

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／資産複合／特殊型	
信託期間	2022年2月15日まで（2012年2月14日設定）	
運用方針	<p>三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド受益証券を通じてわが国の公社債を主要投資対象とするとともに、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用することにより、利子収益の確保と中長期的な値上がり益の獲得をめざします。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資比率は、市況動向等に基づき、信託財産の純資産総額に対して50～100%の範囲内で配分します。</p> <p>クオונツ（定量分析）モデルを活用し、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を用いることで、新興国を含む世界各国の通貨の買建て（ロング・ポジション）と売建て（ショート・ポジション）を構築し、相場環境にかかわらず中長期的な収益の獲得をめざします。</p> <p>実質的な外国為替予約取引および直物為替先渡取引等の合計額（同一通貨においては、ロング・ポジションとショート・ポジションの差額とします。）は、信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p>	
主要運用対象	ベビード	三菱UFJ 国内債券アクティブ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、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を主要取引対象とします。なお、当ファンドでわが国の公社債等に直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビード	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	<p>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。なお、第5計算期末までの間は、収益の分配は行いません。</p>	

※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。

国内債券通貨プラス

愛称：秀債くん



第31期（決算日：2014年9月16日）

第32期（決算日：2014年10月15日）

第33期（決算日：2014年11月17日）

第34期（決算日：2014年12月15日）

第35期（決算日：2015年1月15日）

第36期（決算日：2015年2月16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「国内債券通貨プラス（愛称：秀債くん）」は、去る2月16日に第36期の決算を行いましたので、法令に基づいて第31期～第36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。



東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
URL:<http://www.am.mufig.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部
お客様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)

お客様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

国内債券通貨プラスのご報告

◇最近30期の運用実績	1
◇当作成期中の基準価額等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	9
◇1万口当たりの費用明細	10
◇売買及び取引の状況	11
◇利害関係人との取引状況等	12
◇組入資産の明細	13
◇投資信託財産の構成	13
◇特定資産の価格等の調査	13
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	14
◇損益の状況	15
◇分配金のお知らせ	16
◇お知らせ	16

マザーファンドのご報告

◇三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	17
-------------------------	----

本資料の表記にあたって

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

○最近30期の運用実績

決算期	基 (分配落)	準 価 額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落					
	円		円		%	%	%	百万円	
7期(2012年9月18日)	9,956		0		△0.5	71.5	—	9,175	
8期(2012年10月15日)	9,953		0		△0.0	70.8	—	8,229	
9期(2012年11月15日)	9,952		0		△0.0	72.0	—	7,243	
10期(2012年12月17日)	10,135		5		1.9	70.9	—	6,435	
11期(2013年1月15日)	10,280		5		1.5	70.3	—	5,934	
12期(2013年2月15日)	10,351		5		0.7	74.1	—	4,913	
13期(2013年3月15日)	10,395		25		0.7	75.7	—	3,985	
14期(2013年4月15日)	10,375		25		0.0	76.1	—	3,533	
15期(2013年5月15日)	10,212		25		△1.3	74.7	—	3,317	
16期(2013年6月17日)	10,078		25		△1.1	69.9	—	3,077	
17期(2013年7月16日)	10,068		25		0.1	70.4	—	2,942	
18期(2013年8月15日)	10,050		25		0.1	73.0	—	2,861	
19期(2013年9月17日)	10,063		20		0.3	75.1	—	2,685	
20期(2013年10月15日)	10,079		20		0.4	74.7	—	2,579	
21期(2013年11月15日)	10,013		20		△0.5	73.2	—	2,491	
22期(2013年12月16日)	9,908		15		△0.9	73.8	—	2,326	
23期(2014年1月15日)	9,988		15		1.0	75.5	—	2,281	
24期(2014年2月17日)	9,920		15		△0.5	76.8	—	2,189	
25期(2014年3月17日)	9,894		15		△0.1	77.4	—	2,081	
26期(2014年4月15日)	9,909		15		0.3	76.0	—	2,069	
27期(2014年5月15日)	9,923		15		0.3	71.9	—	2,009	
28期(2014年6月16日)	9,941		10		0.3	74.1	—	1,954	
29期(2014年7月15日)	9,947		10		0.2	71.9	—	1,902	
30期(2014年8月15日)	9,910		10		△0.3	75.4	—	1,803	
31期(2014年9月16日)	9,867		10		△0.3	75.2	—	1,674	
32期(2014年10月15日)	9,900		10		0.4	78.4	—	1,584	
33期(2014年11月17日)	9,977		10		0.9	79.0	—	1,529	
34期(2014年12月15日)	10,085		10		1.2	79.3	—	1,491	
35期(2015年1月15日)	10,234		10		1.6	79.3	—	1,489	
36期(2015年2月16日)	10,043		10		△1.8	80.8	—	1,393	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) わが国の公社債を実質的な主要投資対象とするとともに、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用することにより、利子収益の確保と中長期的な値上がり益の獲得をめざしますが、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等の推移

