

**【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29年10月2日
【計算期間】	第7期中（自平成29年1月27日 至平成29年7月26日）
【ファンド名】	e M A X I S バランス（波乗り型）
【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4月25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7月31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	3,547,421,519	95.39
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		171,436,938	4.61
純資産総額		3,718,858,457	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7月31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	新興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		288,192,181	2.3436 2.3998	675,420,606 691,603,595		18.60
日本	TOPIXマザーファンド	親投資信託 受益証券		386,007,240	1.6534 1.6831	638,224,371 649,688,785		17.47
日本	東証REIT指数マザーファ ンド	親投資信託 受益証券		184,797,975	2.7055 2.5812	499,970,922 477,000,533		12.83
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		229,583,797	1.9484 2.0185	447,324,933 463,414,894		12.46
日本	新興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		340,248,594	1.2658 1.3619	430,716,254 463,384,560		12.46
日本	MUAMG-REITマ ザーファンド	親投資信託 受益証券		292,104,112	1.5429 1.5839	450,693,095 462,663,702		12.44
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		100,620,199	2.4118 2.4494	242,683,757 246,459,115		6.63
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		70,771,705	1.3200 1.3170	93,425,143 93,206,335		2.51

(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7月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.39
合計	95.39

(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 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成24年1月26日)	42,391,869 (分配付) 42,391,869 (分配落)	9,968 (分配付) 9,968 (分配落)
第2計算期間末日 (平成25年1月28日)	453,487,264 (分配付) 453,487,264 (分配落)	12,936 (分配付) 12,936 (分配落)
第3計算期間末日 (平成26年1月27日)	1,610,204,563 (分配付) 1,610,204,563 (分配落)	14,869 (分配付) 14,869 (分配落)

第4計算期間末日 (平成27年 1月26日)	3,115,899,802 (分配付) 3,115,899,802 (分配落)	17,596 (分配付) 17,596 (分配落)
第5計算期間末日 (平成28年 1月26日)	3,366,366,211 (分配付) 3,366,366,211 (分配落)	15,707 (分配付) 15,707 (分配落)
第6計算期間末日 (平成29年 1月26日)	3,677,292,631 (分配付) 3,677,292,631 (分配落)	17,175 (分配付) 17,175 (分配落)
平成28年 7月末日	3,548,212,608	16,055
8月末日	3,579,050,930	15,996
9月末日	3,571,396,956	15,838
10月末日	3,631,124,409	16,005
11月末日	3,726,209,572	16,535
12月末日	3,748,169,817	17,256
平成29年 1月末日	3,673,002,735	17,152
2月末日	3,691,558,547	17,350
3月末日	3,706,986,911	17,383
4月末日	3,724,000,326	17,359
5月末日	3,672,319,223	17,510
6月末日	3,703,972,878	17,689
7月末日	3,718,858,457	17,789

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.32
第2計算期間	29.77
第3計算期間	14.94
第4計算期間	18.34
第5計算期間	10.73
第6計算期間	9.34
第6計算期間末日から 平成29年7月末日までの期間	3.57

(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6計算期間末日から平成29年7月末日までの期間については平成29年7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;

## 「TOPIXマザーファンド」

## 投資状況

平成29年7月31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	291,189,808,190	99.21
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,317,136,090	0.79
純資産総額		293,506,944,280	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7月31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)	2,137,740,000	0.73

(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7月31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			
					単価(円)	金額(円)	償還期限(年/月/日)	
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1,504,600	6,125.50 6,234.00	9,216,431,738 9,379,676,400		3.20
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	9,255,900	707.56 700.00	6,549,110,169 6,479,130,000		2.21
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	980,500	4,978.02 5,390.00	4,880,954,246 5,284,895,000		1.80
日本	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	549,800	8,059.99 8,958.00	4,431,386,178 4,925,108,400		1.68
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	978,100	4,161.99 4,195.00	4,070,848,048 4,103,129,500		1.40
日本	ソニー	株式	電気機器	874,400	3,684.51 4,540.00	3,221,738,660 3,969,776,000		1.35
日本	KDDI	株式	情報・通信業	1,193,000	2,971.05 2,920.00	3,544,473,808 3,483,560,000		1.19
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	1,113,700	3,331.55 3,108.00	3,710,356,212 3,461,379,600		1.18
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	16,586,000	206.52 196.40	3,425,474,490 3,257,490,400		1.11
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	768,500	3,764.78 3,834.00	2,893,237,616 2,946,429,000		1.00
日本	キーエンス	株式	電気機器	56,100	44,782.42 51,020.00	2,512,294,290 2,862,222,000		0.98
日本	任天堂	株式	その他製品	76,200	28,201.47 37,480.00	2,148,952,680 2,855,976,000		0.97
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	486,200	5,283.43 5,832.00	2,568,805,320 2,835,518,400		0.97
日本	ファナック	株式	電気機器	125,500	22,608.70 22,565.00	2,837,392,070 2,831,907,500		0.96
日本	キヤノン	株式	電気機器	666,300	3,519.97 3,837.00	2,345,360,298 2,556,593,100		0.87
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	239,400	9,918.67 10,350.00	2,374,530,903 2,477,790,000		0.84
日本	信越化学工業	株式	化学	232,500	9,636.33 10,110.00	2,240,447,520 2,350,575,000		0.80
日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	899,100	2,671.04 2,563.00	2,401,532,088 2,304,393,300		0.79
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	491,900	4,765.22 4,645.00	2,344,012,652 2,284,875,500		0.78
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	511,200	4,417.22 4,445.00	2,258,083,476 2,272,284,000		0.77
日本	三菱電機	株式	電気機器	1,320,200	1,606.13 1,710.50	2,120,413,390 2,258,202,100		0.77
日本	日立製作所	株式	電気機器	2,972,000	618.75 759.60	1,838,933,200 2,257,531,200		0.77
日本	村田製作所	株式	電気機器	129,800	15,685.25 17,180.00	2,035,946,720 2,229,964,000		0.76
日本	三菱商事	株式	卸売業	916,500	2,405.53 2,396.50	2,204,669,075 2,196,392,250		0.75
日本	パナソニック	株式	電気機器	1,421,300	1,246.05 1,521.00	1,771,012,910 2,161,797,300		0.74
日本	花王	株式	化学	304,700	6,228.21 6,714.00	1,897,735,587 2,045,755,800		0.70
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	437,400	4,533.26 4,657.00	1,982,850,615 2,036,971,800		0.69
日本	ダイキン工業	株式	機械	169,000	11,130.03 11,700.00	1,880,976,008 1,977,300,000		0.67
日本	日本電産	株式	電気機器	160,400	10,378.23 12,160.00	1,664,669,360 1,950,464,000		0.66
日本	東海旅客鉄道	株式	陸運業	102,900	18,499.66 17,750.00	1,903,615,444 1,826,475,000		0.62

(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7月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
--------	---------

株式	水産・農林業	0.11
	鉱業	0.31
	建設業	3.19
	食料品	4.52
	繊維製品	0.70
	パルプ・紙	0.25
	化学	7.01
	医薬品	4.50
	石油・石炭製品	0.50
	ゴム製品	0.95
	ガラス・土石製品	0.98
	鉄鋼	1.28
	非鉄金属	0.97
	金属製品	0.70
	機械	5.19
	電気機器	13.30
	輸送用機器	8.62
	精密機器	1.61
	その他製品	2.11
	電気・ガス業	1.78
	陸運業	4.06
	海運業	0.22
	空運業	0.56
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.93
	卸売業	4.41
	小売業	4.58
	銀行業	7.67
	証券、商品先物取引業	1.09
	保険業	2.46
	その他金融業	1.27
不動産業	2.38	
サービス業	3.82	
合計	99.21	

(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7月31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09月限	大阪取引所	買建	132	2,135,926,280	2,137,740,000	0.73

(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。

&lt; 参考 &gt;

## 「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7月31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	208,877,509,036	61.31
	イギリス	23,817,300,888	6.99
	フランス	12,871,958,635	3.78
	カナダ	12,859,357,052	3.77
	ドイツ	12,636,525,003	3.71
	スイス	11,236,599,705	3.30
	オーストラリア	8,901,203,958	2.61
	オランダ	5,526,169,313	1.62
	スペイン	4,843,526,985	1.42
	香港	4,198,387,193	1.23
	スウェーデン	3,890,279,794	1.14
	イタリア	2,743,752,326	0.81
	デンマーク	2,467,685,612	0.72
	シンガポール	1,663,811,843	0.49
	ベルギー	1,632,434,364	0.48
	フィンランド	1,377,498,982	0.40
	ノルウェー	903,637,866	0.27
	アイルランド	570,590,685	0.17
	ルクセンブルグ	406,911,476	0.12
	オーストリア	343,982,602	0.10
イスラエル	337,269,889	0.10	
ニュージーランド	228,057,237	0.07	
ポルトガル	205,195,753	0.06	
投資証券	アメリカ	6,451,558,252	1.89
	オーストラリア	752,522,961	0.22
	フランス	443,306,119	0.13
	イギリス	328,449,887	0.10
	香港	174,712,504	0.05
	シンガポール	146,888,234	0.04
	カナダ	67,827,235	0.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		9,761,634,945	2.88
純資産総額		340,666,546,334	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7月31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）	9,714,037,058	2.85

（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7月31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)		
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	457,992	16,929.89 16,497.32	7,753,791,558 7,555,642,871		2.22
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	640,768	7,562.28 8,059.96	4,845,722,531 5,164,567,012		1.52

アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	35,408	104,814.84 112,561.41	3,711,313,306 3,985,574,546		1.17
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・サービス	205,565	16,570.15 19,029.85	3,406,364,559 3,911,872,656		1.15
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	236,806	13,656.91 14,549.64	3,234,290,778 3,445,443,825		1.01
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	362,025	9,102.77 8,783.86	3,295,711,133 3,179,976,916		0.93
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	312,341	9,645.69 10,072.74	3,013,048,477 3,146,132,183		0.92
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	27,235	102,689.50 103,897.83	2,796,778,334 2,829,657,549		0.83
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	25,954	105,472.53 105,751.71	2,737,446,357 2,744,680,024		0.81
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	271,596	9,220.75 9,321.15	2,504,590,592 2,531,587,870		0.74
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	415,987	5,936.83 5,881.65	2,469,873,016 2,446,692,018		0.72
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	875,091	2,657.22 2,651.71	2,325,523,647 2,320,487,993		0.68
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	535,848	4,234.12 4,303.65	2,269,376,646 2,306,102,245		0.68
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	223,074	9,520.99 9,954.67	2,124,024,027 2,220,628,836		0.65
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	761,579	3,171.45 2,817.23	2,415,983,677 2,145,547,394		0.63
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	108,150	18,062.08 19,200.90	1,953,493,217 2,076,577,335		0.61
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	165,287	11,704.82 11,931.04	1,934,781,017 1,972,046,139		0.58
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	519,433	3,648.17 3,658.10	1,895,343,990 1,900,139,155		0.56
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	355,879	5,066.16 5,290.17	1,803,038,197 1,882,663,612		0.55
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,733,375	985.59 1,077.77	1,709,157,302 1,868,186,229		0.55
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	194,868	9,008.54 9,315.44	1,755,675,214 1,815,282,818		0.53
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	356,001	4,824.50 5,077.20	1,717,659,766 1,807,489,523		0.53
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	412,992	4,330.13 4,361.03	1,788,699,575 1,801,071,327		0.53
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	241,881	6,734.66 7,440.90	1,629,093,186 1,799,812,453		0.53
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	162,200	10,174.27 10,941.20	1,650,402,267 1,774,663,045		0.52
アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	84,010	19,207.52 21,093.40	1,613,691,265 1,772,056,744		0.52
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	135,443	12,312.85 13,077.57	1,667,838,808 1,771,266,464		0.52
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	106,356	17,220.11 16,340.62	1,831,471,787 1,737,923,831		0.51
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	240,647	7,105.43 7,074.53	1,710,128,287 1,702,466,466		0.50
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	61,322	30,360.48 27,666.82	1,861,834,551 1,696,585,042		0.50

