

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)

月次レポート

2021年
07月30日現在

追加型投信／内外／資産複合

■基準価額および純資産総額の推移



・基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の値です。
・信託報酬率は、後記の「ファンドの費用」に記載しています。

■基準価額および純資産総額

| | |
|--------------|----------|
| 基準価額(1万口当たり) | 11,885円 |
| 前月末比 | +45円 |
| 純資産総額 | 146.35億円 |

■分配金実績(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 決算日 | 分配金 |
|-------|------------|-----|
| 第7期 | 2021/03/25 | 0円 |
| 第6期 | 2020/03/25 | 0円 |
| 第5期 | 2019/03/25 | 0円 |
| 第4期 | 2018/03/26 | 0円 |
| 第3期 | 2017/03/27 | 0円 |
| 第2期 | 2016/03/25 | 0円 |
| 設定来累計 | | 0円 |

・運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

■騰落率

| | 過去1ヵ月 | 過去3ヵ月 | 過去6ヵ月 | 過去1年 | 過去3年 | 設定来 |
|------|-------|-------|-------|------|------|-------|
| ファンド | 0.4% | 1.7% | 4.3% | 6.2% | 5.3% | 18.9% |

・実際のファンドでは、課税条件によってお客さまごとの騰落率は異なります。
また、換金時の費用・税金等は考慮していません。
・設定来のファンドの騰落率は、10,000を起点として計算しています。
・分配金実績がある場合は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しています。

■資産構成

| 資産 | 比率 |
|--------|-------|
| 株式 | 17.8% |
| 国内株式 | 19.9% |
| 債券 | 35.1% |
| 国内債券 | 24.9% |
| 短期金融資産 | 2.3% |

・比率は各資産に対応する投資対象マザーファンド評価額の純資産総額に対する割合です。
・マネー・マーケット・マザーファンドの組み入れがある場合は短期金融資産に含まれます。

■組入上位10カ国・地域

| 国・地域 | 比率 |
|-----------|-------|
| 1 日本 | 52.9% |
| 2 アメリカ | 25.6% |
| 3 フランス | 3.1% |
| 4 イギリス | 2.5% |
| 5 イタリア | 2.5% |
| 6 ドイツ | 2.4% |
| 7 スペイン | 1.6% |
| 8 カナダ | 1.2% |
| 9 オーストラリア | 0.9% |
| 10 オランダ | 0.8% |

■組入上位10通貨

| 通貨 | 比率 |
|--------------|-------|
| 1 日本円 | 79.7% |
| 2 米ドル | 14.6% |
| 3 ユーロ | 2.2% |
| 4 英ポンド | 0.9% |
| 5 カナダドル | 0.7% |
| 6 スイスフラン | 0.6% |
| 7 豪ドル | 0.4% |
| 8 スウェーデンクローナ | 0.2% |
| 9 香港ドル | 0.2% |
| 10 デンマーククローネ | 0.2% |

・為替予約等を含めた実質的な比率です。
・為替ヘッジ相当分は日本円で表示されます。

■当月の基準価額の変動要因(概算)

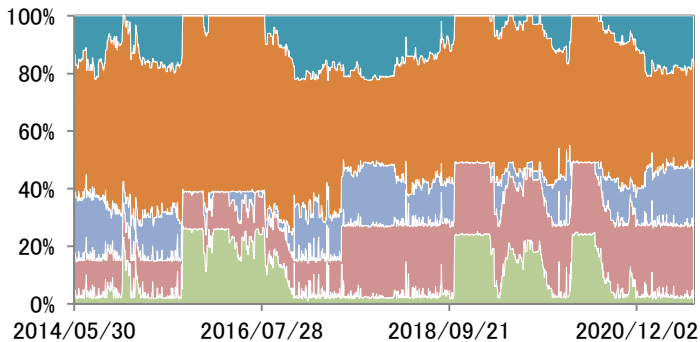
| | 寄与度(円) |
|------------|--------|
| 国内株式 | -55 |
| 先進国株式 | 35 |
| 国内債券 | 19 |
| 先進国債券 | 52 |
| 短期公社債等 | 0 |
| 分配金 | - |
| その他(信託報酬等) | -6 |
| 基準価額 | 45 |

・基準価額に与えた影響等をご理解いただくために簡便的に計算した概算値であり、その正確性、完全性を保証するものではありません。(各資産の変動要因は、投資対象とするマザーファンドの値動き等より算出。)