決算期	年 月 日	基準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	券 率
			騰 落	率			
第31期	(期首) 2014年8月15日	円		%			%
		9,910		—			75.4
	8月末	9,920		0.1			75.2
第32期	(期末) 2014年9月16日						
		9,877		△0.3			75.2
	9月末	9,899		0.3			77.8
第33期	(期首) 2014年9月16日						
		9,867		—			75.2
	9月末	9,910		0.4			78.4
第34期	(期首) 2014年10月15日						
		9,900		—			78.4
	10月末	9,908		0.1			78.3
第35期	(期首) 2014年11月17日						
		9,987		0.9			79.0
	11月末	10,036		0.6			77.5
第36期	(期首) 2014年12月15日						
		10,095		1.2			79.3
	12月末	10,085		—			79.3
第37期	(期首) 2015年1月15日						
		10,167		0.8			77.6
	1月末	10,244		1.6			79.3
第38期	(期首) 2015年1月15日						
		10,234		—			79.3
	1月末	10,197		△0.4			80.3
第39期	(期首) 2015年2月16日						
		10,053		△1.8			80.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

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

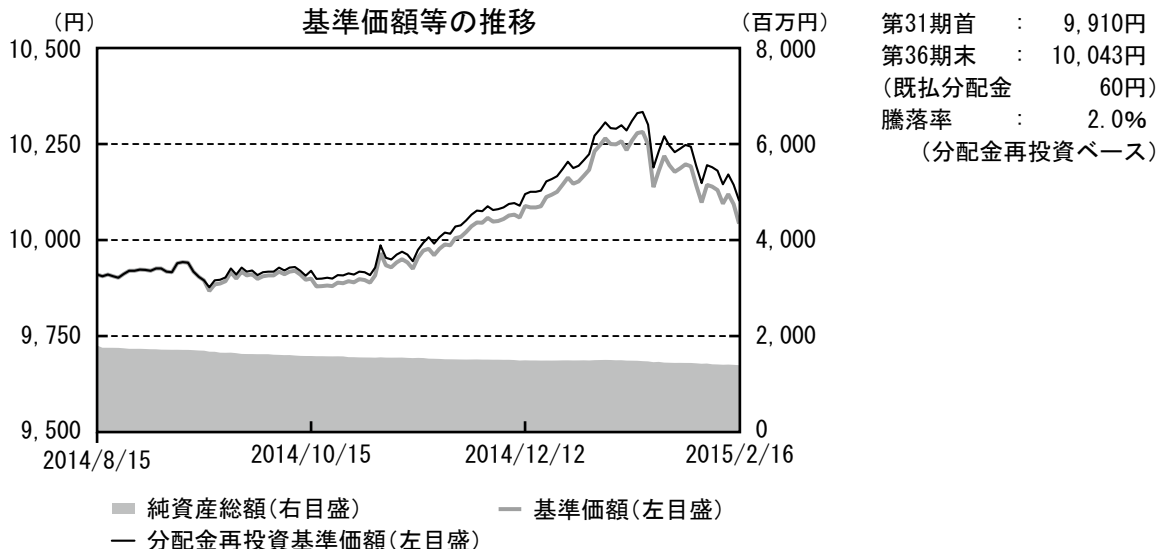
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当作成期中の基準価額等の推移について

(第31期～第36期：2014/8/16～2015/2/16)

基準価額の動き	基準価額は当作成期首に比べ2.0%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。
---------	--



- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の主な変動要因

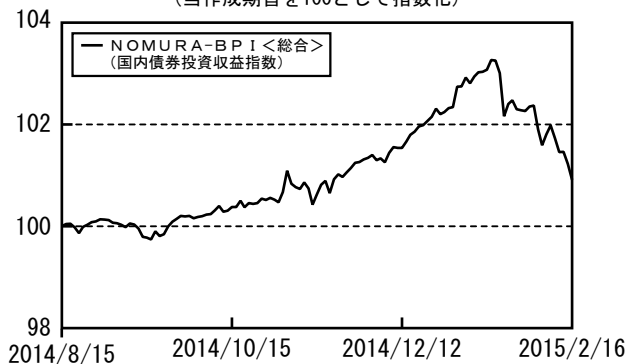
上昇要因	<p>プラスアルファ部分（通貨戦略運用部分）は、計量分析による通貨投資戦略が奏功したことから、基準価額にプラスに寄与しました。</p> <p>また、安定運用部分（国内債券運用部分）は、国内金利の低下（債券価格は上昇）を受けて基準価額にプラスに寄与しました。</p>
------	--

投資環境について

(第31期～第36期：2014/8/16～2015/2/16)

債券市況の推移

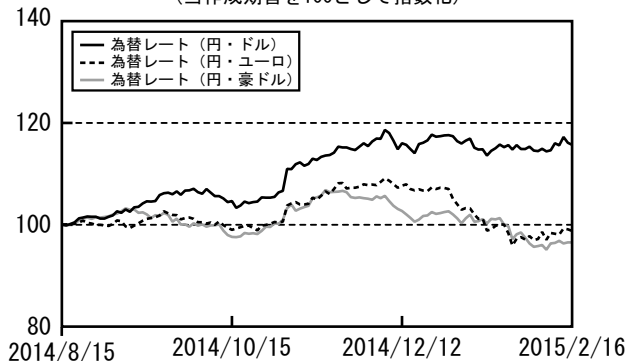
(当作成期首を100として指数化)



