

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年2月9日
【計算期間】	第17期中（自平成29年5月13日 至平成29年11月12日）
【ファンド名】	三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

（注）この半期報告書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第7条第4項の規定により、平成29年8月10日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書とみなされます。

## 1【ファンドの運用状況】

## (1)【投資状況】

## 【投資状況】

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,042,967,954	97.03
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		246,494,733	2.97
純資産総額		8,289,462,687	100.00

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

## 【投資資産】

## (a)【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成29年11月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	TOPIXマザーファンド	親投資信託 受益証券		1,549,892,670	1.6433 1.8790	2,546,944,683 2,912,248,326		35.13
日本	日本債券インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		1,996,103,446	1.3180 1.3228	2,630,919,843 2,640,445,638		31.85
日本	外国株式インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		632,909,539	2.4334 2.6309	1,540,168,806 1,665,121,706		20.09
日本	外国債券インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		398,201,083	1.9928 2.0722	793,558,520 825,152,284		9.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成29年11月30日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.03
合計	97.03

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

## (b)【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## (c)【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成29年11月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第7計算期間末日 (平成20年 5月12日)	2,746,147,589 (分配付) 2,746,147,589 (分配落)	13,089 (分配付) 13,089 (分配落)
第8計算期間末日 (平成21年 5月12日)	3,273,871,072 (分配付) 3,273,871,072 (分配落)	10,434 (分配付) 10,434 (分配落)
第9計算期間末日 (平成22年 5月12日)	4,039,311,318 (分配付) 4,039,311,318 (分配落)	11,197 (分配付) 11,197 (分配落)
第10計算期間末日 (平成23年 5月12日)	4,504,005,329 (分配付) 4,504,005,329 (分配落)	11,150 (分配付) 11,150 (分配落)
第11計算期間末日 (平成24年 5月14日)	4,604,023,393 (分配付) 4,604,023,393 (分配落)	10,787 (分配付) 10,787 (分配落)
第12計算期間末日 (平成25年 5月13日)	6,308,036,748 (分配付) 6,308,036,748 (分配落)	14,602 (分配付) 14,602 (分配落)

第13計算期間末日 (平成26年 5月12日)	6,577,359,901 (分配付) 6,577,359,901 (分配落)	15,049 (分配付) 15,049 (分配落)
第14計算期間末日 (平成27年 5月12日)	7,125,245,315 (分配付) 7,125,245,315 (分配落)	18,132 (分配付) 18,132 (分配落)
第15計算期間末日 (平成28年 5月12日)	6,895,524,970 (分配付) 6,895,524,970 (分配落)	16,954 (分配付) 16,954 (分配落)
第16計算期間末日 (平成29年 5月12日)	7,677,987,175 (分配付) 7,677,987,175 (分配落)	18,763 (分配付) 18,763 (分配落)
平成28年11月末日	7,397,104,907	17,780
12月末日	7,573,767,986	18,242
平成29年 1月末日	7,550,781,702	18,163
2月末日	7,441,022,567	18,299
3月末日	7,508,754,966	18,285
4月末日	7,567,000,046	18,430
5月末日	7,653,985,903	18,656
6月末日	7,766,280,710	18,915
7月末日	7,806,487,778	18,966
8月末日	7,808,908,660	19,003
9月末日	8,025,658,289	19,464
10月末日	8,214,800,224	19,923
11月末日	8,289,462,687	20,068

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第7計算期間	10.12
第8計算期間	20.28
第9計算期間	7.31
第10計算期間	0.41
第11計算期間	3.25
第12計算期間	35.36
第13計算期間	3.06
第14計算期間	20.48
第15計算期間	6.49
第16計算期間	10.67
第16計算期間末日から 平成29年11月末日までの期間	6.95

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額)を控除した額を当該基準価額(分配落の額)で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。ただし、第16計算期間末日から平成29年11月末日までの期間については平成29年11月末日の基準価額から当該基準価額(分配落の額)を控除した額を当該基準価額(分配落の額)で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

## &lt;参考&gt;

「日本債券インデックスマザーファンド」  
投資状況

平成29年11月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	352,187,461,770	82.28
地方債証券	日本	22,979,398,055	5.37
特殊債券	日本	28,948,688,217	6.76
社債券	日本	19,764,888,500	4.62
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		4,178,784,718	0.97
純資産総額		428,059,221,260	100.00

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

## その他の資産の投資状況

平成29年11月30日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引（買建）	1,660,230,000	0.39

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

## 投資資産

## （a）投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成29年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 （千円）	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第312回利付国債(10年)	国債証券		5,130,000	104.24 104.0640	5,347,892,000 5,338,483,200	1.200000 2020/12/20	1.25
日本	第348回利付国債(10年)	国債証券		4,770,000	100.53 100.6830	4,795,701,400 4,802,579,100	0.100000 2027/09/20	1.12
日本	第329回利付国債(10年)	国債証券		4,330,000	105.37 104.9860	4,562,568,500 4,545,893,800	0.800000 2023/06/20	1.06
日本	第333回利付国債(10年)	国債証券		4,180,000	104.63 104.2990	4,373,534,000 4,359,698,200	0.600000 2024/03/20	1.02
日本	第133回利付国債(5年)	国債証券		4,200,000	101.04 101.0600	4,243,993,500 4,244,520,000	0.100000 2022/09/20	0.99
日本	第381回利付国債(2年)	国債証券		4,150,000	100.56 100.4950	4,173,285,800 4,170,542,500	0.100000 2019/10/15	0.97
日本	第339回利付国債(10年)	国債証券		3,910,000	103.38 103.4060	4,042,357,100 4,043,174,600	0.400000 2025/06/20	0.94
日本	第125回利付国債(5年)	国債証券		4,000,000	100.81 100.6870	4,032,534,000 4,027,480,000	0.100000 2020/09/20	0.94
日本	第325回利付国債(10年)	国債証券		3,835,000	104.88 104.3860	4,022,227,500 4,003,203,100	0.800000 2022/09/20	0.94
日本	第342回利付国債(10年)	国債証券		3,950,000	100.90 101.0380	3,985,875,000 3,991,001,000	0.100000 2026/03/20	0.93
日本	第306回利付国債(10年)	国債証券		3,688,000	104.13 103.5380	3,840,446,200 3,818,481,440	1.400000 2020/03/20	0.89
日本	第335回利付国債(10年)	国債証券		3,600,000	104.00 103.9260	3,744,248,000 3,741,336,000	0.500000 2024/09/20	0.87
日本	第332回利付国債(10年)	国債証券		3,310,000	104.43 104.1610	3,456,787,000 3,447,729,100	0.600000 2023/12/20	0.81
日本	第338回利付国債(10年)	国債証券		3,330,000	103.38 103.4060	3,442,554,000 3,443,419,800	0.400000 2025/03/20	0.80
日本	第328回利付国債(10年)	国債証券		3,300,000	104.04 103.7220	3,433,470,000 3,422,826,000	0.600000 2023/03/20	0.80
日本	第343回利付国債(10年)	国債証券		3,360,000	100.71 100.9830	3,383,894,000 3,393,028,800	0.100000 2026/06/20	0.79
日本	第334回利付国債(10年)	国債証券		3,230,000	104.72 104.4370	3,382,747,000 3,373,315,100	0.600000 2024/06/20	0.79
日本	第340回利付国債(10年)	国債証券		3,250,000	103.38 103.4400	3,359,976,000 3,361,800,000	0.400000 2025/09/20	0.79
日本	第305回利付国債(10年)	国債証券		3,258,000	103.67 102.9620	3,377,574,000 3,354,501,960	1.300000 2019/12/20	0.78
日本	第122回利付国債(5年)	国債証券		3,270,000	100.67 100.5020	3,291,909,000 3,286,415,400	0.100000 2019/12/20	0.77
日本	第309回利付国債(10年)	国債証券		3,100,000	103.70 103.1500	3,214,889,000 3,197,650,000	1.100000 2020/06/20	0.75
日本	第130回利付国債(5年)	国債証券		3,150,000	101.13 100.9340	3,185,595,000 3,179,421,000	0.100000 2021/12/20	0.74
日本	第131回利付国債(5年)	国債証券		3,110,000	100.98 100.9700	3,140,765,500 3,140,167,000	0.100000 2022/03/20	0.73
日本	第313回利付国債(10年)	国債証券		2,969,000	105.56 104.7250	3,134,224,850 3,109,285,250	1.300000 2021/03/20	0.73