(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7月31日現在

種類 / 業種別		投資比率(%)
株式	エネルギー	6.41
	素材	4.71
	資本財	7.34
	商業・専門サービス	0.96
	運輸	1.90
	自動車・自動車部品	1.41
	耐久消費財・アパレル	1.73
	消費者サービス	1.79
	メディア	2.52
	小売	3.76
	食品・生活必需品小売り	1.74

食品・飲料・タバコ	5.49
家庭用品・パーソナル用品	2.12
ヘルスケア機器・サービス	4.02
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.37
銀行	9.57
各種金融	4.25
保険	4.23
不動産	0.61
ソフトウェア・サービス	9.60
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.78
電気通信サービス	2.68
公益事業	3.19
半導体・半導体製造装置	2.52
小計	94.68
投資証券	2.46
合計	97.13

(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7月31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9月限)	シカゴ商業取引所	買建	463	アメリカドル	56,446,737.13	57,186,287.50	6,310,506,825	1.85
FTSE100 (2017年9月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	65	イギリスポンド	4,762,402.50	4,744,350.00	687,646,089	0.20
SP/TSE60 (2017年9月限)	モントリオール取引所	買建	26	カナダドル	4,618,477.50	4,610,320.00	407,828,907	0.12
SPI 200 (2017年9月限)	シドニー先物取引所	買建	38	オーストラリアドル	5,423,302.00	5,352,300.00	470,467,170	0.14
EURO ST (2017年9月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	339	ユーロ	11,798,072.25	11,715,840.00	1,518,958,656	0.45
SWISS IX (2017年9月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	31	スイスフラン	2,773,566.25	2,792,790.00	318,629,411	0.09

(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。



&lt; 参考 &gt;

「新興国株式インデックスマザーファンド」

投資状況

平成29年7月31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	香港	11,018,258,468	20.21
	韓国	7,986,930,271	14.65
	台湾	6,341,565,971	11.63
	アメリカ	5,930,468,547	10.88
	インド	4,777,126,086	8.76
	ブラジル	3,644,684,886	6.68
	南アフリカ	3,387,325,274	6.21
	メキシコ	1,876,842,080	3.44
	インドネシア	1,223,000,119	2.24
	マレーシア	1,211,625,720	2.22
	タイ	1,093,885,874	2.01
	ポーランド	695,382,751	1.28
	チリ	616,438,816	1.13
	フィリピン	609,742,276	1.12
	トルコ	597,754,422	1.10
	アラブ首長国連邦	320,504,426	0.59
	カタール	313,238,720	0.57
	コロンビア	244,180,420	0.45
	ギリシャ	195,725,116	0.36
	ハンガリー	174,725,556	0.32
チェコ	100,424,011	0.18	
投資証券	南アフリカ	173,210,499	0.32
	メキシコ	53,353,277	0.10
	トルコ	16,955,325	0.03
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,923,314,608	3.52
純資産総額		54,526,663,519	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7月31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）	1,937,850,832	3.55

（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7月31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)		
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・サービス	552,000	3,648.50 4,306.82	2,014,010,841 2,377,366,848		4.36
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,502	225,355.84 234,501.60	2,141,331,837 2,228,234,203		4.09
アメリカ	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	ソフトウェア・サービス	109,622	13,563.11 17,386.74	1,486,848,211 1,905,969,870		3.50
台湾	TAIWAN SEMI CONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	2,388,000	759.41 777.45	1,813,579,376 1,856,550,600		3.40
南アフリカ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	42,427	22,800.09 24,169.95	967,341,070 1,025,458,485		1.88
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	8,154,550	89.86 91.42	733,763,181 745,497,931		1.37

香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信サービス	594,500	1,202.18 1,179.14	714,723,398 701,003,783		1.29
台湾	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	1,507,840	383.32 428.87	577,997,421 646,674,880		1.19
アメリカ	BAIDU INC - SPON ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	26,400	20,663.03 24,277.00	545,518,461 640,912,800		1.18
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	7,129,350	72.34 76.58	516,105,668 545,998,418		1.00
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	145,682	2,720.97 3,088.65	396,399,179 449,961,510		0.83
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	7,665,000	53.41 53.55	409,624,039 410,481,445		0.75
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	株式	銀行	312,987	1,392.28 1,307.03	435,825,952 409,084,337		0.75
香港	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	株式	保険	500,500	658.17 808.23	329,419,622 404,522,118		0.74
韓国	SK HYNIX INC	株式	半導体・ 半導体製造装置	56,267	5,637.56 6,343.72	317,210,584 356,942,093		0.65
インド	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	エネルギー	125,414	2,381.76 2,758.39	298,706,596 345,941,789		0.63
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS- PREF	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	1,715	171,743.15 188,544.00	294,539,585 323,352,960		0.59
アメリカ	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	株式	銀行	248,956	1,336.33 1,298.81	332,728,962 323,348,907		0.59
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信サービス	3,229,300	89.73 98.67	289,941,983 318,657,313		0.58
アメリカ	JD.COM INC-ADR	株式	小売	63,100	4,411.79 4,990.02	278,443,705 314,870,703		0.58
ブラジル	AMBEV SA	株式	食品・飲料・ タバコ	455,900	686.28 672.89	312,956,930 306,771,918		0.56
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	292,299	1,109.74 1,048.09	324,405,875 306,356,389		0.56
インド	INFOSYS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	177,051	1,641.16 1,725.41	290,571,516 305,486,539		0.56
アメリカ	NETEASE INC-ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	7,700	30,825.16 34,626.72	237,359,172 266,625,794		0.49
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	712,000	345.05 349.01	245,737,197 248,495,832		0.46
アメリカ	CTIP.COM INTERNATIONAL-ADR	株式	小売	36,000	6,008.55 6,588.99	216,341,658 237,203,946		0.44
韓国	POSCO	株式	素材	7,083	26,920.05 32,160.50	190,675,390 227,792,821		0.42
アメリカ	GAZPROM PAO -SPON ADR	株式	エネルギー	524,340	493.26 427.05	259,022,636 223,921,756		0.41
韓国	KB FINANCIAL GROUP INC	株式	銀行	38,309	5,329.11 5,754.52	204,156,790 220,449,906		0.40
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	14,638	15,407.58 14,680.90	225,536,616 214,899,014		0.39

(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7月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	6.29
	素材	6.95
	資本財	3.67
	商業・専門サービス	0.10
	運輸	1.68
	自動車・自動車部品	3.27
	耐久消費財・アパレル	1.19
	消費者サービス	1.17
	メディア	2.41
	小売	2.19
	食品・生活必需品小売り	1.70
	食品・飲料・タバコ	3.50
	家庭用品・パーソナル用品	1.16
	ヘルスケア機器・サービス	0.54
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.69
	銀行	16.65
	各種金融	2.72
	保険	3.40
	不動産	2.18
	ソフトウェア・サービス	12.20
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.63	

	電気通信サービス	5.09
	公益事業	2.49
	半導体・半導体製造装置	5.14
	小計	96.03
投資証券		0.45
合計		96.47

（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7月31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								
MINI MS (2017年9月限)	ニューヨーク証券 取引所	買建	330	アメリカ ドル	17,386,815.00	17,560,950.00	1,937,850,832	3.55

（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>

「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7月31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	359,523,179,830	82.84
地方債証券	日本	23,965,344,042	5.52
特殊債券	日本	31,304,457,489	7.21
社債券	日本	20,089,643,530	4.63
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		872,920,789	0.20
純資産総額		434,009,704,102	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7月31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）	600,640,000	0.14

（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7月31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124回利付国債(5年)	国債証券		4,930,000	100.79	4,969,094,900	0.100000 2020/06/20	1.14
					100.5490	4,957,065,700		
日本	第329回利付国債(10年)	国債証券		4,620,000	105.48	4,873,499,400	0.800000 2023/06/20	1.12
					104.9830	4,850,214,600		
日本	第130回利付国債(5年)	国債証券		4,700,000	101.13	4,753,239,000	0.100000 2021/12/20	1.09
					100.7250	4,734,075,000		
日本	第333回利付国債(10年)	国債証券		4,180,000	104.65	4,374,664,200	0.600000 2024/03/20	1.00
					104.1500	4,353,470,000		
日本	第339回利付国債(10年)	国債証券		4,090,000	103.40	4,229,060,000	0.400000 2025/06/20	0.97
					103.0710	4,215,603,900		
日本	第340回利付国債(10年)	国債証券		3,870,000	103.44	4,003,258,600	0.400000 2025/09/20	0.92
					103.1270	3,991,014,900		
日本	第342回利付国債(10年)	国債証券		3,930,000	100.83	3,962,619,000	0.100000 2026/03/20	0.91
					100.5590	3,951,968,700		
日本	第325回利付国債(10年)	国債証券		3,735,000	104.89	3,917,796,500	0.800000 2022/09/20	0.90
					104.4020	3,899,414,700		

日本	第122回利付国債（5年）	国債証券	3,770,000	100.67 100.4650	3,795,420,600 3,787,530,500	0.100000 2019/12/20	0.87
日本	第332回利付国債（10年）	国債証券	3,610,000	104.54 104.0290	3,774,038,400 3,755,446,900	0.600000 2023/12/20	0.87
日本	第338回利付国債（10年）	国債証券	3,580,000	103.38 103.0520	3,701,004,000 3,689,261,600	0.400000 2025/03/20	0.85
日本	第115回利付国債（5年）	国債証券	3,670,000	100.52 100.3570	3,689,084,000 3,683,101,900	0.200000 2018/09/20	0.85
日本	第128回利付国債（5年）	国債証券	3,650,000	100.98 100.6610	3,685,770,000 3,674,126,500	0.100000 2021/06/20	0.85
日本	第125回利付国債（5年）	国債証券	3,600,000	100.82 100.5650	3,629,658,000 3,620,340,000	0.100000 2020/09/20	0.83
日本	第117回利付国債（5年）	国債証券	3,570,000	100.71 100.5140	3,595,418,400 3,588,349,800	0.200000 2019/03/20	0.83
日本	第123回利付国債（5年）	国債証券	3,560,000	100.72 100.5000	3,585,790,200 3,577,800,000	0.100000 2020/03/20	0.82
日本	第346回利付国債（10年）	国債証券	3,450,000	100.56 100.3340	3,469,626,000 3,461,523,000	0.100000 2027/03/20	0.80
日本	第345回利付国債（10年）	国債証券	3,370,000	100.62 100.4200	3,390,894,000 3,384,154,000	0.100000 2026/12/20	0.78
日本	第344回利付国債（10年）	国債証券	3,210,000	100.69 100.4540	3,232,149,000 3,224,573,400	0.100000 2026/09/20	0.74
日本	第328回利付国債（10年）	国債証券	3,100,000	104.11 103.6690	3,227,534,000 3,213,739,000	0.600000 2023/03/20	0.74
日本	第334回利付国債（10年）	国債証券	3,050,000	104.81 104.2720	3,196,705,000 3,180,296,000	0.600000 2024/06/20	0.73
日本	第313回利付国債（10年）	国債証券	2,969,000	105.56 104.9850	3,134,224,850 3,117,004,650	1.300000 2021/03/20	0.72
日本	第310回利付国債（10年）	国債証券	2,886,000	103.85 103.3930	2,997,168,720 2,983,921,980	1.000000 2020/09/20	0.69
日本	第126回利付国債（5年）	国債証券	2,960,000	100.90 100.5930	2,986,758,400 2,977,552,800	0.100000 2020/12/20	0.69
日本	第312回利付国債（10年）	国債証券	2,830,000	104.78 104.3250	2,965,538,000 2,952,397,500	1.200000 2020/12/20	0.68
日本	第127回利付国債（5年）	国債証券	2,870,000	100.94 100.6370	2,896,978,000 2,888,281,900	0.100000 2021/03/20	0.67
日本	第335回利付国債（10年）	国債証券	2,750,000	104.09 103.6410	2,862,475,000 2,850,127,500	0.500000 2024/09/20	0.66
日本	第341回利付国債（10年）	国債証券	2,770,000	102.62 102.3000	2,842,657,100 2,833,710,000	0.300000 2025/12/20	0.65
日本	第299回利付国債（10年）	国債証券	2,760,000	102.73 102.3100	2,835,541,200 2,823,756,000	1.300000 2019/03/20	0.65
日本	第343回利付国債（10年）	国債証券	2,810,000	100.78 100.4860	2,832,149,000 2,823,656,600	0.100000 2026/06/20	0.65