・NOMURA-BPI <総合> (国内債券投資収益指数)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> (国内債券投資収益指数)は野村証券株式会社の知的財産であり、各ファンドの運用成果に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。

為替市況の推移

(当作成期首を100として指数化)



◎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、国内金利はもみ合いながらも低下基調となっていました。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、日銀の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上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドルは、米国経済が相対的に堅調であることや、FRB（米連邦準備制度理事会）による量的緩和の終了などから、期を通じて対円で上昇しました。
- ・ユーロは、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和策強化への期待や、ギリシャの債務問題などをを受けて、2014年12月上旬から当作成期末にかけて対円で下落しました。
- ・カナダドルは、主要な輸出品目である原油価格が下落したことなどから、12月上旬から対円で下落しました。
- ・オーストラリアドルは、主要な輸出品目である鉱物資源価格が下落したことなどから、12月上旬から当作成期末にかけて対円で下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

＜国内債券通貨プラス＞

[プラスアルファ部分（通貨戦略運用部分）]

通貨配分および通貨への実質投資比率は、「金利水準」「市況動向」「割安度」および「通貨市場のリスク水準」の観点から、計量分析によって算出される各通貨の魅力度を基に決定しました。その結果、通貨への投資比率は当作成期首～2014年10月中旬は概ね60～70%を維持しました。10月下旬～当作成期末は、通貨市場のリスクが上昇したことからリスク抑制を実施し、概ね50～60%の間に減少させました。

通貨配分については、当初、米ドル、カナダドルは市況動向で、オーストラリアドルは金利水準で魅力度が高いと判定され買い建てとしました。その後、カナダドルとオーストラリアドルは、期中に魅力度が低下したことから、売り建てに転じています。ユーロは金利水準と市況動向の面で魅力度が低いと判定され売り建てとしました。

(プラス要因)

買い建てとしていた米ドルは期中に対円で上昇、売り建てとしていたユーロは期中に対円で下落したことから、基準価額にプラスに寄与しました。また、オーストラリアドルは売り建てとした期間に対円で下落したことから、プラスに寄与しました。

(マイナス要因)

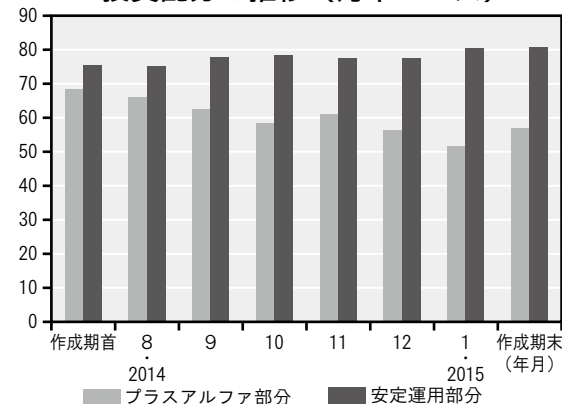
カナダドルは、買い建てとしていた期間に対円で下落したことから、基準価額にマイナスに影響しました。

[安定運用部分（国内債券運用部分）]

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内債券への実質投資を行いました。

(ご参考)

投資配分の推移 (月末ベース)

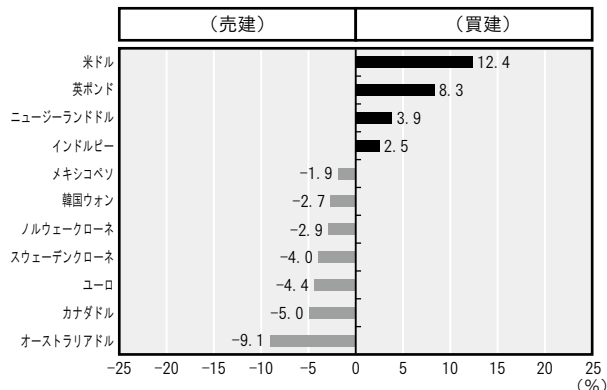


- ・比率は、「国内債券通貨プラス」の純資産総額に対する割合です。
- ・プラスアルファ部分は、新興国を含む世界各国の通貨に0～100%の範囲で投資します。
- ・プラスアルファ部分は、通貨別組入比率における買建比率と売建比率（絶対値）の合計です。
- ・安定運用部分は、国内債券に50～100%の範囲で投資します。

(ご参考)

プラスアルファ部分の通貨別組入比率

(2015年2月16日)



売建比率	買建比率	ネットポジション
-29.8%	27.0%	-2.8%

- ・比率は、「国内債券通貨プラス」における外国為替予約取引および直物為替先渡取引（NDF）等の合計により計算しており、通貨別にみた実質比率を表します。
- ・米ドルにはNDFにかかるポジションが含まれます。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