日本	第347回利付国債(10年)	国債証券	3,080,000	100.79 100.7610	3,104,366,000 3,103,438,800	0.100000 2027/06/20	0.73
日本	第126回利付国債(5年)	国債証券	2,960,000	100.90 100.7180	2,986,758,400 2,981,252,800	0.100000 2020/12/20	0.70
日本	第324回利付国債(10年)	国債証券	2,800,000	104.67 104.1780	2,931,021,500 2,916,984,000	0.800000 2022/06/20	0.68
日本	第127回利付国債(5年)	国債証券	2,870,000	100.94 100.7760	2,896,978,000 2,892,271,200	0.100000 2021/03/20	0.68
日本	第341回利付国債(10年)	国債証券	2,770,000	102.62 102.6600	2,842,657,100 2,843,682,000	0.300000 2025/12/20	0.66
日本	第299回利付国債(10年)	国債証券	2,760,000	102.73 101.8740	2,835,541,200 2,811,722,400	1.300000 2019/03/20	0.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	82.28
地方債証券	5.37
特殊債券	6.76
社債券	4.62
合計	99.02

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

#### (b) 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### (c) その他投資資産の主要なもの

平成29年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
債券先物取引						
長期国債先物17年12月限	大阪取引所	買建	11	1,659,731,880	1,660,230,000	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

#### < 参考 >

#### 「TOPIXマザーファンド」

#### 投資状況

平成29年11月30日現在

(単位: 円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	326,629,824,680	99.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,280,211,651	0.99
純資産総額		329,910,036,331	100.00

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

#### その他の資産の投資状況

平成29年11月30日現在

(単位: 円)

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	3,522,120,000	1.07

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

#### 投資資産

#### (a) 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成29年11月30日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段: 帳簿価額 下段: 評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1,552,200	6,229.53 7,044.00	9,669,487,123 10,933,696,800		3.31
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	8,897,100	709.55 792.10	6,313,000,575 7,047,392,910		2.14
日本	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	567,200	8,287.06 9,485.00	4,700,424,057 5,379,892,000		1.63

日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	899,100	5,042.57 5,879.00	4,533,777,686 5,285,808,900	1.60
日本	ソニー	株式	電気機器	852,200	3,820.20 5,201.00	3,255,582,065 4,432,292,200	1.34
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	953,200	4,186.42 4,547.00	3,990,504,842 4,334,200,400	1.31
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	1,148,900	3,329.64 3,744.00	3,825,429,448 4,301,481,600	1.30
日本	キーエンス	株式	電気機器	62,700	48,733.39 64,910.00	3,055,583,851 4,069,857,000	1.23
日本	KDDI	株式	情報・通信業	1,128,200	2,973.93 3,215.00	3,355,187,854 3,627,163,000	1.10
日本	任天堂	株式	その他製品	78,600	30,626.42 45,200.00	2,407,236,925 3,552,720,000	1.08
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	17,110,000	204.45 203.90	3,498,243,446 3,488,729,000	1.06
日本	ファナック	株式	電気機器	121,300	22,805.00 27,945.00	2,766,247,161 3,389,728,500	1.03
日本	キヤノン	株式	電気機器	687,300	3,602.41 4,298.00	2,475,943,219 2,954,015,400	0.90
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	792,800	3,759.21 3,720.00	2,980,303,214 2,949,216,000	0.89
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	470,300	5,445.71 6,184.00	2,561,120,751 2,908,335,200	0.88
日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	927,500	2,661.28 2,907.50	2,468,341,009 2,696,706,250	0.82
日本	信越化学工業	株式	化学	222,700	9,795.46 11,765.00	2,181,449,534 2,620,065,500	0.79
日本	日立製作所	株式	電気機器	3,066,000	653.43 834.20	2,003,445,122 2,557,657,200	0.78
日本	リクルートホールディングス	株式	サービス業	941,200	2,051.32 2,647.00	1,930,705,134 2,491,356,400	0.76
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	229,300	10,011.48 10,865.00	2,295,633,193 2,491,344,500	0.76
日本	三菱商事	株式	卸売業	882,400	2,442.50 2,813.00	2,155,266,565 2,482,191,200	0.75
日本	パナソニック	株式	電気機器	1,458,600	1,312.94 1,668.00	1,915,058,481 2,432,944,800	0.74
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	527,100	4,420.15 4,605.00	2,329,861,155 2,427,295,500	0.74
日本	東海旅客鉄道	株式	陸運業	114,300	18,835.33 20,775.00	2,152,878,844 2,374,582,500	0.72
日本	三菱電機	株式	電気機器	1,276,800	1,639.20 1,852.50	2,092,934,163 2,365,272,000	0.72
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	474,400	4,724.06 4,960.00	2,241,097,059 2,353,024,000	0.71
日本	日本電産	株式	電気機器	153,600	11,011.92 15,270.00	1,691,432,236 2,345,472,000	0.71
日本	花王	株式	化学	314,000	6,338.33 7,438.00	1,990,235,742 2,335,532,000	0.71
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	451,200	4,633.18 5,095.00	2,090,495,231 2,298,864,000	0.70
日本	ダイキン工業	株式	機械	174,300	11,231.67 12,920.00	1,957,681,512 2,251,956,000	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
水産・農林業	0.10
鉱業	0.31
建設業	3.28
食料品	4.44
繊維製品	0.68
パルプ・紙	0.26
化学	7.21
医薬品	4.33
石油・石炭製品	0.63
ゴム製品	0.95
ガラス・土石製品	1.01
鉄鋼	1.15
非鉄金属	0.97
金属製品	0.70
機械	5.42
電気機器	13.81
輸送用機器	8.67
精密機器	1.59

その他製品	2.13
電気・ガス業	1.57
陸運業	3.92
海運業	0.23
空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.71
卸売業	4.43
小売業	4.63
銀行業	7.22
証券、商品先物取引業	0.98
保険業	2.24
その他金融業	1.21
不動産業	2.26
サービス業	4.17
合計	99.01

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

(b) 投資不動産物件

該当事項はありません。

(c) その他投資資産の主要なもの

平成29年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引						
TOPIX 17年12月限	大阪取引所	買建	196	3,473,670,840	3,522,120,000	1.07

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

< 参考 >

「外国債券インデックスマザーファンド」

投資状況

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	52,784,251,707	42.65
	フランス	12,633,440,308	10.21
	イタリア	12,171,586,606	9.83
	ドイツ	8,861,614,802	7.16
	イギリス	8,504,126,084	6.87
	スペイン	7,165,665,244	5.79
	ベルギー	3,150,727,593	2.55
	オランダ	2,711,087,079	2.19
	オーストラリア	2,587,311,938	2.09
	カナダ	2,580,139,277	2.08
	オーストリア	1,958,478,069	1.58
	メキシコ	1,045,704,472	0.84
	アイルランド	977,896,210	0.79
	デンマーク	805,714,238	0.65
	ポーランド	760,143,214	0.61
	フィンランド	756,721,975	0.61
	南アフリカ	634,471,664	0.51
	スウェーデン	571,199,025	0.46
	マレーシア	518,768,439	0.42
	シンガポール	458,929,855	0.37
ノルウェー	352,970,106	0.29	
スイス	208,487,622	0.17	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,573,053,556	1.28
純資産総額		123,772,489,083	100.00

