

**【表紙】**

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年10月15日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	MAXIS 日経225上場投信
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年4月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

## 第二部【ファンド情報】

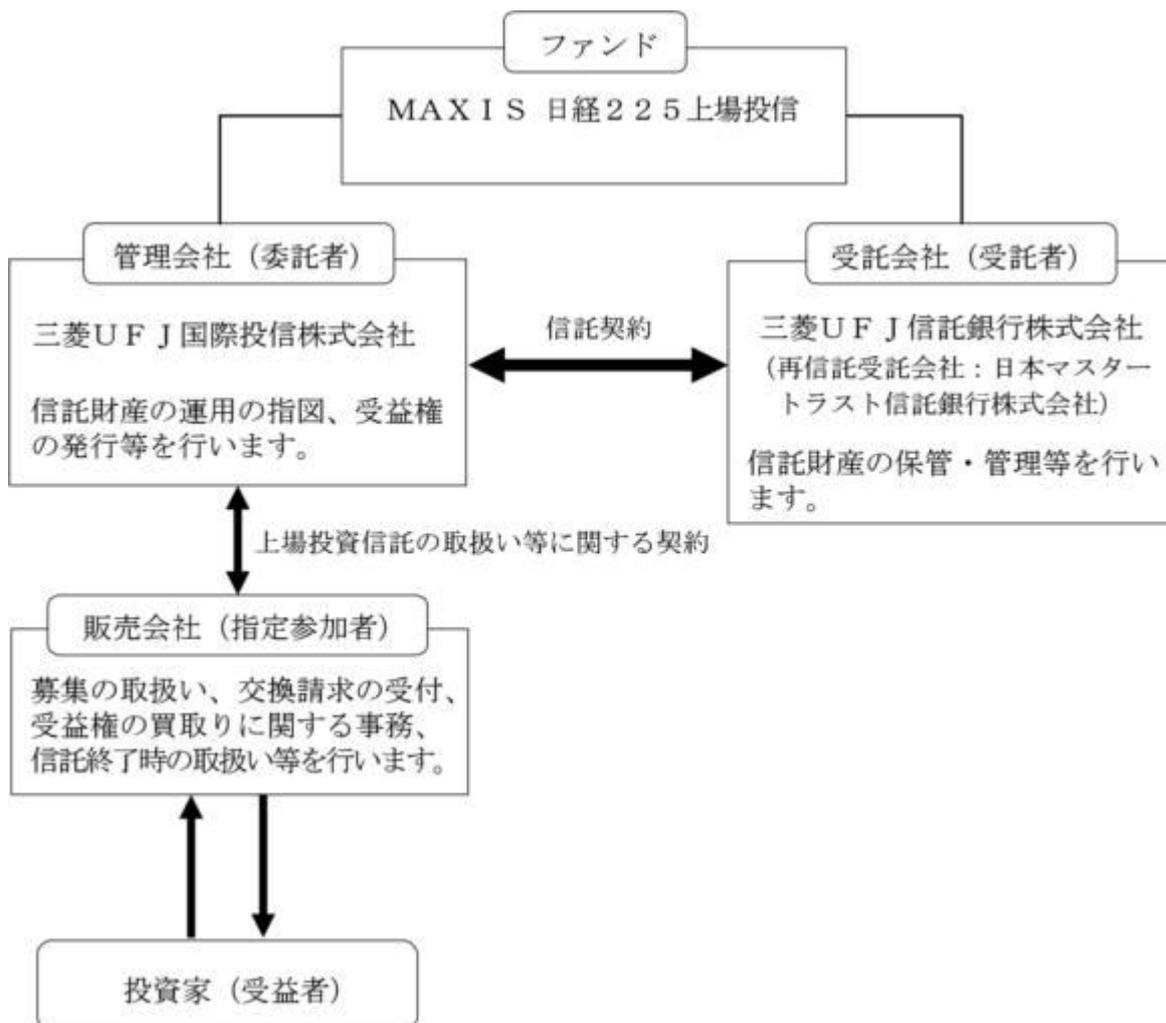
### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況（2019年1月末現在）

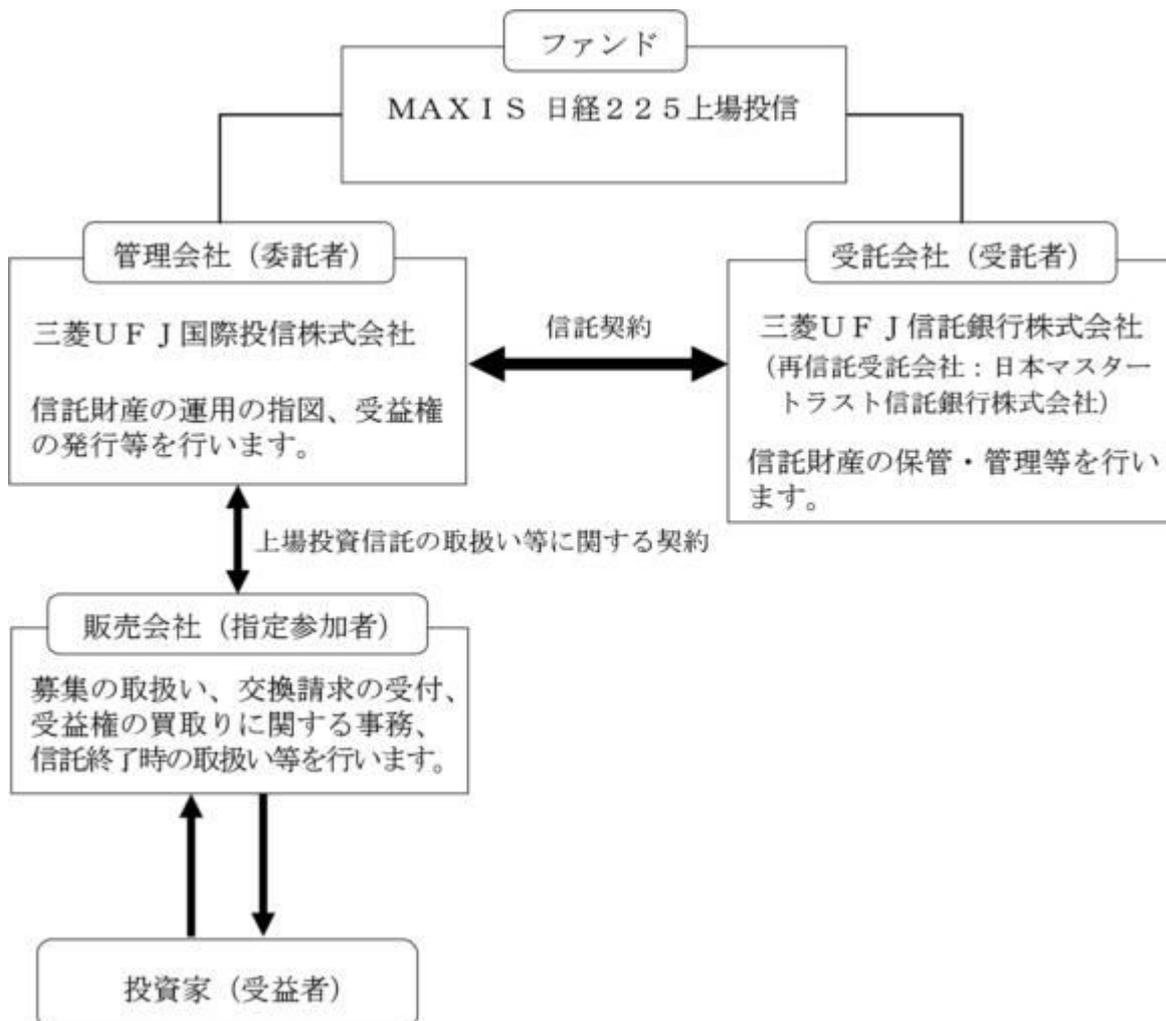
- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
1985年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更  
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