基準価額は当作成期首に比べ1.1%の上昇となりました。

- ・ ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、日銀の金融緩和政策面から金利低下圧力がかかり易い展開を想定し、ベンチマーク対比中立から長めを基本に調節しました。
- ・ 債券種別構成については、日銀による社債買入オペや投資家の資金余剰感を背景とした良好な需給関係から、一般債の спреッド（国債に対する金利差）は横ばいから縮小傾向で推移すると判断し、相対的に спреッド 妙味のある事業債および円建外債のオーバーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より多くすること）、spreッド 妙味の乏しい地方債および政府保証債のアンダーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より少なくすること）を維持しました。

【ベンチマークとの比較】

NOMURA-BPI <総合>（国内債券投資収益指数）をベンチマークとしており、当作成期のベンチマークは0.9%の上昇となりました。ベンチマークとの相対比較では、ベンチマークを0.2%上回りました。

（プラス要因）

デュレーション

- ・ 日銀の国債買入オペによる良好な需給環境を背景に金利低下圧力がかかり易い展開を想定して、2014年10月上旬～2015年1月中旬の期間においてファンド全体のデュレーションをベンチマークに対して長めとしたこと。

債券種別構成

- ・ 作成期を通じて相対的にパフォーマンスの劣後した地方債および政府保証債のアンダーウェイトを維持したこと。

（マイナス要因）

デュレーション

- ・ 2015年1月下旬以降の金利上昇局面で、ファンド全体のデュレーションをベンチマークに対して長めとしたこと。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・わが国の公社債を実質的な主要投資対象とするとともに、外国為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用することにより、利子収益の確保と中長期的な値上がり益の獲得をめざしますが、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す。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期
	2014年8月16日～ 2014年9月16日	2014年9月17日～ 2014年10月15日	2014年10月16日～ 2014年11月17日	2014年11月18日～ 2014年12月15日	2014年12月16日～ 2015年1月15日	2015年1月16日～ 2015年2月16日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.101%	10 0.101%	10 0.100%	10 0.099%	10 0.098%	10 0.099%
当期の収益	—	5	7	6	10	—
当期の収益以外	10	4	2	3	—	10
翌期繰越分配対象額	135	131	128	124	244	234

(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

<国内債券通貨プラス>

◎運用環境の見通し

- ・通貨市場では、将来的な利上げも視野に入り金融政策の引き締めに向かう米国と、量的緩和により緩和的な金融政策を継続する日本・欧州という、金融政策の違いを背景としたトレンドが続いていましたが、このような金融政策の傾向は今後も継続するものと見られます。トレンドが継続しやすい市場環境では、クオンツモデルの市況動向を捉える戦略が有効に機能する傾向にあることから、今後も通貨戦略は有効性を発揮するものと想定しています。

◎今後の運用方針

[プラスアルファ部分（通貨戦略運用部分）]

- ・「金利水準」「市況動向」「割安度」の観点から計量分析によって算出される各通貨の魅力度を基に、新興国を含む世界各国の通貨へ投資を行い、相場環境にかかわらず中長期的な収益の獲得をめざします。

[安定運用部分]

- ・三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内債券への実質投資を行う方針です。

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・先行きについては、設備投資や輸出を中心とした持ち直しや、雇用環境も改善を続けるものの、個人消費の回復が遅れていることなどから、本邦景気は緩やかな改善にとどまるものと思われます。
- ・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原油価格などの下落を受けた物価上昇率の低下に対処するものと思われます。
- ・日銀の社債買入オペ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。
- ・日銀による金融緩和政策を背景に、国内金利は引き続き低位での推移を想定します。

◎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、当面ベンチマーク対比長めを基本に機動的にリスク度合いを調整する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年 8 月16日～2015年 2 月16日)

項 目	第31期～第36期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 71	% 0.712	(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 ）	(19)	(0.196)	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 ）	(49)	(0.489)	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 ）	(3)	(0.027)	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	0.004	(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
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.001)	外国での資産の保管等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	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
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	71	0.716	
作成期間の平均基準価額は、10,021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

(2014年8月16日～2015年2月16日)

スワップ及び先渡取引状況

種 類	第31期～第36期	
	取 引 契 約	金 額
直物為替先渡取引		百万円 527

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第31期～第36期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	千口 -	千円 -	千口 202,499	千円 270,000

○利害関係人との取引状況等

(2014年8月16日～2015年2月16日)

利害関係人との取引状況

＜国内債券通貨プラス＞

該当事項はございません。

＜三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド＞

区 分	第31期～第36期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 2,126	百万円 1,064	% 50.0	百万円 4,429	百万円 786	% 17.7

平均保有割合 11.3%

※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まません。

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内債券通貨プラス＞

該当事項はございません。

＜三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド＞

種 類	第31期～第36期		
	買 付 額	売 付 額	第36期末保有額
公社債	百万円 -	百万円 100	百万円 303

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

○組入資産の明細

(2015年2月16日現在)

スワップ及び先渡取引残高

種 類	取 引 契 約 残 高	
	契約相手方の名称	第36期末想定元本額
直物為替先渡取引	CITIBANK	百万円 37
	UBS	34

親投資信託残高

銘 柄	第30期末	第36期末	
	口 数	口 数	評 価 額
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	千口 1,050,673	千口 848,173	千円 1,135,449

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2015年2月16日現在)