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

## 投資資産

## (a) 投資有価証券の主要銘柄

## a 評価額上位30銘柄

平成29年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	2 T-NOTE 261115	国債証券		6,650,000.00	10,909.27 10,873.2269	725,466,604 723,069,591	2.000000 2026/11/15	0.58
アメリカ	2.125 T-NOTE 211231	国債証券		6,050,000.00	11,390.86 11,256.6480	689,147,277 681,027,205	2.125000 2021/12/31	0.55
アメリカ	0.75 T-NOTE 181031	国債証券		5,800,000.00	11,136.83 11,115.7101	645,936,297 644,711,189	0.750000 2018/10/31	0.52
アメリカ	2.25 T-NOTE 270215	国債証券		5,750,000.00	11,077.73 11,085.0714	636,969,962 637,391,609	2.250000 2027/02/15	0.51
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		5,250,000.00	11,067.67 11,078.9437	581,052,754 581,644,546	2.125000 2025/05/15	0.47
アメリカ	3 T-BOND 441115	国債証券		4,550,000.00	11,471.77 11,619.9351	521,965,934 528,707,048	3.000000 2044/11/15	0.43
アメリカ	1.5 T-NOTE 260815	国債証券		5,050,000.00	10,381.43 10,452.1640	524,262,341 527,834,284	1.500000 2026/08/15	0.43
アメリカ	2.25 T-NOTE 241115	国債証券		4,650,000.00	11,196.83 11,195.3707	520,652,607 520,584,736	2.250000 2024/11/15	0.42
アメリカ	2.75 T-NOTE 240215	国債証券		4,500,000.00	11,691.70 11,547.2777	526,126,741 519,627,497	2.750000 2024/02/15	0.42
アメリカ	2.5 T-NOTE 240515	国債証券		4,350,000.00	11,416.77 11,378.3273	496,629,690 494,957,239	2.500000 2024/05/15	0.40
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		2,950,000.00	16,740.70 16,675.6501	493,850,664 491,931,679	4.250000 2023/10/25	0.40
アメリカ	3 T-BOND 470215	国債証券		4,100,000.00	11,120.96 11,607.6796	455,959,462 475,914,867	3.000000 2047/02/15	0.38
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券		4,050,000.00	11,612.86 11,559.5332	470,320,911 468,161,094	2.750000 2023/11/15	0.38
イタリア	4.75 ITALY GOVT 210901	国債証券		3,000,000.00	15,546.79 15,531.7841	466,403,751 465,953,525	4.750000 2021/09/01	0.38
フランス	5.75 O.A.T 321025	国債証券		2,100,000.00	21,627.73 22,042.4757	454,182,442 462,891,989	5.750000 2032/10/25	0.37
フランス	3 O.A.T 220425	国債証券		3,000,000.00	15,309.15 15,211.5394	459,274,776 456,346,183	3.000000 2022/04/25	0.37
フランス	3.25 O.A.T 211025	国債証券		2,950,000.00	15,286.31 15,168.8277	450,946,274 447,480,418	3.250000 2021/10/25	0.36
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		2,650,000.00	16,556.25 16,791.0886	438,740,650 444,963,848	3.500000 2026/04/25	0.36
アメリカ	2.875 T-BOND 461115	国債証券		3,900,000.00	10,957.95 11,325.8039	427,360,098 441,706,351	2.875000 2046/11/15	0.36
アメリカ	1.125 T-NOTE 200430	国債証券		4,000,000.00	11,072.81 11,026.4203	442,912,640 441,056,812	1.125000 2020/04/30	0.36
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券		3,800,000.00	11,563.56 11,450.5470	439,415,280 435,120,787	2.625000 2020/11/15	0.35
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券		3,800,000.00	11,309.20 11,287.2867	429,749,847 428,916,895	2.375000 2024/08/15	0.35
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		1,970,000.00	20,550.06 21,504.4623	404,836,289 423,637,909	4.500000 2041/04/25	0.34
フランス	2.5 O.A.T 300525	国債証券		2,650,000.00	15,470.28 15,834.3784	409,962,596 419,611,030	2.500000 2030/05/25	0.34
イギリス	3.25 GILT 440122	国債証券		2,150,000.00	19,516.58 19,114.2941	419,606,477 410,957,323	3.250000 2044/01/22	0.33
イタリア	6.5 ITALY GOVT 271101	国債証券		2,150,000.00	18,432.69 19,017.5818	396,303,047 408,878,009	6.500000 2027/11/01	0.33
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		3,600,000.00	10,973.05 10,996.6570	395,030,034 395,879,653	2.000000 2025/02/15	0.32
スペイン	6 SPAIN GOVT 290131	国債証券		2,050,000.00	19,107.37 19,191.1512	391,701,181 393,418,600	6.000000 2029/01/31	0.32
フランス	2.75 O.A.T 271025	国債証券		2,450,000.00	15,723.88 16,045.9448	385,235,100 393,125,648	2.750000 2027/10/25	0.32
アメリカ	1.625 T-NOTE 260215	国債証券		3,700,000.00	10,543.90 10,609.7343	390,124,485 392,560,171	1.625000 2026/02/15	0.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.73
合計	98.73

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

## (b) 投資不動産物件



該当事項はありません。

(c) その他投資資産の主要なもの  
該当事項はありません。

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」  
投資状況

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	245,445,626,919	61.35
	イギリス	27,230,854,269	6.81
	ドイツ	15,251,875,065	3.81
	フランス	15,128,851,394	3.78
	カナダ	14,739,739,089	3.68
	スイス	12,701,179,778	3.17
	オーストラリア	9,797,180,402	2.45
	オランダ	6,546,456,594	1.64
	スペイン	5,292,292,660	1.32
	香港	4,924,103,664	1.23
	スウェーデン	4,332,931,316	1.08
	イタリア	3,151,180,086	0.79
	デンマーク	2,841,638,356	0.71
	シンガポール	1,959,794,653	0.49
	ベルギー	1,797,270,181	0.45
	フィンランド	1,489,605,971	0.37
	ノルウェー	1,050,383,845	0.26
	アイルランド	675,868,383	0.17
	ルクセンブルグ	447,800,932	0.11
	オーストリア	410,376,894	0.10
	イスラエル	408,955,313	0.10
	ポルトガル	251,478,798	0.06
	ニュージーランド	232,100,008	0.06
投資証券	アメリカ	7,429,640,056	1.86
	オーストラリア	886,275,713	0.22
	フランス	532,108,283	0.13
	イギリス	347,338,598	0.09
	香港	214,523,531	0.05
	シンガポール	168,714,644	0.04
	カナダ	66,435,525	0.02
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		14,307,118,422	3.60
純資産総額		400,059,699,342	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	13,722,966,006	3.43

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

投資資産

(a) 投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成29年11月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額		利率(%)	投資比率(%)
					下段：評価額	償還期限(年/月/日)		
					単価(円)	金額(円)		

アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	497,563	17,284.83 18,990.23	8,600,293,361 9,448,837,799	2.36
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	699,743	7,787.47 9,338.24	5,449,231,118 6,534,372,970	1.63
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	38,768	107,035.76 130,120.30	4,149,562,440 5,044,503,926	1.26
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・サービス	225,552	17,190.71 19,623.31	3,877,399,247 4,426,078,283	1.11
アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	257,033	14,014.09 15,665.71	3,602,084,494 4,026,604,566	1.01
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	338,888	9,894.01 11,622.94	3,352,962,955 3,938,877,093	0.98
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	404,288	9,198.18 9,218.35	3,718,715,615 3,726,869,699	0.93
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	29,802	104,646.85 114,477.00	3,118,685,617 3,411,643,643	0.85
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	28,380	107,281.15 116,238.42	3,044,639,093 3,298,846,615	0.82
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	949,430	2,709.36 3,168.77	2,572,356,209 3,008,529,098	0.75
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	452,903	6,015.96 6,350.99	2,724,648,369 2,876,384,235	0.72
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	296,905	9,213.40 9,669.85	2,735,504,586 2,871,029,337	0.72
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	118,947	18,641.75 21,272.69	2,217,381,248 2,530,322,954	0.63
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	243,778	9,757.31 10,015.02	2,378,618,492 2,441,443,739	0.61
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	586,477	4,281.43 4,087.58	2,510,960,515 2,397,274,001	0.60
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	180,667	12,022.96 13,130.01	2,172,153,017 2,372,161,142	0.59
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	569,245	3,736.86 4,057.33	2,127,193,140 2,309,615,100	0.58
アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	91,906	19,891.11 24,973.70	1,828,112,907 2,295,233,239	0.57
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	114,031	17,550.39 19,860.86	2,001,288,693 2,264,754,011	0.57
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	449,110	4,023.71 4,924.59	1,807,090,868 2,211,685,983	0.55
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	262,606	6,986.31 8,408.23	1,834,648,893 2,208,052,172	0.55
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	389,250	5,180.07 5,591.29	2,016,342,831 2,176,411,578	0.54
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	175,945	10,529.33 12,309.81	1,852,584,462 2,165,850,048	0.54
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,912,108	1,035.77 1,117.25	1,980,511,177 2,136,307,557	0.53
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	212,307	9,034.68 9,527.57	1,918,127,314 2,022,770,016	0.51
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	477,107	3,741.34 4,199.63	1,785,024,035 2,003,674,778	0.50
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	387,051	4,931.32 5,098.27	1,908,672,530 1,973,292,437	0.49
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,073	29,925.90 28,207.07	2,007,220,360 1,891,933,074	0.47
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	451,501	4,390.11 4,167.13	1,982,143,118 1,881,467,651	0.47
アメリカ	DOWDUPONT INC	株式	素材	222,518	7,033.37 8,042.94	1,565,053,317 1,789,700,925	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年11月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	6.41
	素材	4.77
	資本財	7.20
	商業・専門サービス	0.94
	運輸	1.96
	自動車・自動車部品	1.53
	耐久消費財・アパレル	1.71
	消費者サービス	1.81

メディア	2.20
小売	3.83
食品・生活必需品小売り	1.67
食品・飲料・タバコ	5.19
家庭用品・パーソナル用品	2.00
ヘルスケア機器・サービス	4.08
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.93
銀行	9.42
各種金融	4.42
保険	4.09
不動産	0.62
ソフトウェア・サービス	9.84
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.97
電気通信サービス	2.42
公益事業	3.17
半導体・半導体製造装置	2.84
小計	94.01
投資証券	2.41
合計	96.42

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

(b) 投資不動産物件

該当事項はありません。

(c) その他投資資産の主要なもの

平成29年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
SP EMINI (2017年12月限)	シカゴ商業取引所	買建	610	アメリカドル	78,913,268.60	80,062,500.00	8,971,003,125	2.24
FTSE100 (2017年12月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	88	イギリスポンド	6,535,705.00	6,505,840.00	978,022,927	0.24
SP/TSE60 (2017年12月限)	モントリオール取引所	買建	31	カナダドル	5,884,116.25	5,874,500.00	511,668,950	0.13
SPI 200 (2017年12月限)	シドニー先物取引所	買建	54	オーストラリアドル	8,064,491.00	8,125,650.00	689,623,915	0.17
EURO ST (2017年12月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	451	ユーロ	16,308,380.25	16,177,370.00	2,148,516,509	0.54
SWISS IX (2017年12月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	40	スイスフラン	3,711,900.00	3,726,000.00	424,130,580	0.11

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

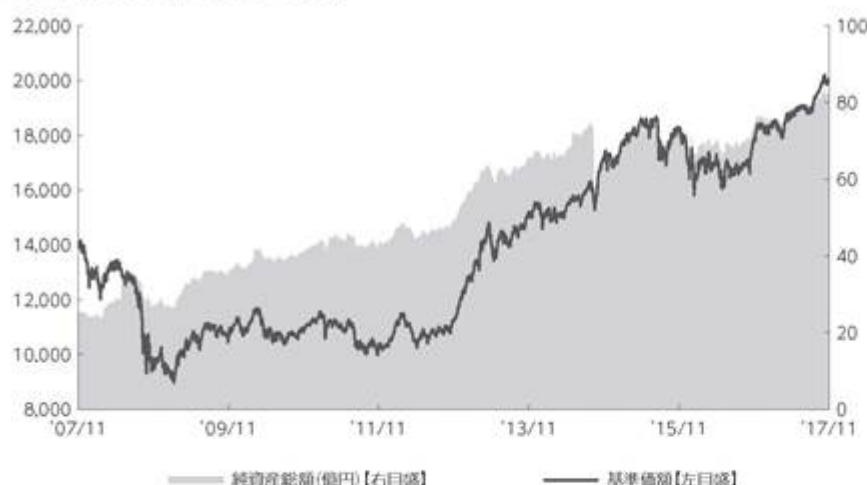
## [ 参考情報 ]



## 運用実績

2017年11月30日現在

## ■基準価額・純資産の推移 2007年11月30日～2017年11月30日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

## ■基準価額・純資産

基準価額	20,068円
純資産総額	82.8億円

## ■分配の推移

2017年 5月	0円
2016年 5月	0円
2015年 5月	0円
2014年 5月	0円
2013年 5月	0円
2012年 5月	0円
設定来累計	60円

●分配金は1万円当たり、税引前

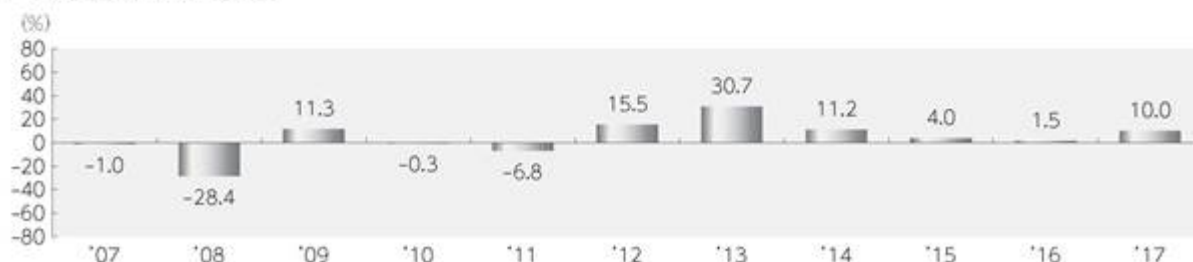
## ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	34.8%	円	69.9%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	1.2%
国内債券	31.5%	アメリカドル	17.4%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.8%
外国株式	19.4%	ユーロ	6.8%	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	日本	0.6%
外国債券	9.8%	イギリスポンド	2.1%	日本電信電話	株式	情報・通信業	日本	0.6%
		カナダドル	1.0%	APPLE INC	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.5%
		オーストラリアドル	0.8%	第312回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.4%
		スイスフラン	0.7%	第348回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.4%
コールローン他 (負債控除後)	4.5%	スウェーデンクローネ	0.3%	第329回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
合計	100.0%	その他	1.0%	第333回利付国債(10年)	債券	国債	日本	0.3%
		合計	100.0%	第133回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.1%
債券先物取引 (買建)	0.1%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 投資信託証券(リートを含む)の組入れがある場合、株式に含めて表示
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

## ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は年初から11月30日までの収益率を表示

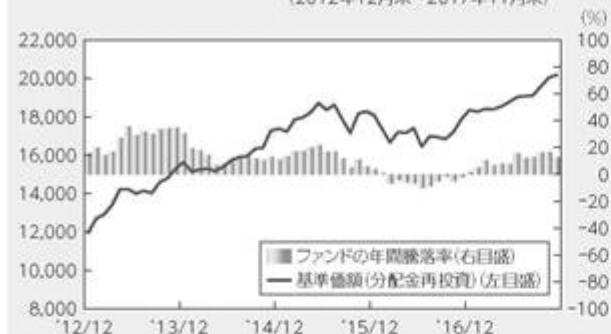
上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

## 【投資リスク】

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移  
(2012年12月末～2017年11月末)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
(2012年12月末～2017年11月末)