## ・大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

## &lt;訂正後&gt;

## 委託会社およびファンドの関係法人の役割



## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いに係る事務の内容等が定められています。

### 委託会社の概況（2019年7月末現在）

- ・ 金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・ 設立年月日  
1985年8月1日
- ・ 資本金  
2,000百万円
- ・ 沿革  
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更  
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・ 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### (1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

#### 価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、当ファンドはその影響を受け株式の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けま

すので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

#### 留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- ・当ファンドは、交換時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・当ファンドは、日経平均株価(日経225)の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、取得申込みの一部が金銭にて行われた場合および組入銘柄の配当金や権利処理等によってファンド内に現金が発生すること等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・当ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格は当ファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、当ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

#### (2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

##### トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

##### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

##### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

##### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

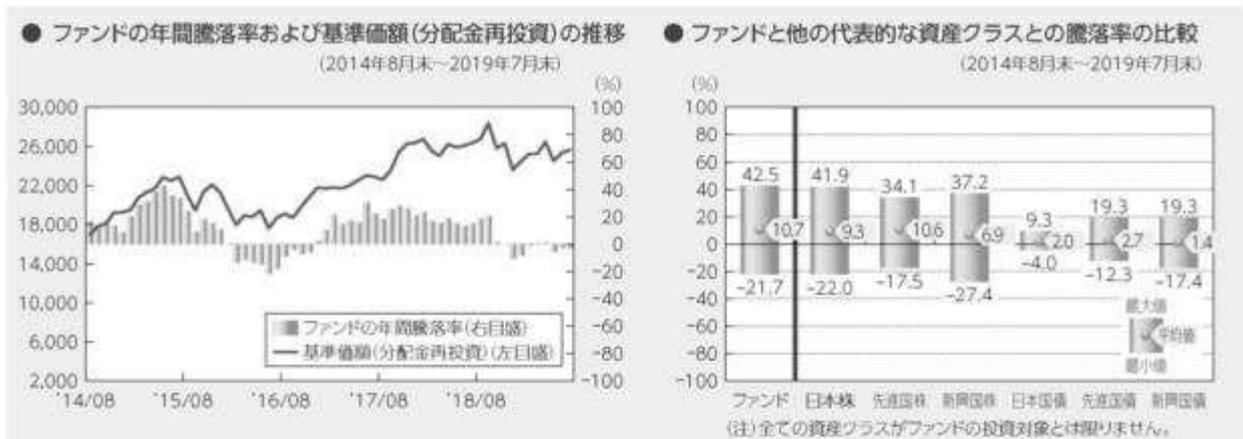
#### <流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■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。



- 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ものと計算しており、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	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(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で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIX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の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIX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(国債)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国債パフォーマンス・インデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。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。
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。

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

## &lt;訂正前&gt;

- ・信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。  
 なお、 と の合計額が信託財産の純資産総額に対して、年率0.27%（税抜 0.25%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1836%（税抜 年0.17%）以内の率を乗じて得た額

信託約款に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品賃料の54%（税抜 50%）以内の額

消費税率が10%となった場合は、以下の通りとなります。

- ・信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。  
 なお、 と の合計額が信託財産の純資産総額に対して、年率0.275%（税抜 0.25%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.187%（税抜 年0.17%）以内の率を乗じて得た額

信託約款に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品賃料の55%（税抜 50%）以内の額

1口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × （保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

上記 の配分

信託財産の純資産総額に応じて	委託会社	受託会社
7,500億円以下の部分	0.1%	0.07%
7,500億円超 1兆円以下の部分	0.11%	0.06%
1兆円超 2兆円以下の部分	0.12%	0.05%
2兆円超の部分	0.13%	0.04%

上記 の配分

委託会社と受託会社で折半します。

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	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
受託会社	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

## &lt;訂正後&gt;

- ・信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。  
 なお、 と の合計額は信託財産の純資産総額に対して、年率0.275%（税抜 0.25%）以内の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.187%（税抜 年0.17%）以内の率を乗じて得た額

信託約款に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品賃料の55%（税抜 50%）

## 以内の額

1 口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (保有日数 / 365)  
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・ 信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・ 信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

## 上記の配分

信託財産の純資産総額に応じて	委託会社	受託会社
7,500億円以下の部分	0.1%	0.07%
7,500億円超 1兆円以下の部分	0.11%	0.06%
1兆円超 2兆円以下の部分	0.12%	0.05%
2兆円超の部分	0.13%	0.04%

## 上記の配分

委託会社と受託会社で折半します。

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	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
受託会社	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

## (4) 【その他の手数料等】

## &lt;訂正前&gt;

- ・ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・ 信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・ 信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- ・ 受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.0081%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.0081%（税抜0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・ 対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.027%（税抜 年0.025%）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

消費税率が10%となった場合は、以下の通りとなります。

- ・受益権の上場に係る費用(追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.00825%(税抜0.0075%))、年間上場料(毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%(税抜0.0075%)))は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に年0.0275%(税抜年0.025%)を乗じて得た額)は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

(注)手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

<訂正後>

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用(消費税等相当額を含みます。)は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産(投資している投資信託を含みます。)の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等(消費税等相当額を含みます。)、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- ・受益権の上場に係る費用(追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.00825%(税抜0.0075%))、年間上場料(毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%(税抜0.0075%)))は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。
- ・対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に年0.0275%(税抜年0.025%)を乗じて得た額)は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

(注)手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

売却価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得として課税されます。

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。

2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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。

なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用があります。）・申告分離課税を選択することもできます。

### 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の損失(譲渡損)については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。 )との損益通算が可能となる仕組みがあります。

特定株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。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やETF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。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する(ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。 )など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

#### 1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

#### 2. 収益分配金の受取り時

15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

#### 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

上記は2019年1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。

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。

### <訂正後>

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 1. 受益権の売却時

売却価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。 )を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得として課税されます。

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。

#### 2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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。

なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用があります。 )・申告分離課税を選択することもできます。

#### 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の損失(譲渡損)については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。 )との損益通算が可能となる仕組みがあります。

特定株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。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やETF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。他の口座で生じた配当所得・譲渡

所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する(ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。)など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

##### 1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

##### 2. 収益分配金の受取り時

15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

##### 3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額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。

上記は2019年7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。

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。

## 5【運用状況】

### 【MAXIS 日経225上場投信】

#### (1)【投資状況】

令和1年7月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	1,382,416,440,960	99.68
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,419,961,690	0.32
純資産総額		1,386,836,402,650	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