（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7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	82.84
地方債証券	5.52
特殊債券	7.21
社債券	4.63
合計	100.20

（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7月31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09月限	大阪取引所	買建	4	600,644,320	600,640,000	0.14

（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7月31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	54,339,076,010	42.48
	フランス	12,850,830,470	10.05
	イタリア	12,429,712,087	9.72
	ドイツ	9,212,436,794	7.20
	イギリス	9,072,968,440	7.09
	スペイン	7,299,992,141	5.71
	ベルギー	3,180,159,845	2.49
	オランダ	2,871,811,702	2.24
	オーストラリア	2,791,303,707	2.18
	カナダ	2,666,095,011	2.08
	オーストリア	1,932,100,937	1.51
	メキシコ	1,113,989,358	0.87
	アイルランド	1,050,593,292	0.82
	ポーランド	873,330,341	0.68
	フィンランド	794,726,709	0.62
	デンマーク	791,334,825	0.62
	南アフリカ	688,516,831	0.54
	スウェーデン	612,055,726	0.48
	マレーシア	522,849,377	0.41
	シンガポール	495,641,394	0.39
ノルウェー	376,338,715	0.29	
スイス	227,377,423	0.18	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		1,728,491,753	1.35
純資産総額		127,921,732,888	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7月31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	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		6,900,000.00	10,883.82 10,997.9292	750,983,614 758,857,121	2.125000 2025/05/15	0.59
アメリカ	2.25 T-NOTE 270215	国債証券		5,850,000.00	10,907.00 11,003.9640	638,060,068 643,731,897	2.250000 2027/02/15	0.50
アメリカ	1.5 T-NOTE 260815	国債証券		5,550,000.00	10,223.97 10,352.2093	567,430,486 574,547,620	1.500000 2026/08/15	0.45
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券		4,800,000.00	11,436.67 11,513.4707	548,960,352 552,646,593	2.750000 2023/11/15	0.43
アメリカ	2 T-NOTE 261115	国債証券		4,950,000.00	10,676.76 10,785.8503	528,499,917 533,899,593	2.000000 2026/11/15	0.42
アメリカ	2.25 T-NOTE 241115	国債証券		4,650,000.00	11,026.95 11,127.2457	512,753,371 517,416,923	2.250000 2024/11/15	0.40
アメリカ	2.5 T-NOTE 240515	国債証券		4,550,000.00	11,243.56 11,335.8761	511,582,048 515,782,365	2.500000 2024/05/15	0.40
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		3,150,000.00	16,344.27 16,288.2536	514,844,655 513,079,989	4.250000 2023/10/25	0.40
フランス	3 O.A.T 220425	国債証券		3,200,000.00	14,945.13 14,892.8955	478,244,363 476,572,656	3.000000 2022/04/25	0.37
アメリカ	0.75 T-NOTE 180831	国債証券		4,300,000.00	10,964.31 10,975.0833	471,465,439 471,928,584	0.750000 2018/08/31	0.37
アメリカ	3 T-BOND 470215	国債証券		4,100,000.00	10,952.23 11,268.6316	449,041,737 462,013,896	3.000000 2047/02/15	0.36
フランス	3.25 O.A.T 211025	国債証券		3,100,000.00	14,937.76 14,883.8200	463,070,788 461,398,420	3.250000 2021/10/25	0.36
アメリカ	2.25 T-NOTE 251115	国債証券		4,150,000.00	10,947.82 11,064.3117	454,334,675 459,168,935	2.250000 2025/11/15	0.36
イタリア	4.75 ITALY GOVT 210901	国債証券		3,000,000.00	15,176.88 15,161.0894	455,306,425 454,832,684	4.750000 2021/09/01	0.36
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券		4,000,000.00	11,138.45 11,236.7335	445,538,125 449,469,343	2.375000 2024/08/15	0.35
アメリカ	2.75 T-NOTE 240215	国債証券		3,900,000.00	11,430.91 11,511.7464	445,805,874 448,958,112	2.750000 2024/02/15	0.35
アメリカ	2.125 T-NOTE 210815	国債証券		4,000,000.00	11,174.44 11,216.9050	446,977,971 448,676,202	2.125000 2021/08/15	0.35

フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		2,200,000.00	20,061.73 20,353.7016	441,358,263 447,781,436	4.500000 2041/04/25	0.35
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		2,750,000.00	16,162.31 16,179.5939	444,463,692 444,938,833	3.500000 2026/04/25	0.35
フランス	2.5 O.A.T 300525	国債証券		2,900,000.00	15,067.66 15,145.7389	436,962,156 439,226,428	2.500000 2030/05/25	0.34
アメリカ	1.125 T-NOTE 200430	国債証券		4,000,000.00	10,904.82 10,937.5816	436,192,859 437,503,265	1.125000 2020/04/30	0.34
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		4,000,000.00	10,806.57 10,917.7531	432,263,020 436,710,125	2.000000 2025/02/15	0.34
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券		2,900,000.00	15,040.69 14,955.5164	436,180,198 433,709,977	3.750000 2021/04/25	0.34
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券		3,800,000.00	11,388.12 11,404.8449	432,748,560 433,384,106	2.625000 2020/11/15	0.34
アメリカ	1.625 T-NOTE 260215	国債証券		4,100,000.00	10,383.93 10,514.2859	425,741,335 431,085,723	1.625000 2026/02/15	0.34
アメリカ	1.75 T-NOTE 211130	国債証券		3,900,000.00	11,042.36 11,035.0000	430,652,130 430,365,000	1.750000 2021/11/30	0.34
フランス	5.75 O.A.T 321025	国債証券		2,000,000.00	21,096.80 21,163.2881	421,936,071 423,265,762	5.750000 2032/10/25	0.33
アメリカ	1.5 T-NOTE 200615	国債証券		3,800,000.00	11,021.86 11,039.7415	418,830,997 419,510,180	1.500000 2020/06/15	0.33
アメリカ	6.25 T-BOND 230815	国債証券		2,900,000.00	13,730.81 13,735.9886	398,193,663 398,343,671	6.250000 2023/08/15	0.31
フランス	4.75 O.A.T 350425	国債証券		2,000,000.00	19,766.43 19,911.6470	395,328,780 398,232,940	4.750000 2035/04/25	0.31

(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7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.65
合計	98.65

(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。

&lt; 参考 &gt;

「新興国債券インデックスマザーファンド」

投資状況

平成29年7月31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	ブラジル	1,432,572,710	10.00
	メキシコ	1,411,675,657	9.85
	インドネシア	1,307,473,975	9.13
	ポーランド	1,306,167,444	9.12
	南アフリカ	1,159,173,810	8.09
	トルコ	1,075,164,187	7.51
	タイ	1,065,382,300	7.44
	コロンビア	968,081,627	6.76
	ロシア	855,457,382	5.97
	マレーシア	837,801,600	5.85
	ハンガリー	635,899,937	4.44
	チェコ	476,681,976	3.33
	ルーマニア	403,919,576	2.82
	ペルー	306,995,118	2.14
	チリ	260,625,051	1.82
アルゼンチン	157,142,100	1.10	
フィリピン	47,072,740	0.33	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		617,705,568	4.30
純資産総額		14,324,992,758	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7月31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)		
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	国債証券		9,400,000.00	3,518.30 3,635.8945	330,720,477 341,774,086	10.000000 2021/01/01	2.39
チリ	5.5 CHILE (GL) 200805	国債証券		1,450,000,000.00	17.94 17.9741	260,258,460 260,625,051	5.500000 2020/08/05	1.82
ブラジル	BRAZIL-LTN 190101	国債証券		7,700,000.00	2,972.07 3,157.5803	228,849,820 243,133,686	2019/01/01	1.70
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	国債証券		5,850,000.00	3,489.42 3,599.8542	204,131,614 210,591,473	10.000000 2023/01/01	1.47
南アフリカ	10.5 SOUTH AFRICA 261221	国債証券		21,400,000.00	946.43 951.8715	202,537,395 203,700,505	10.500000 2026/12/21	1.42
コロンビア	10 TITULOS DE TES 240724	国債証券		4,350,000,000.00	4.40 4.4036	191,761,966 191,558,451	10.000000 2024/07/24	1.34
メキシコ	10 MEXICAN BONOS 241205	国債証券		25,400,000.00	713.15 736.5743	181,141,725 187,089,874	10.000000 2024/12/05	1.31
タイ	3.875 THAILAND 190613	国債証券		51,800,000.00	347.60 345.3528	180,060,803 178,892,761	3.875000 2019/06/13	1.25
メキシコ	6.5 MEXICAN BONOS 210610	国債証券		28,000,000.00	603.57 617.1373	169,000,185 172,798,466	6.500000 2021/06/10	1.21
タイ	3.65 THAILAND 211217	国債証券		48,200,000.00	353.87 357.1195	170,566,352 172,131,618	3.650000 2021/12/17	1.20
インドネシア	8.375 INDONESIA 240315	国債証券		18,000,000,000.00	0.87 0.8961	156,972,920 161,315,098	8.375000 2024/03/15	1.13
インドネシア	8.375 INDONESIA 260915	国債証券		16,930,000,000.00	0.87 0.8976	148,622,331 151,971,298	8.375000 2026/09/15	1.06
ポーランド	3.25 POLAND 190725	国債証券		4,700,000.00	3,116.18 3,133.4202	146,460,818 147,270,749	3.250000 2019/07/25	1.03
コロンビア	7.5 TITULOS DE TE 260826	国債証券		3,700,000,000.00	3.88 3.8682	143,808,696 143,126,217	7.500000 2026/08/26	1.00
タイ	4.875 THAILAND 290622	国債証券		35,000,000.00	393.34 405.3452	137,672,464 141,870,836	4.875000 2029/06/22	0.99
メキシコ	5 MEXICAN BONOS 191211	国債証券		23,700,000.00	589.13 598.2527	139,623,876 141,785,906	5.000000 2019/12/11	0.99

