

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成27年2月10日

【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 金上 孝

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【事務連絡者氏名】 井上 靖

連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資 コアバランス
信託受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資 継続募集額 上限1兆円
信託受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当ありません

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で半期報告書を提出致しましたので、平成26年8月11日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、提出するものです。

【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、原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とし、原届出書に追加される内容を記載する場合は<追加>とします。

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】****(1)【ファンドの目的及び基本的性格】**

[ファンドの目的・特色]

<更新後>

(略)

＜投資環境の3つの局面のイメージ＞

- ◆ 3つの局面は、主に景気動向と市場の変動をもとに判断します。景気動向は金利と株価の上昇(下落)トレンドでその良し悪しを、市場の変動は株価の値動きの荒さなどでその安定度合いを、それぞれ判断します。



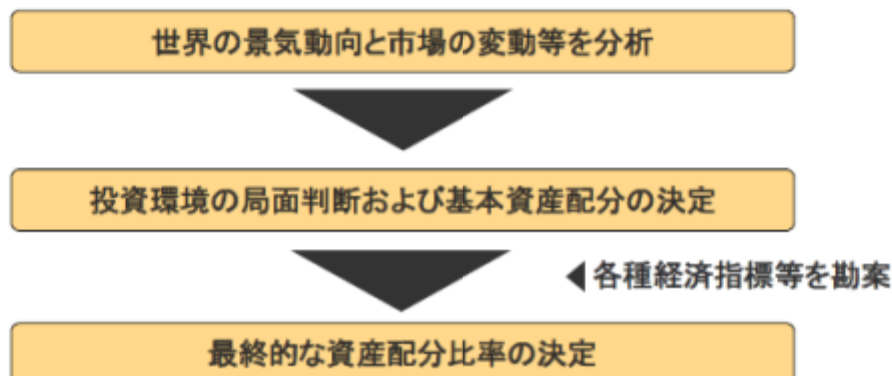
- 「(1)積極局面」とは、景気動向が良く市場の変動が安定的である局面、「(2)中立局面」とは、景気動向が良いが市場の変動が不安定である、もしくは、景気動向が悪いが市場の変動が安定的である局面、「(3)消極局面」とは、景気動向が悪く市場の変動も不安定である局面のことをそれぞれ指しています。

＜各局面での基準となる基本資産配分のイメージ＞



- ❗ 最終的な投資比率は、基準となる基本資産配分をもとに各種経済指標等を勘案し決定するため、上記イメージとは異なる場合があります。このため、資産配分の比率は表示しておりません。
- ❗ 上記イメージは、各局面において基準となる資産配分であり実際の投資比率とは異なります。なお、市場環境等によっては最終的な投資比率どおりの運用ができない場合があります。

＜運用プロセス＞



- ❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市況環境等によっては上記のような運用が行えない場合があります。
- ☞ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

(略)

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金
2,000百万円(平成26年11月末現在)
(略)
- ・大株主の状況(平成26年11月末現在)
(略)

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

有価証券の指図範囲

<更新後>

- (略)
- 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。)で16. で定めるもの以外のもの
(略)

<マザーファンドの概要>

(略)

新興国債券インデックスマザーファンド

(略)

金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができません。

(略)

(3) 【運用体制】

<更新後>

(略)

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。

(5) 【投資制限】

<更新後>

(略)

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

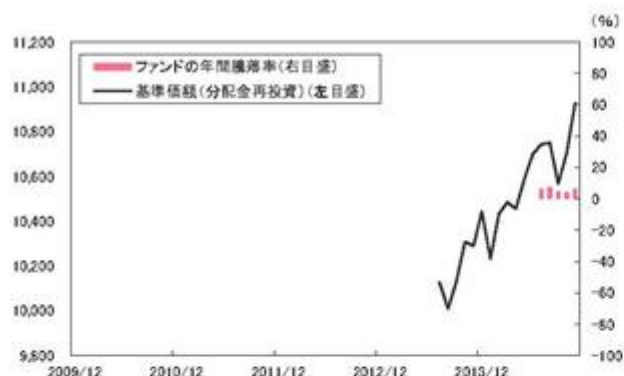
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、(略)投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