令和1年7月31日現在

(単位:円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,439,300,000	0.32

(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。

#### (2)【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

令和1年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	2,336,000	69,468.07	162,277,411,520	65,550.00	153,124,800,000	11.04
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	14,016,000	5,191.25	72,760,560,000	5,628.00	78,882,048,000	5.69
日本	株式	ファナック	電気機器	2,336,000	18,925.56	44,210,108,160	19,530.00	45,622,080,000	3.29
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2,336,000	16,616.54	38,816,237,440	18,695.00	43,671,520,000	3.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	14,016,000	2,862.54	40,121,360,640	2,853.50	39,994,656,000	2.88
日本	株式	ダイキン工業	機械	2,336,000	14,054.62	32,831,592,320	13,585.00	31,734,560,000	2.29
日本	株式	京セラ	電気機器	4,672,000	7,091.85	33,133,123,200	6,690.00	31,255,680,000	2.25
日本	株式	テルモ	精密機器	9,344,000	3,229.80	30,179,251,200	3,182.00	29,732,608,000	2.14
日本	株式	信越化学工業	化学	2,336,000	9,658.66	22,562,629,760	11,155.00	26,058,080,000	1.88
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	7,008,000	3,553.11	24,900,194,880	3,718.00	26,055,744,000	1.88
日本	株式	ユニー・ファミリーマートホールディングス	小売業	9,344,000	2,547.87	23,807,297,280	2,330.00	21,771,520,000	1.57
日本	株式	セコム	サービス業	2,336,000	8,884.61	20,754,448,960	8,551.00	19,975,136,000	1.44
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	4,672,000	3,055.43	14,274,968,960	4,270.00	19,949,440,000	1.44
日本	株式	TDK	電気機器	2,336,000	8,449.83	19,738,802,880	8,470.00	19,785,920,000	1.43
日本	株式	資生堂	化学	2,336,000	8,250.60	19,273,401,600	8,046.00	18,795,456,000	1.36
日本	株式	花王	化学	2,336,000	8,166.08	19,075,962,880	7,979.00	18,638,944,000	1.34
日本	株式	中外製薬	医薬品	2,336,000	7,170.21	16,749,610,560	7,800.00	18,220,800,000	1.31
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	11,680,000	1,543.01	18,022,356,800	1,553.50	18,144,880,000	1.31
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	11,680,000	1,463.91	17,098,468,800	1,435.00	16,760,800,000	1.21
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,336,000	7,000.16	16,352,373,760	7,024.00	16,408,064,000	1.18
日本	株式	第一三共	医薬品	2,336,000	6,080.29	14,203,557,440	6,647.00	15,527,392,000	1.12
日本	株式	ソニー	電気機器	2,336,000	5,865.95	13,702,859,200	6,170.00	14,413,120,000	1.04
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	2,336,000	6,151.18	14,369,156,480	6,057.00	14,149,152,000	1.02
日本	株式	エーザイ	医薬品	2,336,000	5,997.82	14,010,907,520	5,906.00	13,796,416,000	0.99
日本	株式	パンダイナムコホールディングス	その他製品	2,336,000	5,908.85	13,803,073,600	5,900.00	13,782,400,000	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,672,000	2,836.45	13,251,894,400	2,710.50	12,663,456,000	0.91
日本	株式	日東電工	化学	2,336,000	5,146.08	12,021,242,880	5,390.00	12,591,040,000	0.91
日本	株式	オムロン	電気機器	2,336,000	5,360.00	12,520,960,000	5,240.00	12,240,640,000	0.88
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	2,336,000	5,432.87	12,691,184,320	5,181.00	12,102,816,000	0.87
日本	株式	ヤマハ	その他製品	2,336,000	5,229.90	12,217,046,400	5,160.00	12,053,760,000	0.87

(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

令和1年7月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.17

鉱業	0.06
建設業	2.15
食料品	4.20
繊維製品	0.22
パルプ・紙	0.13
化学	8.48
医薬品	7.69
石油・石炭製品	0.29
ゴム製品	0.86
ガラス・土石製品	1.20
鉄鋼	0.10
非鉄金属	0.89
金属製品	0.35
機械	4.66
電気機器	18.57
輸送用機器	4.82
精密機器	3.29
その他製品	2.21
電気・ガス業	0.22
陸運業	2.19
海運業	0.10
空運業	0.06
倉庫・運輸関連業	0.24
情報・通信業	11.67
卸売業	2.08
小売業	14.32
銀行業	0.67
証券、商品先物取引業	0.29
保険業	1.02
その他金融業	0.22
不動産業	1.64
サービス業	4.64
小計	99.68
合計	99.68

（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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

令和 1年 7月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	日経225先物 19年09月限	買建	206	円	4,480,611,240	4,439,300,000	0.32

（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。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和1年7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口当たりの純資産価額）		東京証券取引 所取引価格
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第2計算期間末日（平成22年 1月16日）	23,642,393,961	23,762,617,393	11,013	11,069	11,010
第3計算期間末日（平成22年 7月16日）	41,148,819,594	41,283,472,527	9,473	9,504	9,490
第4計算期間末日（平成23年 1月16日）	60,605,699,980	60,902,976,960	10,601	10,653	10,620
第5計算期間末日（平成23年 7月16日）	72,540,704,466	73,108,537,506	10,092	10,171	10,100
第6計算期間末日（平成24年 1月16日）	94,348,989,710	95,116,200,917	8,485	8,554	8,500
第7計算期間末日（平成24年 7月16日）	132,992,229,464	134,210,159,396	8,845	8,926	8,830
第8計算期間末日（平成25年 1月16日）	223,315,618,598	224,682,641,024	10,782	10,848	10,760
第9計算期間末日（平成25年 7月16日）	283,977,912,469	285,906,852,889	14,869	14,970	14,870
第10計算期間末日（平成26年 1月16日）	445,963,087,944	448,352,024,066	16,054	16,140	16,060
第11計算期間末日（平成26年 7月16日）	561,994,860,866	565,572,504,966	15,709	15,809	15,700
第12計算期間末日（平成27年 1月16日）	472,142,428,615	475,681,395,910	17,210	17,339	17,210
第13計算期間末日（平成27年 7月16日）	693,666,131,660	697,784,083,535	21,056	21,181	21,070
第14計算期間末日（平成28年 1月16日）	742,475,197,068	747,681,886,083	17,540	17,663	17,550
第15計算期間末日（平成28年 7月16日）	763,270,560,790	770,054,377,840	16,877	17,027	16,870
第16計算期間末日（平成29年 1月16日）	920,391,274,790	927,502,532,965	19,544	19,695	19,560
第17計算期間末日（平成29年 7月16日）	998,228,592,902	1,006,956,826,742	20,586	20,766	20,600
第18計算期間末日（平成30年 1月16日）	1,383,405,146,456	1,392,255,861,630	24,540	24,697	24,520
第19計算期間末日（平成30年 7月16日）	1,418,067,701,951	1,428,955,481,885	23,183	23,361	23,180
第20計算期間末日（平成31年 1月16日）	1,360,096,445,742	1,372,811,975,926	20,965	21,161	20,950
第21計算期間末日（令和 1年 7月16日）	1,393,616,612,870	1,407,686,982,514	22,087	22,310	22,090
平成30年 7月末日	1,401,922,535,430		23,138		23,130
8月末日	1,457,651,579,932		23,467		23,440
9月末日	1,488,573,757,706		24,911		24,900
10月末日	1,346,709,315,941		22,655		22,640
11月末日	1,392,466,518,173		23,099		23,100
12月末日	1,289,103,496,865		20,720		20,690
平成31年 1月末日	1,379,847,711,011		21,304		21,300
2月末日	1,385,569,025,134		21,945		21,920

3月末日	1,395,348,007,570		21,932		21,920
4月末日	1,494,219,064,585		23,029		23,030
令和 1年 5月末日	1,371,808,714,570		21,315		21,310
6月末日	1,379,303,913,766		22,044		22,000
7月末日	1,386,836,402,650		22,073		22,080

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金	
第2計算期間		56円00銭
第3計算期間		31円00銭
第4計算期間		52円00銭
第5計算期間		79円00銭
第6計算期間		69円00銭
第7計算期間		81円00銭
第8計算期間		66円00銭
第9計算期間		101円00銭
第10計算期間		86円00銭
第11計算期間		100円00銭
第12計算期間		129円00銭
第13計算期間		125円00銭
第14計算期間		123円00銭
第15計算期間		150円00銭
第16計算期間		151円00銭
第17計算期間		180円00銭
第18計算期間		157円00銭
第19計算期間		178円00銭
第20計算期間		196円00銭
第21計算期間		223円00銭

