

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>クオンツ（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	ベビーファンド	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	ベビーファンド	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。

償還報告書（全体版）

[満期償還]

国内債券通貨プラス

愛称：秀債くん

第115期（決算日：2021年9月15日）

第116期（決算日：2021年10月15日）

第117期（決算日：2021年11月15日）

第118期（決算日：2021年12月15日）

第119期（決算日：2022年1月17日）

信託終了日：2022年2月15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、「国内債券通貨プラス」は、この度、信託期間を満了し、償還の運びとなりました。ここに謹んで運用経過と償還内容を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国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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、
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、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

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	基準 (分配落)	標準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金					
	円 銭		円		%	%	%	百万円	
91期(2019年9月17日)	9,666		4		△0.8	85.6	—	2,116	
92期(2019年10月15日)	9,661		4		△0.0	85.5	—	2,089	
93期(2019年11月15日)	9,630		4		△0.3	86.2	—	2,075	
94期(2019年12月16日)	9,622		4		△0.0	88.3	—	2,045	
95期(2020年1月15日)	9,553		4		△0.7	83.8	—	2,014	
96期(2020年2月17日)	9,481		4		△0.7	86.9	—	1,969	
97期(2020年3月16日)	9,500		1		0.2	87.6	—	1,953	
98期(2020年4月15日)	9,342		1		△1.7	89.2	—	1,898	
99期(2020年5月15日)	9,361		1		0.2	89.5	—	1,895	
100期(2020年6月15日)	9,384		1		0.3	82.6	—	1,852	
101期(2020年7月15日)	9,322		1		△0.7	83.4	—	1,824	
102期(2020年8月17日)	9,278		1		△0.5	85.7	—	1,775	
103期(2020年9月15日)	9,327		1		0.5	86.4	—	1,762	
104期(2020年10月15日)	9,380		1		0.6	86.4	—	1,755	
105期(2020年11月16日)	9,403		1		0.3	83.2	—	1,708	
106期(2020年12月15日)	9,361		1		△0.4	86.0	—	1,658	
107期(2021年1月15日)	9,325		1		△0.4	83.1	—	1,596	
108期(2021年2月15日)	9,270		1		△0.6	84.9	—	1,546	
109期(2021年3月15日)	9,322		1		0.6	85.5	—	1,537	
110期(2021年4月15日)	9,342		1		0.2	82.3	—	1,439	
111期(2021年5月17日)	9,332		1		△0.1	84.2	—	1,401	
112期(2021年6月15日)	9,332		1		0.0	87.6	—	1,365	
113期(2021年7月15日)	9,304		1		△0.3	83.3	—	1,338	
114期(2021年8月16日)	9,309		1		0.1	85.8	—	1,301	
115期(2021年9月15日)	9,306		1		△0.0	83.1	—	1,271	
116期(2021年10月15日)	9,278		1		△0.3	84.9	—	1,243	
117期(2021年11月15日)	9,214		1		△0.7	88.1	—	1,195	
118期(2021年12月15日)	9,216		1		0.0	88.2	—	1,133	
119期(2022年1月17日)	9,182		1		△0.4	88.4	—	1,125	
(償還時)	(償還価額)								
120期(2022年2月15日)	9,076.04		—		△1.2	—	—	1,088	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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おります。

(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 円 銭	騰 落 率		債 組 入 比 率 %	債 先 物 比 率 %
第115期	(期 首) 2021年8月16日	9,309		—	85.8	—
	8月末	9,302		△0.1	82.9	—
	(期 末) 2021年9月15日	9,307		△0.0	83.1	—
第116期	(期 首) 2021年9月15日	9,306		—	83.1	—
	9月末	9,275		△0.3	83.3	—
	(期 末) 2021年10月15日	9,279		△0.3	84.9	—
第117期	(期 首) 2021年10月15日	9,278		—	84.9	—
	10月末	9,244		△0.4	85.0	—
	(期 末) 2021年11月15日	9,215		△0.7	88.1	—
第118期	(期 首) 2021年11月15日	9,214		—	88.1	—
	11月末	9,229		0.2	86.1	—
	(期 末) 2021年12月15日	9,217		0.0	88.2	—
第119期	(期 首) 2021年12月15日	9,216		—	88.2	—
	12月末	9,203		△0.1	88.0	—
	(期 末) 2022年1月17日	9,183		△0.4	88.4	—
第120期	(期 首) 2022年1月17日	9,182		—	88.4	—
	1月末	9,148		△0.4	88.5	—
	(償還時) 2022年2月15日	(償還価額) 9,076.04		△1.2	—	—

(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おります。

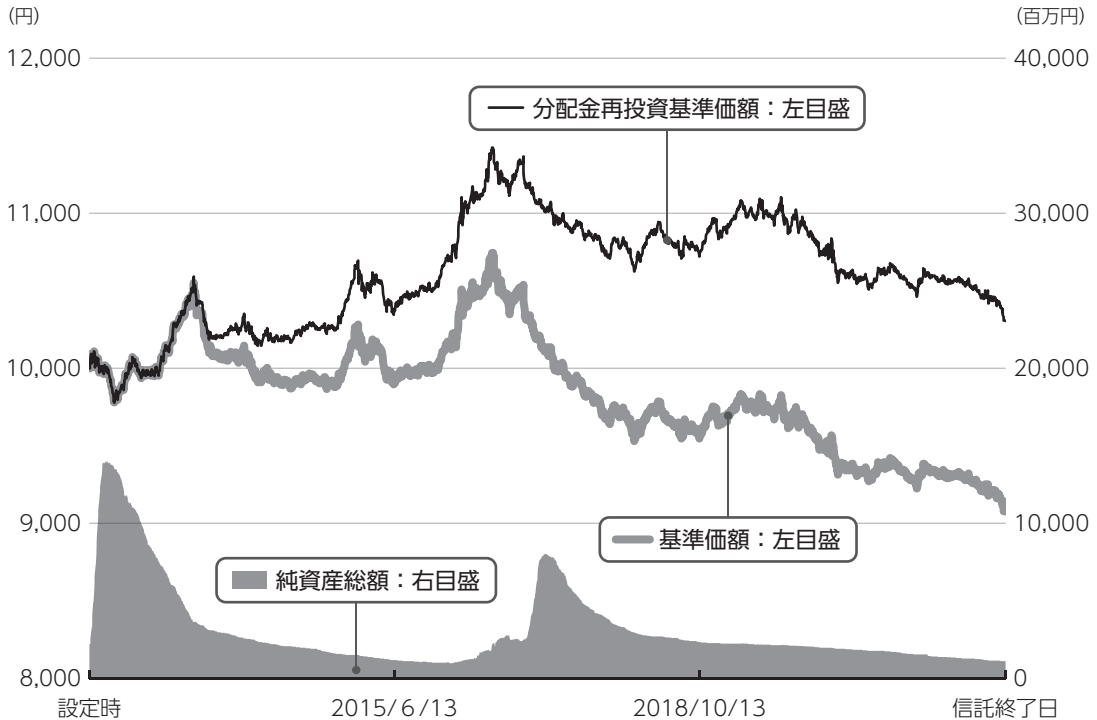
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第1期～第120期：2012年2月14日～2022年2月15日