<追加>

(3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

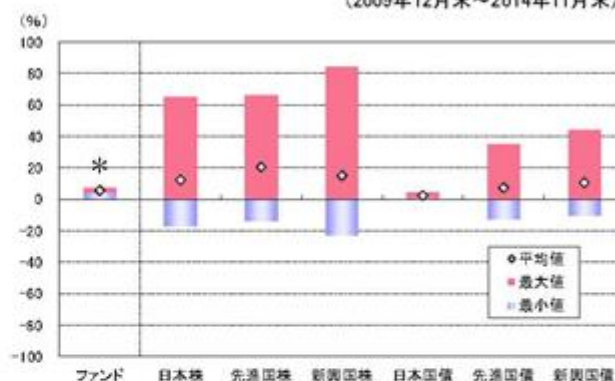


・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。

・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。

●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2009年12月末～2014年11月末)



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

ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大・最小騰落率(%)

| | ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|-----|------|-------|-------|-------|------|-------|-------|
| 平均値 | +5.6 | +12.3 | +20.4 | +14.9 | +2.3 | +7.3 | +10.3 |
| 最大値 | +7.4 | +65.0 | +65.7 | +83.8 | +4.1 | +34.9 | +43.7 |
| 最小値 | +3.9 | -17.0 | -13.6 | -22.8 | +0.4 | -12.7 | -10.1 |

(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

・2009年12月～2014年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

＊ファンドについては2014年7月～2014年11月の同様の騰落率を表示したものです。

| 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、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、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)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證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。

4【手数料等及び税金】

<更新後>

(略)

(4)【その他の手数料等】

(略)

費用または費用を対価とする役務の内容について

| 費用名 | 直接・間接 | 説明 |
|--------------------|-------|--|
| 申込手数料 | 直接 | 商品および投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等の対価 |
| 換金（解約）手数料 | 直接 | 商品の換金に関する事務手続等の対価 |
| 信託財産留保額 | 直接 | 信託期間の途中で換金する場合に、換金に必要な費用を賄うため換金代金から控除され、信託財産中に留保される額 |
| 信託報酬 | 間接 | （委託会社（再委託先への報酬を含む場合があります。）） ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 （販売会社） 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価 （受託会社） 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価 |
| 監査報酬 | 間接 | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| 売買委託手数料 | 間接 | 有価証券等を売買する際に発生する費用 |
| 保管費用 （カストディフィー） | 間接 | 外国での資産の保管等に要する費用 |

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

(5)【課税上の取扱い】

(略)

上記は平成26年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

平成26年11月28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 | 10,924,380 | 95.38 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 529,379 | 4.62 |
| 純資産総額 | | 11,453,759 | 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。

(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

平成26年11月28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 | 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 | | 1,366,758 | 1.8814 2.1500 | 2,571,496 2,938,529 | | 25.66 |
| 日本 | TOPIXマザーファンド | 親投資信託 受益証券 | | 1,896,236 | 1.1971 1.3898 | 2,270,128 2,635,388 | | 23.01 |
| 日本 | 日本債券インデックスマザー ファンド | 親投資信託 受益証券 | | 1,734,692 | 1.2309 1.2565 | 2,135,316 2,179,640 | | 19.03 |
| 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 | | 1,154,515 | 1.3499 1.4987 | 1,558,588 1,730,271 | | 15.11 |
| 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 | | 439,832 | 1.8329 2.2081 | 806,197 971,193 | | 8.48 |
| 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 | | 204,425 | 1.9707 2.2960 | 402,878 469,359 | | 4.10 |

(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26年11月28日現在

| 種類/業種別 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.38 |
| 合計 | 95.38 |

(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】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成26年11月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

| | 純資産総額 | 基準価額 (1万口当たりの純資産価額) |
|--------------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| 第1計算期間末日 (平成26年5月12日) | 10,576,574 (分配付) 10,576,574 (分配落) | 10,474 (分配付) 10,474 (分配落) |
| 平成25年11月末日 | 10,595,995 | 10,290 |
| 12月末日 | 10,753,487 | 10,443 |
| 平成26年1月末日 | 10,332,396 | 10,233 |
| 2月末日 | 10,533,884 | 10,432 |
| 3月末日 | 10,585,973 | 10,484 |
| 4月末日 | 10,556,704 | 10,455 |
| 5月末日 | 10,691,645 | 10,588 |
| 6月末日 | 10,911,010 | 10,699 |

| | | |
|-------|------------|--------|
| 7月末日 | 10,964,504 | 10,742 |
| 8月末日 | 10,972,858 | 10,750 |
| 9月末日 | 10,785,725 | 10,567 |
| 10月末日 | 10,926,584 | 10,705 |
| 11月末日 | 11,453,759 | 10,926 |

