020年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2020年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東洋証券株式会社	13,494 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ひろぎん証券株式会社	5,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	10,007 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＦＦＧ証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

（２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

３【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2021年1月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 4月24日	有価証券届出書
2020年 4月24日	有価証券報告書
2020年10月26日	有価証券届出書の訂正届出書

2020年10月26日	半期報告書
-------------	-------

独立監査人の監査報告書

令和2年6月26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 印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也 印

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平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35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令和2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。

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

独立監査人の監査報告書

令和３年２月24日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 鶴田 光夫 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
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eMAXIS債券バランス（２資産均等型）の令和２年１月28日から令和３年１月26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、eMAXIS債券バランス（２資産均等型）の令和３年１月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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国際投信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。

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和2年11月30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 印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也 印

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国際投信株式会社の令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（令和2年4月1日から令和2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国際投信株式会社の令和2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（令和2年4月1日から令和2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に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、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）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。