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したのものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI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、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、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(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第7計算期間	638,764,330	109,783,445	2,098,024,678
第8計算期間	1,268,473,180	228,660,790	3,137,837,068
第9計算期間	633,936,909	164,317,669	3,607,456,308
第10計算期間	598,636,768	166,579,386	4,039,513,690
第11計算期間	496,629,506	268,214,770	4,267,928,426
第12計算期間	479,436,473	427,385,954	4,319,978,945
第13計算期間	566,914,647	516,144,882	4,370,748,710
第14計算期間	862,967,407	1,303,977,581	3,929,738,536
第15計算期間	480,651,250	343,168,605	4,067,221,181
第16計算期間	476,190,654	451,218,247	4,092,193,588
第17計算期期首から 平成29年11月30日までの期間	259,131,055	220,715,330	4,130,609,313

### 3【ファンドの経理状況】

#### 【中間財務諸表】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年5月13日から平成29年11月12日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）】  
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 [平成29年 5月12日現在]	第17期中間計算期間末 [平成29年11月12日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	1,960,111
コール・ローン	249,983,210	264,548,031
親投資信託受益証券	7,447,598,083	7,996,334,332
未収入金	11,412,000	9,899,000
流動資産合計	7,708,993,293	8,272,741,474
資産合計	7,708,993,293	8,272,741,474
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	16,808,128	11,544,511
未払受託者報酬	2,007,599	2,138,446
未払委託者報酬	12,045,544	12,830,635
未払利息	357	1,279
その他未払費用	144,490	153,911
流動負債合計	31,006,118	26,668,782
負債合計	31,006,118	26,668,782
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,092,193,588	4,101,772,016
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,585,793,587	4,144,300,676
（分配準備積立金）	1,975,043,349	1,879,905,816
元本等合計	7,677,987,175	8,246,072,692
純資産合計	7,677,987,175	8,246,072,692
負債純資産合計	7,708,993,293	8,272,741,474



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期中間計算期間 自 平成28年 5月13日 至 平成28年11月12日	第17期中間計算期間 自 平成29年 5月13日 至 平成29年11月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	932	1,165
有価証券売買等損益	85,837,387	565,956,249
営業収益合計	85,838,319	565,957,414
<b>営業費用</b>		
支払利息	52,046	70,574
受託者報酬	1,871,085	2,138,446
委託者報酬	11,226,472	12,830,635
その他費用	134,655	153,911
営業費用合計	13,284,258	15,193,566
営業利益又は営業損失( )	72,554,061	550,763,848
経常利益又は経常損失( )	72,554,061	550,763,848
中間純利益又は中間純損失( )	72,554,061	550,763,848
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	3,238,592	9,342,049
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,828,303,789	3,585,793,587
剰余金増加額又は欠損金減少額	147,783,791	194,848,173
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	147,783,791	194,848,173
剰余金減少額又は欠損金増加額	116,681,798	177,762,883
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	116,681,798	177,762,883
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,935,198,435	4,144,300,676

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
-------------------	---

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第 16 期 [ 平成29年5月12日現在 ]	第 17 期中間計算期間末 [ 平成29年11月12日現在 ]
1 期首元本額	4,067,221,181円	4,092,193,588円
期中追加設定元本額	476,190,654円	212,407,351円
期中一部解約元本額	451,218,247円	202,828,923円
2 受益権の総数	4,092,193,588口	4,101,772,016口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8763円 (18,763円)	2.0104円 (20,104円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 16 期 [ 平成29年5月12日現在 ]	第 17 期中間計算期間末 [ 平成29年11月12日現在 ]
1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## &lt;参考&gt;

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

	[ 平成29年5月12日現在 ]	[ 平成29年11月10日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,914,804,368	9,957,124,426
国債証券	375,490,639,450	349,971,718,920
地方債証券	25,386,389,693	22,205,410,232
特殊債券	32,153,699,816	27,580,819,772
社債券	20,958,312,800	19,271,418,080
派生商品評価勘定		446,760
未収入金	120,332,000	
未収利息	975,110,866	894,251,502
前払金	700,000	
前払費用	118,159,618	50,723,925
差入委託証拠金	4,410,000	4,800,000
流動資産合計	460,122,558,611	429,936,713,617
資産合計	460,122,558,611	429,936,713,617
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	126,480	938,640
前受金		620,000
未払金	2,492,372,402	25,190,380,500
未払解約金	512,331,831	355,303,482
未払利息	7,034	16,067
流動負債合計	3,004,837,747	25,547,258,689
負債合計	3,004,837,747	25,547,258,689
純資産の部		
元本等		
元本	346,837,954,485	305,674,192,524
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	110,279,766,379	98,715,262,404
元本等合計	457,117,720,864	404,389,454,928
純資産合計	457,117,720,864	404,389,454,928
負債純資産合計	460,122,558,611	429,936,713,617

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(注2) 平成29年11月12日が休業日のため、前営業日の平成29年11月10日現在における親投資信託の状況です。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 期首	平成28年5月13日	平成29年5月13日
期首元本額	392,963,515,092円	346,837,954,485円
期首からの追加設定元本額	245,553,693,560円	104,456,950,781円
期首からの一部解約元本額	291,679,254,167円	145,620,712,742円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内債券)	54,615,483,471円	40,731,089,103円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,911,704,114円	11,963,345,534円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,872,202,478円	2,089,203,814円
eMAXIS バランス(波乗り型)	478,157,438円	71,974,681円
コアバランス	2,044,029円	2,576,680円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	6,231,670円	78,547,549円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	2,420,327円	42,028,528円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	4,262,915円	18,588,159円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス	113,708,426円	586,419,276円
国内債券セレクション(ラップ向け)	4,501,380円	2,711,111,869円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	31,301,599円	455,307,165円
つみたて8資産均等バランス		1,374,667円
つみたて4資産均等バランス		1,997,371円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		1,853,398円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		390,066円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		52,409円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	17,309,618,544円	7,232,131,547円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,497,356,560円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	82,107,820円	13,600,303円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKU SHIN)	598,261,047円	511,985,174円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	7,881,350,735円	6,251,699,867円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	442,095,198円	396,677,721円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	504,579,550円	408,378,998円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	59,802,401円	60,261,840円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	59,441,649円	109,599,110円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	46,440,556円	110,549,921円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	42,802,857円	102,957,490円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィル ダー)	88,464,709円	198,625,529円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	18,110,184円	34,402,168円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	1,659,004円	5,358,271円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資 家限定)	2,299,233,788円	131,628,928円

三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,282,635,043円	14,375,566,611円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	1,873,954,110円	1,707,378,786円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	6,219,044,942円	6,170,723,935円
MUAM 日本債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)	159,938,336,353円	154,391,578,204円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	5,661,045,142円	2,106,689,812円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,003,390,686円	474,762,844円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,362,090,967円	141,298,672円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	582,256,980円	559,766,434円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	158,108,340円	155,017,770円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,547,131,810円	5,515,086,418円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	4,031,768,610円	3,982,765,052円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,361,732円	
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	8,761,774,765円	6,235,131,754円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,647,703,661円	2,399,425,261円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	658,523,690円	562,131,359円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	57,044,851円	67,329,217円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	12,188,316,244円	19,142,297,053円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	26,310,784円	27,337,322円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	60,808,964円	50,208,579円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	54,028,124円	46,084,930円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	38,284,243円	31,937,267円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	19,292,503円	
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	225,020,167円	204,623,347円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	482,066,864円	417,180,856円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	198,546,601円	134,235,140円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	414,897,943円	342,832,493円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,316,415,148円	3,419,047,099円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)	1,748,884,567円	1,864,287,036円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)	3,421,157,759円	3,671,398,971円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	1,827,142,808円	1,987,892,503円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)	1,055,267,635円	1,166,460,663円
(合計)	346,837,954,485円	305,674,192,524円
2 受益権の総数	346,837,954,485口	305,674,192,524口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3180円 (13,180円)	1.3229円 (13,229円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	同 左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。	同 左
	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
債券関連

区 分	種 類	[ 平成29年5月12日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	904,080,000		903,960,000	120,000
	合 計	904,080,000		903,960,000	120,000

区 分	種 類	[ 平成29年11月10日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,659,720,000		1,659,240,000	480,000
	合 計	1,659,720,000		1,659,240,000	480,000