▶ 設定来の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第120期末	9,076.04円
既払分配金	1,277円
騰落率	3.1%
	(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみな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。

基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ3.1%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

> 基準価額の主な変動要因**上昇要因**

安定運用部分（国内債券運用部分）は、国内金利の低下などを受けて基準価額にプラスに寄与しました。

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。

第1期～第120期：2012年2月14日～2022年2月15日

投資環境について

▶ 債券市況

国内金利は設定時に比べ低下しました。

2012年の資産買入基金の段階的な増額、2013年の「量的・質的金融緩和」の導入、2016年1月の「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入、9月の「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の導入と日銀が金融緩和政策を強化する中、国内金利は低下基調をたどりました。

▶ 為替市況

主な通貨の値動きは、騰落率が高い通貨から順に米ドル、スイスフラン、英ポンド、ユーロ、円、豪ドルとなりました。

米ドルは、設定時から2015年後半にかけては日銀による金融緩和の強化などを背景に対円で上昇しました。その後は2016年10月にかけて中国景気の減速懸念や資源価格の下落、英国の欧州連合（EU）離脱問題などを背景に対円で下落したも

の、11月にトランプ氏が米大統領選挙に勝利したことなどをを受けて反発しました。2017年から2020年にかけては米ドル安基調で推移したものの、2021年から信託終了日にかけては米金利の上昇などを受けて米ドル高基調となりました。信託期間を通してみると、米ドルは対円で上昇しました。

ユーロは、設定時から2014年前半にかけては欧州債務危機に対する懸念が後退したことなどをを受けて対米ドルで上昇しました。その後は2014年6月に欧州中央銀行（ECB）によりマイナス金利政策が導入されるなど緩和的な金融政策が続いたことなどがユーロの上値を重くしました。信託期間を通してみると、ユーロは対米ドルで下落したものの、円安米ドル高が進行したことを受けて対円で上昇しました。

▶ 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）

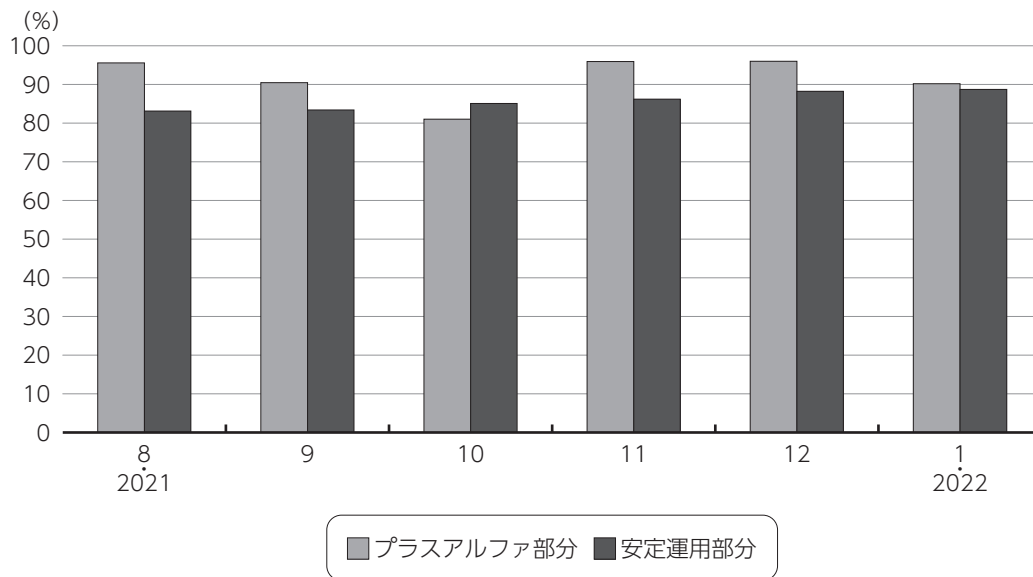
信託期間を通じて、通貨配分および通貨への実質投資比率は、「金利水準」「市況動向」「割安度」および「通貨市場のリスク水準」の観点から、計量分析によって

算出される各通貨の魅力度を基に決定しました。

最終作成期（2021年8月17日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、信託終了日にかけて各通貨への投資を終了して安定運用に切り替えました。

