250747

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	無期限（2008年３月12日設定）	
運用方針	主として円建ての外国投資信託であるＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドおよび証券投資信託である日本短期債券マザーファンドの投資信託証券への投資を通じて、世界（含む日本）の地球温暖化対策関連企業の株式に実質的な投資を行います。実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	地球温暖化対策株式ファンド	ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドおよび日本短期債券マザーファンドの投資信託証券を主要投資対象とします。
	ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド	主として世界（含む日本）の地球温暖化対策関連企業の株式を主要投資対象とします。原則として為替ヘッジは行いません。
	日本短期債券マザーファンド	わが国の公社債・金融商品を主要投資対象とします。 外貨建資産への投資は行いません。
主な組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。	
分配方針	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。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

地球温暖化対策株式ファンド

愛称：青い地球

第29期（決算日：2015年５月12日）
第30期（決算日：2015年８月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「地球温暖化対策株式ファンド（愛称：青い地球）」は、去る８月12日に第30期の決算を行いましたので、法令に基づいて第29期～第30期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱ＵＦＪ投信株式会社は2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱ＵＦＪ国際投信株式会社」となりました。

三菱UFJ国際投信
MUFG
東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
URL:http://www.am.mufg.jp/

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先
お客さま専用フリーダイヤル TEL.0120-151034
（9:00～17:00、土・日・祝日・12月31日～１月３日を除く）
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目 次

地球温暖化対策株式ファンドのご報告

◇最近 10 期の運用実績 …… 1
◇当作成期中の基準価額と市況等の推移 …… 2
◇運用経過 …… 3
◇今後の運用方針 …… 8
◇１万口当たりの費用明細 …… 9
◇売買及び取引の状況 …… 9
◇利害関係人との取引状況等 …… 10
◇自社による当ファンドの設定・解約状況 …… 11
◇組入資産の明細 …… 11
◇投資信託財産の構成 …… 11
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況 …… 12
◇損益の状況 …… 13
◇お知らせ …… 14

投資対象ファンドのご報告

◇ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド …… 18
◇日本短期債券マザーファンド …… 20

本資料の表記にあたって

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

○最近10期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
21期(2013年５月13日)	7,283	0	13.8	0.1	－	98.4	1,561
22期(2013年８月12日)	7,062	0	△ 3.0	0.1	－	98.2	1,467
23期(2013年11月12日)	7,733	0	9.5	0.1	－	98.6	1,507
24期(2014年２月12日)	8,231	0	6.4	0.1	－	98.1	1,496
25期(2014年５月12日)	8,106	0	△ 1.5	0.1	－	97.8	835
26期(2014年８月12日)	8,180	0	0.9	0.1	－	98.1	811
27期(2014年11月12日)	8,613	0	5.3	0.1	－	98.1	807
28期(2015年２月12日)	8,494	0	△ 1.4	0.1	－	97.9	760
29期(2015年５月12日)	9,356	0	10.1	0.1	－	98.0	763
30期(2015年８月12日)	8,669	0	△ 7.3	0.2	－	98.5	664

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については前営業日の基準価額を基に計算しております。
(注) 当ファンドは、投資信託証券への投資を行い、信託財産の成長をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
			騰落率			
	（期　首）	円	%	%	%	%
	2015年２月12日	8,494	－	0.1	－	97.9
	２月末	8,856	4.3	0.1	－	98.2
第29期	３月末	8,966	5.6	0.1	－	98.2
	４月末	9,330	9.8	0.1	－	98.0
	（期　末）					
	2015年５月12日	9,356	10.1	0.1	－	98.0
	（期　首）					
	2015年５月12日	9,356	－	0.1	－	98.0
	５月末	9,549	2.1	0.1	－	98.0
第30期	６月末	8,999	△ 3.8	0.1	－	98.2
	７月末	8,721	△ 6.8	0.2	－	97.8
	（期　末）					
	2015年８月12日	8,669	△ 7.3	0.2	－	98.5

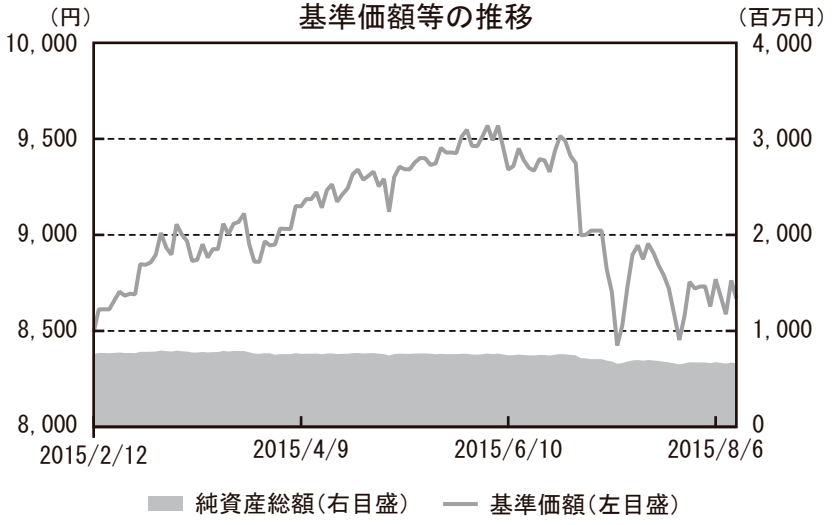
（注）当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については前営業日の基準価額を基に計算しております。
（注）騰落率は期首比。
（注）当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について