【分配の推移】

| | |
|--------|------------|
| | 1万口当たりの分配金 |
| 第1計算期間 | 0円 |

【収益率の推移】

| | |
|-------------------------------|--------|
| | 収益率(%) |
| 第1計算期間 | 4.74 |
| 第1計算期間末日から 平成26年11月末日までの期間 | 4.31 |

(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(分配落ちの額。以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。ただし、第1計算期間末日から平成26年11月末日までの期間については平成26年11月末日の基準価額から前期末基準価額を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

(4) 【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 | 10,307,254 | 209,632 | 10,097,622 |
| 第2計算期期首から 平成26年11月28日までの期間 | 384,950 | | 10,482,572 |

< 参考 >

「TOPIXマザーファンド」

(1) 投資状況

平成26年11月28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 | 233,318,046,790 | 98.76 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 2,921,604,911 | 1.24 |
| 純資産総額 | | 236,239,651,701 | 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26年11月28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) | 2,919,735,000 | 1.24 |

(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

平成26年11月28日現在

| 国/ 地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 株式数 | 上段：帳簿価額 下段：評価額 | | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----------|-------------------|----|--------|------------|------------------------|---------------------------------|--------------------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | | |
| 日本 | トヨタ自動車 | 株式 | 輸送用機器 | 1,562,900 | 5,570.87 7,314.00 | 8,706,712,723 11,431,050,600 | | 4.84 |
| 日本 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 銀行業 | 8,970,500 | 545.73 686.40 | 4,895,470,965 6,157,351,200 | | 2.61 |
| 日本 | ソフトバンク | 株式 | 情報・通信業 | 591,200 | 8,045.34 7,963.00 | 4,756,405,008 4,707,725,600 | | 1.99 |
| 日本 | 三井住友フィナンシャルグループ | 株式 | 銀行業 | 845,500 | 4,232.97 4,475.00 | 3,578,976,135 3,783,612,500 | | 1.60 |
| 日本 | 本田技研工業 | 株式 | 輸送用機器 | 1,019,400 | 3,518.96 3,571.50 | 3,587,227,824 3,640,787,100 | | 1.54 |
| 日本 | みずほフィナンシャルグループ | 株式 | 銀行業 | 15,454,500 | 201.53 204.50 | 3,114,547,221 3,160,445,250 | | 1.34 |
| 日本 | KDDI | 株式 | 情報・通信業 | 378,600 | 5,910.85 7,604.00 | 2,237,847,810 2,878,874,400 | | 1.22 |
| 日本 | 日本電信電話 | 株式 | 情報・通信業 | 437,500 | 5,461.39 6,351.00 | 2,389,358,125 2,778,562,500 | | 1.18 |
| 日本 | 日本たばこ産業 | 株式 | 食料品 | 703,500 | 3,125.00 3,802.50 | 2,198,437,500 2,675,058,750 | | 1.13 |
| 日本 | キヤノン | 株式 | 電気機器 | 656,800 | 3,070.66 3,801.50 | 2,016,809,488 2,496,825,200 | | 1.06 |
| 日本 | 日立製作所 | 株式 | 電気機器 | 2,720,000 | 733.67 916.50 | 1,995,582,400 2,492,880,000 | | 1.06 |
| 日本 | ファナック | 株式 | 電気機器 | 117,900 | 18,229.76 20,020.00 | 2,149,288,704 2,360,358,000 | | 1.00 |
| 日本 | アステラス製薬 | 株式 | 医薬品 | 1,351,300 | 1,151.12 1,707.00 | 1,555,508,456 2,306,669,100 | | 0.98 |
| 日本 | 三菱地所 | 株式 | 不動産業 | 831,000 | 2,311.92 2,671.50 | 1,921,205,520 2,220,016,500 | | 0.94 |
| 日本 | 武田薬品工業 | 株式 | 医薬品 | 444,400 | 4,910.10 4,972.00 | 2,182,048,440 2,209,556,800 | | 0.94 |
| 日本 | パナソニック | 株式 | 電気機器 | 1,380,500 | 1,204.86 1,532.50 | 1,663,309,230 2,115,616,250 | | 0.90 |
| 日本 | セブン&アイ・ホールディングス | 株式 | 小売業 | 467,700 | 3,692.48 4,427.50 | 1,726,972,896 2,070,741,750 | | 0.88 |
| 日本 | 三井不動産 | 株式 | 不動産業 | 593,000 | 2,984.40 3,430.50 | 1,769,749,200 2,034,286,500 | | 0.86 |
| 日本 | 三菱商事 | 株式 | 卸売業 | 856,800 | 1,888.72 2,245.00 | 1,618,255,296 1,923,516,000 | | 0.81 |
| 日本 | ソニー | 株式 | 電気機器 | 727,900 | 1,862.73 2,600.00 | 1,355,881,167 1,892,540,000 | | 0.80 |
| 日本 | 東日本旅客鉄道 | 株式 | 陸運業 | 207,600 | 7,513.54 8,897.00 | 1,559,810,904 1,847,017,200 | | 0.78 |
| 日本 | 東京海上ホールディングス | 株式 | 保険業 | 460,100 | 2,974.70 3,880.50 | 1,368,659,470 1,785,418,050 | | 0.76 |
| 日本 | 日産自動車 | 株式 | 輸送用機器 | 1,590,100 | 891.73 1,108.50 | 1,417,939,873 1,762,625,850 | | 0.75 |