（ご参考）

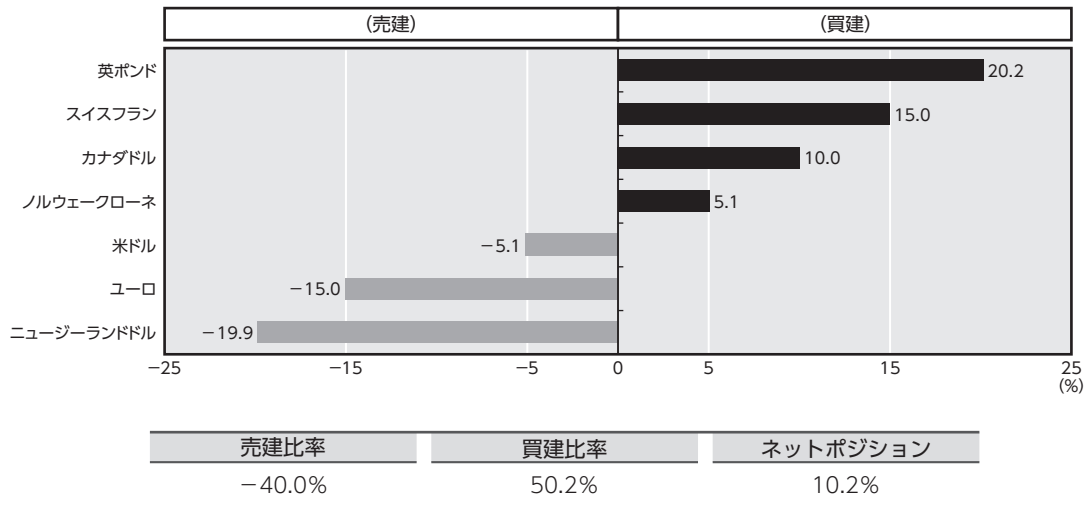
■ 投資配分の推移（月末ベース）



- ・ 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。
- ・ 安定運用部分には経過利子を含めて表示しています。

(ご参考)

■プラスアルファ部分の通貨別組入比率 (2022年1月末)



- ・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

信託期間を通じて、わが国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果めざして運用を行ってまいりました。

運用にあたっては、マクロ分析や金利予測に基づいて、デュレーション（平均回収期間や金利感応度）および残存期間別

構成のコントロール、利回り較差に着目した債券種別構成および銘柄選択でアクティブに超過収益の獲得を目指しました。さらに、ポートフォリオとベンチマークを比較分析することにより、リスクのチェックとコントロールを行いました。

組入比率

設定時から債券現物の高位組み入れを維持しました。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。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、第10期から第12期は各5円、第13期から第18期は各25円、第19期から第21期は各20円、第22期から第27期は各15円、第28期から第36期は各10円、第37期から第42期は各15円、第43期から第51期は各10円、第52期から第54期は各35円、第55期から第57期は各40円、第58期から第60期は各30円、第61期から第63期は各25円、第64期から第66期は各20円、第67期から第69期は各15円、第70期から第75期は各10円、第76期から第78期は各8円、第79期から第81期は各7円、第82期から第90期は各5円、第91期から第96期は各4円、第97期から第119期は各1円の分配とし、その他の期につきましては見送りとさせていただきます。なお、信託約款の規定に従い、第5期までの収益分配は行っていません。信託期間中、累計で1,277円の分配を行わせていただきました。

分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項目	第115期 2021年8月17日～ 2021年9月15日	第116期 2021年9月16日～ 2021年10月15日	第117期 2021年10月16日～ 2021年11月15日	第118期 2021年11月16日～ 2021年12月15日	第119期 2021年12月16日～ 2022年1月17日
当期分配金 (対基準価額比率)	1 (0.011%)	1 (0.011%)	1 (0.011%)	1 (0.011%)	1 (0.011%)
当期の収益	—	—	—	0	—
当期の収益以外	1	1	1	0	1
翌期繰越分配対象額	38	37	36	36	35

(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。

▶ 償還価額

▶ 国内債券通貨プラス

償還価額は、9,076円04銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2021年8月17日～2022年2月15日

1万口当たりの費用明細

項目	第115期～第120期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	66	0.717	(a) 信託報酬 = 作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (作成期中の日数 ÷ 年間日数)
（投信会社）	(18)	(0.193)	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）	(46)	(0.497)	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の対価
（受託会社）	(3)	(0.028)	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の対価
(b) その他費用	0	0.002	(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)	(0.000)	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
（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
合計	66	0.719	

作成期中の平均基準価額は、9,228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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

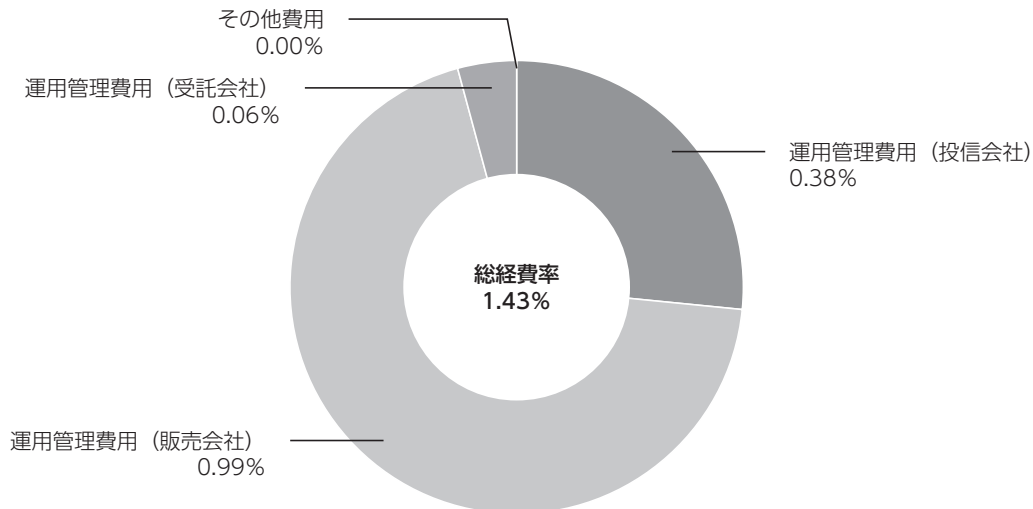
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.43%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2021年8月17日～2022年2月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第115期～第120期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド		—	—	785,648	1,142,305

○利害関係人との取引状況等

(2021年8月17日～2022年2月15日)

利害関係人との取引状況

<国内債券通貨プラス>

区 分	第115期～第120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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	10,703	2,921	27.3	10,896	2,778	25.5
為替直物取引	—	—	—	7	7	100.0

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

区 分	第115期～第120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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	1,971	122	6.2	1,841	425	23.1

平均保有割合 7.6%

※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

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

種 類	第115期～第120期		
	買 付 額	売 付 額	第120期末保有額
	百万円	百万円	百万円
公社債	100	—	299

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

<三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド>

種 類	第115期～第120期	
	買 付	額
公社債		百万円 400

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銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、アコム、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2022年2月15日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘 柄	第114期末	
	口	数
三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド		千口 785,648