（第29期～第30期：2015/２/13～2015/８/12）

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ2.1%の上昇となりました。



第29期首　：　8,494円
第30期末　：　8,669円
（既払分配金　　0円）
騰落率　　：　2.1%

基準価額の主な変動要因

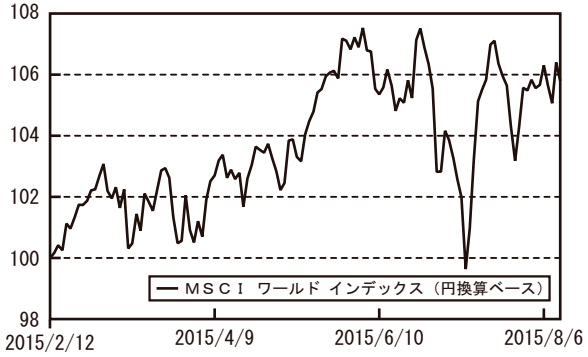
上昇要因	地球温暖化対策関連企業の株価が下落したものの、主要通貨が対円で概ね上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

投資環境について

（第29期～第30期：2015/２/13～2015/８/12）

株式市況の推移

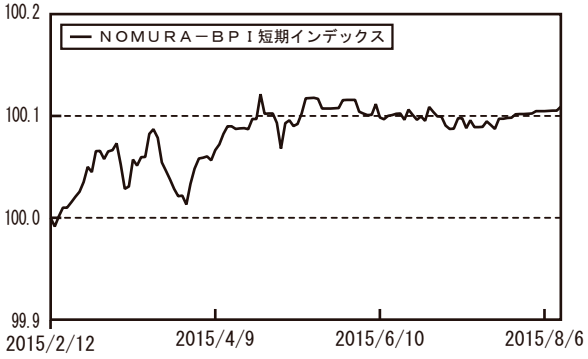
（当作成期首を100として指数化）



・ＭＳＣＩ ワールド インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数です。ＭＳＣＩ ワールド インデックス（円換算ベース）は、ＭＳＣＩ ワールド インデックス（米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、ＭＳＣＩ ワールド 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。

債券市況の推移

（当作成期首を100として指数化）



・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックスは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスのサブインデックスで、残存期間１年から３年の債券で構成されています。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスとは、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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスおよびＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し野村證券株式会社は一切関係ありません。

◎株式市況

・作成期首から2015年６月初めにかけては、米国の良好な経済指標や、好調な企業業績などを背景に堅調に推移しました。
・その後作成期末にかけては、ギリシャ情勢への懸念や中国株式市況の急落に加え、米国の利上げ動向などに左右され下落するなど不安定な動きとなりましたが、作成期を通じてみると上昇しました。

◎為替市況

・米ドル、ユーロ、英ポンドなどの主要通貨は概ね対円で上昇しました。

◎国内短期債券市況

・日銀の国債買入オペによる良好な需給環境やギリシャの債務問題に対する懸念などを背景に、債券市況は2015年４月にかけて上昇しました。その後作成期末にかけては、米国の年内の利上げに対する警戒感や、中国株式市場急落などを受けた中国の景気減速懸念などからもみ合う展開となり、作成期を通じてみると債券市況は短期ゾーンを中心に小幅な上昇となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜地球温暖化対策株式ファンド＞

・当ファンドは、アイルランド籍円建て外国投資信託であるＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドへの投資を通じて、世界（含む日本）の地球温暖化対策関連企業の株式などを高位に組み入れる運用を行いました。また、余裕資金の効率的運用のため、日本短期債券マザーファンド投資信託証券を一部組み入れた運用を行いました。
・当作成期は、地球温暖化対策関連企業の株価が下落したものの、主要通貨が対円で概ね上昇したことから、基準価額は2.1%上昇しました。

＜ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド＞

基準価額は当作成期首に比べ2.7%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

・成長見通しが明るく、長期的なプロジェクトなどの受注状況が良好な銘柄への投資を継続しました。
・投資分野別では、「再生エネルギー」、「水関連ビジネス」、「エネルギーの効率活用」の３つの分野を中心とした投資を継続しました。
・「再生エネルギー」分野については、コスト削減や、技術の進展に加え、助成金の投入など政策面での支援によって発電能力の拡大が見込まれることから、投資を継続しました。作成期末にかけて、原油価格の下落などを受けて「再生エネルギー」分野の銘柄の株価が下落しましたが、太陽光発電関連の需要が堅調に推移していることなどから、保有を継続しました。
・「水関連ビジネス」分野については、米国の建設市場の成長を背景とした水関連の設備投資需要の高まりなどから、投資を継続しました。
・「エネルギーの効率活用」分野については、資源価格が下落基調で推移したことなどを受け、全体では組み入れを引き下げました。しかし、ビルディングシステムや、照明、ＨＶＡＣ（冷暖房空調）システムなどを手掛けている企業については、資源価格の変動に左右されず、受注残の増加など安定した成長が見込まれると判断し、組み入れを引き上げました。
・前記のような方針に基づき運用した結果、原油価格の下落や、中国経済の減速に伴う需要減少懸念などにより「エネルギーの効率活用」分野や「水関連ビジネス」分野の現地通貨ベースでの株価が下落したことがマイナスに影響しました。個別銘柄では主に以下の銘柄が下落したことがマイナスに影響しました。