| | | | | | | | | |
|----|------------|----|----------------|-----------|------------------------|--------------------------------|--|------|
| 日本 | 東海旅客鉄道 | 株式 | 陸運業 | 101,400 | 11,644.52 17,275.00 | 1,180,754,328 1,751,685,000 | | 0.74 |
| 日本 | NTTドコモ | 株式 | 情報・通信業 | 921,200 | 1,590.66 1,851.50 | 1,465,315,992 1,705,601,800 | | 0.72 |
| 日本 | 信越化学工業 | 株式 | 化学 | 212,800 | 5,591.78 7,990.00 | 1,189,930,784 1,700,272,000 | | 0.72 |
| 日本 | 富士重工業 | 株式 | 輸送用機器 | 385,500 | 2,615.26 4,318.00 | 1,008,182,730 1,664,589,000 | | 0.70 |
| 日本 | 小松製作所 | 株式 | 機械 | 587,900 | 2,090.56 2,811.00 | 1,229,040,224 1,652,586,900 | | 0.70 |
| 日本 | 野村ホールディングス | 株式 | 証券、商品 先物取引業 | 2,285,700 | 645.26 714.00 | 1,474,870,782 1,631,989,800 | | 0.69 |
| 日本 | 三菱電機 | 株式 | 電気機器 | 1,133,000 | 1,141.29 1,426.50 | 1,293,081,570 1,616,224,500 | | 0.68 |

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|------------|----------|
| 株式 | |
| 水産・農林業 | 0.08 |
| 鉱業 | 0.41 |
| 建設業 | 2.61 |
| 食料品 | 4.02 |
| 繊維製品 | 0.76 |
| パルプ・紙 | 0.22 |
| 化学 | 5.82 |
| 医薬品 | 4.42 |
| 石油・石炭製品 | 0.46 |
| ゴム製品 | 0.88 |
| ガラス・土石製品 | 0.92 |
| 鉄鋼 | 1.54 |
| 非鉄金属 | 0.95 |
| 金属製品 | 0.63 |
| 機械 | 5.28 |
| 電気機器 | 13.00 |
| 輸送用機器 | 11.74 |
| 精密機器 | 1.45 |
| その他製品 | 1.38 |
| 電気・ガス業 | 2.04 |
| 陸運業 | 3.92 |
| 海運業 | 0.32 |
| 空運業 | 0.60 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.22 |
| 情報・通信業 | 6.87 |
| 卸売業 | 4.14 |
| 小売業 | 4.03 |
| 銀行業 | 9.10 |
| 証券、商品先物取引業 | 1.43 |
| 保険業 | 2.34 |
| その他金融業 | 1.26 |
| 不動産業 | 3.10 |
| サービス業 | 2.84 |
| 合計 | 98.76 |

（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

平成26年11月28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 14年12月限 | 大阪取引所 | 買建 | 207 | 2,867,108,848 | 2,919,735,000 | 1.24 |