○投資信託財産の構成

(2022年2月15日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 1,094,830	% 100.0
投資信託財産総額	1,094,830	100.0

○特定資産の価格等の調査

(2021年8月17日～2022年2月15日)

当作成期において、資産の取引はございません。

○資産、負債、元本及び基準(償還)価額の状況

項 目	第115期末	第116期末	第117期末	第118期末	第119期末	償 還 時
	2021年9月15日現在	2021年10月15日現在	2021年11月15日現在	2021年12月15日現在	2022年1月17日現在	2022年2月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	2,348,637,666	2,325,411,768	2,225,882,531	1,942,404,211	2,190,549,606	1,094,830,088
コール・ローン等	182,286,381	164,452,117	108,961,849	122,252,459	114,948,240	1,094,830,088
三菱UFJ 国内債券アクティブマネージャーファンド(詳細欄)	1,088,324,479	1,084,854,951	1,085,740,788	1,017,398,238	1,010,837,497	—
未収入金	1,078,026,806	1,076,104,700	1,031,179,894	802,753,514	1,064,763,869	—
(B) 負債	1,077,166,700	1,081,745,889	1,030,120,755	808,540,007	1,064,853,193	6,229,732
未払金	1,075,523,510	1,071,165,726	1,023,765,748	802,387,312	1,063,267,515	—
未払収益分配金	136,629	134,051	129,773	123,031	122,593	—
未払解約金	—	8,961,409	4,731,282	4,663,483	—	4,965,515
未払信託報酬	1,502,920	1,481,118	1,490,434	1,362,981	1,459,632	1,261,150
未払利息	185	178	88	62	94	168
その他未払費用	3,456	3,407	3,430	3,138	3,359	2,899
(C) 純資産総額(A-B)	1,271,470,966	1,243,665,879	1,195,761,776	1,133,864,204	1,125,696,413	1,088,600,356
元本	1,366,295,783	1,340,516,193	1,297,731,315	1,230,312,104	1,225,930,050	1,199,422,390
次期繰越損益金	△ 94,824,817	△ 96,850,314	△ 101,969,539	△ 96,447,900	△ 100,233,637	—
償還差損金	—	—	—	—	—	△ 110,822,034
(D) 受益権総口数	1,366,295,783口	1,340,516,193口	1,297,731,315口	1,230,312,104口	1,225,930,050口	1,199,422,390口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,306円	9,278円	9,214円	9,216円	9,182円	—
1万口当たり償還価額(C/D)	—	—	—	—	—	9,076円04銭

○損益の状況

項 目	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期	第120期
	2021年8月17日～ 2021年9月15日	2021年9月16日～ 2021年10月15日	2021年10月16日～ 2021年11月15日	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日	2022年1月18日～ 2022年2月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 3,035	△ 1,794	△ 3,328	△ 3,507	△ 1,460	△ 4,421
受取利息	152	38	—	10	77	—
支払利息	△ 3,187	△ 1,832	△ 3,328	△ 3,517	△ 1,537	△ 4,421
(B) 有価証券売買損益	1,165,878	△ 2,194,220	△ 6,583,329	1,716,735	△ 2,541,918	△ 11,487,235
売買益	23,302,342	28,563,610	27,993,075	36,713,815	18,387,477	17,758,407
売買損	△22,136,464	△30,757,830	△34,576,404	△34,997,080	△20,929,395	△29,245,642
(C) 信託報酬等	△ 1,506,376	△ 1,484,525	△ 1,493,864	△ 1,366,119	△ 1,462,991	△ 1,264,049
(D) 当期繰越益金(A+B+C)	△ 343,533	△ 3,680,539	△ 8,080,521	347,109	△ 4,006,369	△ 12,755,705
(E) 前期繰越損益金	△81,635,722	△80,562,204	△ 81,679,303	△85,215,108	△ 84,675,575	△ 86,880,811
(F) 追加信託差損益金	△12,708,933	△12,473,520	△ 12,079,942	△11,456,870	△ 11,429,100	△ 11,185,518
(配当等相当額)	(3,248,104)	(3,187,133)	(3,085,518)	(2,925,316)	(2,915,150)	(2,852,224)
(売買損益相当額)	(△15,957,037)	(△15,660,653)	(△ 15,165,460)	(△14,382,186)	(△ 14,344,250)	(△ 14,037,742)
(G) 計(D+E+F)	△94,688,188	△96,716,263	△101,839,766	△96,324,869	△100,111,044	—
(H) 収益分配金	△ 136,629	△ 134,051	△ 129,773	△ 123,031	△ 122,593	—
次期繰越損益金(G+H)	△94,824,817	△96,850,314	△101,969,539	△96,447,900	△100,233,637	—
償還差損金(D+E+F+H)	—	—	—	—	—	△110,822,034
追加信託差損益金	△12,708,933	△12,473,520	△ 12,079,942	△11,456,870	△ 11,429,100	—
(配当等相当額)	(3,248,317)	(3,187,148)	(3,085,534)	(2,925,331)	(2,915,199)	(—)
(売買損益相当額)	(△15,957,250)	(△15,660,668)	(△ 15,165,476)	(△14,382,201)	(△ 14,344,299)	(—)
分配準備積立金	2,051,381	1,878,516	1,688,688	1,594,843	1,466,330	—
繰越損益金	△84,167,265	△86,255,310	△ 91,578,285	△86,585,873	△ 90,270,867	—

(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 1,398,532,060円
 作成期中追加設定元本額 1,361,663円
 作成期中一部解約元本額 200,471,333円
 また、1口当たり純資産額は、作成期末0.907604円です。

② 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は110,822,034円です。

③ 分配金の計算過程

項 目	2021年8月17日～ 2021年9月15日	2021年9月16日～ 2021年10月15日	2021年10月16日～ 2021年11月15日	2021年11月16日～ 2021年12月15日	2021年12月16日～ 2022年1月17日
費用控除後の配当等収益額	—円	—円	—円	117,002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	—円	—円	—円	—円	—円
収益調整金額	3,248,317円	3,187,148円	3,085,534円	2,925,331円	2,915,199円
分配準備積立金額	2,188,010円	2,012,567円	1,818,461円	1,600,872円	1,588,923円
当ファンドの分配対象収益額	5,436,327円	5,199,715円	4,903,995円	4,643,205円	4,504,122円
1万口当たり収益分配対象額	39円	38円	37円	37円	36円
1万口当たり分配金額	1円	1円	1円	1円	1円
収益分配金金額	136,629円	134,051円	129,773円	123,031円	122,593円