・表示桁未満の数値がある場合、四捨五入しています。・原則として、比率は純資産総額に対する割合です。・短期金融資産は未収・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。

※後記の「本資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

■資産別組入比率推移



・比率は各資産に対応する投資対象マザーファンド評価額の純資産総額に対する割合です。
・マネー・マーケット・マザーファンドの組み入れがある場合は短期金融資産に含みます。

■運用担当者コメント

【市況動向】

海外先進国の株式市況は、米連邦準備制度理事会(FRB)や欧州中央銀行(ECB)による金融緩和姿勢の継続や、好調な米企業業績が好感されたことなどに伴い上昇しました。

国内の株式市況は、東京都において4度目の緊急事態宣言が発出されたことや、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等から、下落しました。

日本を含む先進国の債券利回りは、主要中央銀行による金融緩和姿勢の継続や、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等から債券の安全資産としての需要が高まったことなどを背景に、低下しました。

為替市場では、米ドルは米国長期金利低下により、日米金利差が縮小したことなどから円に対して下落しました。ユーロは欧州の景気指標が下振れしたことなどから円に対して下落しました。

【運用状況・今後の運用方針】

三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき、各マザーファンド等を組み入れた運用を行いました。

『株式ウェイトマトリクス』の7月末の状況は以下のようになっています。

- ・国内株式の「投資環境」はやや良好、「株式部分の収益寄与」は高い局面
 - ・先進国株式の「投資環境」はやや良好、「株式部分の収益寄与」は高い局面
- 引き続き、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づいた運用を行う方針です。

・市況の変動等により方針通りの運用が行われない場合があります。

※後記の「本資料のご利用にあたっての注意事項等」をご覧ください。

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)

追加型投信／内外／資産複合

ファンドの目的・特色

■ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産を実質的な主要投資対象とし、値上がり益の獲得および利子・配当等収益の確保をめざします。

■ファンドの特色

投資対象 ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、国内および先進国の株式、債券および短期金融資産に実質的な投資を行います。

- ・国内、先進国の株式・債券および短期公社債等に投資するファンドです。
- ・国内株式、先進国株式の組入比率を抑えて、比較的安定的な基準価額の上昇をめざすファンドです。

<ファンドが投資対象とするマザーファンド>

TOPIXマザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

国内債券インデックスマザーファンド

ヘッジ付外国債券インデックスマザーファンド

マネー・マーケット・マザーファンド

(運用方法)

- ・三菱UFJ信託銀行株式会社の投資助言・情報提供に基づき、三菱UFJ国際投信株式会社がファンドの運用を行います。
- ・投資環境等に応じて、機動的に各資産の組入比率を調整します。各資産の組入比率の調整にあたっては、三菱UFJ信託銀行が運用する年金ファンド「下方リスク抑制バランス」の運用手法を活用します。
- ・株式の組入比率については、投資環境や株式部分の収益寄与に基づいて決定する「株式ウエイトマトリクス」を活用します。
 - *「投資環境」は、株式市場や景気の方角性、信用リスクに対する市場の反応の大きさ、株式市場の値動きの大きさ等を測る複数の指標を用いて計算される相場局面判断インデックスをもとに判断します。
 - *「株式部分の収益寄与」は、過去の株式の収益率に組入比率を勘案して算出します。
 - *「株式ウエイトマトリクス」は、各資産(国内株式、先進国株式)ごとに異なります。また、「投資環境」を判断する各指標については、今後変更になる場合があります。
- ・株式部分以外への投資については、先進国債券に一定の比率で投資を行い、残りは国内債券等に投資します。
- ・なお、国内外の債券市場が下落した場合等に債券の組入比率を引き下げ、マネー・マーケット・マザーファンド等への投資を行う場合があります。

為替対応方針 実質組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。その他の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。

■ファンドの仕組み

- ・運用は主に各マザーファンド等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および国内の短期金融資産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。

■分配方針

- ・年1回の決算時(3月25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。

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。

ご購入の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)

追加型投信／内外／資産複合

投資リスク

■基準価額の変動要因

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。

| | |
|---------------------|--|
| 価格変動 リスク | 一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式や組入公社債の価格の下落は基準価額の下落要因となります。 |
| 為替変動 リスク | 組入外貨建資産のうち債券部分については、原則として為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分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。その他の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ので、為替変動の影響を大きく受けます。 |
| 信用 リスク | 組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。 |
| 流動性 リスク | 有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。 |