（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 >

「外国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成26年11月28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 | 138,833,457,212 | 60.30 |
| | イギリス | 19,484,497,776 | 8.46 |
| | カナダ | 10,034,920,979 | 4.36 |
| | スイス | 8,866,129,288 | 3.85 |
| | ドイツ | 8,652,649,889 | 3.76 |
| | フランス | 8,479,321,456 | 3.68 |
| | オーストラリア | 6,547,069,850 | 2.84 |
| | スペイン | 3,433,043,715 | 1.49 |
| | オランダ | 2,995,894,912 | 1.30 |
| | スウェーデン | 2,944,034,962 | 1.28 |
| | 香港 | 2,867,514,645 | 1.25 |
| | イタリア | 2,057,713,221 | 0.89 |
| | デンマーク | 1,469,229,878 | 0.64 |
| | シンガポール | 1,337,006,707 | 0.58 |
| | ベルギー | 1,212,758,251 | 0.53 |
| | フィンランド | 858,082,731 | 0.37 |
| | ノルウェー | 666,684,078 | 0.29 |
| | イスラエル | 519,877,053 | 0.23 |
| | ルクセンブルグ | 300,661,546 | 0.13 |
| | アイルランド | 296,997,523 | 0.13 |
| オーストリア | 206,627,791 | 0.09 | |
| ポルトガル | 156,221,861 | 0.07 | |
| ニュージーランド | 141,195,088 | 0.06 | |
| 投資証券 | アメリカ | 3,620,776,653 | 1.57 |
| | オーストラリア | 517,139,072 | 0.22 |
| | イギリス | 321,098,279 | 0.14 |
| | フランス | 289,275,701 | 0.13 |
| | 香港 | 105,088,512 | 0.05 |
| | シンガポール | 101,795,153 | 0.04 |
| | カナダ | 44,885,156 | 0.02 |
| | オランダ | 25,216,759 | 0.01 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 2,862,027,244 | 1.24 |
| 純資産総額 | | 230,248,892,941 | 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26年11月28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) | 2,918,779,741 | 1.27 |

(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

平成26年11月28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 | 370,710 | 9,975.06 14,069.37 | 3,697,856,383 5,215,656,152 | | 2.27 |
| アメリカ | EXXON MOBIL CORP | 株式 | エネルギー | 263,978 | 12,020.44 11,170.37 | 3,173,132,792 2,948,732,037 | | 1.28 |