項 目	第36期末	
	評 価 額	比 率
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド	千円 1,135,449	% 81.1
コール・ローン等、その他	264,332	18.9
投資信託財産総額	1,399,781	100.0

(注) 作成期末における外貨建純資産(6,574千円)の投資信託財産総額(1,399,781千円)に対する比率は0.5%です。

(注) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、作成期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=118.59円		
------------------	--	--

○特定資産の価格等の調査

(2014年8月16日～2015年2月16日)

特定資産の種類	件数
直物為替先渡取引	14

当作成期に、当ファンドにおいて行った取引のうち、「投資信託及び投資法人に関する法律」第11条に基づき価格等の調査が必要とされた資産の取引については、あらた監査法人へその調査を委託し、調査報告書を受領しました。当該取引については、取引相手方の名称、通貨の種類、売買別、想定元本、満期日、その他当該取引の内容に関することについて調査を依頼しました。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第31期末	第32期末	第33期末	第34期末	第35期末	第36期末
	2014年9月16日現在	2014年10月15日現在	2014年11月17日現在	2014年12月15日現在	2015年1月15日現在	2015年2月16日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	2,768,721,798	2,390,914,181	2,320,282,422	2,299,745,665	2,253,734,074	2,105,250,927
コール・ローン等	398,622,597	320,454,509	326,235,072	292,006,617	277,415,284	259,060,641
三菱UFJ 国内債券アクティブマネージメント(円価額)	1,297,693,494	1,266,454,118	1,222,926,619	1,203,995,810	1,224,074,305	1,135,449,743
未収入金	1,072,405,138	804,005,124	771,120,282	803,742,829	752,244,051	710,740,137
未収利息	569	430	449	409	434	406
(B) 負債	1,094,209,053	806,236,193	790,724,315	807,966,440	764,689,003	711,887,515
未払金	1,071,945,158	801,709,541	767,662,749	802,057,919	756,600,334	706,638,932
未払収益分配金	1,697,097	1,600,651	1,533,054	1,479,136	1,454,955	1,387,435
未払解約金	18,430,474	1,110,581	19,545,152	2,799,105	4,847,249	2,083,503
未払信託報酬	2,131,417	1,811,251	1,978,805	1,626,534	1,782,360	1,773,562
その他未払費用	4,907	4,169	4,555	3,746	4,105	4,083
(C) 純資産総額(A-B)	1,674,512,745	1,584,677,988	1,529,558,107	1,491,779,225	1,489,045,071	1,393,363,412
元本	1,697,097,669	1,600,651,542	1,533,054,345	1,479,136,599	1,454,955,403	1,387,435,893
次期繰越損益金	△ 22,584,924	△ 15,973,554	△ 3,496,238	12,642,626	34,089,668	5,927,519
(D) 受益権総口数	1,697,097,669口	1,600,651,542口	1,533,054,345口	1,479,136,599口	1,454,955,403口	1,387,435,893口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,867円	9,900円	9,977円	10,085円	10,234円	10,043円

○損益の状況

項 目	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期
	2014年8月16日～ 2014年9月16日	2014年9月17日～ 2014年10月15日	2014年10月16日～ 2014年11月17日	2014年11月18日～ 2014年12月15日	2014年12月16日～ 2015年1月15日	2015年1月16日～ 2015年2月16日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	20,124	14,799	14,314	13,147	13,922	13,524
受取利息	20,124	14,799	14,314	13,147	13,922	13,524
(B) 有価証券売買損益	△ 3,622,128	7,471,910	16,050,417	19,353,767	25,164,785	△ 23,910,687
売買益	14,029,710	38,294,674	60,773,879	38,544,223	49,676,167	23,073,763
売買損	△ 17,651,838	△ 30,822,764	△ 44,723,462	△ 19,190,456	△ 24,511,382	△ 46,984,450
(C) 先物取引等取引損益	204,056	1,260,478	△ 720,506	△ 239,760	△ 283,551	485,663
取引益	791,131	1,431,566	2,301,876	353,945	809,644	663,396
取引損	△ 587,075	△ 171,088	△ 3,022,382	△ 593,705	△ 1,093,195	△ 177,733
(D) 信託報酬等	△ 2,137,876	△ 1,818,681	△ 2,008,432	△ 1,632,109	△ 1,786,465	△ 1,781,193
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 5,535,824	6,928,506	13,335,793	17,495,045	23,108,691	△ 25,192,693
(F) 前期繰越損益金	△ 19,901,689	△ 25,586,914	△ 19,399,310	△ 7,327,612	8,544,744	28,792,149
(G) 追加信託差損益金	4,549,686	4,285,505	4,100,333	3,954,329	3,891,188	3,715,498
(配当等相当額)	(6,180,600)	(5,832,955)	(5,589,860)	(5,396,731)	(5,310,888)	(5,069,415)
(売買損益相当額)	(△ 1,630,914)	(△ 1,547,450)	(△ 1,489,527)	(△ 1,442,402)	(△ 1,419,700)	(△ 1,353,917)
(H) 計(E+F+G)	△ 20,887,827	△ 14,372,903	△ 1,963,184	14,121,762	35,544,623	7,314,954
(I) 収益分配金	△ 1,697,097	△ 1,600,651	△ 1,533,054	△ 1,479,136	△ 1,454,955	△ 1,387,435
次期繰越損益金(H+I)	△ 22,584,924	△ 15,973,554	△ 3,496,238	12,642,626	34,089,668	5,927,519
追加信託差損益金	4,549,686	4,285,505	4,100,333	3,954,329	3,891,188	3,715,498
(配当等相当額)	(6,180,730)	(5,833,077)	(5,590,000)	(5,396,830)	(5,310,985)	(5,069,509)
(売買損益相当額)	(△ 1,631,044)	(△ 1,547,572)	(△ 1,489,667)	(△ 1,442,501)	(△ 1,419,797)	(△ 1,354,011)
分配準備積立金	16,793,958	15,145,453	14,114,913	13,093,003	30,198,480	27,404,714
繰越損益金	△ 43,928,568	△ 35,404,512	△ 21,711,484	△ 4,404,706	—	△ 25,192,693