タイ	3.85 THAILAND 251212	国債証券		38,500,000.00	362.76 368.2649	139,664,219 141,782,014	3.850000 2025/12/12	0.99
ポーランド	2.5 POLAND 260725	国債証券		4,600,000.00	2,743.98 2,877.7085	126,223,498 132,374,591	2.500000 2026/07/25	0.92
インドネシア	8.25 INDONESIA 210715	国債証券		15,000,000,000.00	0.85 0.8733	128,980,630 131,005,125	8.250000 2021/07/15	0.91
ポーランド	1.75 POLAND 210725	国債証券		4,400,000.00	2,902.22 2,974.7236	127,698,067 130,887,838	1.750000 2021/07/25	0.91
ブラジル	BRAZIL-LTN 200101	国債証券		4,500,000.00	2,727.18 2,878.8088	122,723,238 129,546,399	2020/01/01	0.90
南アフリカ	8.75 SOUTH AFRICA 480228	国債証券		16,800,000.00	786.17 759.8080	132,076,573 127,647,744	8.750000 2048/02/28	0.89
ブラジル	10 (IN)BRAZIL NTN 250101	国債証券		3,550,000.00	3,412.43 3,577.8672	121,141,287 127,014,285	10.000000 2025/01/01	0.89
ルーマニア	5.75 ROMANIA GOVE 200429	国債証券		4,000,000.00	3,177.75 3,158.5703	127,110,155 126,342,815	5.750000 2020/04/29	0.88
メキシコ	8 MEXICAN BONOS 200611	国債証券		18,500,000.00	636.71 642.0953	117,792,056 118,787,643	8.000000 2020/06/11	0.83
タイ	3.625 THAILAND 230616	国債証券		32,200,000.00	354.09 359.9995	114,018,972 115,919,862	3.625000 2023/06/16	0.81
メキシコ	7.75 MEXICAN BONO 421113	国債証券		17,500,000.00	606.26 661.7500	106,096,295 115,806,253	7.750000 2042/11/13	0.81
インドネシア	9 INDONESIA 290315	国債証券		12,100,000,000.00	0.90 0.9443	109,459,736 114,265,839	9.000000 2029/03/15	0.80
ブラジル	BRAZIL-LTN 190701	国債証券		3,700,000.00	2,774.70 3,022.7727	102,663,926 111,842,591	2019/07/01	0.78
ブラジル	10 (IN)BRAZIL NT 270101	国債証券		3,120,000.00	3,467.72 3,562.7183	108,192,956 111,156,811	10.000000 2027/01/01	0.78

（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7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	95.69
合計	95.69

（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 >

#### 「東証REIT指数マザーファンド」 投資状況

平成29年7月31日現在  
(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	日本	16,546,164,900	97.93
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		349,880,332	2.07
純資産総額		16,896,045,232	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7月31日現在  
(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引 (買建)	350,200,000	2.07

（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7月31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	日本ビルファンド投資法人	投資証券	
日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券		2,043	633,381.85 579,000	1,293,999,135 1,182,897,000		7.00
日本	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券		6,201	173,288.05 156,300	1,074,559,241 969,216,300		5.74
日本	日本リテールファンド投資法人	投資証券		4,158	237,715.88 210,600	988,422,644 875,674,800		5.18
日本	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券		4,768	178,246.93 164,400	849,881,386 783,859,200		4.64
日本	オリックス不動産投資法人	投資証券		4,170	181,428.20 167,400	756,555,630 698,058,000		4.13
日本	大和ハウスリート投資法人	投資証券		2,223	282,422.25 273,200	627,824,673 607,323,600		3.59
日本	日本プロロジスリート投資法人	投資証券		2,529	238,533.47 232,500	603,251,167 587,992,500		3.48
日本	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券		1,365	452,358.13 414,500	617,468,853 565,792,500		3.35
日本	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券		2,001	295,577.39 269,400	591,450,366 539,069,400		3.19
日本	ジャパン・ホテル・リート投資法人	投資証券		6,239	77,951.49 79,700	486,339,359 497,248,300		2.94
日本	アクティビア・プロパティーズ投資法人	投資証券		934	549,246.85 495,500	512,996,558 462,797,000		2.74
日本	GLP投資法人	投資証券		3,784	127,221.30 120,000	481,405,409 454,080,000		2.69
日本	ケネディクス・オフィス投資法人	投資証券		632	653,530.96 623,000	413,031,570 393,736,000		2.33
日本	フロンティア不動産投資法人	投資証券		735	504,193.66 471,500	370,582,343 346,552,500		2.05
日本	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券		718	495,059.20 458,000	355,452,512 328,844,000		1.95
日本	森ヒルズリート投資法人	投資証券		2,322	154,252.44 138,900	358,174,168 322,525,800		1.91
日本	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券		1,373	238,001.83 224,000	326,776,524 307,552,000		1.82
日本	産業ファンド投資法人	投資証券		587	525,396.45 499,000	308,407,717 292,913,000		1.73
日本	森トラスト総合リート投資法人	投資証券		1,545	180,794.65 182,800	279,327,744 282,426,000		1.67
日本	大和証券オフィス投資法人	投資証券		466	577,911.63 543,000	269,306,823 253,038,000		1.50
日本	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券		1,936	140,286.35 128,800	271,594,381 249,356,800		1.48
日本	ヒューリックリート投資法人	投資証券		1,386	192,527.28 173,700	266,842,812 240,748,200		1.42
日本	インヴィンシブル投資法人	投資証券		4,820	52,180.41 49,400	251,509,580 238,108,000		1.41
日本	イオンリート投資法人	投資証券		1,897	125,821.62 120,900	238,683,617 229,347,300		1.36
日本	プレミア投資法人	投資証券		1,952	129,398.12 112,500	252,585,146 219,600,000		1.30
日本	日本賃貸住宅投資法人	投資証券		2,431	82,725.40 82,100	201,105,454 199,585,100		1.18
日本	東急リアル・エステート投資法人	投資証券		1,449	141,759.16 134,200	205,409,035 194,455,800		1.15
日本	ケネディクス商業リート投資法人	投資証券		786	265,441.95 241,900	208,637,376 190,133,400		1.13
日本	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	投資証券		1,639	124,240.85 114,600	203,630,764 187,829,400		1.11

(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7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資証券	97.93
合計	97.93

(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7月31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(%)
不動産投信指数先物取引						
東証REIT 17年09月限	大阪取引所	買建	206	339,800,248	350,200,000	2.07

(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。

## &lt;参考&gt;

## 「MUAMG-REITマザーファンド」

## 投資状況

平成29年7月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	12,483,097,946	70.53
	オーストラリア	1,394,630,356	7.88
	イギリス	984,285,576	5.56
	フランス	782,112,823	4.42
	シンガポール	565,937,472	3.20
	香港	368,943,767	2.08
	カナダ	325,770,478	1.84
	スペイン	159,380,394	0.90
	ベルギー	140,917,536	0.80
	ニュージーランド	88,122,149	0.50
	オランダ	84,995,788	0.48
	アイルランド	47,061,506	0.27
	ドイツ	37,148,339	0.21
	イタリア	18,096,872	0.10
イスラエル	9,784,530	0.06	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		208,825,601	1.17
純資産総額		17,699,111,133	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7月31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)		
アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券		43,344	20,156.53 17,713.38	873,664,679 767,768,829		4.34
アメリカ	PROLOGIS INC	投資証券		73,634	5,910.34 6,792.04	435,202,417 500,125,257		2.83
アメリカ	PUBLIC STORAGE	投資証券		20,761	24,785.71 22,383.39	514,576,197 464,701,642		2.63
アメリカ	WELLTOWER INC	投資証券		50,832	7,401.17 8,063.27	376,216,502 409,872,369		2.32
アメリカ	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券		19,131	19,646.71 21,242.37	375,861,285 406,387,876		2.30
フランス	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券		13,782	28,910.65 27,673.79	398,446,626 381,400,208		2.15
アメリカ	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券		50,959	7,086.67 7,471.79	361,129,973 380,755,379		2.15
アメリカ	VENTAS INC	投資証券		49,178	6,929.97 7,406.69	340,802,556 364,246,299		2.06
アメリカ	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券		21,358	14,450.33 13,499.11	308,630,201 288,314,108		1.63
香港	LINK REIT	投資証券		307,000	726.70 902.90	223,098,711 277,192,449		1.57
アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券		22,156	11,366.04 12,489.41	251,826,203 276,715,434		1.56

オーストラリア	SCENTRE GROUP	投資証券	739,225	399.94 360.39	295,649,342 266,409,297		1.51
アメリカ	ESSEX PROPERTY TRUST INC	投資証券	9,109	25,578.02 29,205.23	232,990,243 266,030,449		1.50
アメリカ	REALTY INCOME CORP	投資証券	37,910	6,434.50 6,312.02	243,932,217 239,288,678		1.35
アメリカ	HCP INC	投資証券	64,796	3,362.36 3,512.44	217,867,770 227,592,094		1.29
アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	102,646	2,124.23 2,064.64	218,044,482 211,927,909		1.20
アメリカ	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	23,885	9,515.48 8,713.23	227,277,251 208,115,641		1.18
アメリカ	GGP INC	投資証券	80,770	2,843.71 2,513.77	229,687,224 203,037,445		1.15
オーストラリア	WESTFIELD CORP	投資証券	264,887	818.34 691.77	216,770,011 183,241,674		1.04
アメリカ	MID-AMERICA APARTMENT COMM	投資証券	15,735	10,862.85 11,444.39	170,927,007 180,077,610		1.02
アメリカ	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	投資証券	12,620	12,525.82 13,286.14	158,075,955 167,671,086		0.95
イギリス	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	109,436	1,513.17 1,471.14	165,595,666 160,995,786		0.91
アメリカ	SL GREEN REALTY CORP	投資証券	14,112	12,142.91 11,393.63	171,360,802 160,787,012		0.91
アメリカ	UDR INC	投資証券	36,944	4,004.60 4,338.96	147,945,997 160,298,612		0.91
アメリカ	DUKE REALTY CORP	投資証券	49,210	2,999.31 3,185.80	147,596,192 156,773,439		0.89
オーストラリア	GOODMAN GROUP	投資証券	220,651	628.48 696.16	138,675,843 153,610,165		0.87
アメリカ	EXTRA SPACE STORAGE INC	投資証券	17,411	8,523.43 8,598.47	148,401,509 149,707,995		0.85
アメリカ	REGENCY CENTERS CORP	投資証券	20,279	7,673.73 7,300.75	155,615,753 148,052,030		0.84
アメリカ	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券	10,006	15,794.39 14,655.58	158,038,721 146,643,768		0.83
アメリカ	KIMCO REALTY CORP	投資証券	59,194	2,835.99 2,252.24	167,873,888 133,319,301		0.75

(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7月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資証券	98.82
合計	98.82