| | | | | | | | |
|------|------------------------------|----|------------------------|-----------|------------------------|--------------------------------|------|
| アメリカ | MICROSOFT CORP | 株式 | ソフトウェア・サービス | 484,630 | 4,700.82 5,645.48 | 2,278,160,722 2,735,970,183 | 1.19 |
| 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 | 174,608 | 11,938.86 12,675.43 | 2,084,621,409 2,213,232,930 | 0.96 |
| アメリカ | GENERAL ELECTRIC CO | 株式 | 資本財 | 621,183 | 3,118.90 3,176.84 | 1,937,412,255 1,973,399,063 | 0.86 |
| アメリカ | WELLS FARGO & CO | 株式 | 銀行 | 306,894 | 5,811.00 6,417.52 | 1,783,362,415 1,969,499,733 | 0.86 |
| スイス | NESTLE SA-REG | 株式 | 食品・飲料・タバコ | 199,645 | 8,460.54 8,839.09 | 1,689,104,628 1,764,681,420 | 0.77 |
| アメリカ | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 株式 | 家庭用品・パーソナル用品 | 167,632 | 9,748.06 10,508.28 | 1,634,087,380 1,761,524,395 | 0.77 |
| アメリカ | JPMORGAN CHASE & CO | 株式 | 銀行 | 232,780 | 6,404.51 7,133.99 | 1,490,843,956 1,660,652,100 | 0.72 |
| 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 | 142,427 | 9,646.43 11,393.43 | 1,373,913,139 1,622,732,054 | 0.70 |
| アメリカ | CHEVRON CORP | 株式 | エネルギー | 117,543 | 14,750.37 13,609.45 | 1,733,803,305 1,599,696,204 | 0.69 |
| 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 | 43,498 | 31,442.19 35,515.64 | 1,367,672,445 1,544,859,700 | 0.67 |
| アメリカ | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 株式 | 電気通信サービス | 256,589 | 5,732.97 5,916.22 | 1,471,017,732 1,518,039,334 | 0.66 |
| 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 | 392,576 | 3,429.85 3,676.95 | 1,346,477,696 1,443,483,500 | 0.63 |
| イギリス | HSBC HOLDINGS PLC | 株式 | 銀行 | 1,184,703 | 1,106.95 1,173.44 | 1,311,407,933 1,390,180,422 | 0.60 |
| アメリカ | INTEL CORP | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | 306,735 | 3,140.18 4,362.68 | 963,205,811 1,338,188,796 | 0.58 |
| アメリカ | AT&T INC | 株式 | 電気通信サービス | 321,003 | 4,297.66 4,153.41 | 1,379,561,913 1,333,260,248 | 0.58 |
| アメリカ | BANK OF AMERICA CORP | 株式 | 銀行 | 650,904 | 1,749.80 2,022.91 | 1,138,954,422 1,316,723,660 | 0.57 |
| アメリカ | COCA-COLA CO/THE | 株式 | 食品・飲料・タバコ | 244,375 | 4,835.60 5,236.40 | 1,181,701,460 1,279,646,887 | 0.56 |
| 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 | 178,596 | 6,535.75 7,064.24 | 1,167,259,592 1,261,645,453 | 0.55 |
| アメリカ | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 株式 | 各種金融 | 71,125 | 15,135.80 17,520.50 | 1,076,536,337 1,246,145,825 | 0.54 |
| アメリカ | CITIGROUP INC | 株式 | 銀行 | 187,657 | 5,575.72 6,399.78 | 1,046,324,164 1,200,965,373 | 0.52 |
| アメリカ | GOOGLE INC-CL C | 株式 | ソフトウェア・サービス | 17,803 | 61,638.02 63,887.94 | 1,097,341,816 1,137,397,086 | 0.49 |
| アメリカ | GOOGLE INC-CL A | 株式 | ソフトウェア・サービス | 17,534 | 62,456.17 64,758.11 | 1,095,106,656 1,135,468,839 | 0.49 |
| アメリカ | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 株式 | ソフトウェア・サービス | 58,679 | 22,417.59 19,147.34 | 1,315,441,781 1,123,547,262 | 0.49 |
| アメリカ | FACEBOOK INC-A | 株式 | ソフトウェア・サービス | 122,170 | 6,967.29 9,177.01 | 851,194,295 1,121,155,629 | 0.49 |
| アメリカ | GILEAD SCIENCES INC | 株式 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 93,590 | 9,548.25 11,858.46 | 893,621,166 1,109,834,113 | 0.48 |
| アメリカ | WALT DISNEY CO/THE | 株式 | メディア | 100,921 | 9,716.14 10,867.70 | 980,562,706 1,096,779,313 | 0.48 |
| アメリカ | PEPSICO INC | 株式 | 食品・飲料・タバコ | 93,289 | 10,332.11 11,746.15 | 963,873,114 1,095,786,633 | 0.48 |
| アメリカ | ORACLE CORP | 株式 | ソフトウェア・サービス | 220,694 | 4,842.70 4,950.29 | 1,068,755,010 1,092,499,323 | 0.47 |

(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26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | | 投資比率(%) | |
|----------|------------|---------|--|
| 株式 | エネルギー | 8.86 | |
| | 素材 | 5.10 | |
| | 資本財 | 7.10 | |
| | 商業・専門サービス | 0.84 | |
| | 運輸 | 2.13 | |
| | 自動車・自動車部品 | 1.66 | |
| | 耐久消費財・アパレル | 1.65 | |
| | 消費者サービス | 1.65 | |
| | メディア | 2.98 | |
| | 小売 | 3.16 | |
| | | | |
| | | | |

| | |
|------------------------|-------|
| 食品・生活必需品小売り | 2.11 |
| 食品・飲料・タバコ | 6.14 |
| 家庭用品・パーソナル用品 | 1.75 |
| ヘルスケア機器・サービス | 3.30 |
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.81 |
| 銀行 | 9.62 |
| 各種金融 | 3.96 |
| 保険 | 4.19 |
| 不動産 | 0.74 |
| ソフトウェア・サービス | 6.96 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.56 |
| 電気通信サービス | 3.21 |
| 公益事業 | 3.33 |
| 半導体・半導体製造装置 | 1.78 |
| 小計 | 96.57 |
| 投資証券 | 2.18 |
| 合計 | 98.76 |