(注) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (D) 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) (G) 追加信託差損益金とるのは、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 1,820,276,263円
 作成期中追加設定元本額 1,973,527円
 作成期中一部解約元本額 434,813,897円
- ② 分配金の計算過程

		第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期
費用控除後の配当等収益額	A	—円	910,034円	1,145,256円	956,965円	1,075,393円	—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	—円	—円	—円	17,701,371円	—円
収益調整金額	C	6,180,730円	5,833,077円	5,590,000円	5,396,830円	5,310,985円	5,069,509円
分配準備積立金額	D	18,491,055円	15,836,070円	14,502,711円	13,615,174円	12,876,671円	28,792,149円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	24,671,785円	22,579,181円	21,237,967円	19,968,969円	36,964,420円	33,861,658円
当ファンドの期末残存口数	F	1,697,097,669口	1,600,651,542口	1,533,054,345口	1,479,136,599口	1,454,955,403口	1,387,435,893口
1万円当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	145円	141円	138円	134円	254円	244円
1万円当たり分配金額	H	10円	10円	10円	10円	10円	10円
収益分配金額	I=F*H/10,000	1,697,097円	1,600,651円	1,533,054円	1,479,136円	1,454,955円	1,387,435円

○分配金のお知らせ

	第31期	第32期	第33期	第34期	第35期	第36期
1万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

- ◆分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。
- ◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。
- ◆課税上の取り扱い
 - ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
 - ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
 - ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
 - ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、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。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※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。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※2014年1月1日より、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円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5年間非課税となります。

*三菱UFJ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]

- ①書面決議を行う場合の受益者数要件の撤廃を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ②併合手続要件の緩和を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ③買取請求の一部適用除外を信託約款に記載し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ④運用報告書の二段階化について信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑤新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ⑥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)
- ⑦2014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。

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

《第15期》決算日2015年2月16日

[計算期間：2014年2月18日～2015年2月16日]

「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」は、2月16日に第15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15期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。ただし、事業債、円建外債についてはBBB格（S&P、ムーディーズ、格付投資情報センターおよび日本格付研究所のいずれかから取得したもの）相当以上の格付を有する債券を対象とします。NOMURA-BPI<総合>（国内債券投資収益指数）をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。</p> <p>経済や金利の分析をベースに、デュレーション・残存構成・債券種別等をコントロールするアクティブ運用を行います。具体的には、次のプロセスによります。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 経済分析や市場分析等を踏まえて金利の方向性等を予測し、デュレーションに関する戦略を策定します。 2) また、同様の分析を行い金利の期間構造等を予測し、上記のデュレーション戦略を加味して、残存構成に関する戦略を策定します。 3) さらに、各債券種別間の利回り較差動向等を予測し、債券種別構成に関する戦略を策定します。 4) 以上の戦略を総合して、ポートフォリオを構築します。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)		NOMURA-BPI<総合> (国内債券投資収益指数)		債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2011年2月15日)	12,009	2.1	327.49	1.5	98.7	—	18,285
12期(2012年2月15日)	12,431	3.5	337.71	3.1	98.7	—	18,103
13期(2013年2月15日)	12,743	2.5	344.76	2.1	98.6	—	21,044
14期(2014年2月17日)	13,092	2.7	353.28	2.5	98.0	—	16,061
15期(2015年2月16日)	13,387	2.3	359.95	1.9	99.1	—	9,850

(注) NOMURA-BPI<総合>（国内債券投資収益指数）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>（国内債券投資収益指数）は野村證券株式会社の知的財産であり、各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<総合> (国内債券投資収益指数)		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2014年2月17日	13,092	—	353.28	—	98.0	—
2月末	13,107	0.1	353.61	0.1	98.5	—
3月末	13,078	△0.1	352.80	△0.1	97.1	—
4月末	13,102	0.1	353.31	0.0	97.5	—
5月末	13,144	0.4	354.39	0.3	97.4	—
6月末	13,187	0.7	355.41	0.6	98.9	—
7月末	13,208	0.9	356.01	0.8	98.6	—
8月末	13,258	1.3	357.15	1.1	97.4	—
9月末	13,271	1.4	357.41	1.2	98.3	—
10月末	13,339	1.9	359.08	1.6	97.9	—
11月末	13,426	2.6	361.19	2.2	97.7	—
12月末	13,594	3.8	364.96	3.3	95.6	—
2015年1月末 (期 末)	13,615	4.0	365.07	3.3	97.6	—
2015年2月16日	13,387	2.3	359.95	1.9	99.1	—