(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。

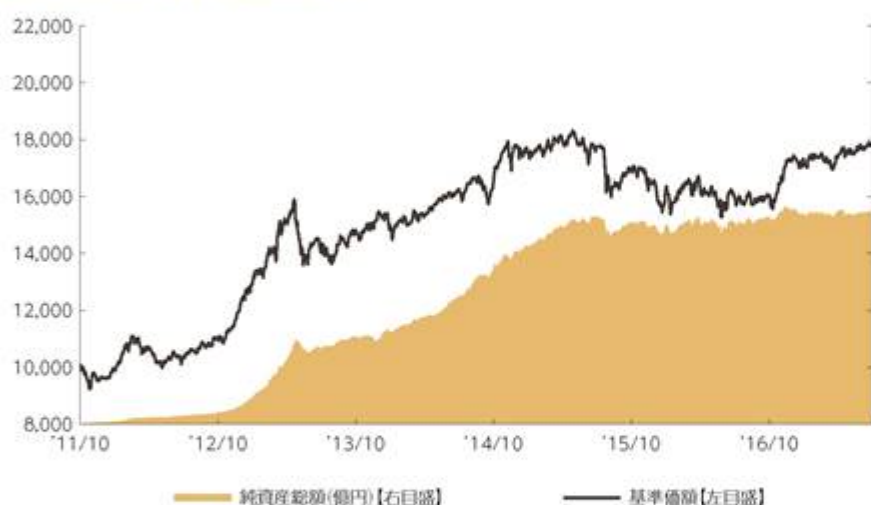
[ 参考情報 ]



## 運用実績

2017年7月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2011年10月31日(設定日)～2017年7月31日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 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	17,789円
純資産総額	37.1億円

### ■分配の推移

2017年1月	0円
2016年1月	0円
2015年1月	0円
2014年1月	0円
2013年1月	0円
2012年1月	0円
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

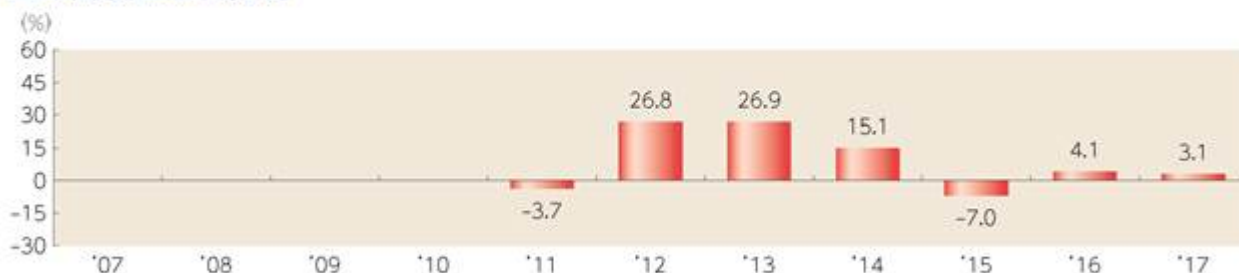
### ■主要な資産の状況

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	17.3%	円	37.3%	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・サービス	香港	0.8%
国内債券	2.5%	アメリカドル	20.8%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	韓国	0.8%
国内リート	12.6%	ユーロ	6.9%	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%
外国株式	24.1%	香港ドル	4.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製造装置	台湾	0.6%
外国債券	24.2%	韓国ウォン	2.8%	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	債券	国債	ブラジル	0.3%
外国リート	12.5%	ブラジルレアル	2.6%	5.5 CHILE (GL) 200805	債券	国債	チリ	0.2%
コールローン他		南アフリカランド	2.4%	BRAZIL-LTN 190101	債券	国債	ブラジル	0.2%
(負債控除後)	6.8%	ニュー台湾ドル	2.2%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.9%
合計	100.0%	その他	20.8%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	0.9%
		合計	100.0%	野村不動産マスターファンド投資法人	リート	-	日本	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.0%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (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)
- 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。
- 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



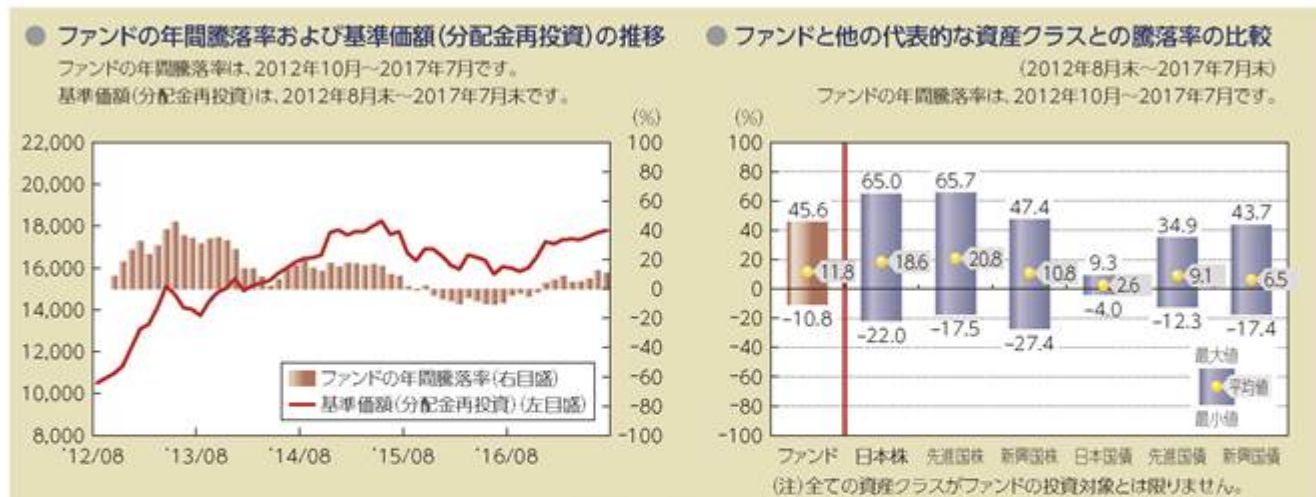
- 収益率は基準価額で計算
- 2011年は設定日から年末までの、2017年は年初から7月31日までの収益率を表示
- ファンド内にベンチマークはありません。

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。



- 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	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	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、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。
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1計算期間	51,206,550	8,680,675	42,525,875
第2計算期間	422,324,976	114,297,236	350,553,615
第3計算期間	1,700,154,151	967,777,336	1,082,930,430
第4計算期間	1,351,868,569	664,011,220	1,770,787,779
第5計算期間	987,724,940	615,313,510	2,143,199,209
第6計算期間	506,445,414	508,603,996	2,141,040,627
第7計算期期首から 平成29年7月31日までの期間	249,816,062	300,268,843	2,090,587,846

### 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1月27日から平成29年7月26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。

【eMAXIS バランス(波乗り型)】  
(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 [平成29年 1月26日現在]	第7期中間計算期間末 [平成29年 7月26日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	106,022,891	99,497,799
親投資信託受益証券	3,509,672,539	3,561,617,937
未収入金	86,633,793	90,107,551
流動資産合計	3,702,329,223	3,751,223,287
資産合計	3,702,329,223	3,751,223,287
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	15,105,181	8,749,739
未払受託者報酬	1,183,251	1,188,468
未払委託者報酬	8,677,081	8,715,399
未払利息	150	181
その他未払費用	70,929	71,247
流動負債合計	25,036,592	18,725,034
負債合計	25,036,592	18,725,034
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,141,040,627	2,090,263,077
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,536,252,004	1,642,235,176
(分配準備積立金)	355,831,198	310,183,206
元本等合計	3,677,292,631	3,732,498,253
純資産合計	3,677,292,631	3,732,498,253
負債純資産合計	3,702,329,223	3,751,223,287



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 平成28年 1月27日 至 平成28年 7月26日	第7期中間計算期間 自 平成29年 1月27日 至 平成29年 7月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,502	769
有価証券売買等損益	83,624,083	154,126,302
その他収益	8,592	-
<b>営業収益合計</b>	<b>83,638,177</b>	<b>154,127,071</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,771	23,877
受託者報酬	1,127,875	1,188,468
委託者報酬	8,271,024	8,715,399
その他費用	67,678	71,247
<b>営業費用合計</b>	<b>9,482,348</b>	<b>9,998,991</b>
営業利益又は営業損失( )	74,155,829	144,128,080
経常利益又は経常損失( )	74,155,829	144,128,080
中間純利益又は中間純損失( )	74,155,829	144,128,080
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( )	4,843,634	8,636,054
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,223,167,002	1,536,252,004
剰余金増加額又は欠損金減少額	156,508,941	181,636,246
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	156,508,941	181,636,246
剰余金減少額又は欠損金増加額	111,823,159	211,145,100
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	111,823,159	211,145,100
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,337,164,979	1,642,235,176

## (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6期 [平成29年1月26日現在]	第7期中間計算期間末 [平成29年7月26日現在]
1 期首元本額	2,143,199,209円	2,141,040,627円
期中追加設定元本額	506,445,414円	243,917,627円
期中一部解約元本額	508,603,996円	294,695,177円
2 受益権の総数	2,141,040,627口	2,090,263,077口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7175円 (17,175円)	1.7857円 (17,857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6期 [平成29年1月26日現在]	第7期中間計算期間末 [平成29年7月26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;

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。  
中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,625,668,966	36,048,702,861
株式	312,182,586,220	301,364,854,370
派生商品評価勘定	28,072,640	5,182,340
未収入金	2,964,308	
未収配当金	380,097,155	284,708,464
前払金	9,335,000	2,610,000
その他未収収益	58,162,462	41,500,614
差入委託証拠金	81,270,000	52,470,000
流動資産合計	368,368,156,751	337,800,028,649
資産合計	368,368,156,751	337,800,028,649
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		567,420
未払金	1,612,560	24,320
未払解約金	919,364,604	922,535,200
未払利息	78,942	65,766
受入担保金	53,395,218,943	33,863,719,585
流動負債合計	54,316,275,049	34,786,912,291
負債合計	54,316,275,049	34,786,912,291
純資産の部		
元本等		
元本	197,761,894,116	179,776,583,157
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	116,289,987,586	123,236,533,201
元本等合計	314,051,881,702	303,013,116,358
純資産合計	314,051,881,702	303,013,116,358
負債純資産合計	368,368,156,751	337,800,028,649

(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。

## (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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 154,772,715,263円	平成29年1月27日 197,761,894,116円
期首からの追加設定元本額	166,912,622,328円	79,358,312,304円
期首からの一部解約元本額	123,923,443,475円	97,343,623,263円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内株式)	17,441,432,955円	18,660,461,918円
eMAXIS TOPIXインデックス	17,633,210,066円	13,194,776,799円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,634,048,628円	1,663,087,858円
eMAXIS バランス(波乗り型)	100,960,100円	465,473,145円
コアバランス	489,415円	1,057,031円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	3,118,403円	18,528,368円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	1,555,114円	24,847,691円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	3,899,310円	16,764,167円
eMAXIS Slim 国内株式インデックス		217,390,411円
国内株式セレクション(ラップ向け)		864,977,587円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		178,993,329円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	7,036,956,180円	4,679,520,190円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	13,404,165,514円	8,384,824,341円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	250,636,859円	206,830,498円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	188,702,304円	222,730,976円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,067,088,420円	940,734,995円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	73,907,470円	54,198,152円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	433,330,225円	319,582,526円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	34,616,516円	60,121,196円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	5,129,674円	8,693,027円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	9,363,027円	17,085,742円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	27,623,433円	75,541,086円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	26,450,062円	70,863,456円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	31,262,681円	112,589,973円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	5,745,437,114円	71,751,194円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	12,479,605,748円	11,464,511,770円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	409,726,963円	357,737,515円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	3,578,514,255円	3,246,523,490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)	37,292,152,342円	35,418,790,971円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	5,250,516,580円	3,803,569,001円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,090,983,851円	1,082,134,027円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	465,827,963円	169,260,203円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	278,167,907円	257,833,311円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	138,526,439円	125,838,290円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	519,931,034円	482,766,069円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,154,769,691円	1,049,112,706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)	3,737,953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)	4,341,840円	6,276,716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)	229,420,040円	358,332,973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)	1,679,653,743円	3,288,140,222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)	241,903,703円	1,083,209,752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)	85,567,531円	103,817,555円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	6,492,637円	18,607,568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)	3,525,359,864円	4,986,128,908円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	6,427,680,988円	6,301,704,398円
三菱UFJ TOPIX・ライト	308,124,526円	277,946,163円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	8,177,256円	7,461,293円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	39,541,844円	32,108,045円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	75,269,181円	40,180,677円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	55,085,146円	43,731,463円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	2,607,002,054円	2,223,724,574円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	652,481,005円	511,022,004円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	82,292,004円	68,705,939円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	598,399,397円	493,663,167円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	68,956,074円	51,020,752円