（注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

「TOPIXマザーファンド」の状況  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

	[ 平成29年5月12日現在 ]	[ 平成29年11月10日現在 ]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,179,829,879	42,825,405,387
株式	261,455,285,242	322,172,929,940
派生商品評価勘定	116,512,100	41,903,120
未収入金	1,531,882,119	2,042,543,192
未収配当金	2,750,721,949	2,206,496,103
その他未収収益	141,442,071	212,955,741
差入委託証拠金	162,060,000	109,275,000
流動資産合計	306,337,733,360	369,611,508,483
資産合計	306,337,733,360	369,611,508,483
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,231,280	2,215,660
前受金	146,225,000	94,887,600
未払解約金	2,398,834,031	1,263,534,089
未払利息	57,506	69,107
受入担保金	37,612,061,571	40,756,863,105
流動負債合計	40,162,409,388	42,117,569,561
負債合計	40,162,409,388	42,117,569,561
純資産の部		
元本等		
元本	162,155,720,098	173,512,464,669
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	104,019,603,874	153,981,474,253
元本等合計	266,175,323,972	327,493,938,922
純資産合計	266,175,323,972	327,493,938,922

負債純資産合計	306,337,733,360	369,611,508,483
---------	-----------------	-----------------

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月26日から翌年3月25日までであります。

(注2) 平成29年11月12日が休業日のため、前営業日の平成29年11月10日現在における親投資信託の状況です。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 新株予約権証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 期首	平成28年5月13日	平成29年5月13日
期首元本額	172,879,052,524円	162,155,720,098円
期首からの追加設定元本額	168,501,320,021円	83,958,305,248円
期首からの一部解約元本額	179,224,652,447円	72,601,560,677円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内株式)	8,987,609,338円	19,967,969,114円
eMAXIS TOPIXインデックス	14,914,692,515円	12,068,390,162円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,689,805,505円	1,656,304,973円
eMAXIS バランス(波乗り型)	98,288,536円	542,346,464円
コアバランス	612,246円	673,301円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	1,803,006円	17,241,494円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	1,750,448円	24,560,212円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	4,904,254円	18,753,437円
eMAXIS Slim 国内株式インデックス	109,344,598円	399,742,340円
国内株式セレクション(ラップ向け)	3,197,560円	831,143,655円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	27,253,424円	345,140,355円
つみたて日本株式(TOPIX)		1,295,564円
つみたて8資産均等バランス		1,038,571円
つみたて4資産均等バランス		1,471,858円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		1,115,264円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		1,312,885円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		2,022,814円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	4,815,037,401円	3,411,162,166円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	9,329,167,096円	6,096,901,195円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	137,717,312円	466,610,904円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKU SHIN)	166,414,745円	242,792,830円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,144,209,884円	943,430,193円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	63,253,965円	40,168,143円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	370,560,983円	234,309,169円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	49,674,963円	79,567,371円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	7,754,797円	16,008,656円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	13,341,250円	27,985,345円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィル ダー)	53,185,734円	103,562,186円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	56,028,222円	91,743,168円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	71,797,051円	201,113,510円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資 家限定)	1,279,696,190円	62,748,372円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資 家限定)	12,100,674,469円	10,427,422,611円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投 資家限定)	388,477,853円	297,417,253円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投 資家限定)	3,399,219,258円	2,952,507,510円
MUAM 日本株式インデックスファンド(適格機関投 資家限定)	26,891,185,016円	37,625,939,293円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投 資家限定)	4,719,275,312円	1,479,034,146円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投 資家限定)	1,621,955,959円	333,302,056円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資 家限定)	379,029,349円	33,676,321円

三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	271,225,968円	228,946,222円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	133,464,212円	112,513,727円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	504,345,123円	445,728,054円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,116,375,960円	968,761,225円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,986,285円	
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	5,379,338円	4,894,716円
MUAMトピックスリスクコントロール(10%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	305,704,661円	390,809,864円
MUAM インデックスファンドTOPIXi(適格機関投資家限定)	8,726,654円	8,726,654円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2,437,164,375円	2,974,454,267円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	458,324,941円	1,144,546,676円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	108,664,662円	79,904,155円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	18,081,005円	18,278,955円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,399,526,999円	5,189,584,584円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	6,499,486,949円	5,585,263,172円
三菱UFJ TOPIX・ライト	286,835,700円	243,464,510円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,569,437円	6,748,503円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	35,313,662円	25,711,284円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	47,365,335円	35,492,473円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	46,526,162円	34,554,718円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	2,324,452,290円	2,074,738,589円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	573,736,506円	441,407,296円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	72,317,825円	59,343,104円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	529,468,800円	401,476,470円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	59,837,483円	35,074,131円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	416,948,878円	300,821,988円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,976,424,923円	1,844,732,400円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)	512,144,720円	458,678,812円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)	2,018,943,569円	1,854,652,493円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	1,651,072,539円	1,539,686,755円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)	1,292,832,409円	1,247,679,330円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	44,138,554,489円	44,707,864,681円
(合計)	162,155,720,098円	173,512,464,669円
2 貸付有価証券 株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	35,669,719,380円	38,457,832,150円
3 受益権の総数	162,155,720,098口	173,512,464,669口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6415円 (16,415円)	1.8874円 (18,874円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
----	----------------	-----------------

1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
株式関連

区 分	種 類	[ 平成29年5月12日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,109,845,000		4,221,270,000	111,425,000
	合 計	4,109,845,000		4,221,270,000	111,425,000

区 分	種 類	[ 平成29年11月10日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,276,492,400		4,316,310,000	39,817,600
	合 計	4,276,492,400		4,316,310,000	39,817,600

（注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

	[ 平成29年5月12日現在 ]	[ 平成29年11月10日現在 ]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金		283,136,721
コール・ローン	2,780,221,664	155,439,330
国債証券	130,789,630,361	123,096,339,568
派生商品評価勘定	77,407	331,291
未収入金	373,231,304	333,800,231
未收利息	1,028,010,670	947,057,770
前払費用	87,707,844	57,431,603
流動資産合計	135,058,879,250	124,873,536,514
資産合計	135,058,879,250	124,873,536,514
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,060,440	80
未払金	518,343,180	
未払解約金	2,108,413,364	225,114,746
未払利息	3,979	250
流動負債合計	2,628,820,963	225,115,076
負債合計	2,628,820,963	225,115,076
純資産の部		
元本等		
元本	66,568,708,547	59,959,864,430
剰余金		



剰余金又は欠損金( )	65,861,349,740	64,688,557,008
元本等合計	132,430,058,287	124,648,421,438
純資産合計	132,430,058,287	124,648,421,438
負債純資産合計	135,058,879,250	124,873,536,514

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(注2) 平成29年11月12日が休業日のため、前営業日の平成29年11月10日現在における親投資信託の状況です。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 期首	平成28年5月13日	平成29年5月13日
期首元本額	79,369,567,734円	66,568,708,547円
期首からの追加設定元本額	13,460,264,160円	6,841,650,346円
期首からの一部解約元本額	26,261,123,347円	13,450,494,463円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外債券)	821,265,780円	938,587,754円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,507,288,833円	9,653,502,743円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,382,417,182円	1,444,883,621円
eMAXIS バランス(波乗り型)	235,783,018円	228,059,456円
コアバランス	1,384,859円	1,149,326円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	340,241円	3,888,003円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	201,099円	3,168,177円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	470,926円	1,957,307円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	72,793,229円	357,440,385円
海外債券セレクション(ラップ向け)	3,753,251円	833,438,493円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	22,528,484円	313,920,166円
つみたて8資産均等バランス		947,799円
つみたて4資産均等バランス		1,319,802円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		446,301円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		133,696円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		33,267円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	7,007,945,425円	7,403,623,324円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	41,113,041円	72,416,289円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	18,601,350円	42,363,547円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	14,975,628円	34,469,247円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィル ダー)	21,995,342円	47,247,805円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	6,029,049円	10,912,935円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	1,099,638円	3,398,887円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資 家限定)	1,302,553,961円	70,131,166円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資 家限定)	3,286,110,907円	3,092,710,068円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投 資家限定)	2,107,382,988円	1,979,560,640円
MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投 資家限定)	19,104,565,071円	21,010,399,332円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投 資家限定)	7,767,247,723円	2,699,695,687円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投 資家限定)	2,012,259,532円	456,320,350円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資 家限定)	462,962,970円	45,170,894円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投 資家限定)	223,771,422円	203,254,660円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投 資家限定)	72,586,651円	66,848,054円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資 家限定)	2,746,567,790円	2,558,904,722円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,048,392円	