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第2計算期間	18.22
第3計算期間	13.70
第4計算期間	12.45
第5計算期間	4.05
第6計算期間	15.23
第7計算期間	5.19
第8計算期間	22.64
第9計算期間	38.84

第10計算期間	8.54
第11計算期間	1.52
第12計算期間	10.37
第13計算期間	23.07
第14計算期間	16.11
第15計算期間	2.92
第16計算期間	16.69
第17計算期間	6.25
第18計算期間	19.96
第19計算期間	4.80
第20計算期間	8.72
第21計算期間	6.41

（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。

#### （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第2計算期間	1,152,141	2,358,706	2,146,847
第3計算期間	2,763,419	566,623	4,343,643
第4計算期間	3,211,401	1,838,179	5,716,865
第5計算期間	3,633,306	2,162,411	7,187,760
第6計算期間	4,323,579	392,336	11,119,003
第7計算期間	11,530,640	7,613,471	15,036,172
第8計算期間	12,087,808	6,411,519	20,712,461
第9計算期間	5,712,787	7,326,828	19,098,420
第10計算期間	21,462,485	12,782,578	27,778,327
第11計算期間	12,825,673	4,827,559	35,776,441
第12計算期間	7,350,417	15,693,003	27,433,855
第13計算期間	18,084,353	12,574,593	32,943,615
第14計算期間	19,920,745	10,533,555	42,330,805
第15計算期間	11,511,403	8,616,761	45,225,447
第16計算期間	16,275,294	14,406,316	47,094,425
第17計算期間	20,892,895	19,497,132	48,490,188
第18計算期間	16,220,162	8,336,368	56,373,982
第19計算期間	18,197,330	13,404,009	61,167,303
第20計算期間	15,843,932	12,136,081	64,875,154
第21計算期間	8,537,337	10,316,663	63,095,828

（注）解約口数は、交換口数を表示しております。

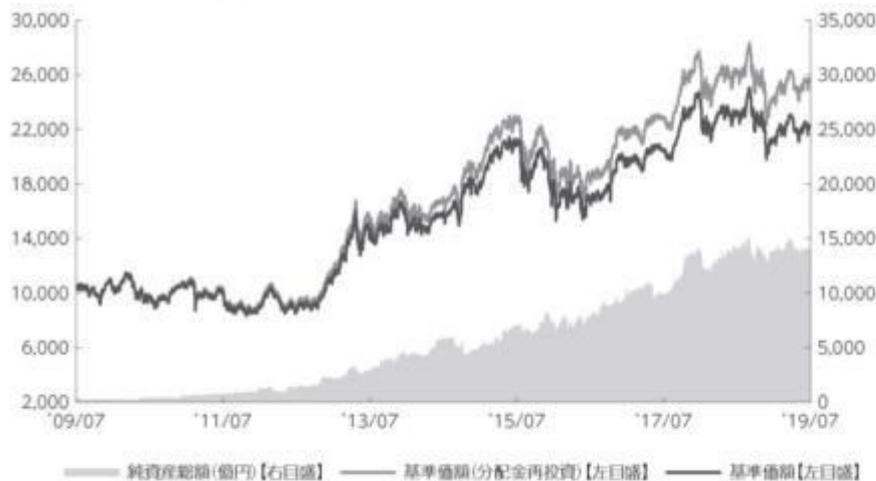
#### 参考情報



## 運用実績

2019年7月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2009年7月31日～2019年7月31日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)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	22,073円
純資産総額	13,868億円

### ■分配の推移

2019年 7月	223円
2019年 1月	196円
2018年 7月	178円
2018年 1月	157円
2017年 7月	180円
2017年 1月	151円
設定来累計	2,405円

\*分配金は10当たり、税引前

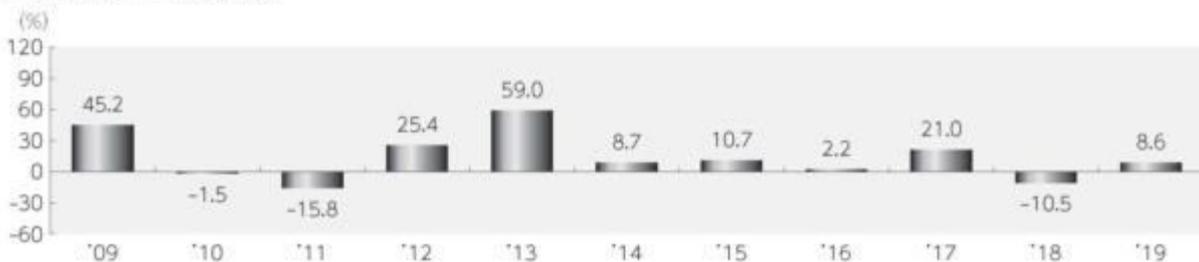
### ■主要な資産の状況

組入上位業種	比率	組入上位銘柄	業種	比率
1 電気機器	18.6%	1 ファーストリテイリング	小売業	11.0%
2 小売業	14.3%	2 ソフトバンクグループ	情報・通信業	5.7%
3 情報・通信業	11.7%	3 ファナック	電気機器	3.3%
4 化学	8.5%	4 東京エレクトロン	電気機器	3.1%
5 医薬品	7.7%	5 KDDI	情報・通信業	2.9%
6 輸送用機器	4.8%	6 ダイキン工業	機械	2.3%
7 機械	4.7%	7 京セラ	電気機器	2.3%
8 サービス業	4.6%	8 テルモ	精密機器	2.1%
9 食料品	4.2%	9 信越化学工業	化学	1.9%
10 精密機器	3.3%	10 リクルートホールディングス	サービス業	1.9%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.3%

- 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)
- 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

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2009年は設定日から年末までの、2019年は年初から7月31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。

## 第3【ファンドの経理状況】

1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2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、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、当期（平成31年1月17日から令和1年7月16日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【MAXIS 日経225上場投信】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 [平成31年1月16日現在]	第21期 [令和1年7月16日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	118,793,468,877	496,253,366,985
株式	1,356,854,492,280	1,387,790,336,660
派生商品評価勘定	136,766,280	103,633,660
未収入金	-	242,819,020
未収配当金	2,321,838,000	1,982,330,900
未収利息	-	14,211,225
前払金	299,960,000	-
その他未収収益	4,374,702	78,806,862
差入委託証拠金	635,040,000	639,630,000
流動資産合計	1,479,045,940,139	1,887,105,135,312
<b>資産合計</b>		
1,479,045,940,139		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	32,283,220	-
前受金	-	463,750,000
未払金	476,097,840	-
未払収益分配金	12,715,530,184	14,070,369,644
未払受託者報酬	486,173,304	490,151,301
未払委託者報酬	822,216,884	829,646,839
未払利息	219,621	1,076,665
受入担保金	104,158,766,460	477,391,727,693
その他未払費用	258,206,884	241,800,300
流動負債合計	118,949,494,397	493,488,522,442
<b>負債合計</b>		
118,949,494,397		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	478,584,011,058	465,457,923,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	881,512,434,684	928,158,689,714
(分配準備積立金)	62,076,020	30,599,896
元本等合計	1,360,096,445,742	1,393,616,612,870
<b>純資産合計</b>		
1,360,096,445,742		
<b>負債純資産合計</b>		
1,479,045,940,139		