三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	516,894,534円	344,306,315円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,020,617,361円	1,927,455,597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)	518,745,368円	488,963,143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)	2,045,351,514円	1,974,721,155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)	1,675,329,773円	1,621,154,452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)	1,305,128,496円	1,272,659,538円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド (合計)	44,159,507,387円 197,761,894,116円	44,253,311,125円 179,776,583,157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	52,106,792,760円	32,174,239,710円
3 受益権の総数	197,761,894,116口	179,776,583,157口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5880円 (15,880円)	1.6855円 (16,855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1月26日現在]	[平成29年7月26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。 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。 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 同 左 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1月26日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,052,205,000	2,080,350,000	28,145,000
	合計	2,052,205,000	2,080,350,000	28,145,000

区分	種類	[平成29年7月26日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,648,750,000	1,653,420,000	4,670,000
	合計	1,648,750,000	1,653,420,000	4,670,000

## (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。

「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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,938,472,139	11,267,435,661
コール・ローン	757,207,462	366,567,301
株式	331,372,007,156	327,379,329,182
投資証券	8,646,491,644	8,431,681,331
派生商品評価勘定	197,953,037	109,970,258
未収入金	2,503,484	28,551,552
未収配当金	270,353,018	316,361,071
差入委託証拠金	2,396,324,416	3,395,709,507
流動資産合計	362,581,312,356	351,295,605,863
資産合計	362,581,312,356	351,295,605,863
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,270,297	27,266,506
未払金		40,778,286
未払解約金	2,775,565,667	3,502,854,104
未払利息	1,074	668
流動負債合計	2,816,837,038	3,570,899,564
負債合計	2,816,837,038	3,570,899,564
純資産の部		
元本等		
元本	157,553,049,161	139,916,664,974
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	202,211,426,157	207,808,041,325
元本等合計	359,764,475,318	347,724,706,299
純資産合計	359,764,475,318	347,724,706,299
負債純資産合計	362,581,312,356	351,295,605,863

(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。

(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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首	平成28年1月27日	平成29年1月27日
期首元本額	107,511,806,135円	157,553,049,161円
期首からの追加設定元本額	144,979,276,843円	70,695,249,741円
期首からの一部解約元本額	94,938,033,817円	88,331,633,928円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	9,085,495,234円	12,117,764,719円
eMAXIS 先進国株式インデックス	15,876,735,618円	14,121,740,717円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,127,906,691円	1,135,881,178円
eMAXIS バランス(波乗り型)	440,942,158円	100,391,640円
コアバランス	334,848円	409,938円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	1,083,522円	6,291,614円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	540,205円	8,502,457円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	1,314,722円	5,574,620円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス		380,523,536円
海外株式セレクション(ラップ向け)		847,317,209円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		122,748,728円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,195,430,610円	8,302,258,052円

e M A X I S 全世界株式インデックス	2,403,154,118円	2,382,325,685円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,946,692,552円	2,881,564,268円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	8,010,223,988円	5,278,234,178円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	172,233,366円	136,580,851円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	108,700,594円	137,468,788円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	741,556,257円	640,577,427円
e M A X I S バランス(4資産均等型)	23,857,779円	41,232,696円
e M A X I S 最適化バランス(マイゴールキーパー)	2,124,749円	4,171,000円
e M A X I S 最適化バランス(マイディフェンダー)	5,078,721円	9,993,305円
e M A X I S 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	16,949,822円	48,928,900円
e M A X I S 最適化バランス(マイフォワード)	17,424,332円	46,449,347円
e M A X I S 最適化バランス(マイストライカー)	21,533,854円	77,216,640円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	4,914,179,280円	61,838,588円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,409,436,185円	13,025,489,476円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	284,785,571円	245,296,351円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,487,134,519円	2,210,018,204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)	61,047,009,810円	48,900,278,589円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	241,669,808円	222,686,707円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	95,336,166円	86,455,504円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,806,983,965円	1,650,434,683円
M S C I 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)	3,294,610,468円	3,083,788,207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)	7,780,282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)	6,639,978,588円	6,963,668,718円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	71,333,026円	51,936,621円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	416,031,045円	314,325,364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)	940,643,556円	2,018,569,648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)	136,674,496円	666,066,259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)	99,729,242円	121,301,046円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	5,552,746円	16,036,760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)	2,448,789,957円	2,614,654,810円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,899,611,663円	2,012,346,546円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,798,039円	2,550,221円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	13,714,523円	11,012,787円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	29,699,389円	15,750,461円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	23,727,293円	18,635,340円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	92,367,343円	80,609,710円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	28,410,060円	23,677,019円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	205,200,405円	169,297,996円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	47,341,709円	34,751,412円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	356,529,046円	235,143,266円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,191,772,490円	4,197,802,089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)	179,840,881円	167,139,901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)	708,931,968円	679,001,694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)	663,866,929円	635,647,013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)	562,264,973円	546,306,491円
(合計)	157,553,049,161円	139,916,664,974円
2 受益権の総数	157,553,049,161口	139,916,664,974口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2834円 (22,834円)	2.4852円 (24,852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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26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。 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。 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 同 左 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1月26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	19,569,730,594		19,718,794,974	149,064,380
	合 計	19,569,730,594		19,718,794,974	149,064,380

区 分	種 類	[ 平成29年7月26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	8,478,701,766		8,577,334,998	98,633,232
	合 計	8,478,701,766		8,577,334,998	98,633,232

## (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1月26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	1,410,252,000		1,402,936,000	7,316,000
	カナダドル	86,466,600		86,650,000	183,400
	オーストラリアドル	60,125,450		60,025,000	100,450
	イギリスポンド	156,714,360		157,278,000	563,640
	スイスフラン	68,180,400		68,034,000	146,400
	香港ドル	29,318,800		29,160,000	158,800
	スウェーデンクローネ	25,680,400		25,700,000	19,600
	デンマーククローネ	16,410,200		16,370,000	40,200
	ユーロ	268,382,400		267,872,000	510,400



	買建			
	アメリカドル	45,253,600	45,252,000	1,600
	オーストラリアドル	42,765,050	42,880,000	114,950
	ユーロ	12,176,600	12,176,000	600
	合計	2,221,725,860	2,214,333,000	7,618,360

区分	種類	[平成29年7月26日現在]		
		契約額等(円)		時価 (円)
		うち1年超		
				評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建			
	アメリカドル	4,029,076,180	4,039,951,000	10,874,820
	カナダドル	258,645,000	259,318,000	673,000
	オーストラリアドル	167,865,200	168,388,000	522,800
	イギリスポンド	450,597,880	451,794,000	1,196,120
	スイスフラン	223,221,700	223,155,000	66,700
	香港ドル	71,475,000	71,600,000	125,000
	シンガポールドル	32,761,160	32,840,000	78,840
	スウェーデンクローネ	74,700,000	74,910,000	210,000
	デンマーククローネ	52,379,800	52,560,000	180,200
ユーロ	825,015,600	827,151,000	2,135,400	
	合計	6,185,737,520	6,201,667,000	15,929,480

## (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ではありません。

## 「新興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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,592,965,929	1,913,659,711
コール・ローン	196,309,444	175,688,521
株式	40,947,746,543	51,061,609,557
投資証券	178,423,566	240,762,621
派生商品評価勘定	81,981,282	107,247,116
未収入金		5,957,746
未収配当金	58,451,437	253,521,047
差入委託証拠金	197,462,184	197,701,324
流動資産合計	43,253,340,385	53,956,147,643
資産合計	43,253,340,385	53,956,147,643
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	203,161	547,989
未払金	7,385	24,767
未払解約金	76,247,436	3,715,731
未払利息	278	320
流動負債合計	76,458,260	4,288,807
負債合計	76,458,260	4,288,807
純資産の部		
元本等		
元本	20,724,821,460	22,218,078,079
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	22,452,060,665	31,733,780,757
元本等合計	43,176,882,125	53,951,858,836
純資産合計	43,176,882,125	53,951,858,836
負債純資産合計	43,253,340,385	53,956,147,643

(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。

## (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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 18,949,314,185円	平成29年1月27日 20,724,821,460円
期首からの追加設定元本額	6,013,448,770円	3,215,095,999円
期首からの一部解約元本額	4,237,941,495円	1,721,839,380円
元本の内訳*		
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,837,117,156円	13,186,766,975円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,242,235,603円	1,184,970,139円
eMAXIS バランス（波乗り型）	204,265,975円	233,231,142円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	160,296,031円	163,601,007円
コアバランス	108,371円	
海外株式セレクション（ラップ向け）		29,357,957円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		125,474,847円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	4,481,077,922円	5,314,282,241円
新興国株式インデックスオープン	267,471,144円	282,217,557円
eMAXIS 全世界株式インデックス	347,790,220円	347,808,950円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）	144,599,424円	166,050,386円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	6,428,307円	7,839,331円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	2,020,076円	3,417,140円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	9,269,583円	23,538,287円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	10,906,768円	25,907,823円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	26,327,391円	87,708,783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）	2,859,869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）	961,438,197円	1,019,040,262円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	3,508,926円	2,102,106円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	15,842,516円	11,389,617円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	1,257,981円	3,373,529円
（合計）	20,724,821,460円	22,218,078,079円
2 受益権の総数	20,724,821,460口	22,218,078,079口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0833円 （20,833円）	2.4283円 （24,283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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26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。 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。 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 同 左 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1月26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	1,916,480,388		1,998,243,709	81,763,321
	合計	1,916,480,388		1,998,243,709	81,763,321

区分	種類	[平成29年7月26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	2,610,271,548		2,716,696,275	106,424,727
	合計	2,610,271,548		2,716,696,275	106,424,727

## (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ではありません。

## 通貨関連

区分	種類	[平成29年1月26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 買建 香港ドル メキシコペソ 南アフリカランド	29,318,800 21,480,400 42,486,000		29,160,000 21,440,000 42,700,000	158,800 40,400 214,000
	合計	93,285,200		93,300,000	14,800

区分	種類	[平成29年7月26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 買建 香港ドル 韓国ウォン ニュー台湾ドル 南アフリカランド	121,595,000 54,898,000 40,456,600 25,761,000		121,720,000 55,055,000 40,590,000 25,620,000	125,000 157,000 133,400 141,000
	合計	242,710,600		242,985,000	274,400