（マイナス要因）
◎銘柄
・BORGWARNER INC（米国）：主に自動車部品の製造販売をグローバルに展開。中国経済の減速懸念から、中国における自動車需要が落ち込むとの見方が広まったことや、市場予想を下回る企業決算などが嫌気され、株価は下落。
・COSAN LTD-CLASS A SHARES（米国）：ブラジルで再生可能エネルギーおよびエネルギー関連、インフラ関連事業に従事。ブラジルの経済情勢の悪化や、原油や砂糖価格の下落などの影響を受け、株価は下落。
・前記のように地球温暖化対策関連企業の株価が現地通貨ベースで下落したものの、米ドルや英ポンドなどの主要通貨が対円で概ね上昇したことから、基準価額は上昇しました。

（ご参考）

組入上位５業種

作成期首（2015年２月12日）

	業　種（投資分野）	比　率
1	再生エネルギー	40.8%
2	エネルギーの効率活用	34.7%
3	水関連ビジネス	24.0%
4	廃棄物処理・資源リサイクル	0.5%
5	－	－

（注）比率はＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドの現物株式評価額に対する割合です。
（注）業種（投資分野）はクラインウォート・ベンソン・インベスターズ（ダブリン）リミテッドが独自に分類したものです。

作成期末（2015年８月12日）

	業　種（投資分野）	比　率
1	再生エネルギー	47.9%
2	水関連ビジネス	26.9%
3	エネルギーの効率活用	25.3%
4	－	－
5	－	－

（注）比率はＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドの現物株式評価額に対する割合です。
（注）業種（投資分野）はクラインウォート・ベンソン・インベスターズ（ダブリン）リミテッドが独自に分類したものです。

＜日本短期債券マザーファンド＞

基準価額は当作成期首に比べ0.2%の上昇となりました。

◎組入比率
・作成期を通じて高位組み入れを維持しました。
◎債券種別構成
・国内金利の低位安定推移を見込み、利回り向上の観点から一般債をオーバーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より多くすること）としました。
◎デュレーション（平均回収期間や金利感応度）
・2015年５月までは、既に金利水準が低く、特に短期ゾーンの金利低下余地が限定的との判断により、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としました。その後、中期ゾーンの金利低下余地を見込み、デュレーションはベンチマーク対比で短めから中立に変更しました。
◎残存期間構成
・デュレーションをベンチマーク対比で中立にした前記局面において、中期ゾーンの金利低下余地を見込み、同ゾーンをオーバーウェイトとしました。

【ベンチマークとの比較】
ファンドの騰落率は、ベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックス）の騰落率（0.1%）を0.1%上回りました。この主な要因は、次の通りです。

（プラス要因）
◎残存期間構成
・2015年６月以降の中長期ゾーンの金利低下局面で、中期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。
◎債券種別構成
・作成期を通じて一般債をオーバーウェイトとしたこと。

（ご参考）

利回り・デュレーション

作成期首（2015年２月12日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	0.8%
デュレーション	1.6年

・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

作成期末（2015年８月12日）

最終利回り	0.2%
直接利回り	1.0%
デュレーション	1.6年

・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

・当ファンドは、投資信託証券への投資を行い、信託財産の成長をめざすことを目標としておりますが、特定の指数を上回るまたは連動をめざした運用を行っていないため、また、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数はありません。
・従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

分配金について

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

【分配原資の内訳】

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項目		第29期 2015年２月13日～2015年５月12日	第30期 2015年５月13日～2015年８月12日
当期分配金 （対基準価額比率）		－ －%	－ －%
	当期の収益	－	－
	当期の収益以外	－	－
翌期繰越分配対象額		530	531

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

＜地球温暖化対策株式ファンド＞
◎今後の運用方針
・運用の基本方針にしたがって、アイルランド籍円建て外国投資信託であるＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンドおよび証券投資信託である日本短期債券マザーファンドへの投資を行います。

＜ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド＞
◎運用環境の見通し
・米国の景気回復基調などを背景に、グローバル株式市況を取り巻く投資環境は好転していると考えています。

◎今後の運用方針
・前述のような運用環境を踏まえ、当ファンドは成長見通しが明るく、長期的なプロジェクトなどの受注状況が良好な企業に注目し、銘柄選択に注力していく方針です。
・投資分野別では、「再生エネルギー」分野について、今後コスト削減や助成金の投入など政策面での支援によって発電能力の拡大が見込まれると考えている太陽光発電ビジネスに注目しています。
・「エネルギーの効率活用」分野では、ビルディングシステムや、照明、ＨＶＡＣ（冷暖房空調）システムなどを手掛けている企業について、資源価格の変動に左右されず、安定した成長が見込まれると判断し、注目しています。
・「水関連ビジネス」分野では、米国の建設市場の持続的な成長から水関連設備投資需要が高まると見込んでおり、水道設備などを手掛ける企業に注目しています。

＜日本短期債券マザーファンド＞
◎運用環境の見通し
・本邦マクロ経済は、個人消費の回復が2015年６月の悪天候の影響などもあり一時的に遅れていると考えられるものの、雇用環境は着実に改善を続けていることや企業の設備投資意欲の高まりなどから、本邦景気は緩やかに回復していくものと思われます。
・「物価安定の目標」の実現に向けて日銀は、引き続き現行の金融緩和姿勢をもって臨むものと思われますが、今後の追加金融緩和観測が後退すると見込まれるため、さらなる金利低下余地は限定的と思われます。
・国内事業債のスプレッドについては日銀の社債買入オペや投資家の資金余剰感などによる良好な需給環境を背景に低位での安定推移を予想します。

◎今後の運用方針
・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
・ファンド全体のデュレーションは、既に金利水準が低いことから当面ベンチマーク対比中立の水準で機動的に調整する方針です。
・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

○１万口当たりの費用明細

（2015年２月13日～2015年８月12日）

項目	第29期～第30期 金額	第29期～第30期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	52	0.578	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(12)	(0.133)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(38)	(0.424)	分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.021)	投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.001	(b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	52	0.579	
作成期中の平均基準価額は、9,070円です。			