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2012年2月14日			投資信託契約終了時の状況		
	投資信託契約終了日	2022年2月15日			資産総額	1,094,830,088円	
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	6,229,732円	純資産総額	1,088,600,356円
受益権口数	2,208,840,876口	1,199,422,390口	△1,009,418,486口	受益権口数	1,199,422,390口	1万円当たり償還金	9,076円04銭
元本額	2,208,840,876円	1,199,422,390円	△1,009,418,486円				
毎計算期末の状況							
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金			
				金額	分配率		
第1期	10,375,326,258円	10,398,570,934円	10,022円	－円	－%		
第2期	13,921,222,683	13,925,834,628	10,003	－	－		
第3期	13,933,183,320	13,723,890,880	9,850	－	－		
第4期	13,002,800,823	12,821,301,367	9,860	－	－		
第5期	11,359,894,826	11,317,478,192	9,963	－	－		
第6期	10,652,131,811	10,663,456,189	10,011	0	0.00		
第7期	9,216,162,462	9,175,593,692	9,956	0	0.00		
第8期	8,268,425,719	8,229,526,425	9,953	0	0.00		
第9期	7,278,460,273	7,243,480,129	9,952	0	0.00		
第10期	6,350,175,157	6,435,602,939	10,135	5	0.05		
第11期	5,772,888,624	5,934,274,657	10,280	5	0.05		
第12期	4,747,298,516	4,913,865,570	10,351	5	0.05		
第13期	3,833,727,478	3,985,183,380	10,395	25	0.25		
第14期	3,405,328,286	3,533,153,383	10,375	25	0.25		
第15期	3,248,792,086	3,317,714,839	10,212	25	0.25		
第16期	3,053,343,394	3,077,291,897	10,078	25	0.25		
第17期	2,922,343,663	2,942,155,036	10,068	25	0.25		
第18期	2,847,257,858	2,861,484,060	10,050	25	0.25		
第19期	2,669,053,799	2,685,812,365	10,063	20	0.20		
第20期	2,559,446,410	2,579,545,809	10,079	20	0.20		
第21期	2,488,020,520	2,491,148,545	10,013	20	0.20		
第22期	2,347,885,791	2,326,296,466	9,908	15	0.15		
第23期	2,284,778,504	2,281,992,329	9,988	15	0.15		
第24期	2,206,969,149	2,189,391,539	9,920	15	0.15		
第25期	2,103,486,633	2,081,226,112	9,894	15	0.15		
第26期	2,088,236,022	2,069,212,323	9,909	15	0.15		
第27期	2,024,650,930	2,009,075,896	9,923	15	0.15		
第28期	1,966,165,520	1,954,565,179	9,941	10	0.10		
第29期	1,913,116,120	1,902,989,445	9,947	10	0.10		
第30期	1,820,276,263	1,803,809,938	9,910	10	0.10		
第31期	1,697,097,669	1,674,512,745	9,867	10	0.10		

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第32期	1,600,651,542円	1,584,677,988円	9,900円	10円	0.10%
第33期	1,533,054,345	1,529,558,107	9,977	10	0.10
第34期	1,479,136,599	1,491,779,225	10,085	10	0.10
第35期	1,454,955,403	1,489,045,071	10,234	10	0.10
第36期	1,387,435,893	1,393,363,412	10,043	10	0.10
第37期	1,324,904,999	1,339,223,089	10,108	15	0.15
第38期	1,253,106,579	1,267,761,874	10,117	15	0.15
第39期	1,228,117,659	1,222,983,061	9,958	15	0.15
第40期	1,162,958,839	1,152,197,892	9,907	15	0.15
第41期	1,116,651,339	1,110,699,763	9,947	15	0.15
第42期	1,093,989,610	1,088,430,349	9,949	15	0.15
第43期	1,048,981,967	1,044,377,969	9,956	10	0.10
第44期	1,050,993,554	1,049,616,864	9,987	10	0.10
第45期	1,011,564,167	1,009,860,792	9,983	10	0.10
第46期	1,001,176,523	1,006,144,671	10,050	10	0.10
第47期	957,373,348	969,489,997	10,127	10	0.10
第48期	1,017,164,629	1,030,848,465	10,135	10	0.10
第49期	1,138,534,458	1,180,715,270	10,370	10	0.10
第50期	1,190,563,780	1,249,660,588	10,496	10	0.10
第51期	1,563,999,796	1,637,906,308	10,473	10	0.10
第52期	1,697,321,880	1,793,331,503	10,566	35	0.35
第53期	2,192,083,104	2,328,582,897	10,623	35	0.35
第54期	2,481,007,853	2,608,640,285	10,514	35	0.35
第55期	2,393,111,389	2,476,197,297	10,347	40	0.40
第56期	2,392,418,531	2,502,409,037	10,460	40	0.40
第57期	2,484,593,788	2,569,929,486	10,343	40	0.40
第58期	4,925,360,083	5,054,945,319	10,263	30	0.30
第59期	7,575,115,624	7,702,179,924	10,168	30	0.30
第60期	7,800,975,779	7,878,245,025	10,099	30	0.30
第61期	7,486,845,513	7,475,526,700	9,985	25	0.25
第62期	6,617,818,735	6,631,451,380	10,021	25	0.25
第63期	5,835,794,634	5,782,613,031	9,909	25	0.25
第64期	5,148,620,558	5,108,467,030	9,922	20	0.20
第65期	4,706,616,006	4,619,944,702	9,816	20	0.20
第66期	4,304,838,555	4,214,171,458	9,789	20	0.20
第67期	4,117,369,531	4,004,655,745	9,726	15	0.15
第68期	3,763,522,183	3,632,744,111	9,653	15	0.15
第69期	3,460,089,001	3,363,628,002	9,721	15	0.15
第70期	3,276,759,449	3,178,508,847	9,700	10	0.10
第71期	3,100,686,723	2,976,870,769	9,601	10	0.10