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自 平成30年 7月17日 至 平成31年 1月16日		自 平成31年 1月17日 至 令和 1年 7月16日	
営業収益				
受取配当金		14,291,200,660		15,476,542,320
受取利息		150,683		52,418
有価証券売買等損益		122,651,014,156		72,480,539,506
派生商品取引等損益		1,687,421,050		455,180,640
その他収益		63,157,945		142,800,839
営業収益合計		109,983,925,918		88,555,115,723
営業費用				
支払利息		37,409,617		18,580,427
受託者報酬		486,173,304		490,151,301
委託者報酬		822,216,884		829,646,839
その他費用		259,280,880		242,123,490
営業費用合計		1,605,080,685		1,580,502,057
営業利益又は営業損失( )		111,589,006,603		86,974,613,666
経常利益又は経常損失( )		111,589,006,603		86,974,613,666
当期純利益又は当期純損失( )		111,589,006,603		86,974,613,666
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額( )		-		-
期首剰余金又は期首欠損金( )		966,836,507,720		881,512,434,684
剰余金増加額又は欠損金減少額		236,772,599,934		124,857,537,297
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		236,772,599,934		124,857,537,297
剰余金減少額又は欠損金増加額		197,792,136,183		151,115,526,289
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		197,792,136,183		151,115,526,289
分配金		12,715,530,184		14,070,369,644
期末剰余金又は期末欠損金( )		881,512,434,684		928,158,689,714

## (3) 【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。
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)

	第20期	第21期
	[平成31年 1月16日現在]	[令和 1年 7月16日現在]
1. 期首元本額	451,231,194,231円	478,584,011,058円
期中追加設定元本額	116,880,686,364円	62,979,935,049円
期中一部交換元本額	89,527,869,537円	76,106,022,951円

	第20期 [平成31年 1月16日現在]	第21期 [令和 1年 7月16日現在]
2. 貸付有価証券 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	99,590,931,040円	452,222,354,680円
3. 受益権の総数	64,875,154口	63,095,828口

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第20期 自 平成30年 7月17日 至 平成31年 1月16日	第21期 自 平成31年 1月17日 至 令和 1年 7月16日																																																												
1. その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。	1. その他費用 上場費用および商標使用料等を含んでおります。																																																												
2. 分配金の計算過程	2. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>14,317,099,671円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>28,177,601円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>14,345,277,272円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,567,671,068円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=C-D</td> <td>12,777,606,204円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>12,715,530,184円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>62,076,020円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>64,875,154口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>196円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	14,317,099,671円	分配準備積立金額	B	28,177,601円	配当等収益合計額	C=A+B	14,345,277,272円	経費	D	1,567,671,068円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,777,606,204円	収益分配金金額	F	12,715,530,184円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	62,076,020円	当ファンドの期末残存口数	H	64,875,154口	1口当たり分配金額	I=F/H	196円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>15,600,815,150円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>B</td> <td>62,076,020円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>15,662,891,170円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>1,561,921,630円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=C-D</td> <td>14,100,969,540円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>F</td> <td>14,070,369,644円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>30,599,896円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>H</td> <td>63,095,828口</td> </tr> <tr> <td>1口当たり分配金額</td> <td>I=F/H</td> <td>223円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	15,600,815,150円	分配準備積立金額	B	62,076,020円	配当等収益合計額	C=A+B	15,662,891,170円	経費	D	1,561,921,630円	当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,100,969,540円	収益分配金金額	F	14,070,369,644円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,599,896円	当ファンドの期末残存口数	H	63,095,828口	1口当たり分配金額	I=F/H	223円
項目																																																													
当期配当等収益額	A	14,317,099,671円																																																											
分配準備積立金額	B	28,177,601円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	14,345,277,272円																																																											
経費	D	1,567,671,068円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	12,777,606,204円																																																											
収益分配金金額	F	12,715,530,184円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	62,076,020円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	64,875,154口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	196円																																																											
項目																																																													
当期配当等収益額	A	15,600,815,150円																																																											
分配準備積立金額	B	62,076,020円																																																											
配当等収益合計額	C=A+B	15,662,891,170円																																																											
経費	D	1,561,921,630円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	14,100,969,540円																																																											
収益分配金金額	F	14,070,369,644円																																																											
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	30,599,896円																																																											
当ファンドの期末残存口数	H	63,095,828口																																																											
1口当たり分配金額	I=F/H	223円																																																											

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1 金融商品の状況に関する事項

区分	第20期 自 平成30年 7月17日 至 平成31年 1月16日	第21期 自 平成31年 1月17日 至 令和 1年 7月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

区分	第20期 自 平成30年 7月17日 至 平成31年 1月16日	第21期 自 平成31年 1月17日 至 令和 1年 7月16日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第20期 [ 平成31年 1月16日現在 ]	第21期 [ 令和 1年 7月16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>(1) 有価証券            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>(2) デリバティブ取引            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>(3) 上記以外の金融商品</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p>

区分	第20期 [平成31年 1月16日現在]	第21期 [令和 1年 7月16日現在]
	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>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>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。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第20期 [平成31年 1月16日現在]	第21期 [令和 1年 7月16日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	127,363,589,511	62,541,476,831
合計	127,363,589,511	62,541,476,831

## （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

## 第20期 [平成31年 1月16日現在]

区分	種類	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	3,184,660,000		3,289,230,000	104,570,000
合計		3,184,660,000		3,289,230,000	104,570,000

## 第21期 [令和 1年 7月16日現在]

区分	種類	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	5,722,720,000		5,826,500,000	103,780,000
合計		5,722,720,000		5,826,500,000	103,780,000

（注）時価の算定方法

- 1 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。
  - 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
  - 3 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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第20期 [平成31年 1月16日現在]	第21期 [令和 1年 7月16日現在]
1口当たり純資産額	20,965円	22,087円

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1332	日本水産	2,366,000	708.00	1,675,128,000	貸付有価証券 798,000株
1333	マルハニチロ	236,600	3,245.00	767,767,000	貸付有価証券 79,800株
1605	国際石油開発帝石	946,400	962.90	911,288,560	貸付有価証券 319,200株
1721	コムシスホールディングス	2,366,000	2,766.00	6,544,356,000	貸付有価証券 798,000株
1801	大成建設	473,200	3,800.00	1,798,160,000	貸付有価証券 159,600株
1802	大林組	2,366,000	1,069.00	2,529,254,000	貸付有価証券 798,000株
1803	清水建設	2,366,000	890.00	2,105,740,000	貸付有価証券 798,000株
1808	長谷工コーポレーション	473,200	1,181.00	558,849,200	貸付有価証券 159,600株
1812	鹿島建設	1,183,000	1,453.00	1,718,899,000	貸付有価証券 399,000株
1925	大和ハウス工業	2,366,000	3,139.00	7,426,874,000	貸付有価証券 1,759,500株