（注）作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）消費税は報告日の税率を採用しています。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
（注）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2015年２月13日～2015年８月12日）

投資信託証券

銘柄		第29期～第30期 買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千円	千口	千円
国内	ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド	－	－	11	112,730

（注）金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

（2015年２月13日～2015年８月12日）

利害関係人との取引状況

＜地球温暖化対策株式ファンド＞

該当事項はございません。

＜日本短期債券マザーファンド＞

区分	第29期～第30期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	6,884	1,635	23.8	8,632	2,515	29.1

平均保有割合　0.0%

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

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

＜日本短期債券マザーファンド＞

種類	第29期～第30期		
	買付額	売付額	第30期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	100	708	605

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

＜日本短期債券マザーファンド＞

種類	第29期～第30期
	買付額
	百万円
公社債	500

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

○自社による当ファンドの設定・解約状況

作成期首残高(元本)	当作成期設定元本	当作成期解約元本	作成期末残高(元本)	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
105	－	－	105	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2015年８月12日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	第28期末	第30期末		
	口数	口数	評価額	比率
	千口	千口	千円	%
ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド	81	69	653,834	98.5
合計	81	69	653,834	98.5

(注) 比率は地球温暖化対策株式ファンドの純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

銘柄	第28期末	第30期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本短期債券マザーファンド	946	946	1,051

○投資信託財産の構成

(2015年８月12日現在)

項目	第30期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	653,834	97.7
日本短期債券マザーファンド	1,051	0.2
コール・ローン等、その他	14,637	2.1
投資信託財産総額	669,522	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第29期末 2015年５月12日現在	第30期末 2015年８月12日現在
	円	円
(A) 資産	765,817,270	669,522,800
コール・ローン等	17,097,969	14,636,727
投資信託受益証券(評価額)	747,668,240	653,834,160
日本短期債券マザーファンド(評価額)	1,051,037	1,051,890
未収利息	24	23
(B) 負債	2,594,156	5,436,712
未払解約金	395,200	3,315,936
未払信託報酬	2,193,300	2,115,325
その他未払費用	5,656	5,451
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	763,223,114	664,086,088
元本	815,750,887	766,052,427
次期繰越損益金	△ 52,527,773	△101,966,339
(D) 受益権総口数	815,750,887口	766,052,427口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,356円	8,669円

○損益の状況

項目	第29期 2015年２月13日～ 2015年５月12日	第30期 2015年５月13日～ 2015年８月12日
	円	円
(A) **配当等収益**	**2,221**	**2,162,358**
受取配当金	－	2,159,962
受取利息	2,221	2,396
(B) **有価証券売買損益**	**72,256,628**	**△ 52,567,030**
売買益	76,299,103	1,815,401
売買損	△ 4,042,475	△ 54,382,431
(C) **信託報酬等**	**△ 2,198,956**	**△ 2,120,776**
(D) **当期損益金（A＋B＋C）**	**70,059,893**	**△ 52,525,448**
(E) **前期繰越損益金**	**△31,411,755**	**35,882,480**
(F) **追加信託差損益金**	**△91,175,911**	**△ 85,323,371**
（配当等相当額）	（ 4,633,007）	（ 4,762,032）
（売買損益相当額）	（△95,808,918）	（△ 90,085,403）
(G) **計（D＋E＋F）**	**△52,527,773**	**△101,966,339**
(H) **収益分配金**	**0**	**0**
次期繰越損益金（G＋H）	**△52,527,773**	**△101,966,339**
追加信託差損益金	△91,175,911	△ 85,323,371
（配当等相当額）	（ 4,633,009）	（ 4,762,037）
（売買損益相当額）	（△95,808,920）	（△ 90,085,408）
分配準備積立金	38,648,138	35,926,059
繰越損益金	－	△ 52,569,027

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

＜注記事項＞
①作成期首（前作成期末）元本額　894,918,631円
　作成期中追加設定元本額　13,345,001円
　作成期中一部解約元本額　142,211,205円
②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は101,966,339円です。
③分配金の計算過程

項目	2015年２月13日～ 2015年５月12日	2015年５月13日～ 2015年８月12日
費用控除後の配当等収益額	4,106円	43,579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	20,953,245円	－円
収益調整金額	4,633,009円	4,762,037円
分配準備積立金額	17,690,787円	35,882,480円
当ファンドの分配対象収益額	43,281,147円	40,688,096円
１万口当たり収益分配対象額	530円	531円
１万口当たり分配金額	－円	－円
収益分配金金額	－円	－円

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

［お知らせ］

①2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。（2015年７月１日）

②2014年１月１日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15％に2.1％の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％、地方税５％（法人受益者は15.315％の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2015年８月12日現在）

＜日本短期債券マザーファンド＞

下記は、日本短期債券マザーファンド全体(7,229,015千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債　種類別開示

区分	第30期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	560,300	575,415	7.2	－	－	2.6	4.6
	(560,300)	(575,415)	(7.2)	(－)	(－)	(2.6)	(4.6)
特殊債券(除く金融債)	1,342,000	1,372,198	17.1	－	－	12.1	5.0
	(1,342,000)	(1,372,198)	(17.1)	(－)	(－)	(12.1)	(5.0)
金融債券	500,000	501,474	6.2	－	－	3.7	2.5
	(500,000)	(501,474)	(6.2)	(－)	(－)	(3.7)	(2.5)
普通社債券	5,336,000	5,388,702	67.1	－	－	16.3	50.8
	(5,336,000)	(5,388,702)	(67.1)	(－)	(－)	(16.3)	(50.8)
合計	7,738,300	7,837,791	97.6	－	－	34.7	62.9
	(7,738,300)	(7,837,791)	(97.6)	(－)	(－)	(34.7)	(62.9)