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第72期	2,923,054,499円	2,804,895,771円	9,596円	10円	0.10%
第73期	2,807,012,394	2,714,456,264	9,670	10	0.10
第74期	2,776,818,904	2,706,128,185	9,745	10	0.10
第75期	2,753,975,126	2,676,643,955	9,719	10	0.10
第76期	2,703,909,979	2,615,469,215	9,673	8	0.08
第77期	2,600,494,966	2,504,148,303	9,630	8	0.08
第78期	2,526,525,798	2,443,013,263	9,669	8	0.08
第79期	2,480,644,845	2,383,981,094	9,610	7	0.07
第80期	2,403,925,550	2,299,524,350	9,566	7	0.07
第81期	2,349,989,019	2,277,883,054	9,693	7	0.07
第82期	2,319,724,027	2,257,270,783	9,731	5	0.05
第83期	2,297,636,799	2,221,568,282	9,669	5	0.05
第84期	2,293,532,647	2,227,798,908	9,713	5	0.05
第85期	2,285,732,736	2,235,697,458	9,781	5	0.05
第86期	2,271,423,158	2,215,319,838	9,753	5	0.05
第87期	2,242,447,610	2,183,465,760	9,737	5	0.05
第88期	2,214,900,120	2,164,282,489	9,771	5	0.05
第89期	2,208,771,101	2,147,108,401	9,721	5	0.05
第90期	2,191,732,002	2,136,254,737	9,747	5	0.05
第91期	2,189,008,892	2,116,004,512	9,666	4	0.04
第92期	2,162,845,270	2,089,515,474	9,661	4	0.04
第93期	2,155,673,738	2,075,995,361	9,630	4	0.04
第94期	2,126,027,148	2,045,614,659	9,622	4	0.04
第95期	2,108,991,055	2,014,722,192	9,553	4	0.04
第96期	2,077,193,533	1,969,486,097	9,481	4	0.04
第97期	2,056,708,919	1,953,781,657	9,500	1	0.01
第98期	2,032,064,917	1,898,403,932	9,342	1	0.01
第99期	2,025,261,500	1,895,765,941	9,361	1	0.01
第100期	1,974,234,066	1,852,678,629	9,384	1	0.01
第101期	1,957,666,086	1,824,847,169	9,322	1	0.01
第102期	1,914,092,252	1,775,906,818	9,278	1	0.01
第103期	1,890,117,899	1,762,906,862	9,327	1	0.01
第104期	1,871,947,471	1,755,848,263	9,380	1	0.01
第105期	1,817,313,741	1,708,904,567	9,403	1	0.01
第106期	1,771,992,361	1,658,768,105	9,361	1	0.01
第107期	1,711,617,823	1,596,067,113	9,325	1	0.01
第108期	1,668,614,852	1,546,886,632	9,270	1	0.01
第109期	1,649,395,575	1,537,593,275	9,322	1	0.01
第110期	1,541,333,955	1,439,858,116	9,342	1	0.01
第111期	1,501,707,685	1,401,422,944	9,332	1	0.01

計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第112期	1,463,366,964円	1,365,673,403円	9,332円	1円	0.01%
第113期	1,438,969,375	1,338,773,059	9,304	1	0.01
第114期	1,398,532,060	1,301,961,708	9,309	1	0.01
第115期	1,366,295,783	1,271,470,966	9,306	1	0.01
第116期	1,340,516,193	1,243,665,879	9,278	1	0.01
第117期	1,297,731,315	1,195,761,776	9,214	1	0.01
第118期	1,230,312,104	1,133,864,204	9,216	1	0.01
第119期	1,225,930,050	1,125,696,413	9,182	1	0.01

〇分配金のお知らせ

	第115期	第116期	第117期	第118期	第119期
1 万口当たり分配金 (税込み)	1円	1円	1円	1円	1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。
 - ・分配時において、外国税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。

※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。

※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。

〇償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金 (税込み)	9,076円04銭
------------------	-----------

- ◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。
- ◆課税上の取り扱い
 - ・個人受益者の場合、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)が譲渡所得等として課税され、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。

※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。

三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド

《第22期》決算日2022年2月15日

[計算期間：2021年2月16日～2022年2月15日]

「三菱UFJ 国内債券アクティブマザーファンド」は、2月15日に第22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22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。</p> <p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、これを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。</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		NOMURA-BPI総合		債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率					
18期(2018年2月15日)	円	%		%	%		%		百万円
19期(2019年2月15日)	14,354	1.2	380.62	1.0	95.9	—	—	—	7,800
20期(2019年2月15日)	14,595	1.7	386.63	1.6	96.8	—	—	—	8,896
21期(2020年2月17日)	14,824	1.6	391.16	1.2	98.4	—	—	—	10,627
22期(2021年2月15日)	14,620	△1.4	385.59	△1.4	96.0	—	—	—	11,997
22期(2022年2月15日)	14,468	△1.0	381.06	△1.2	98.1	—	—	—	12,793

(注) 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。

(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		N O M U R A - B P I 総 合		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	率	騰 落 率	率		
(期 首) 2021年2月15日	円 14,620	% —	385.59	% —	% 96.0	% —
2月末	14,520	△0.7	383.06	△0.7	95.5	—
3月末	14,627	0.0	385.72	0.0	96.0	—
4月末	14,660	0.3	386.44	0.2	95.3	—
5月末	14,670	0.3	386.62	0.3	96.3	—
6月末	14,683	0.4	386.90	0.3	96.4	—
7月末	14,761	1.0	388.81	0.8	97.0	—
8月末	14,752	0.9	388.46	0.7	97.1	—
9月末	14,701	0.6	387.12	0.4	96.6	—
10月末	14,685	0.4	386.72	0.3	96.3	—
11月末	14,723	0.7	387.65	0.5	97.8	—
12月末	14,690	0.5	386.84	0.3	98.0	—
2022年1月末	14,583	△0.3	384.06	△0.4	97.8	—
(期 末) 2022年2月15日	14,468	△1.0	381.06	△1.2	98.1	—