1928	積水ハウス	2,366,000	1,895.00	4,483,570,000	貸付有価証券 798,000株
1963	日揮	2,366,000	1,455.00	3,442,530,000	貸付有価証券 1,752,500株(42,200 株)
6366	千代田化工建設	2,366,000	306.00	723,996,000	貸付有価証券 1,058,900株
2002	日清製粉グループ本社	2,366,000	2,494.00	5,900,804,000	貸付有価証券 798,000株
2269	明治ホールディングス	473,200	7,560.00	3,577,392,000	貸付有価証券 159,600株
2282	日本ハム	1,183,000	4,545.00	5,376,735,000	貸付有価証券 399,000株
2501	サッポロホールディングス	473,200	2,423.00	1,146,563,600	
2502	アサヒグループホールディングス	2,366,000	5,033.00	11,908,078,000	
2503	キリンホールディングス	2,366,000	2,297.50	5,435,885,000	
2531	宝ホールディングス	2,366,000	1,137.00	2,690,142,000	貸付有価証券 798,000株
2801	キッコーマン	2,366,000	4,835.00	11,439,610,000	貸付有価証券 798,000株
2802	味の素	2,366,000	1,855.00	4,388,930,000	貸付有価証券 798,000株
2871	ニチレイ	1,183,000	2,658.00	3,144,414,000	貸付有価証券 399,000株
2914	日本たばこ産業	2,366,000	2,466.50	5,835,739,000	
3101	東洋紡	236,600	1,316.00	311,365,600	貸付有価証券 123,300株(43,500 株)
3103	ユニチカ	236,600	415.00	98,189,000	貸付有価証券 79,800株
3401	帝人	473,200	1,849.00	874,946,800	貸付有価証券 159,600株
3402	東レ	2,366,000	757.20	1,791,535,200	貸付有価証券 1,759,500株
3861	王子ホールディングス	2,366,000	579.00	1,369,914,000	貸付有価証券 798,000株
3863	日本製紙	236,600	1,927.00	455,928,200	貸付有価証券 104,000株(24,200 株)
3405	クラレ	2,366,000	1,274.00	3,014,284,000	
3407	旭化成	2,366,000	1,133.00	2,680,678,000	貸付有価証券 798,000株
4004	昭和電工	236,600	2,993.00	708,143,800	
4005	住友化学	2,366,000	489.00	1,156,974,000	貸付有価証券 798,000株
4021	日産化学	2,366,000	4,585.00	10,848,110,000	貸付有価証券 798,000株
4042	東ソー	1,183,000	1,518.00	1,795,794,000	貸付有価証券 399,000株
4043	トクヤマ	473,200	2,713.00	1,283,791,600	貸付有価証券 159,600株

4061	デンカ	473,200	3,155.00	1,492,946,000	貸付有価証券 159,600株
4063	信越化学工業	2,366,000	9,658.00	22,850,828,000	貸付有価証券 798,000株
4183	三井化学	473,200	2,599.00	1,229,846,800	貸付有価証券 159,600株
4188	三菱ケミカルホールディングス	1,183,000	748.80	885,830,400	貸付有価証券 399,000株
4208	宇部興産	236,600	2,225.00	526,435,000	貸付有価証券 79,800株
4272	日本化薬	2,366,000	1,333.00	3,153,878,000	貸付有価証券 798,000株
4452	花王	2,366,000	8,166.00	19,320,756,000	
4631	D I C	236,600	2,854.00	675,256,400	貸付有価証券 110,600株
4901	富士フイルムホールディングス	2,366,000	5,433.00	12,854,478,000	貸付有価証券 798,000株
4911	資生堂	2,366,000	8,251.00	19,521,866,000	
6988	日東電工	2,366,000	5,146.00	12,175,436,000	貸付有価証券 798,000株
4151	協和キリン	2,366,000	1,885.00	4,459,910,000	
4502	武田薬品工業	2,366,000	3,876.00	9,170,616,000	貸付有価証券 1,759,500株
4503	アステラス製薬	11,830,000	1,543.00	18,253,690,000	貸付有価証券 3,990,000株
4506	大日本住友製薬	2,366,000	1,947.00	4,606,602,000	貸付有価証券 798,000株
4507	塩野義製薬	2,366,000	6,151.00	14,553,266,000	貸付有価証券 798,000株
4519	中外製薬	2,366,000	7,170.00	16,964,220,000	
4523	エーザイ	2,366,000	5,998.00	14,191,268,000	貸付有価証券 798,000株
4568	第一三共	2,366,000	6,080.00	14,385,280,000	貸付有価証券 798,000株
4578	大塚ホールディングス	2,366,000	3,850.00	9,109,100,000	
5019	出光興産	946,400	3,175.00	3,004,820,000	貸付有価証券 319,200株
5020	J X T Gホールディングス	2,366,000	526.40	1,245,462,400	貸付有価証券 798,000株
5101	横浜ゴム	1,183,000	2,068.00	2,446,444,000	貸付有価証券 552,900株
5108	ブリヂストン	2,366,000	4,237.00	10,024,742,000	
5201	A G C	473,200	3,720.00	1,760,304,000	
5202	日本板硝子	236,600	701.00	165,856,600	貸付有価証券 163,900株(84,100株)
5214	日本電気硝子	709,800	2,724.00	1,933,495,200	貸付有価証券 331,700株
5232	住友大阪セメント	236,600	4,120.00	974,792,000	貸付有価証券 91,200株(11,400株)
5233	太平洋セメント	236,600	3,220.00	761,852,000	貸付有価証券 79,800株

5301	東海カーボン	2,366,000	1,067.00	2,524,522,000	貸付有価証券 1,105,800株
5332	TOTO	1,183,000	4,325.00	5,116,475,000	貸付有価証券 399,000株
5333	日本碍子	2,366,000	1,549.00	3,664,934,000	貸付有価証券 887,400株(89,400 株)
5401	日本製鉄	236,600	1,820.50	430,730,300	貸付有価証券 79,800株
5406	神戸製鋼所	236,600	689.00	163,017,400	貸付有価証券 179,200株(99,400 株)
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	236,600	1,525.00	360,815,000	貸付有価証券 79,800株
5541	大平洋金属	236,600	2,228.00	527,144,800	貸付有価証券 79,800株
5703	日本軽金属ホールディングス	2,366,000	230.00	544,180,000	貸付有価証券 798,000株
5706	三井金属鉱業	236,600	2,545.00	602,147,000	貸付有価証券 79,800株
5707	東邦亜鉛	236,600	2,472.00	584,875,200	貸付有価証券 79,800株
5711	三菱マテリアル	236,600	3,040.00	719,264,000	貸付有価証券 105,300株(25,500 株)
5713	住友金属鉱山	1,183,000	3,105.00	3,673,215,000	貸付有価証券 642,600株(43,600 株)
5714	DOWAホールディングス	473,200	3,455.00	1,634,906,000	貸付有価証券 249,800株(90,200 株)
5801	古河電気工業	236,600	3,120.00	738,192,000	貸付有価証券 79,800株
5802	住友電気工業	2,366,000	1,401.00	3,314,766,000	貸付有価証券 798,000株
5803	フジクラ	2,366,000	410.00	970,060,000	貸付有価証券 798,000株
3436	SUMCO	236,600	1,352.00	319,883,200	
5901	東洋製罐グループホールディングス	2,366,000	2,045.00	4,838,470,000	貸付有価証券 798,000株
5631	日本製鋼所	473,200	1,841.00	871,161,200	貸付有価証券 222,600株(63,000 株)
6103	オークマ	473,200	5,600.00	2,649,920,000	貸付有価証券 159,600株
6113	アマダホールディングス	2,366,000	1,197.00	2,832,102,000	貸付有価証券 798,000株
6301	小松製作所	2,366,000	2,471.50	5,847,569,000	貸付有価証券 798,000株
6302	住友重機械工業	473,200	3,590.00	1,698,788,000	貸付有価証券 159,600株
6305	日立建機	2,366,000	2,699.00	6,385,834,000	貸付有価証券 798,000株
6326	クボタ	2,366,000	1,711.00	4,048,226,000	