(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

平成26年11月28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 (2014年12月限) | シカゴ商業取引所 | 買建 | 143 | アメリカドル | 14,625,957.50 | 14,816,587.50 | 1,751,765,140 | 0.76 |
| FTSE100 (2014年12月限) | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | 買建 | 22 | イギリスポンド | 1,467,635.00 | 1,478,400.00 | 274,583,232 | 0.12 |
| SP/TSE60 (2014年12月限) | モンテリオール取引所 | 買建 | 8 | カナダドル | 1,385,170.00 | 1,390,720.00 | 144,940,838 | 0.06 |
| SPI 200 (2014年12月限) | シドニー先物取引所 | 買建 | 10 | オーストラリアドル | 1,360,290.00 | 1,353,500.00 | 136,310,985 | 0.06 |
| EURO ST (2014年12月限) | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | 買建 | 100 | ユーロ | 3,126,075.00 | 3,241,000.00 | 477,075,200 | 0.21 |
| SWISS IX (2014年12月限) | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | 買建 | 12 | スイスフラン | 1,082,815.00 | 1,094,640.00 | 134,104,346 | 0.06 |

(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 >

「新興国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成26年11月28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 | 6,573,097,848 | 19.55 |
| | 韓国 | 4,697,450,915 | 13.97 |
| | 台湾 | 3,973,545,104 | 11.82 |
| | ブラジル | 3,140,990,593 | 9.34 |
| | 南アフリカ | 2,508,037,342 | 7.46 |
| | インド | 2,361,828,951 | 7.03 |
| | アメリカ | 1,665,931,976 | 4.96 |
| | メキシコ | 1,619,784,470 | 4.82 |
| | マレーシア | 1,206,518,863 | 3.59 |
| | インドネシア | 872,859,074 | 2.60 |
| | タイ | 809,676,480 | 2.41 |
| | トルコ | 566,598,406 | 1.69 |
| | ポーランド | 540,680,131 | 1.61 |
| | チリ | 467,458,646 | 1.39 |
| | フィリピン | 395,818,935 | 1.18 |
| | カタール | 295,604,338 | 0.88 |
| | コロンビア | 275,640,520 | 0.82 |
| | アラブ首長国連邦 | 214,365,427 | 0.64 |
| | ギリシャ | 181,046,947 | 0.54 |
| | チェコ | 73,254,933 | 0.22 |
| ハンガリー | 65,378,608 | 0.19 | |
| 投資証券 | 南アフリカ | 82,274,586 | 0.24 |
| | メキシコ | 61,948,073 | 0.18 |
| | トルコ | 21,425,126 | 0.06 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 948,966,285 | 2.81 |
| 純資産総額 | | 33,620,182,577 | 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26年11月28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) | 920,558,879 | 2.74 |

(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

平成26年11月28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) | | |
| 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 | 7,530 | 142,088.80 135,627.20 | 1,069,928,709 1,021,272,816 | | 3.04 |
| 台湾 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | 1,690,000 | 461.83 534.80 | 780,506,220 903,812,000 | | 2.69 |
| 香港 | TENCENT HOLDINGS LTD | 株式 | ソフトウェア・サービス | 354,100 | 1,520.42 1,907.77 | 538,382,492 675,543,127 | | 2.01 |
| 香港 | CHINA MOBILE LTD | 株式 | 電気通信サービス | 420,000 | 1,170.13 1,447.98 | 491,455,650 608,154,750 | | 1.81 |
| 香港 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 株式 | 銀行 | 4,952,550 | 81.74 88.45 | 404,821,437 438,053,047 | | 1.30 |
| 南アフリカ | NASPERS LTD-N SHS | 株式 | メディア | 27,200 | 11,634.78 15,564.34 | 316,466,233 423,350,048 | | 1.26 |