## (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。
- 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。

「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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,574,028,591	2,527,555,230
国債証券	349,528,665,110	353,498,898,120
地方債証券	25,080,161,940	24,205,227,642
特殊債証券	31,125,427,559	31,338,012,611
社債券	20,009,260,240	20,089,664,600
派生商品評価勘定		78,920
未収入金	344,344,800	4,978,703,500
未収利息	999,862,160	935,373,276
前払費用	29,304,916	65,198,834
差入委託証拠金		3,420,000
流動資産合計	429,691,055,316	437,642,132,733
資産合計	429,691,055,316	437,642,132,733
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		283,240
前受金		140,000
未払金	517,377,300	517,824,320
未払解約金	1,286,797,899	3,932,815,554
未払利息	3,653	4,611
流動負債合計	1,804,178,852	4,451,067,725
負債合計	1,804,178,852	4,451,067,725
純資産の部		
元本等		
元本	325,711,127,600	328,991,946,937
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	102,175,748,864	104,199,118,071
元本等合計	427,886,876,464	433,191,065,008
純資産合計	427,886,876,464	433,191,065,008
負債純資産合計	429,691,055,316	437,642,132,733

(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。

(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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 358,800,295,657円	平成29年1月27日 325,711,127,600円
期首からの追加設定元本額	179,316,766,966円	185,485,455,407円
期首からの一部解約元本額	212,405,935,023円	182,204,636,070円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内債券)	44,373,568,521円	50,770,798,802円
eMAXIS 国内債券インデックス	17,653,095,259円	12,807,185,418円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,797,303,712円	1,958,389,385円
eMAXIS バランス(波乗り型)	69,214,119円	70,538,067円
コアバランス	2,477,753円	2,438,389円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	10,396,504円	65,736,866円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	2,077,116円	35,477,904円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	3,194,340円	15,049,562円
eMAXIS Slim 国内債券インデックス		277,966,173円
国内債券セレクション(ラップ向け)		2,724,301,140円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		210,757,531円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	16,926,878,352円	9,405,334,701円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	1,480,371,804円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	19,113,224円	35,029,431円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKU SHIN)	467,018,159円	451,235,350円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	7,017,461,177円	5,612,234,787円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	490,618,980円	444,386,327円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	568,547,830円	510,581,768円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	63,022,348円	60,892,304円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	39,694,435円	73,871,733円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	28,909,762円	53,454,746円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	28,269,347円	56,507,477円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィル ダー)	43,251,418円	128,913,067円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	8,485,203円	23,710,138円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	682,997円	2,668,605円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資 家限定)	10,141,550,976円	136,528,529円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資 家限定)	14,786,566,802円	14,344,726,683円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投 資家限定)	1,965,834,712円	1,824,762,844円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投 資家限定)	6,353,199,930円	6,202,163,677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)	154,048,851,244円	161,039,780,817円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投 資家限定)	6,158,886,058円	4,819,764,849円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投 資家限定)	2,435,145,073円	1,371,310,235円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資 家限定)	1,645,114,181円	644,280,909円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投 資家限定)	583,663,735円	575,951,724円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投 資家限定)	161,597,201円	158,854,775円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資 家限定)	5,606,570,673円	5,517,661,382円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資 家限定)	4,122,838,094円	4,025,031,177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)	6,181,404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)	3,967,618,417円	6,452,207,273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)	580,208,197円	2,116,024,100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)	609,745,031円	667,480,961円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限 定)	20,131,733円	62,167,327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)	8,311,348,934円	20,178,591,204円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	27,406,688円	26,327,041円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	66,466,513円	57,544,919円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	80,792,269円	47,027,361円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	44,341,227円	37,979,118円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	19,821,328円	
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	241,047,327円	218,443,329円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	526,973,710円	472,330,722円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	215,724,689円	174,682,521円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	511,380,772円	367,728,557円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	3,288,740,953円	3,374,891,793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)	1,771,876,449円	1,785,598,920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)	3,430,782,274円	3,511,594,108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)	1,835,936,307円	1,883,143,257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)	1,051,132,339円	1,099,907,154円
(合計)	325,711,127,600円	328,991,946,937円
2 受益権の総数	325,711,127,600口	328,991,946,937口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3137円 (13,137円)	1.3167円 (13,167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1月26日現在]	[平成29年7月26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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。  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。	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
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

## 債券関連

[平成29年1月26日現在]

該当事項はありません。

区分	種類	[平成29年7月26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	600,640,000	600,440,000	200,000
	合計	600,640,000	600,440,000	200,000

## (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ではありません。



「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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	221,237,328	146,646,793
コール・ローン	91,099,011	325,131,245
国債証券	126,908,564,888	126,467,413,311
派生商品評価勘定	1,346,139	24,422
未収入金	616,493,800	760,583,612
未収利息	1,123,602,851	1,022,026,152
前払費用	20,535,506	63,010,360
流動資産合計	128,982,879,523	128,784,835,895
資産合計	128,982,879,523	128,784,835,895
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	186,151	705,981
未払解約金	486,324,229	429,361,640
未払利息	129	593
流動負債合計	486,510,509	430,068,214
負債合計	486,510,509	430,068,214
純資産の部		
元本等		
元本	65,998,579,038	63,109,024,154
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	62,497,789,976	65,245,743,527
元本等合計	128,496,369,014	128,354,767,681
純資産合計	128,496,369,014	128,354,767,681
負債純資産合計	128,982,879,523	128,784,835,895

(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。

(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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 74,161,141,669円	平成29年1月27日 65,998,579,038円
期首からの追加設定元本額	13,273,734,432円	11,065,772,561円
期首からの一部解約元本額	21,436,297,063円	13,955,327,445円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外債券）	1,315,354,078円	1,140,188,842円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,901,960,026円	10,366,782,151円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,303,526,132円	1,383,627,098円
eMAXIS バランス（波乗り型）	233,601,225円	229,674,869円
コアバランス	1,801,361円	1,096,565円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定 拠出年金）	568,679円	3,486,029円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定 拠出年金）	173,270円	2,876,765円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定 拠出年金）	359,988円	1,619,942円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス		173,406,590円
海外債券セレクション（ラップ向け）		843,882,659円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		148,914,686円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	6,836,197,898円	7,181,076,419円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	27,571,318円	50,022,740円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	12,217,616円	20,976,617円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	10,619,481円	19,283,418円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィル ダー）	12,184,471円	31,425,595円

eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	4,772,810円	7,689,947円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	459,800円	1,734,773円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	5,605,811,776円	74,439,056円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,334,377,636円	3,182,038,457円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,149,324,465円	2,023,099,001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)	12,657,845,434円	18,925,969,370円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	8,377,071,849円	6,329,802,803円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	2,492,854,798円	1,350,729,509円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	545,500,831円	210,710,548円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	223,229,745円	216,278,493円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	73,320,391円	69,910,383円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,780,222,400円	2,630,348,414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)	7,460,770円	
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	247,358,751円	132,724,529円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	298,413,627円	175,893,984円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	1,584,045円	4,825,997円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	3,240,167円	3,083,753円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	10,559,392円	8,907,247円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	17,072,836円	9,554,138円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	5,496,663円	4,550,048円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	97,358,484円	83,790,687円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	65,331,745円	57,065,149円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	118,840,310円	102,694,443円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	109,473,853円	84,806,907円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	206,100,053円	143,138,214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)	1,629,911,967円	2,412,849,795円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,012,347,781円	1,997,009,409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)	207,747,377円	203,255,347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)	546,183,646円	546,793,232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)	383,221,161円	384,569,453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)	129,948,932円	132,420,083円
(合計)	65,998,579,038円	63,109,024,154円
2 受益権の総数	65,998,579,038口	63,109,024,154口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9470円 (19,470円)	2.0339円 (20,339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1月26日現在]	[平成29年7月26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。 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

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>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>	<p>同 左</p> <p>同 左</p>
---------------------------	---	-----------------------

(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1月26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	266,860,220		265,872,200	988,020
	カナダドル	13,843,926		13,864,000	20,074
	オーストラリアドル	13,735,885		13,720,000	15,885
	イギリスポンド	44,216,696		44,323,800	107,104
	スイスフラン	2,267,960		2,267,800	160
	シンガポールドル	1,601,120		1,603,000	1,880
	スウェーデンクローネ	3,081,648		3,084,000	2,352
	ノルウェークローネ	1,224,828		1,226,700	1,872
	デンマーククローネ	2,789,734		2,782,900	6,834
	メキシコペソ	4,685,608		4,716,800	31,192
	ポーランドズロチ	4,188,735		4,195,500	6,765
	南アフリカランド	2,039,328		2,049,600	10,272
	ユーロ	243,850,600		243,520,000	330,600
	合 計	604,386,288		603,226,300	1,159,988

区 分	種 類	[ 平成29年7月26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	233,585,966		233,891,900	305,934
	カナダドル	11,605,560		11,624,600	19,040
	オーストラリアドル	13,267,800		13,293,500	25,700
	イギリスポンド	40,770,920		40,807,200	36,280
	スイスフラン	2,349,060		2,349,000	60
	シンガポールドル	3,276,116		3,284,000	7,884
	スウェーデンクローネ	4,076,900		4,086,000	9,100
	ノルウェークローネ	2,525,292		2,523,600	1,692
	デンマーククローネ	3,503,960		3,504,000	40
	メキシコペソ	5,220,129		5,220,700	571
	ポーランドズロチ	6,096,544		6,108,000	11,456
	南アフリカランド	4,625,964		4,611,600	14,364
	ユーロ	221,160,330		221,442,000	281,670
	合 計	552,064,541		552,746,100	681,559

(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。

「新興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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	283,275,557	226,198,941
コール・ローン	12,448,283	47,674,226
国債証券	11,954,762,413	13,893,747,821
派生商品評価勘定	240	115,950
未収利息	192,344,208	210,120,246
前払費用	9,757,327	23,522,576
流動資産合計	12,452,588,028	14,401,379,760
資産合計	12,452,588,028	14,401,379,760
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,000	89,427
前受収益		2,870
未払金	4,353,208	58,502,093
未払解約金	4,697,747	5,806,815
未払利息	17	86
流動負債合計	9,051,972	64,401,291
負債合計	9,051,972	64,401,291
純資産の部		
元本等		
元本	9,838,910,954	10,459,280,787
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,604,625,102	3,877,697,682
元本等合計	12,443,536,056	14,336,978,469
純資産合計	12,443,536,056	14,336,978,469
負債純資産合計	12,452,588,028	14,401,379,760

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

(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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首	平成28年1月27日	平成29年1月27日
期首元本額	8,564,024,345円	9,838,910,954円
期首からの追加設定元本額	2,423,895,407円	1,232,768,434円
期首からの一部解約元本額	1,149,008,798円	612,398,601円
元本の内訳*		
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,025,757,388円	2,044,546,921円
eMAXIS バランス(波乗り型)	362,197,161円	339,638,163円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	252,265,861円	278,987,769円
コアバランス	1,449,710円	1,715,675円
海外債券セレクション(ラップ向け)		100,246,057円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		220,403,667円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,920,515,190円	4,642,337,785円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	2,188,596,618円	2,679,856,252円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	2,453,011円	11,004,612円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	3,288,707円	5,993,371円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	15,091,598円	41,342,509円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	17,736,686円	45,505,636円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	1,423,716円	5,134,936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)	4,646,370円	
三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	27,159,975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 )	7,437,903円	17,132,984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 )	6,911,309円	19,681,612円
世界8資産バランスファンドVL ( 適格機関投資家限定 )	1,979,751円	5,752,838円
( 合 計 )	9,838,910,954円	10,459,280,787円
2 受益権の総数	9,838,910,954口	10,459,280,787口
3 1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	1.2647円 ( 12,647円 )	1.3707円 ( 13,707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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26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1月26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			
	ハンガリーフォロント	3,931,000	3,932,000	1,000
	南アフリカランド	854,240	854,000	240
	合 計	4,785,240	4,786,000	760