(注)（)内は非上場債で内書き。
(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	第30期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第636回東京都公募公債	2.04	100,000	101,697	2016/6/20
第665回東京都公募公債	1.43	200,000	209,106	2018/12/20
第140回神奈川県公募公債	1.94	100,000	101,602	2016/6/20
平成18年度第２回愛知県公募公債	2.0	160,300	163,010	2016/6/27
小計		560,300	575,415	
特殊債券（除く金融債）				
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	200,000	209,058	2018/9/28
第194回政府保証中小企業債券	1.5	122,000	127,496	2018/9/18
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	1.69	100,000	104,511	2018/6/20
Ｆ23回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	1.075	100,000	102,702	2018/5/29
第30回公営企業債券（財投機関債）	1.97	100,000	105,308	2018/6/20
第11回阪神高速道路	0.319	100,000	100,631	2018/12/20
第39回日本政策金融公庫（財投機関債）	0.24	100,000	100,403	2018/11/7
第21回東日本高速道路	0.58	120,000	121,587	2018/6/20
第44回韓国産業銀行（2014）	0.43	200,000	200,240	2016/1/29
第12回韓国輸出入銀行	0.4	200,000	200,262	2016/3/14
小計		1,342,000	1,372,198	
金融債券				
い第746号商工債券	0.3	100,000	100,276	2017/7/27
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,504	2017/10/27
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,383	2017/6/27
第273回信金中金債	0.3	100,000	100,311	2017/8/25
小計		500,000	501,474	
普通社債券				
第409回中部電力	3.9	200,000	206,486	2016/6/24
第474回中部電力	1.69	136,000	137,290	2016/3/25
第446回関西電力	1.78	100,000	100,916	2016/3/18
第382回東北電力	3.125	200,000	209,866	2017/4/25
第416回九州電力	0.661	200,000	201,060	2016/12/22
第10回新関西国際空港	0.161	100,000	100,096	2017/9/20
第17回積水ハウス	0.125	200,000	200,024	2018/4/20
第７回セブン&アイ・ホールディングス	0.258	200,000	200,270	2016/6/20
第10回セブン&アイ・ホールディングス	0.15	100,000	100,057	2018/6/20
第13回住友大阪セメント	0.6	100,000	100,446	2016/9/5
第13回トヨタ自動車	0.289	100,000	100,140	2016/6/20
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	100,000	100,586	2018/4/20
第12回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.16	100,000	103,788	2017/7/28
第132回三菱東京ＵＦＪ銀行	0.46	100,000	100,441	2017/1/24
第１回三菱ＵＦＪ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.345	200,000	200,692	2017/6/7
第５回住友信託銀行（劣後特約付）	2.25	100,000	101,401	2016/4/27
第10回三井住友銀行（劣後特約付）	2.11	200,000	205,694	2017/2/16
第58回三井住友銀行	0.33	100,000	100,467	2018/4/20
第６回みずほ銀行（劣後特約付）	2.25	200,000	204,780	2016/11/4
第23回日産フィナンシャルサービス	0.278	100,000	100,134	2016/6/20
第32回日産フィナンシャルサービス	0.12	200,000	199,916	2018/3/20

銘柄	第30期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第62回アコム	1.07	100,000	100,456	2016/3/4
第70回アコム	0.36	100,000	99,972	2018/5/29
第138回オリックス	1.69	100,000	103,044	2017/8/25
第38回野村ホールディングス	0.605	200,000	200,496	2016/2/26
第99回三菱地所	0.553	100,000	100,371	2016/6/14
第12回ポスコ（2013）	0.93	100,000	100,423	2016/12/9
第23回ＧＥキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,694	2016/9/20
第10回ＪＰモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.462	200,000	200,538	2016/6/13
第９回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.11	100,000	102,623	2016/12/28
第９回モルガン・スタンレー	0.557	300,000	302,319	2018/5/22
第10回現代キャピタル・サービシズ・インク	0.75	100,000	100,088	2015/10/16
第４回ビー・エヌ・ピー・パリバ	0.53	100,000	100,350	2016/9/13
第５回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	200,000	201,282	2016/6/10
第８回オーストラリア・ニュージーランド銀行	1.09	200,000	201,004	2016/2/16
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	200,000	200,492	2016/12/19
小計		5,336,000	5,388,702	
合計		7,738,300	7,837,791	

ＫＢＩエコ・クライメット・チェンジ・ファンド

決算日　2015年２月28日

［計算期間：2014年３月１日～2015年２月28日］

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	アイルランド籍オープンエンド契約型外国投信（円建て）
ファンドの目的	主として世界（含む日本）の地球温暖化対策関連企業の株式を実質的な投資対象とし、信託財産の成長を目指します。
主な投資対象	世界（日本を含む）の地球温暖化対策関連企業の株式
設定日	2008年３月12日
決算日	原則として２月28日
投資運用会社	クラインウォート・ベンソン・インベスターズ（ダブリン）リミテッド Kleinwort Benson Investors Dublin Limited
信託報酬等	純資産総額の年0.67%以内（運用報酬：年0.605%、管理報酬：年0.065%以内）
分配方針	原則として、配当等収益および売買益（含む評価益）等より、年４回分配を行う方針であり、これらを超過する分配は行いません。