アドバンスト・バランス ( F O F s 用 ) ( 適格機関投資家限定 )	160,215,991円	119,122,341円
アドバンスト・バランス ( F O F s 用 ) ( 適格機関投資家限定 )	204,350,336円	134,140,063円
世界8資産バランスファンドV L ( 適格機関投資家限定 )	4,601,010円	5,107,508円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型) V A	3,103,338円	3,001,247円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型) V A	9,684,414円	7,566,236円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型) V A	11,193,604円	9,120,071円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型) V A	4,769,489円	3,773,454円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドV A	87,143,429円	75,272,018円
三菱UFJ バランスV A 3 0 D ( 適格機関投資家限定 )	59,945,011円	51,988,031円
三菱UFJ バランスV A 6 0 D ( 適格機関投資家限定 )	108,282,119円	88,337,827円
三菱UFJ バランスV A 3 0 G ( 適格機関投資家限定 )	98,999,047円	64,023,677円
三菱UFJ バランスV A 6 0 G ( 適格機関投資家限定 )	171,593,156円	133,731,439円
外国債券インデックスファンドi ( 適格機関投資家限定 )	2,114,453,069円	2,381,254,055円
三菱UFJ < D C > 外国債券インデックスファンド	2,002,966,302円	2,010,182,461円
三菱UFJ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)	208,380,073円	207,089,413円
三菱UFJ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)	550,346,235円	555,654,759円
三菱UFJ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	386,384,049円	393,041,927円
三菱UFJ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)	132,254,093円	137,154,000円
( 合 計 )	66,568,708,547円	59,959,864,430円
2 受益権の総数	66,568,708,547口	59,959,864,430口
3 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.9894円 ( 19,894円 )	2.0789円 ( 20,789円 )

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	[ 平成29年5月12日現在 ]	[ 平成29年11月10日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	[ 平成29年5月12日現在 ]		
		契 約 額 等 ( 円 )	時 価 ( 円 )	評 価 損 益 ( 円 )
		うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル	127,593,760	127,590,400	3,360
	カナダドル	5,818,400	5,818,400	
	オーストラリアドル	5,884,830	5,884,900	70
	イギリスポンド	22,014,300	22,014,000	300

	デンマーククローネ	1,996,800		1,996,800	
	メキシコペソ	2,721,195		2,718,000	3,195
	ユーロ	121,326,352		121,324,000	2,352
	買建				
	アメリカドル	284,465,070		283,660,800	804,270
	カナダドル	13,320,160		13,299,200	20,960
	オーストラリアドル	12,609,000		12,610,500	1,500
	イギリスポンド	47,296,960		46,963,200	333,760
	スウェーデンクローネ	3,200,000		3,207,500	7,500
	ノルウェークローネ	1,984,200		1,986,000	1,800
	デンマーククローネ	4,172,500		4,160,000	12,500
	メキシコペソ	6,001,000		6,040,000	39,000
	ポーランドズロチ	4,425,480		4,393,500	31,980
	南アフリカランド	3,385,600		3,404,000	18,400
	ユーロ	254,646,900		253,790,000	856,900
	合 計	922,862,507		920,861,200	1,983,033

区 分	種 類	[ 平成29年11月10日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	124,969,790		124,707,000	262,790
	カナダドル	6,263,690		6,261,500	2,190
	オーストラリアドル	6,976,830		6,965,600	11,230
	イギリスポンド	17,901,920		17,882,400	19,520
	スイスフラン	2,281,960		2,281,800	160
	シンガポールドル	1,673,920		1,669,400	4,520
	マレーシアリングgit	9,385,732		9,384,587	1,145
	ノルウェークローネ	1,396,900		1,394,000	2,900
	デンマーククローネ	1,775,000		1,775,000	
	メキシコペソ	2,979,675		2,975,000	4,675
	ポーランドズロチ	1,560,505		1,560,500	5
	ユーロ	117,591,076		117,569,000	22,076
	合 計	294,756,998		294,425,787	331,211

## (注) 時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

	[ 平成29年5月12日現在 ]	[ 平成29年11月10日現在 ]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,410,538,802	8,021,648,266
コール・ローン	3,089,760,164	527,213,234
株式	309,229,876,905	375,839,549,976
投資証券	7,989,655,718	9,767,325,008
派生商品評価勘定	43,191,184	51,337,838
未収入金	8,977,231,289	162,997
未収配当金	619,577,275	376,852,715
差入委託証拠金	3,278,306,933	2,431,381,667
流動資産合計	336,638,138,270	397,015,471,701
資産合計	336,638,138,270	397,015,471,701
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,809,034	22,631,291
未払金		52,864,310
未払解約金	3,648,576,787	480,798,578
未払利息	4,422	850

流動負債合計	3,652,390,243	556,295,029
負債合計	3,652,390,243	556,295,029
純資産の部		
元本等		
元本	137,017,202,778	150,939,543,131
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	195,968,545,249	245,519,633,541
元本等合計	332,985,748,027	396,459,176,672
純資産合計	332,985,748,027	396,459,176,672
負債純資産合計	336,638,138,270	397,015,471,701

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(注2) 平成29年11月12日が休業日のため、前営業日の平成29年11月10日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 期首	平成28年5月13日	平成29年5月13日
期首元本額	136,910,588,935円	137,017,202,778円
期首からの追加設定元本額	153,902,470,267円	47,729,217,568円
期首からの一部解約元本額	153,795,856,424円	33,806,877,215円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	9,941,102,010円	13,188,351,590円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,836,732,618円	13,652,169,169円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,145,144,329円	1,164,540,034円
eMAXIS バランス(波乗り型)	195,449,985円	166,077,754円
コアバランス	458,860円	346,945円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	615,318円	6,140,276円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	593,676円	8,505,165円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	1,634,211円	6,493,006円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	187,851,870円	813,292,370円
海外株式セレクション(ラップ向け)	3,225,127円	821,530,212円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	18,432,345円	248,155,793円
つみたて先進国株式		575,581円
つみたて8資産均等バランス		749,341円
つみたて4資産均等バランス		1,045,058円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		761,628円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		898,192円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		1,426,426円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,679,239,467円	8,873,342,665円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,377,930,535円	2,441,733,561円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	2,746,833,986円	2,457,989,979円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	5,656,621,246円	4,359,445,879円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	113,562,512円	334,264,883円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	94,246,909円	172,766,427円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	781,285,141円	668,097,305円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	33,664,211円	57,240,955円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	3,677,922円	8,084,098円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	7,740,970円	17,197,826円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	34,005,389円	70,558,123円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	36,408,176円	63,216,172円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	48,596,190円	145,110,132円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	1,078,970,724円	55,569,849円

三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	13,411,940,787円	12,377,209,621円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	263,175,398円	214,614,182円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,317,023,051円	2,108,839,464円
MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	49,862,986,580円	58,626,883,097円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	230,407,728円	202,703,007円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	89,565,460円	80,621,415円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,710,242,579円	1,558,444,952円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,112,414,073円	3,079,673,407円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,032,731円	
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	6,975,931,241円	6,953,840,175円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	61,841,575円	42,594,477円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	365,112,988円	236,107,381円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	1,382,413,011円	2,116,264,534円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	259,970,356円	814,269,856円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	123,882,140円	95,889,232円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	15,245,041円	16,188,819円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)	949,629,866円	3,709,718,749円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,940,765,146円	2,095,015,371円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,568,128円	2,422,489円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	12,001,808円	9,017,622円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	18,323,254円	14,399,282円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	19,740,928円	15,083,013円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	85,496,025円	76,675,480円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	24,640,625円	20,683,028円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	180,455,086円	140,159,914円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	40,515,958円	25,309,768円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	282,957,955円	213,433,135円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,198,780,634円	4,293,387,716円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)	173,569,383円	163,446,895円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)	687,145,111円	660,449,976円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	642,134,748円	625,695,461円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)	548,269,657円	544,825,219円
(合計)	137,017,202,778円	150,939,543,131円
2 受益権の総数	137,017,202,778口	150,939,543,131口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4302円 (24,302円)	2.6266円 (26,266円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成29年5月12日現在]	[平成29年11月10日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありせん。	同左