6361	荏原製作所	473,200	2,898.00	1,371,333,600	
6367	ダイキン工業	2,366,000	14,055.00	33,254,130,000	貸付有価証券 1,098,000株
6471	日本精工	2,366,000	945.00	2,235,870,000	貸付有価証券 798,000株
6472	N T N	2,366,000	315.00	745,290,000	貸付有価証券 1,681,800株(883,800 株)
6473	ジェイテクト	2,366,000	1,306.00	3,089,996,000	貸付有価証券 798,000株
7004	日立造船	473,200	395.00	186,914,000	貸付有価証券 210,700株(51,100 株)
7011	三菱重工業	236,600	4,768.00	1,128,108,800	貸付有価証券 79,800株
7013	I H I	236,600	2,428.00	574,464,800	貸付有価証券 79,800株
3105	日清紡ホールディングス	2,366,000	830.00	1,963,780,000	
4902	コニカミノルタ	2,366,000	1,087.00	2,571,842,000	貸付有価証券 851,600株(53,600 株)
6479	ミネベアミツミ	2,366,000	1,834.00	4,339,244,000	貸付有価証券 1,568,800株(320,800 株)
6501	日立製作所	473,200	4,020.00	1,902,264,000	貸付有価証券 159,600株
6503	三菱電機	2,366,000	1,426.50	3,375,099,000	貸付有価証券 798,000株
6504	富士電機	473,200	3,625.00	1,715,350,000	貸付有価証券 159,600株
6506	安川電機	2,366,000	3,500.00	8,281,000,000	貸付有価証券 798,000株
6645	オムロン	2,366,000	5,360.00	12,681,760,000	貸付有価証券 798,000株
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	473,200	2,075.00	981,890,000	貸付有価証券 159,600株
6701	日本電気	236,600	4,410.00	1,043,406,000	貸付有価証券 79,800株
6702	富士通	236,600	7,791.00	1,843,350,600	貸付有価証券 79,800株
6703	沖電気工業	236,600	1,414.00	334,552,400	貸付有価証券 153,600株(73,800 株)
6724	セイコーエプソン	4,732,000	1,753.00	8,295,196,000	貸付有価証券 2,278,800株(682,800 株)
6752	パナソニック	2,366,000	921.60	2,180,505,600	貸付有価証券 798,000株
6758	ソニー	2,366,000	5,866.00	13,878,956,000	貸付有価証券 798,000株
6762	T D K	2,366,000	8,450.00	19,992,700,000	貸付有価証券 798,000株
6770	アルプスアルパイン	2,366,000	1,882.00	4,452,812,000	貸付有価証券 798,000株

6841	横河電機	2,366,000	2,080.00	4,921,280,000	貸付有価証券 798,000株
6857	アドバンテスト	4,732,000	3,055.00	14,456,260,000	貸付有価証券 1,994,900株(398,900 株)
6952	カシオ計算機	2,366,000	1,264.00	2,990,624,000	貸付有価証券 1,150,000株(352,000 株)
6954	ファナック	2,366,000	18,925.00	44,776,550,000	貸付有価証券 860,600株(62,600 株)
6971	京セラ	4,732,000	7,092.00	33,559,344,000	貸付有価証券 1,596,000株
6976	太陽誘電	2,366,000	2,145.00	5,075,070,000	貸付有価証券 1,660,400株(612,400 株)
7735	S C R E E Nホールディングス	473,200	5,090.00	2,408,588,000	貸付有価証券 251,700株(41,700 株)
7751	キヤノン	3,549,000	3,184.00	11,300,016,000	
7752	リコー	2,366,000	1,048.00	2,479,568,000	貸付有価証券 1,051,100株(253,100 株)
8035	東京エレクトロン	2,366,000	16,615.00	39,311,090,000	貸付有価証券 798,000株
6902	デンソー	2,366,000	4,651.00	11,004,266,000	貸付有価証券 798,000株
7003	三井E & Sホールディングス	236,600	922.00	218,145,200	貸付有価証券 79,800株
7012	川崎重工業	236,600	2,516.00	595,285,600	貸付有価証券 141,600株(61,800 株)
7201	日産自動車	2,366,000	774.10	1,831,520,600	貸付有価証券 798,000株
7202	いすゞ自動車	1,183,000	1,205.50	1,426,106,500	貸付有価証券 399,000株
7203	トヨタ自動車	2,366,000	7,000.00	16,562,000,000	貸付有価証券 798,000株
7205	日野自動車	2,366,000	856.00	2,025,296,000	貸付有価証券 798,000株
7211	三菱自動車工業	236,600	498.00	117,826,800	貸付有価証券 179,200株(99,400 株)
7261	マツダ	473,200	1,113.00	526,671,600	貸付有価証券 159,600株
7267	本田技研工業	4,732,000	2,836.50	13,422,318,000	
7269	スズキ	2,366,000	4,598.00	10,878,868,000	貸付有価証券 851,000株
7270	S U B A R U	2,366,000	2,715.50	6,424,873,000	貸付有価証券 1,759,500株
7272	ヤマハ発動機	2,366,000	1,876.00	4,438,616,000	
4543	テルモ	9,464,000	3,230.00	30,568,720,000	貸付有価証券 3,692,000株

7731	ニコン	2,366,000	1,547.00	3,660,202,000	貸付有価証券 798,000株
7733	オリンパス	9,464,000	1,201.00	11,366,264,000	貸付有価証券 3,192,000株
7762	シチズン時計	2,366,000	556.00	1,315,496,000	貸付有価証券 1,185,700株(387,700 株)
7911	凸版印刷	1,183,000	1,770.00	2,093,910,000	貸付有価証券 550,000株
7912	大日本印刷	1,183,000	2,326.00	2,751,658,000	貸付有価証券 399,000株
7951	ヤマハ	2,366,000	5,230.00	12,374,180,000	貸付有価証券 798,000株
9501	東京電力ホールディングス	236,600	540.00	127,764,000	貸付有価証券 79,800株
9502	中部電力	236,600	1,503.50	355,728,100	貸付有価証券 114,600株(34,800 株)
9503	関西電力	236,600	1,267.00	299,772,200	貸付有価証券 79,800株
9531	東京瓦斯	473,200	2,634.00	1,246,408,800	貸付有価証券 159,600株
9532	大阪瓦斯	473,200	1,910.00	903,812,000	貸付有価証券 159,600株
9001	東武鉄道	473,200	3,130.00	1,481,116,000	貸付有価証券 159,600株
9005	東京急行電鉄	1,183,000	1,944.00	2,299,752,000	貸付有価証券 399,000株
9007	小田急電鉄	1,183,000	2,545.00	3,010,735,000	貸付有価証券 680,100株(281,100 株)
9008	京王電鉄	473,200	7,010.00	3,317,132,000	貸付有価証券 159,600株
9009	京成電鉄	1,183,000	3,985.00	4,714,255,000	貸付有価証券 399,000株
9020	東日本旅客鉄道	236,600	10,090.00	2,387,294,000	貸付有価証券 112,400株
9021	西日本旅客鉄道	236,600	8,873.00	2,099,351,800	貸付有価証券 79,800株
9022	東海旅客鉄道	236,600	21,710.00	5,136,586,000	貸付有価証券 81,000株(1,200株)
9062	日本通運	236,600	5,760.00	1,362,816,000	貸付有価証券 79,800株
9064	ヤマトホールディングス	2,366,000	2,180.50	5,159,063,000	貸付有価証券 1,005,900株(207,900 株)
9101	日本郵船	236,600	1,811.00	428,482,600	貸付有価証券 179,200株(99,400 株)
9104	商船三井	236,600	2,637.00	623,914,200	貸付有価証券 175,900株(96,100 株)
9107	川崎汽船	236,600	1,398.00	330,766,800	貸付有価証券 181,000株