区 分	種 類	[ 平成29年7月26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			
	ポーランドズロチ	9,115,620	9,162,000	46,380
	買建			
	アメリカドル	11,162,080	11,191,000	28,920
	タイバーツ	3,329,200	3,340,000	10,800
	メキシコペソ	7,535,160	7,548,000	12,840
	ブラジルレアル	3,545,157	3,528,000	17,157
	チェココルナ	4,481,780	4,500,000	18,220
	ハンガリーフォロント	4,679,000	4,690,400	11,400
	南アフリカランド	6,002,740	5,978,000	24,740
	ロシアルーブル	3,710,400	3,720,000	9,600
	ルーマニアレイ	2,835,700	2,853,000	17,300
	トルコリラ	6,256,280	6,262,000	5,720
	合 計	62,653,117	62,772,400	26,523

## (注)時価の算定方法

- 1 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はありません。

「東証REIT指数マザーファンド」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1月26日現在]	[平成29年7月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	260,969,022	358,967,169
投資証券	16,623,598,310	16,079,671,150
派生商品評価勘定	1,486,444	5,123,048
未収配当金	126,081,744	98,746,613
差入委託証拠金	17,412,500	7,482,000
流動資産合計	17,029,548,020	16,549,989,980
資産合計	17,029,548,020	16,549,989,980
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	578,556	734,748
前受金	150,000	5,939,000
未払金	16,272,500	55,266,997
未払解約金	29,341,270	5,150,835
未払利息	370	654
流動負債合計	46,342,696	67,092,234
負債合計	46,342,696	67,092,234
純資産の部		
元本等		
元本	6,235,686,088	6,511,118,510
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	10,747,519,236	9,971,779,236
元本等合計	16,983,205,324	16,482,897,746
純資産合計	16,983,205,324	16,482,897,746
負債純資産合計	17,029,548,020	16,549,989,980

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

(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	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。

## （貸借対照表に関する注記）

	[ 平成29年1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 6,460,011,075円	平成29年1月27日 6,235,686,088円
期首からの追加設定元本額	1,908,286,071円	932,245,867円
期首からの一部解約元本額	2,132,611,058円	656,813,445円
元本の内訳*		
eMAXIS 国内リートインデックス	4,507,090,853円	4,664,637,928円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	948,051,651円	1,127,111,004円
eMAXIS バランス（波乗り型）	168,337,454円	185,260,850円
三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファン ド	936,645円	933,853円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年 金）	88,294,746円	111,240,389円
J-REITインデックスファンド（ラップ向け）	350,360,035円	42,102,019円
オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）		144,451,150円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）		119,729,554円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	40,083,638円	11,669,157円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	114,980,036円	47,708,072円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	585,496円	1,165,560円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	1,526,848円	3,323,038円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィル ダー）	5,255,271円	16,845,463円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	6,176,899円	18,697,781円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	3,313,590円	13,948,860円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限 定）	692,926円	2,293,832円
（合計）	6,235,686,088円	6,511,118,510円
2 受益権の総数	6,235,686,088口	6,511,118,510口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.7236円 (27,236円)	2.5315円 (25,315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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26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。 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。 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 同 左 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

## 投資証券関連

区分	種類	[ 平成29年1月26日現在 ]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	390,475,000	391,406,000	931,000
	合計	390,475,000	391,406,000	931,000

区分	種類	[ 平成29年7月26日現在 ]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	454,007,000	458,425,000	4,418,000
	合計	454,007,000	458,425,000	4,418,000

## （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。

## 「MUAM G - REIT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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	236,495,589	142,986,108
コール・ローン	23,037,826	35,687,922
投資証券	17,775,865,340	17,649,161,542
派生商品評価勘定		17,928
未収入金	311,251	588,429,274
未収配当金	29,121,293	34,530,551
流動資産合計	18,064,831,299	18,450,813,325
資産合計	18,064,831,299	18,450,813,325
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,663,614	26,678,387
未払利息	32	65
流動負債合計	13,663,646	26,678,452
負債合計	13,663,646	26,678,452
純資産の部		
元本等		
元本	11,695,691,336	11,528,162,106
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,355,476,317	6,895,972,767
元本等合計	18,051,167,653	18,424,134,873
純資産合計	18,051,167,653	18,424,134,873
負債純資産合計	18,064,831,299	18,450,813,325

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月6日から翌年1月5日までであります。

## （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	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	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1月26日現在 ]	[ 平成29年7月26日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 10,882,281,209円	平成29年1月27日 11,695,691,336円
期首からの追加設定元本額	2,838,417,482円	1,504,152,657円
期首からの一部解約元本額	2,025,007,355円	1,671,681,887円
元本の内訳*		
三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	204,202,699円	194,905,017円
三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）	143,880,869円	134,280,200円
三菱UFJ 資産設計ファンド（分配型）	21,854,802円	19,949,314円
三菱UFJ 資産設計ファンド（バランス型）	41,557,743円	38,381,929円
三菱UFJ 資産設計ファンド（株式重視型）	18,257,695円	16,987,369円
ファンド・マネジャー（海外リート）	623,435,864円	80,428,117円
eMAXIS 先進国リートインデックス	6,942,060,647円	6,740,127,580円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,653,291,655円	1,759,921,860円
eMAXIS バランス（波乗り型）	294,577,208円	291,998,128円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	1,287,040,620円	1,433,991,560円



三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	154,962,193円	178,710,211円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)		227,362,728円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		190,589,271円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	66,853,044円	16,961,648円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	199,376,811円	74,249,898円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	1,540,661円	2,775,831円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	4,017,578円	7,766,557円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	13,827,418円	40,219,844円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	14,447,064円	39,346,238円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	9,290,641円	35,523,723円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	1,216,124円	3,685,083円
(合計)	11,695,691,336円	11,528,162,106円
2 受益権の総数	11,695,691,336口	11,528,162,106口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5434円 (15,434円)	1.5982円 (15,982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1月26日現在]	[平成29年7月26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、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>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>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	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

[平成29年1月26日現在]

該当事項はありません。

区分	種類	[平成29年7月26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	436,451,340		436,449,000	2,340
	カナダドル	8,942,400		8,942,000	400
	オーストラリアドル	48,745,400		48,741,000	4,400
	イギリスポンド	29,149,200		29,148,000	1,200
	香港ドル	12,180,500		12,172,000	8,500
	シンガポールドル	18,062,748		18,062,000	748
	ユーロ	44,288,740		44,288,400	340
合計	597,820,328		597,802,400	17,928	

(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。



## 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成29年7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	3,729,078,702
負債総額	10,220,245
純資産総額( - )	3,718,858,457
発行済口数	2,090,587,846 口
1口当たり純資産価額( / )	1.7789 ( 1万口当たり 17,789 )

## &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7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	339,153,406,503
負債総額	45,646,462,223
純資産総額( - )	293,506,944,280
発行済口数	174,388,658,966 口
1口当たり純資産価額( / )	1.6831 ( 1万口当たり 16,831 )

## &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7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	341,522,159,802
負債総額	855,613,468
純資産総額( - )	340,666,546,334
発行済口数	139,084,112,865 口
1口当たり純資産価額( / )	2.4494 ( 1万口当たり 24,494 )

## &lt;参考&gt;

## 「新興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7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	56,517,816,883
負債総額	1,991,153,364
純資産総額( - )	54,526,663,519
発行済口数	22,721,006,405 口
1口当たり純資産価額( / )	2.3998 ( 1万口当たり 23,998 )

## &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7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	438,634,616,658
負債総額	4,624,912,556
純資産総額( - )	434,009,704,102
発行済口数	329,555,529,026 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3170 ( 1万口当たり 13,170 )

## &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7月31日現在  
(単位：円)

資産総額	128,888,684,324
負債総額	966,951,436
純資産総額( - )	127,921,732,888
発行済口数	63,374,449,817 口
1口当たり純資産価額( / )	2.0185 ( 1万口当たり 20,185 )

## &lt;参考&gt;

「新興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7月31日現在  
(単位:円)

資産総額	14,378,760,052
負債総額	53,767,294
純資産総額( - )	14,324,992,758
発行済口数	10,518,603,534 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3619 ( 1万口当たり 13,619 )

## &lt;参考&gt;

「東証REIT指数マザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成29年7月31日現在  
(単位:円)

資産総額	17,142,206,008
負債総額	246,160,776
純資産総額( - )	16,896,045,232
発行済口数	6,545,819,800 口
1口当たり純資産価額( / )	2.5812 ( 1万口当たり 25,812 )

## &lt;参考&gt;

「MUAMG-REITマザーファンド」の現況  
純資産額計算書平成29年7月31日現在  
(単位:円)

資産総額	17,719,969,044
負債総額	20,857,911
純資産総額( - )	17,699,111,133
発行済口数	11,174,596,242 口
1口当たり純資産価額( / )	1.5839 ( 1万口当たり 15,839 )

#### 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、(<http://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4月25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。

### 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

###### (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7月末現在）  
（略）
- ・大株主の状況（平成29年7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>

###### 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。

#### 新興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新興国の株式等に投資を行い、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。

(略)

(投資制限)

(略)

スワップ取引を行うことができます。

金利先渡し取引および為替先渡し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。

#### 日本債券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。

#### 外国債券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。

#### 新興国債券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新興国の現地通貨建の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。

（略）

（投資制限）

（略）

スワップ取引を行うことができます。

金利先渡し取引、為替先渡し取引および直物為替先渡し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。

東証REIT指数マザーファンド

（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不動産投資信託証券に投資を行い、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。

（略）

（投資制限）

（略）

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。

MUAMG-REIT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不動産投資信託証券に投資を行い、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。

（略）

（投資制限）

（略）

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

（5）課税上の取扱い

<更新後>

（略）

上記は平成29年7月末現在のものですので、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

<更新後>

(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

<更新後>

名称	資本金の額 (平成29年3月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社山形銀行	12,008 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社横浜銀行	215,628 百万円	銀行業務を営んでいます。
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。
株式会社福島銀行	18,127 百万円	銀行業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 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。
エース証券株式会社	8,831 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。
株式会社SBI証券	48,323 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。
岡三オンライン証券株式会社	1,000 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。
ぐんぎん証券株式会社	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。
GMOクリック証券株式会社	4,346 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。
高木証券株式会社	11,069 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。
立花証券株式会社	6,695 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。
楽天証券株式会社	7,495 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。
東洋証券株式会社	13,494 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。
SMB 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。
マネックス証券株式会社	12,200 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。
株式会社証券ジャパン	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。
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。
浜銀TT証券株式会社	3,307 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。
ひろぎん証券株式会社	5,000 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。
フィデリティ証券株式会社	8,157 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。

ふくおか証券株式会社	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。
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

#### <更新後>

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7月末現在)

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年8月30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 柴 毅 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 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eMAXIS バランス（波乗り型）の平成29年1月27日から平成29年7月26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、eMAXIS バランス（波乗り型）の平成29年7月26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1月27日から平成29年7月26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。