ご参考として掲載されている当ファンドの損益計算書及び投資有価証券明細表は、2015年２月28日の現地Financial Statementsからの抜粋であり、現地の会計基準に基づき作成され、監査を受けたものです。

損益計算書
至2015年２月28日

	至2015年２月28日 日本円
収益	
営業収益	18,647,915
フェア・バリューでの損益の金融資産純利益	55,242,108
純為替損	720,217
投資収益合計	74,610,240
営業費用	(11,691,669)
金融費用控除前純利益	62,918,571
金融費用	
買戻し可能利益参加型株式保有者への配当	(6,144,940)
フェア・バリューでの損益ではない金融負債金利費用	(43,995)
還付請求不可の源泉徴収税	(5,983,129)
ディーリング・プライスのオペレーションによる買戻し可能利益参加型株式保有者に起因する純資産の増加	50,746,507

ファンドのユニット買戻し可能利益参加型株式保有に起因する純資産の減少以外に、当該期間に認識された利益・損失はありません。決算結果に至るまでの当会計期間中、上記全ての金額はファンド運営に関係したものです。

投資明細書
2015年２月28日時点

括弧内は2014年２月28日時点の相当国保有率を示す

フェア・バリューによる金融資産損益	フェア・バリュー 日本円	純資産比率 (%)
株式: 100.59% (2014: 98.65%)		
Australia: 0.00% (2014: 0.65%)	—	—
Austria: 3.44% (2014: 0.00%)	26,539,745	3.44
Belgium: 0.00% (2014: 0.79%)	—	—
Bermuda: 2.10% (2014: 3.21%)	16,246,166	2.10
Brazil: 0.00% (2014: 1.88%)	—	—
Canada: 11.04% (2014: 8.00%)	85,365,905	11.04
Cayman Islands: 3.36% (2014: 2.39%)	25,944,725	3.36
France: 0.00% (2014: 5.46%)	—	—
Germany: 5.74% (2014: 5.97%)	44,387,980	5.74
Guernsey: 2.04% (2014: 1.43%)	15,764,027	2.04
Ireland: 4.20% (2014: 3.17%)	32,477,795	4.20
Isle of Man: 0.97% (2014: 0.63%)	7,512,056	0.97
Italy: 1.14% (2014: 2.63%)	8,841,933	1.14
Japan: 1.91% (2014: 2.03%)	14,790,000	1.91
Jersey: 3.02% (2014: 1.61%)	23,412,268	3.02
Netherlands: 1.67% (2014: 2.49%)	12,918,706	1.67
People's Republic of China: 3.15% (2014: 2.51%)	24,351,435	3.15
Spain: 3.78% (2014: 2.42%)	29,206,655	3.78
Switzerland: 1.26% (2014: 5.55%)	9,753,825	1.26
Taiwan: 1.78% (2014: 0.00%)	13,726,453	1.78
United Kingdom: 7.55% (2014: 9.14%)	58,375,405	7.55
United States: 42.44% (2014: 36.69%)	328,033,719	42.44
株式合計	777,648,798	100.59
投資合計額	777,648,798	100.59
現金および現金同等物*	1,577,029	0.20
その他純負債	(6,108,376)	(0.79)
買戻し可能利益参加型株式保有者に起因する純資産	773,117,451	100.00

*すべての現金保有はNorthern Trust Company, London Branchに保管されております。
*国保有率は法人登録国で表示しています。
*各比率は小数第３位以下を四捨五入しています。

日本短期債券マザーファンド

《第17期》決算日2015年７月22日

［計算期間：2014年７月23日～2015年７月22日］

「日本短期債券マザーファンド」は、７月22日に第17期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックス		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2011年７月22日)	10,912	0.4	233.16	0.2	98.9	－	8,078
14期(2012年７月23日)	10,992	0.7	234.25	0.5	97.7	－	7,041
15期(2013年７月22日)	11,028	0.3	234.61	0.2	98.2	－	6,509
16期(2014年７月22日)	11,076	0.4	235.35	0.3	99.0	－	12,003
17期(2015年７月22日)	11,106	0.3	235.80	0.2	98.5	－	7,875

（注）ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックスは、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスのサブインデックスで、残存期間１年から３年の債券で構成されています。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスとは、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、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合インデックスおよびＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックスは野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し野村證券株式会社は一切関係ありません。

（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA－BPI短期インデックス		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2014年７月22日	11,076	－	235.35	－	99.0	－
７月末	11,075	△0.0	235.34	△0.0	98.6	－
８月末	11,077	0.0	235.36	0.0	99.0	－
９月末	11,080	0.0	235.39	0.0	97.8	－
10月末	11,086	0.1	235.58	0.1	99.1	－
11月末	11,091	0.1	235.69	0.1	97.0	－
12月末	11,088	0.1	235.83	0.2	98.6	－
2015年１月末	11,093	0.2	235.71	0.2	97.6	－
２月末	11,097	0.2	235.72	0.2	98.6	－
３月末	11,094	0.2	235.60	0.1	99.2	－
４月末	11,102	0.2	235.81	0.2	98.7	－
５月末	11,105	0.3	235.84	0.2	95.6	－
６月末	11,105	0.3	235.80	0.2	95.9	－
（期末）						
2015年７月22日	11,106	0.3	235.80	0.2	98.5	－