(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

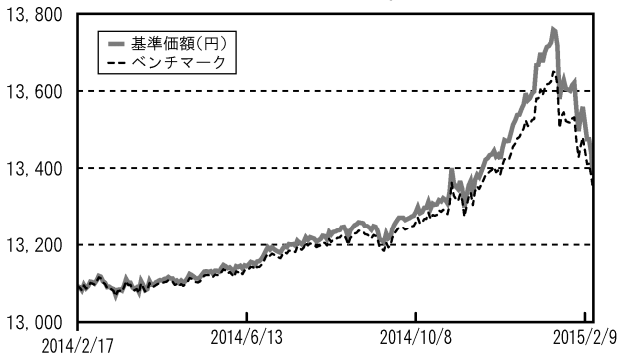
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.3%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（NOMURA-BPI<総合>（国内債券投資収益指数））の騰落率（1.9%）を0.4%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

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、国内金利はもみ合いながらも低下（債券価格は上昇）基調となっていました。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、日銀の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上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ファンド全体のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）については、日銀の金融緩和政策面から金利低下圧力がかかり易い展開を想定し、ベンチマーク対比中立から長めを基本に調節しましたが、金利低下余地は乏しいと判断した2014年5月中旬から7月下旬にかけては中立から短めで調整しました。
- ・債券種別構成については、日銀による社債買入オペや投資家の資金余剰感を背景とした良好な需給関係から、一般債のスプレッド（国債に対する金利差）は横ばいから縮小傾向で推移すると判断し、相対的にスプレッド妙味のある事業債および円建外債のオーバーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より多くすること）、スプレッド妙味の乏しい地方債および政府保証債のアンダーウェイト（投資比率を基準となる配分比率より少なくすること）を維持しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

（プラス要因）

デュレーション

- ・日銀の国債買入オペによる良好な需給環境を背景に金利低下圧力がかかり易い展開を想定

して、2014年7月下旬～8月下旬、10月上旬～2015年1月中旬の期間においてファンド全体のデュレーションをベンチマークに対して長めとしたこと。

債券種別構成

- ・期を通じて相対的にパフォーマンスの劣後した地方債および政府保証債のアンダーウェイトを維持したこと。

（マイナス要因）

デュレーション

- ・2015年1月下旬以降の金利上昇局面で、ファンド全体のデュレーションをベンチマークに対して長めとしたこと。

○今後の運用方針

●運用環境の見通し

- ・先行きについては、設備投資や輸出を中心とした持ち直しや、雇用環境も改善を続けるものの、個人消費の回復が遅れていることなどから、本邦景気は緩やかな改善にとどまるものと思われれます。
- ・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原油価格などの下落を受けた物価上昇率の低下に対処するものと思われれます。
- ・日銀の社債買入オペ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。
- ・日銀による金融緩和政策を背景に、国内金利は引き続き低位での推移を想定します。

●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、当面ベンチマーク対比長めを基本に機動的にリスク度合いを調整する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2014年2月18日～2015年2月16日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2014年2月18日～2015年2月16日)

公社債

		買付額	売付額
国	国債証券	千円 5,068,181	千円 8,512,398
	特殊債券	400,286	—
内	社債券	801,241	3,761,310 (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2月18日～2015年2月16日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
公社債	6,269	1,593	25.4	12,273	2,355	19.2

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買付額	売付額	当期末保有額
公社債	百万円 —	百万円 100	百万円 303

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買付額
公社債	百万円 300

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

○組入資産の明細

(2015年2月16日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	5,680,000	6,225,039	63.2	—	60.2	3.0	—
特殊債券 (除く金融債)	400,000 (400,000)	400,612 (400,612)	4.1 (4.1)	— (—)	— (—)	— (—)	4.1 (4.1)
普通社債券	3,100,000 (3,100,000)	3,138,651 (3,138,651)	31.9 (31.9)	— (—)	3.2 (3.2)	17.5 (17.5)	11.2 (11.2)
合 計	9,180,000 (3,500,000)	9,764,302 (3,539,263)	99.1 (35.9)	— (—)	63.3 (3.2)	20.5 (17.5)	15.3 (15.3)