9202	A N Aホールディングス	236,600	3,654.00	864,536,400	貸付有価証券 120,400株(50,100株)
9301	三菱倉庫	1,183,000	3,020.00	3,572,660,000	貸付有価証券 482,900株(83,900株)
4689	ヤフー	946,400	328.00	310,419,200	貸付有価証券 319,200株
4704	トレンドマイクロ	2,366,000	4,780.00	11,309,480,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	236,600	435.00	102,921,000	貸付有価証券 79,800株
9432	日本電信電話	473,200	5,148.00	2,436,033,600	貸付有価証券 159,600株
9433	K D D I	14,196,000	2,862.50	40,636,050,000	貸付有価証券 4,788,000株
9437	N T T ドコモ	236,600	2,588.50	612,439,100	貸付有価証券 79,800株
9602	東宝	236,600	4,855.00	1,148,693,000	貸付有価証券 79,800株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	11,830,000	1,464.00	17,319,120,000	貸付有価証券 3,990,000株
9766	コナミホールディングス	2,366,000	4,790.00	11,333,140,000	貸付有価証券 1,048,000株
9984	ソフトバンクグループ	14,196,000	5,191.00	73,691,436,000	貸付有価証券 4,788,000株
2768	双日	236,600	348.00	82,336,800	貸付有価証券 79,800株
8001	伊藤忠商事	2,366,000	2,123.50	5,024,201,000	貸付有価証券 798,000株
8002	丸紅	2,366,000	722.00	1,708,252,000	貸付有価証券 798,000株
8015	豊田通商	2,366,000	3,315.00	7,843,290,000	貸付有価証券 798,000株
8031	三井物産	2,366,000	1,815.50	4,295,473,000	貸付有価証券 798,000株
8053	住友商事	2,366,000	1,657.50	3,921,645,000	貸付有価証券 798,000株
8058	三菱商事	2,366,000	2,940.00	6,956,040,000	貸付有価証券 798,000株
3086	J . フロント リテイリング	1,183,000	1,287.00	1,522,521,000	貸付有価証券 739,800株(340,800株)
3099	三越伊勢丹ホールディングス	2,366,000	897.00	2,122,302,000	貸付有価証券 798,000株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	2,366,000	3,796.00	8,981,336,000	貸付有価証券 798,000株
8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	9,464,000	2,548.00	24,114,272,000	貸付有価証券 3,192,000株
8233	高島屋	1,183,000	1,250.00	1,478,750,000	貸付有価証券 505,900株(106,900株)
8252	丸井グループ	2,366,000	2,342.00	5,541,172,000	貸付有価証券 798,000株

8267	イオン	2,366,000	1,887.50	4,465,825,000	貸付有価証券 798,000株
9983	ファーストリテイリング	2,366,000	69,470.00	164,366,020,000	貸付有価証券 798,000株
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	2,366,000	415.00	981,890,000	貸付有価証券 1,792,500株(994,500株)
8303	新生銀行	236,600	1,675.00	396,305,000	貸付有価証券 177,900株(98,100株)
8304	あおぞら銀行	236,600	2,577.00	609,718,200	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,366,000	522.90	1,237,181,400	貸付有価証券 798,000株
8308	りそなホールディングス	236,600	455.00	107,653,000	貸付有価証券 79,800株
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	236,600	3,919.00	927,235,400	貸付有価証券 79,800株
8316	三井住友フィナンシャルグループ	236,600	3,824.00	904,758,400	貸付有価証券 79,800株
8331	千葉銀行	2,366,000	547.00	1,294,202,000	貸付有価証券 798,000株
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	473,200	2,009.00	950,658,800	貸付有価証券 245,900株(86,300株)
8355	静岡銀行	2,366,000	816.00	1,930,656,000	貸付有価証券 1,616,100株(818,100株)
8411	みずほフィナンシャルグループ	2,366,000	158.60	375,247,600	貸付有価証券 798,000株
8601	大和証券グループ本社	2,366,000	475.00	1,123,850,000	貸付有価証券 798,000株
8604	野村ホールディングス	2,366,000	375.60	888,669,600	貸付有価証券 798,000株
8628	松井証券	2,366,000	1,021.00	2,415,686,000	貸付有価証券 969,400株(171,400株)
8630	SOMPOホールディングス	591,500	4,380.00	2,590,770,000	貸付有価証券 199,500株
8725	MS&ADインシュアランスグループホール	709,800	3,564.00	2,529,727,200	貸付有価証券 239,400株
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	473,200	2,591.00	1,226,061,200	貸付有価証券 159,600株
8750	第一生命ホールディングス	236,600	1,632.50	386,249,500	貸付有価証券 79,800株
8766	東京海上ホールディングス	1,183,000	5,658.00	6,693,414,000	貸付有価証券 399,000株
8795	T&Dホールディングス	473,200	1,195.00	565,474,000	貸付有価証券 159,600株
8253	クレディセゾン	2,366,000	1,303.00	3,082,898,000	貸付有価証券 1,370,300株(572,300株)
3289	東急不動産ホールディングス	2,366,000	651.00	1,540,266,000	貸付有価証券 798,000株

8801	三井不動産	2,366,000	2,543.00	6,016,738,000	貸付有価証券 798,000株
8802	三菱地所	2,366,000	2,032.50	4,808,895,000	貸付有価証券 798,000株
8804	東京建物	1,183,000	1,324.00	1,566,292,000	
8830	住友不動産	2,366,000	3,967.00	9,385,922,000	貸付有価証券 798,000株
2432	ディー・エヌ・エー	709,800	2,229.00	1,582,144,200	貸付有価証券 239,400株
4324	電通	2,366,000	3,755.00	8,884,330,000	
4751	サイバーエージェント	473,200	3,880.00	1,836,016,000	貸付有価証券 361,800株
4755	楽天	2,366,000	1,174.00	2,777,684,000	
6098	リクルートホールディングス	7,098,000	3,553.00	25,219,194,000	貸付有価証券 3,694,000株
6178	日本郵政	2,366,000	1,146.00	2,711,436,000	貸付有価証券 798,000株
9681	東京ドーム	1,183,000	1,010.00	1,194,830,000	貸付有価証券 747,400株（348,400株）
9735	セコム	2,366,000	8,885.00	21,021,910,000	貸付有価証券 798,000株
合 計		419,846,700		1,387,790,336,660	

(注1)貸付株式の（ ）内は、委託者の利害関係人である三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

【MAXIS 日経225上場投信】

【純資産額計算書】

令和1年7月31日現在

(単位：円)

資産総額	1,842,359,950,144
------	-------------------

負債総額	455,523,547,494
純資産総額( - )	1,386,836,402,650
発行済口数	62,830,548口
1口当たり純資産価額( / )	22,073

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額等

2019年7月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ・ 会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・ 投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

&lt;更新後&gt;

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2019年7月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	885	13,059,701
追加型公社債投資信託	16	1,155,778
単位型株式投資信託	67	327,853
単位型公社債投資信託	2	11,024
合計	970	14,554,356

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

## 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】

&lt;更新後&gt;

## (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2019年3月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名称	資本金の額 (2019年3月末現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167 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。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 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。
クレディ・スイス証券株式会社	78,100 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。
J P モルガン証券株式会社	73,272 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。

U B S 証券株式会社	32,100 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。
ソシエテ・ジェネラル証券株式 会社	35,765 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。
シティグループ証券株式会社	96,307 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。
大和証券株式会社	100,000 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。
東海東京証券株式会社	6,000 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。
ドイツ証券株式会社	72,728 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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000 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。
野村證券株式会社	10,000 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。
B N P パリバ証券株式会社	102,025 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。
エービーエヌ・アムロ・クリア リング証券株式会社	5,500 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。
マッコーリー・キャピタル・セ キュリティーズ・ジャパン・リ ミテッド	7,350 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。
メリルリンチ日本証券株式会社	83,140 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。
モルガン・スタンレー M U F J 証券株式会社	62,149 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。
三菱UFJモルガン・スタン レー証券株式会社	40,500 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】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2019年1月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581株)を所有しています。

(注)関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2019年7月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

# 独立監査人の監査報告書

令和1年8月21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MAXIS日経225上場投信の平成31年1月17日から令和1年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、独立の立場から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監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MAXIS日経225上場投信の令和1年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に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データは監査の対象に含まれていません。