(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

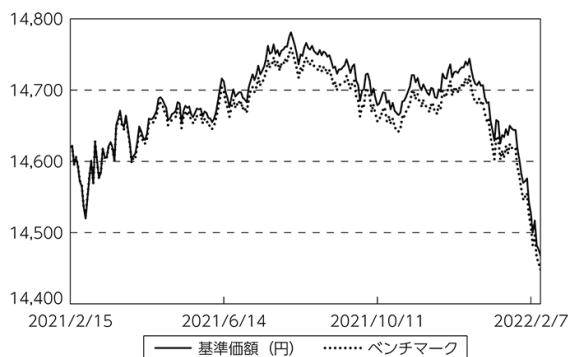
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ1.0%の下落となりました。

◎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(−1.2%)を0.2%上回りました。

基準価額等の推移



(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。

● 基準価額の主な変動要因

(下落要因)

国内金利が上昇したことなどが基準価額の下落要因となりました。

● 投資環境について**◎ 国内債券市況**

国内金利は上昇しました。

- ・国内金利は、米国金利の上昇や日銀による金融緩和政策の修正に対する警戒感などから上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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）についてはベンチマーク（NOMURA-BPI総合）対比で中立を基本に調整しました。年限別構成については、中期ゾーンのアンダーウェイト・超長期ゾーンのオーバーウェイトを基本に調整しました。
- ・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）は横ばい圏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、円建外債および資産担保証券（ABS）のオーバーウェイト、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)

◎ 債券種別構成

- ・期を通じてパフォーマンスの優れた事業債、円建外債およびABSのオーバーウェイトを維持したこと。

◎ 年限別構成

- ・2021年2月末から8月末にかけてパフォーマンスの優れた超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

(マイナス要因)

◎ 年限別構成

- ・期首から2021年2月末および11月末から期末にかけてパフォーマンスの劣後した超長期ゾーンをオーバーウェイトとしたこと。

○ 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を維持する方針です。
- ・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中立を基本に機動的にリスク度合いを調整する方針です。
- ・債券種別構成については、事業債、円建外債およびABSをベンチマーク対比多めの保有を維持する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2021年2月16日～2022年2月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、14,680円です。			

(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) 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）を期中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

(2021年2月16日～2022年2月15日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 2,758,169	千円 1,981,566
	社債券	1,403,181	700,834 (200,000)

(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

(2021年2月16日～2022年2月15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	百万円 4,161	百万円 414	% 9.9	百万円 2,682	百万円 621	% 23.2

(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 100	百万円 —	百万円 299

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 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UFJモルガン・スタンレー証券、アコムです。

○組入資産の明細

(2022年2月15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	7,110,000	7,652,117	59.8	—	59.8	—	—
普通社債券	4,900,000	4,899,096	38.3	—	2.3	25.0	11.0
	(4,800,000)	(4,798,891)	(37.5)	(—)	(2.3)	(24.2)	(11.0)
合 計	12,010,000	12,551,213	98.1	—	62.1	25.0	11.0
	(4,800,000)	(4,798,891)	(37.5)	(—)	(2.3)	(24.2)	(11.0)

(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
国債証券	%	千円	千円
第5回利付国債(40年)	2.0	70,000	90,699
第7回利付国債(40年)	1.7	70,000	85,866
第10回利付国債(40年)	0.9	80,000	80,213
第11回利付国債(40年)	0.8	60,000	58,285
第14回利付国債(40年)	0.7	70,000	65,104
第353回利付国債(10年)	0.1	100,000	100,136
第354回利付国債(10年)	0.1	160,000	160,168
第356回利付国債(10年)	0.1	170,000	169,870
第357回利付国債(10年)	0.1	80,000	79,875
第359回利付国債(10年)	0.1	50,000	49,835
第360回利付国債(10年)	0.1	240,000	238,980
第361回利付国債(10年)	0.1	110,000	109,376
第363回利付国債(10年)	0.1	300,000	297,522
第23回利付国債(30年)	2.5	40,000	51,356
第26回利付国債(30年)	2.4	50,000	63,865
第28回利付国債(30年)	2.5	20,000	26,033
第30回利付国債(30年)	2.3	60,000	76,759
第31回利付国債(30年)	2.2	30,000	37,970
第32回利付国債(30年)	2.3	50,000	64,288
第33回利付国債(30年)	2.0	50,000	61,863
第34回利付国債(30年)	2.2	70,000	89,257
第36回利付国債(30年)	2.0	80,000	99,720
第37回利付国債(30年)	1.9	40,000	49,214
第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	24,265
第39回利付国債(30年)	1.9	70,000	86,397
第42回利付国債(30年)	1.7	70,000	83,791
第44回利付国債(30年)	1.7	20,000	23,971
第45回利付国債(30年)	1.5	30,000	34,726
第46回利付国債(30年)	1.5	90,000	104,206
第47回利付国債(30年)	1.6	20,000	23,587
第49回利付国債(30年)	1.4	40,000	45,488
第50回利付国債(30年)	0.8	80,000	80,405
第53回利付国債(30年)	0.6	40,000	38,262
第54回利付国債(30年)	0.8	120,000	120,000
第58回利付国債(30年)	0.8	140,000	139,098
第60回利付国債(30年)	0.9	110,000	111,555
第61回利付国債(30年)	0.7	90,000	86,764
第67回利付国債(30年)	0.6	210,000	195,552
第69回利付国債(30年)	0.7	50,000	47,764
第72回利付国債(30年)	0.7	50,000	47,718
第111回利付国債(20年)	2.2	60,000	69,231
第113回利付国債(20年)	2.1	50,000	57,512
第114回利付国債(20年)	2.1	50,000	57,735
第116回利付国債(20年)	2.2	70,000	81,662
第118回利付国債(20年)	2.0	60,000	69,256