（注）騰落率は期首比。
（注）「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

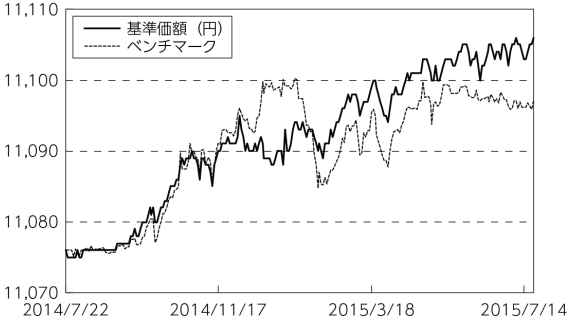
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.3%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（0.2%）を0.1%上回りました。

基準価額の推移



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

●投資環境について

◎国内短期債券市況

・日銀による大規模国債買入オペの効果や世界景気に対する慎重な見方を受けて、国内金利は低下（債券価格は上昇）基調となっていましたが、日銀が2014年10月末に「量的・質的金融緩和」の拡大を決定したことから2015年１月中旬にかけて一段の低下となりました。その後は、日銀による追加金融緩和観測の後退や米国金利の上昇などから国内金利はもみ合いながら上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

◎組入比率

・期を通じて高位組み入れを維持しました。

◎債券種別構成

・国内金利の低位安定推移を見込み、利回り向上の観点から一般債をオーバーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より多くすること）としました。

◎デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

・2015年５月までは、既に金利水準が低く、特に短期ゾーンの金利低下余地が限定的との判断により、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としました。その後、国内金利は中期ゾーンのさらなる金利上昇余地は乏しいと判断し、デュレーションはベンチマーク対比で短めから中立に変更しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

・当期の基準価額騰落率は0.3%の上昇となり、ベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ短期インデックスの0.2%の上昇を0.1%上回りました。この主な要因は、次の通りです。

（プラス要因）

◎デュレーション

・2015年１月以降の日銀の追加緩和観測の後退を受けた金利上昇局面で、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としたこと。

◎債券種別構成

・2015年１月以降の一般債のスプレッド（利回り格差）縮小局面で一般債をオーバーウェイトとしたこと。

（マイナス要因）

◎デュレーション

・2014年10月以降の日銀の金融緩和拡大を受けた金利低下局面で、デュレーションをベンチマーク対比で短めの水準としたこと。

◎債券種別構成
・2014年10月以降の一般債のスプレッド拡大局面で一般債のオーバーウェイトを維持したこと。

○今後の運用方針

◎運用環境の見通し
・個人消費の回復が遅れていることや輸出・生産の伸びが鈍化してきているものの、雇用環境は着実に改善を続けていることや企業の設備投資意欲の高まりなどから、本邦景気は緩やかに回復していくものと思われます。
・日銀は「物価安定の目標」の実現に向けて引き続き強力な金融緩和姿勢をもって臨むものと思われます。
・日銀の社債買入オペや投資家の資金余剰感などによる良好な需給環境を背景に一般債の国債に対する金利差は低位での安定推移を予想します。
・国内金利はレンジ内での推移を想定しますが、短期ゾーンに関しては低下余地は限定的と思われます。

◎今後の運用方針
・安定した利子収益確保をめざし、債券組入比率は引き続き高位に維持する方針です。
・ファンド全体のデュレーションは、ベンチマーク対比で中立の水準で機動的に調整する方針です。
・債券種別構成は、流動性や銘柄分散に留意しつつ、一般債の組入比率をベンチマーク比高めに維持します。

○１万口当たりの費用明細

（2014年７月23日～2015年７月22日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2014年７月23日～2015年７月22日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	4,167,180	3,586,996
	地方債証券	367,601	－
	特殊債券	801,231	3,608,348 (150,000)
	社債券	3,587,604	5,547,145 (100,000)

（注）金額は受渡代金。（経過利子分は含まれておりません。）
（注）（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
（注）社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

（2014年７月23日～2015年７月22日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	8,923	2,232	25.0	12,742	4,143	32.5

（注）公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	506	909	605

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種　　類	買　　付　　額
	百万円
公社債	900

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

○組入資産の明細

（2015年７月22日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区　　分	当　　期　　末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	1,500,000	1,501,953	19.1	－	－	19.1	－
地方債証券	360,300	366,709	4.7	－	－	－	4.7
	(　360,300)	(　366,709)	(4.7)	(－)	(－)	(　－)	(4.7)
特殊債券（除く金融債）	400,000	400,548	5.1	－	－	－	5.1
	(　400,000)	(　400,548)	(5.1)	(－)	(－)	(　－)	(5.1)
金融債券	500,000	501,499	6.4	－	－	5.1	1.3
	(　500,000)	(　501,499)	(6.4)	(－)	(－)	(5.1)	(1.3)
普通社債券	4,936,000	4,988,297	63.3	－	－	12.8	50.5
	(4,936,000)	(4,988,297)	(63.3)	(－)	(－)	(12.8)	(50.5)
合　　計	7,696,300	7,759,006	98.5	－	－	37.0	61.6
	(6,196,300)	(6,257,053)	(79.5)	(－)	(－)	(17.9)	(61.6)