2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。</p>	同 左

（有価証券に関する注記）  
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
株式関連

区 分	種 類	[ 平成29年5月12日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,184,695,335		6,221,983,435	37,288,100
	合 計	6,184,695,335		6,221,983,435	37,288,100

区 分	種 類	[ 平成29年11月10日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,598,973,007		10,627,679,154	28,706,147
	合 計	10,598,973,007		10,627,679,154	28,706,147

（注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

区 分	種 類	[ 平成29年5月12日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	6,585,869,400		6,584,576,000	1,293,400
	カナダドル	365,767,300		365,728,000	39,300
	オーストラリアドル	285,834,600		285,838,000	3,400
	イギリスポンド	719,446,100		719,124,000	322,100
	スイスフラン	361,880,350		361,792,000	88,350
	香港ドル	117,033,600		116,960,000	73,600
	シンガポールドル	80,843,900		80,900,000	56,100
	スウェーデンクローネ	115,470,000		115,470,000	
	ノルウェークローネ	19,872,000		19,860,000	12,000
	デンマーククローネ	83,250,000		83,200,000	50,000
	ユーロ	1,312,554,800		1,312,280,000	274,800
	合 計	10,047,822,050		10,045,728,000	2,094,050

区 分	種 類	[ 平成29年11月10日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	22,674,200		22,674,000	200
	オーストラリアドル	13,060,800		13,060,500	300
	イギリスポンド	14,901,900		14,902,000	100
	合 計	50,636,900		50,636,500	400

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産総額	8,292,977,552
負債総額	3,514,865
純資産総額( - )	8,289,462,687
発行済口数	4,130,609,313 口
1口当たり純資産価額( / )	2.0068 ( 1万口当たり 20,068 )

## &lt;参考&gt;

## 「日本債券インデックスマザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産総額	435,897,871,433
負債総額	7,838,650,173
純資産総額( - )	428,059,221,260
発行済口数	323,594,910,181 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3228 ( 1万口当たり 13,228 )

## &lt;参考&gt;

## 「TOPIXマザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産総額	373,679,762,595
負債総額	43,769,726,264
純資産総額( - )	329,910,036,331
発行済口数	175,581,517,240 口
1口当たり純資産価額( / )	1.8790 ( 1万口当たり 18,790 )

## &lt;参考&gt;

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産総額	123,927,594,017
負債総額	155,104,934
純資産総額( - )	123,772,489,083
発行済口数	59,728,934,344 口
1口当たり純資産価額( / )	2.0722 ( 1万口当たり 20,722 )

## &lt;参考&gt;

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成29年11月30日現在

(単位：円)

資産総額	400,218,657,630
負債総額	158,958,288
純資産総額( - )	400,059,699,342
発行済口数	152,061,401,806 口
1口当たり純資産価額( / )	2.6309 ( 1万口当たり 26,309 )



#### 4【委託会社等の概況】

##### (1)【資本金の額】

半期代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

半期代替書面については、(<https://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>)でもご覧いただけます。

##### (2)【事業の内容及び営業の状況】

半期代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

##### (3)【その他】

該当事項はありません。

#### 5【委託会社等の経理状況】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

##### (1)【貸借対照表】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(1)「貸借対照表」の記載のとおりです。

##### (2)【損益計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(2)「損益計算書」の記載のとおりです。

##### (3)【株主資本等変動計算書】

半期代替書面における「委託会社等の経理状況」の(3)「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

## 6【その他】

平成29年8月10日提出済みの有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の記載事項の一部について、内容の更新等を行います。原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とします。

## 証券情報

(4) 発行(売出)価格

<更新後>

(略)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(略)

## 有価証券報告書

## 第一部 ファンド情報

## 第1 ファンドの状況

1 ファンドの性格

(1) ファンドの目的及び基本的性格

[ファンドの目的・特色]

<更新後>

(略)

## ファンドの特色



主として、日本債券インデックスマザーファンド、TOPIXマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンドおよび外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、内外の主要金融資産にバランスよく分散投資を行います。

マザーファンドの基本方針は以下の通りです。

ファンド名	基本方針
日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
TOPIXマザーファンド	東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(略)

☞「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。



国内債券32%、国内株式35%、外国債券10%、外国株式20%および短期金融商品3%の比率で配分した基本ポートフォリオのもと、個別資産毎におけるパッシブ運用を行い、委託会社が独自に指数化する合成インデックスをベンチマーク<sup>(注1)</sup>として、ベンチマークと同程度の投資成果をあげることをめざします。

委託会社が独自に指数化する合成インデックスとは、NOMURA-BPI総合インデックス32%、東証株価指数(TOPIX)35%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)10%、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)20%、無担保コール翌日物レート(短資協会発表)の平均値3%を合成したものです。

資産配分については、三菱UFJ信託銀行株式会社からの投資助言を受けることとします。<sup>(注2)</sup>

長期的な運用環境の動向等により、基本ポートフォリオを見直す場合があります。

(注1)ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

(注2)投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

(略)

## ■分配方針

- ・年1回の決算時(5月12日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- ・分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 指数について

(略)

FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき当社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(略)

## (3) ファンドの仕組み

### 委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金  
2,000百万円(平成29年11月末現在)  
(略)
- ・大株主の状況(平成29年11月末現在)  
(略)

## 2 投資方針

### (2) 投資対象

<更新後>

(略)

#### <マザーファンドの概要>

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

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

(運用方法)

投資対象

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

投資態度

主として対象インデックスに採用されている公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

(略)

(投資制限)

(略)

スワップ取引を行うことができます。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

TOPIXマザーファンド

(略)

(運用方法)

(略)

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

(略)

(投資制限)

(略)

スワップ取引を行うことができます。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に採用されている国債を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている国債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

(略)

(投資制限)

(略)

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

外国株式インデックスマザーファンド

（略）

（運用方法）

（略）

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

（略）

（投資制限）

（略）

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

#### 4 手数料等及び税金

（3）信託報酬等

<更新後>

（略）

信託財産の純資産総額 × 年0.378% 以内（税抜 年0.35%以内）の率（平成30年2月10日現在：年 0.378% （税抜 年0.35%））

（略）

（5）課税上の取扱い

<更新後>

（略）

上記は平成29年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（略）

## 第2 管理及び運営

<更新後>

1 申込（販売）手続等

（略）

申込価額の照会方法	（略） ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
-----------	---

（略）

2 換金（解約）手続等

（略）

解約価額の照会方法	（略） ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
-----------	---

（略）

3 資産管理等の概要

（1）資産の評価

（略）

基準価額の照会方法	（略） ホームページアドレス <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a>
-----------	---

（略）

(5) その他  
(略)

公告	(略) <a href="https://www.am.mufg.jp/">https://www.am.mufg.jp/</a> (略)
----	---

**第二部 委託会社等の情報****第2 その他の関係法人の概況**

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

## (1) 受託会社

&lt;更新後&gt;

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成29年3月末現在)

(略)

## (2) 販売会社

&lt;更新後&gt;

名称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
損害保険ジャパン日本興亜株式会社	70,000 百万円	損害保険業務を営んでいます。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 3 資本関係

&lt;更新後&gt;

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成29年11月末現在)

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月20日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）の平成29年5月13日から平成29年11月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）の平成29年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年5月13日から平成29年11月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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