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121回利付国債 (20年)	1.9	60,000	68,964	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	110,000	128,659	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	130,000	153,686	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	130,000	150,606	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	150,000	172,830	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	90,000	103,077	2031/12/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	190,000	215,980	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	50,000	57,423	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	60,000	69,012	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	60,000	69,109	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	100,000	114,256	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	60,000	69,325	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	130,000	150,471	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	80,000	91,787	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	60,000	68,199	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	110,000	125,185	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	120,000	135,195	2034/9/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	140,000	154,408	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	150,000	167,413	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	110,000	121,343	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	130,000	139,954	2035/12/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	100,000	96,502	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	100,000	100,478	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	120,000	122,078	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	100,000	103,022	2037/3/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	140,000	141,818	2037/9/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	140,000	139,169	2038/3/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	140,000	143,082	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	80,000	79,078	2038/12/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	150,000	142,707	2039/6/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	120,000	115,330	2040/3/20
第176回利付国債 (20年)	0.5	110,000	106,744	2041/3/20
小 計		7,110,000	7,652,117	
普通社債券				
第500回関西電力	0.455	100,000	100,829	2026/3/19
第14回セブン&アイ・ホールディングス	0.19	100,000	99,876	2025/12/19
第16回Zホールディングス	0.6	100,000	100,513	2025/6/11
第19回Zホールディングス	0.35	100,000	99,336	2026/7/28
第15回楽天グループ	0.5	100,000	99,702	2024/12/2
第34回ソニー	0.13	100,000	99,762	2024/10/10
第43回IHI	0.2	100,000	99,476	2024/10/17
第47回IHI	0.35	100,000	99,745	2025/9/3
第9回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	0.22	100,000	99,719	2025/10/10
第1回明治安田生命2018基金	0.315	100,000	100,098	2023/9/25
第1回日本生命2019基金	0.25	100,000	100,064	2024/8/1
第1回明治安田生命2019基金	0.29	100,000	100,015	2024/8/2

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
普通社債券	%	千円	千円
第1回楽天カード	0.14	100,000	99,883
第1回日本生命2021基金劣後特約付	0.28	100,000	99,988
第35回丸井グループ	0.17	100,000	99,593
第27回あおぞら銀行	0.15	100,000	100,048
第13回三井住友トラスト・ホールディングス期限前償還条項付	0.41	100,000	99,888
第18回みずほフィナンシャルグループ期限前償還条項付	0.42	100,000	99,903
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	0.18	100,000	99,990
第14回SBIホールディングス	0.7	200,000	200,322
第19回SBIホールディングス	0.45	100,000	99,977
第23回SBIホールディングス	0.73	100,000	100,161
第7回イオンフィナンシャルサービス	0.19	100,000	99,963
第11回イオンフィナンシャルサービス	0.3	100,000	99,785
第16回イオンフィナンシャルサービス	0.27	200,000	199,252
第75回アコム	0.309	100,000	100,145
第79回アコム	0.29	100,000	100,005
第81回アコム	0.17	100,000	99,204
第36回大和証券グループ本社	0.23	100,000	99,502
第1回野村ホールディングス	0.3	100,000	100,002
第2回野村ホールディングス	0.29	100,000	99,814
第2回ソフトバンク	0.33	100,000	99,898
第8回ソフトバンク	0.35	100,000	99,822
第11回ソフトバンク	0.3	100,000	99,504
第12回東京電力パワーグリッド	0.44	100,000	100,312
第27回東京電力パワーグリッド	0.6	100,000	100,861
第34回東京電力パワーグリッド	0.75	100,000	101,489
第38回東京電力パワーグリッド	0.58	100,000	100,953
第1回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	0.18	100,000	99,838
第35回フランス相互信用連合銀行	0.279	100,000	99,519
第9回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付	1.1	100,000	99,377
第3回香港上海銀行	0.204	100,000	99,452
第6回マラヤン・バンキング	0.224	200,000	199,688
第1回パークレイズ・ピーエルシー期限前償還条項付	1.232	100,000	101,223
第3回ソシエテ ジェネラル円貨社債（2018）	0.804	100,000	100,395
UBS GROUP FUNDING (SWITZERLAND)	0.719	100,000	100,205
小 計		4,900,000	4,899,096
合 計		12,010,000	12,551,213

○投資信託財産の構成

(2022年2月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 12,551,213	% 98.1
コール・ローン等、その他	246,326	1.9
投資信託財産総額	12,797,539	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年2月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,797,539,372
コール・ローン等	216,599,279
公社債(評価額)	12,551,213,000
未収利息	28,814,182
前払費用	912,911
(B) 負債	3,779,172
未払解約金	3,779,139
未払利息	33
(C) 純資産総額(A-B)	12,793,760,200
元本	8,842,987,308
次期繰越損益金	3,950,772,892
(D) 受益権総口数	8,842,987,308口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,468円

<注記事項>

- ①期首元本額 8,206,367,473円
 期中追加設定元本額 2,725,763,868円
 期中一部解約元本額 2,089,144,033円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,468円です。

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)

国内債券セレクション(ラップ向け)	5,188,072,252円
三菱UFJ ライフプラン 50	566,891,571円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式20型	538,025,694円
三菱UFJ 日本バランスオープン 株式40型	533,097,168円
三菱UFJ ライフプラン 25	456,486,141円
三菱UFJ ライフプラン 50VA(適格機関投資家限定)	177,151,664円
三菱UFJ ライフプラン 75	174,584,868円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2030	157,179,831円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	140,938,640円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定成長型)	134,738,775円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	116,036,987円
三菱UFJ <DC>ターゲット・イヤー ファンド 2040	115,931,323円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定型)	98,061,762円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(安定型)	91,634,819円
三菱UFJ 世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限定)	81,402,286円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(成長型)	61,629,526円
三菱UFJ <DC>ライフ・バランスファンド(積極型)	57,108,177円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(安定成長型)	48,367,097円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(積極型)	35,900,986円
三菱UFJ ライフ・バランスファンド(成長型)	23,102,459円
三菱UFJ 世界バランスファンド 25VA(適格機関投資家限定)	22,066,427円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2030	14,331,656円
三菱UFJ ターゲット・イヤーファンド 2040	10,247,199円
合計	8,842,987,308円

○損益の状況 (2021年2月16日~2022年2月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	97,386,439
受取利息	97,467,801
支払利息	△ 81,362
(B) 有価証券売買損益	△ 248,639,100
売買益	5,388,200
売買損	△ 254,027,300
(C) 保管費用等	△ 21,712
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 151,274,373
(E) 前期繰越損益金	3,791,029,446
(F) 追加信託差損益金	1,276,065,972
(G) 解約差損益金	△ 965,048,153
(H) 計(D+E+F+G)	3,950,772,892
次期繰越損益金(H)	3,950,772,892

- (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) (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) (G)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。