(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力しています。

(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	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122回利付国債 (5年)		0.1	300,000	299,421	2019/12/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	120,000	132,248	2052/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	40,000	40,619	2054/3/20
第315回利付国債 (10年)		1.2	200,000	213,176	2021/6/20
第318回利付国債 (10年)		1.0	100,000	105,371	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)		1.1	210,000	222,818	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	100,000	105,402	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)		0.9	100,000	104,681	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)		0.8	200,000	207,880	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)		0.7	200,000	206,282	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	200,000	204,572	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)		0.8	100,000	103,812	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)		0.8	100,000	103,751	2023/9/20
第334回利付国債 (10年)		0.6	300,000	305,259	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	100,000	100,737	2024/9/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	100,000	120,961	2035/9/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	110,000	133,046	2036/6/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	100,000	118,974	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	50,000	60,475	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	50,000	60,545	2038/3/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	120,000	141,102	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	30,000	34,707	2039/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	100,000	115,837	2041/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	50,000	54,540	2042/9/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	100,000	104,049	2044/3/20
第74回利付国債 (20年)		2.1	100,000	115,813	2024/12/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	60,000	69,741	2025/6/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	70,000	80,917	2025/12/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	100,000	119,179	2026/6/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	100,000	117,294	2027/3/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	40,000	46,917	2027/6/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	10,000	11,738	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	100,000	118,688	2028/3/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	100,000	117,432	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	100,000	117,368	2028/9/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	30,000	34,432	2028/12/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	100,000	117,210	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)		2.1	200,000	234,324	2029/12/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	200,000	231,200	2030/6/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	20,000	23,358	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	100,000	118,097	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	100,000	113,513	2031/6/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	70,000	77,004	2031/12/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	200,000	216,402	2032/3/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	100,000	109,324	2032/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第145回利付国債 (20年)	1.7	210,000	228,005	2033/6/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	100,000	106,390	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	180,000	188,091	2034/3/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	110,000	112,330	2034/9/20
小 計		5,680,000	6,225,039	
特殊債券(除く金融債)				
第12回韓国輸出入銀行	0.4	400,000	400,612	2016/3/14
小 計		400,000	400,612	
普通社債券				
第526回東京電力	1.78	100,000	100,506	2017/5/31
第383回東北電力	2.9	100,000	107,421	2017/12/25
第459回東北電力	0.869	100,000	101,265	2017/2/24
第469回東北電力	1.543	100,000	107,072	2023/6/23
第424回九州電力	1.233	100,000	103,544	2023/11/24
第426回九州電力	1.064	100,000	102,012	2024/2/23
第23回太平洋セメント	0.79	100,000	101,571	2018/9/10
第63回アコム	0.99	100,000	101,407	2017/6/7
第64回アコム	0.88	100,000	101,596	2018/9/5
第163回オリックス	0.746	100,000	101,233	2017/8/7
第167回オリックス	0.508	200,000	201,418	2018/3/7
第26回三菱UFJリース	0.441	100,000	100,641	2019/11/21
第39回野村ホールディングス	0.853	300,000	304,668	2018/2/26
第12回ポスコ (2013)	0.93	100,000	100,287	2016/12/9
第10回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.462	300,000	300,921	2016/6/13
第13回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	0.373	200,000	200,384	2017/2/13
第10回現代キャピタル・サービシズ・インク	0.75	100,000	100,258	2015/10/16
第6回パークレイズ・バンク	0.328	200,000	200,108	2017/6/23
第4回ビー・エヌ・ビー・バリバ	0.53	200,000	200,716	2016/9/13
第20回ラボバンク・ネダーランド	0.487	100,000	100,315	2016/5/24
第22回ラボバンク・ネダーランド	0.377	100,000	100,244	2016/12/19
第23回ラボバンク・ネダーランド	0.557	200,000	201,064	2018/12/19
小 計		3,100,000	3,138,651	
合 計		9,180,000	9,764,302	

○投資信託財産の構成

(2015年2月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	9,764,302	98.6
コール・ローン等、その他	136,615	1.4
投資信託財産総額	9,900,917	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年2月16日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,900,917,001
コール・ローン等	104,753,808
公社債(評価額)	9,764,302,400
未收利息	29,823,377
前払費用	2,037,416
(B) 負債	50,718,081
未払解約金	50,718,081
(C) 純資産総額(A-B)	9,850,198,920
元本	7,358,279,915
次期繰越損益金	2,491,919,005
(D) 受益権総口数	7,358,279,915口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,387円

<注記事項>

①期首元本額	12,267,956,900円
期中追加設定元本額	2,303,110,576円
期中一部解約元本額	7,212,787,561円

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)

国内債券通貨プラス	848,173,410円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式20型	814,802,069円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式40型	797,309,401円
三菱UFJ ライフプラン 25	325,777,224円
三菱UFJ ライフプラン 50	376,684,105円
三菱UFJ ライフプラン 75	104,431,401円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式20型	125,753,662円
三菱UFJ グローバルバランスオープン 株式40型	51,076,112円
三菱UFJ ライフプラン 50VA(適格機関投資家限定)	944,854,792円
世界バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,366,262,164円
世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	603,155,575円
合計	7,358,279,915円

[お知らせ]

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)

○損益の状況 (2014年2月18日～2015年2月16日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	148,708,783
受取利息	148,708,783
(B) 有価証券売買損益	126,695,414
売買益	175,460,574
売買損	△ 48,765,160
(C) 当期損益金(A+B)	275,404,197
(D) 前期繰越損益金	3,793,373,664
(E) 追加信託差損益金	765,674,856
(F) 解約差損益金	△2,342,533,712
(G) 計(C+D+E+F)	2,491,919,005
次期繰越損益金(G)	2,491,919,005

(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せん。

(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。