■その他の留意点

・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。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。

・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、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、ファンドの基準価額に影響する場合があります。

ご購入の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)

追加型投信／内外／資産複合

手続・手数料等

■お申込みメモ

| | |
|-------------------|---|
| 購入単位 | 販売会社が定める単位／販売会社にご確認ください。 |
| 購入価額 | 購入申込受付日の翌営業日の基準価額 ※基準価額は1万口当たりで表示されます。基準価額は委託会社の照会先でご確認ください。 |
| 換金単位 | 販売会社が定める単位／販売会社にご確認ください。 |
| 換金価額 | 換金申込受付日の翌営業日の基準価額 |
| 換金代金 | 原則として、換金申込受付日から起算して6営業日目から販売会社においてお支払いします。 |
| 申込不可日 | 次のいずれかに該当する日には、購入・換金はできません。 ・ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行の休業日 ・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 ※具体的な日付については、委託会社のホームページ(「ファンド関連情報」内の「お申込み不可日一覧」)をご覧ください。 |
| 申込締切時間 | 原則として、午後3時までに販売会社が受付けたものを当日の申込分とします。 |
| 換金制限 | ファンドの資金管理を円滑に行うため、大口の換金のお申込みに制限を設ける場合があります。 |
| 購入・換金申込受付の中止及び取消し | 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、購入・換金のお申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取消すことがあります。 |
| 信託期間 | 無期限(2014年5月30日設定) |
| 繰上償還 | 受益権の口数が10億口を下回るようになった場合等には、信託期間を繰上げて償還となることがあります。 |
| 決算日 | 毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日) |
| 収益分配 | 年1回の決算時に分配金額を決定します。(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。) 販売会社との契約によっては、全額再投資されます。(税金が差引かれる場合があります。) |
| 課税関係 | 課税上は、株式投資信託として取扱われます。個人受益者については、収益分配時の普通分配金ならびに換金時および償還時の譲渡益に対して課税されます。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。税法が改正された場合等には、変更となることがあります。くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。 |

■ファンドの費用

お客さまが直接的に負担する費用

購入時手数料 ありません。

信託財産留保額 ありません。

お客さまが信託財産で間接的に負担する費用

運用管理費用(信託報酬) 日々の純資産総額に対して、**年率0.66%(税抜 年率0.6%)**をかけた額

その他の費用・手数料 監査法人に支払われるファンドの監査費用・有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料・有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用・外国株式インデックスマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額・その他信託事務の処理にかかる諸費用等についてもファンドが負担します。
※上記の費用・手数料については、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。

※運用管理費用(信託報酬)および監査費用は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。毎計算期間の6ヵ月終了時、毎決算時または償還時にファンドから支払われます。

※上記の費用(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。

本資料のご利用にあたっての注意事項等

●本資料は、三菱UFJ国際投信が作成した資料です。投資信託をご購入の場合は、販売会社よりお渡しする最新の投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認ください。●本資料の内容は作成時点のものであり、将来予告なく変更されることがあります。●本資料は信頼できると判断した情報等に基づき作成しておりますが、その正確性・完全性等を保証するものではありません。●本資料中のグラフ・数値等は、過去の実績・状況であり、将来の市場環境等や運用成果等を示唆・保証するものではありません。また税金・手数料等を考慮しておりませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。●投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。銀行等の登録金融機関でご購入いただいた投資信託は、投資者保護基金の補償の対象ではありません。●投資信託は、販売会社がお申込みの取扱いを行い委託会社が運用を行います。

●委託会社(ファンドの運用の指図等)

三菱UFJ国際投信株式会社
金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第404号
加入協会:一般社団法人 投資信託協会
一般社団法人 日本投資顧問業協会

<ホームページアドレス> <https://www.am.mufig.jp/>
<お客さま専用フリーダイヤル> 0120-151034
(受付時間 営業日の9:00~17:00)

●受託会社(ファンドの財産の保管・管理等)

三菱UFJ信託銀行株式会社

ご購入の際には、必ず投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

販売会社情報一覧表

投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は下記の販売会社まで

ファンド名称: 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)

| 商号 | 登録番号等 | 日本証券業協会 | 一般社団法人 日本 投資顧問業 協会 | 一般社団法人 金融先物 取引業協会 | 一般社団法人 第二種 金融商品 取引業協会 |
|----------|----------------------------|---------|-----------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| 楽天証券株式会社 | 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第195号 | ○ | ○ | ○ | ○ |