（注）（　）内は非上場債で内書き。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第120回利付国債（５年）	0.2	100,000	100,559	2019/９/20
第121回利付国債（５年）	0.1	300,000	300,435	2019/９/20
第122回利付国債（５年）	0.1	500,000	500,545	2019/12/20
第123回利付国債（５年）	0.1	600,000	600,414	2020/３/20
小計		1,500,000	1,501,953	
地方債証券				
第636回東京都公募公債	2.04	100,000	101,811	2016/６/20
第140回神奈川県公募公債	1.94	100,000	101,710	2016/６/20
平成18年度第２回愛知県公募公債	2.0	160,300	163,188	2016/６/27
小計		360,300	366,709	
特殊債券(除く金融債)				
第44回韓国産業銀行（2014）	0.43	200,000	200,264	2016/１/29
第12回韓国輸出入銀行	0.4	200,000	200,284	2016/３/14
小計		400,000	400,548	
金融債券				
い第746号商工債券	0.3	100,000	100,278	2017/７/27
い第749号農林債券	0.3	200,000	200,518	2017/10/27
第271回信金中金債	0.35	100,000	100,386	2017/６/27
第273回信金中金債	0.3	100,000	100,317	2017/８/25
小計		500,000	501,499	
普通社債券				
第409回中部電力	3.9	200,000	206,916	2016/６/24
第474回中部電力	1.69	136,000	137,410	2016/３/25
第446回関西電力	1.78	100,000	101,001	2016/３/18
第382回東北電力	3.125	200,000	210,180	2017/４/25
第416回九州電力	0.661	200,000	201,090	2016/12/22
第10回新関西国際空港	0.161	100,000	100,099	2017/９/20
第17回積水ハウス	0.125	200,000	199,930	2018/４/20
第７回セブン&アイ・ホールディングス	0.258	200,000	200,288	2016/６/20
第13回住友大阪セメント	0.6	100,000	100,465	2016/９/５
第13回トヨタ自動車	0.289	100,000	100,149	2016/６/20
第33回みずほコーポレート銀行	0.41	100,000	100,552	2018/４/20
第12回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	2.16	100,000	103,892	2017/７/28
第132回三菱東京ＵＦＪ銀行	0.46	100,000	100,451	2017/１/24
第１回三菱ＵＦＪ信託銀行（特定社債間限定同順位）	0.345	200,000	200,694	2017/６/７
第５回住友信託銀行（劣後特約付）	2.25	100,000	101,515	2016/４/27
第10回三井住友銀行（劣後特約付）	2.11	200,000	205,892	2017/２/16
第58回三井住友銀行	0.33	100,000	100,430	2018/４/20
第６回みずほ銀行（劣後特約付）	2.25	200,000	205,002	2016/11/４
第23回日産フィナンシャルサービス	0.278	100,000	100,144	2016/６/20
第32回日産フィナンシャルサービス	0.12	200,000	199,852	2018/３/20
第62回アコム	1.07	100,000	100,503	2016/３/４
第70回アコム	0.36	100,000	100,092	2018/５/29
第138回オリックス	1.69	100,000	103,119	2017/８/25
第38回野村ホールディングス	0.605	200,000	200,484	2016/２/26

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券	%	千円	千円	
第99回三菱地所	0.553	100,000	100,397	2016/6/14
第12回ポスコ（2013）	0.93	100,000	100,431	2016/12/9
第23回ＧＥキャピタルコーポレーション	0.45	200,000	200,718	2016/9/20
第10回ＪＰモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.462	200,000	200,568	2016/6/13
第９回ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.11	100,000	102,648	2016/12/28
第10回現代キャピタル・サービシズ・インク	0.75	100,000	100,113	2015/10/16
第４回ビー・エヌ・ピー・パリバ	0.53	100,000	100,362	2016/9/13
第５回オーストラリア・コモンウェルス銀行	0.89	200,000	201,328	2016/6/10
第８回オーストラリア・ニュージーランド銀行	1.09	200,000	201,090	2016/2/16
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	200,000	200,492	2016/12/19
小計		4,936,000	4,988,297	
合計		7,696,300	7,759,006	

○投資信託財産の構成

（2015年７月22日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	7,759,006	98.4
コール・ローン等、その他	122,729	1.6
投資信託財産総額	7,881,735	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年７月22日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,881,735,434
コール・ローン等	107,197,370
公社債(評価額)	7,759,006,926
未収利息	14,158,405
前払費用	1,372,733
(B) 負債	6,327,164
未払解約金	6,327,164
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	7,875,408,270
元本	7,091,301,433
次期繰越損益金	784,106,837
(D) 受益権総口数	7,091,301,433口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,106円

＜注記事項＞

①期首元本額　10,838,030,764円
　期中追加設定元本額　6,695,431,488円
　期中一部解約元本額　10,442,160,819円

○損益の状況 (2014年７月23日～2015年７月22日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	84,213,446
受取利息	84,213,446
(B) 有価証券売買損益	△ 56,424,506
売買益	4,344,000
売買損	△ 60,768,506
(C) 当期損益金(Ａ＋Ｂ)	27,788,940
(D) 前期繰越損益金	1,165,905,922
(E) 追加信託差損益金	732,765,819
(F) 解約差損益金	△1,142,353,844
(G) 計(Ｃ＋Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	784,106,837
次期繰越損益金(Ｇ)	784,106,837

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

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

三菱ＵＦＪ グローバル・エコ・ウォーター・ファンド	8,887,168円
地球温暖化対策株式ファンド	946,881円
三菱ＵＦＪ 日本短期債券ファンド	3,862,628,126円
日本短期債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	128,848,163円
日本短期債券ファンド（適格機関投資家限定）	92,740,175円
三菱ＵＦＪ 積立ファンド（日本バランス型）	1,713,018,682円
三菱ＵＦＪ ＴＯＰＩＸ・ライト	532,868,314円
三菱ＵＦＪ 日本バランス２０	56,007,057円
三菱ＵＦＪ 日本バランス５０	42,795,980円
三菱ＵＦＪ 国内バランス２０	573,583,866円
三菱ＵＦＪ 国内バランス５０	78,977,021円
合計	7,091,301,433円

［お 知 ら せ］

①デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
（2014年12月１日）
②2015年７月１日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
（2015年７月１日）