| | | | | | | | | |
|-------|------------------------------|----|----------------------------|-----------|--------------------------|----------------------------|--|------|
| 香港 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 株式 | 銀行 | 5,063,350 | 72.13 78.99 | 365,232,093 399,979,333 | | 1.19 |
| ブラジル | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 株式 | 銀行 | 188,148 | 1,581.85 1,808.77 | 297,623,268 340,316,570 | | 1.01 |
| メキシコ | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 株式 | 電気通信 サービス | 2,300,000 | 113.72 142.00 | 261,564,970 326,611,270 | | 0.97 |
| 香港 | BANK OF CHINA LTD-H | 株式 | 銀行 | 5,450,000 | 52.30 58.86 | 285,075,875 320,814,250 | | 0.95 |
| 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 | 852,157 | 313.77 370.92 | 267,385,392 316,083,778 | | 0.94 |
| アメリカ | GAZPROM OAO | 株式 | エネルギー | 784,000 | 452.82 357.25 | 355,707,578 280,089,180 | | 0.83 |
| 南アフリカ | MTN GROUP LTD | 株式 | 電気通信 サービス | 114,000 | 2,393.77 2,429.82 | 272,890,600 276,999,844 | | 0.82 |
| ブラジル | BANCO BRADESCO SA-PREF | 株式 | 銀行 | 143,704 | 1,617.80 1,855.46 | 232,485,552 266,637,110 | | 0.79 |
| インド | INFOSYS LTD | 株式 | ソフトウェア・ サービス | 30,630 | 6,143.96 8,426.18 | 188,189,556 258,094,107 | | 0.77 |
| ブラジル | AMBEV SA | 株式 | 食品・飲料・ タバコ | 320,200 | 769.45 773.18 | 246,378,274 247,574,285 | | 0.74 |
| インド | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 株式 | 銀行 | 102,100 | 1,753.84 2,224.51 | 179,067,972 227,123,287 | | 0.68 |
| 香港 | CNOOC LTD | 株式 | エネルギー | 1,224,000 | 197.64 183.00 | 241,911,360 223,992,000 | | 0.67 |
| 香港 | CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 株式 | 保険 | 509,000 | 309.57 411.75 | 157,573,675 209,580,750 | | 0.62 |
| 韓国 | SK HYNIX INC | 株式 | 半導体・ 半導体製造装置 | 39,600 | 4,508.85 5,134.30 | 178,550,590 203,318,478 | | 0.60 |
| 南アフリカ | SASOL LTD | 株式 | エネルギー | 37,550 | 6,395.95 5,412.28 | 240,168,267 203,231,114 | | 0.60 |
| 韓国 | HYUNDAI MOTOR CO | 株式 | 自動車・ 自動車部品 | 10,450 | 24,523.52 19,367.65 | 256,270,808 202,391,942 | | 0.60 |
| 香港 | PETROCHINA CO LTD-H | 株式 | エネルギー | 1,445,000 | 139.08 132.67 | 200,970,600 191,715,375 | | 0.57 |
| アメリカ | LUKOIL OAO | 株式 | エネルギー | 33,200 | 6,518.01 5,725.98 | 216,421,595 190,102,732 | | 0.57 |
| ブラジル | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 株式 | エネルギー | 286,900 | 830.14 627.51 | 238,169,518 180,033,651 | | 0.54 |
| 台湾 | MEDIATEK INC | 株式 | 半導体・ 半導体製造装置 | 97,236 | 1,918.40 1,776.30 | 186,537,931 172,720,306 | | 0.51 |
| 香港 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 株式 | エネルギー | 1,746,000 | 104.61 98.05 | 182,657,790 171,208,395 | | 0.51 |
| インド | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 株式 | エネルギー | 86,900 | 1,926.87 1,908.09 | 167,446,442 165,813,412 | | 0.49 |
| インド | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 株式 | ソフトウェア・ サービス | 32,150 | 4,264.29 5,120.86 | 137,097,129 164,635,938 | | 0.49 |
| 韓国 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 株式 | テクノロジー・ ハードウェア および機器 | 1,420 | 111,203.89 110,519.00 | 157,909,621 156,936,980 | | 0.47 |

(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26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|------------------------|----------|
| 株式 | |
| エネルギー | 8.81 |
| 素材 | 7.38 |
| 資本財 | 4.58 |
| 商業・専門サービス | 0.17 |
| 運輸 | 1.64 |
| 自動車・自動車部品 | 3.27 |
| 耐久消費財・アパレル | 1.08 |
| 消費者サービス | 0.94 |
| メディア | 2.04 |
| 小売 | 1.56 |
| 食品・生活必需品小売り | 1.96 |
| 食品・飲料・タバコ | 4.91 |
| 家庭用品・パーソナル用品 | 1.19 |
| ヘルスケア機器・サービス | 0.70 |
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 1.47 |
| 銀行 | 18.76 |
| 各種金融 | 2.81 |
| 保険 | 3.66 |
| 不動産 | 1.95 |
| ソフトウェア・サービス | 4.94 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.25 |

| | | |
|------|-------------|-------|
| | 電気通信サービス | 7.41 |
| | 公益事業 | 3.34 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.87 |
| | 小計 | 96.68 |
| 投資証券 | | 0.49 |
| 合計 | | 97.18 |

（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

平成26年11月28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 (2014年12月限) | ニューヨーク証券取引所 | 買建 | 153 | アメリカドル | 7,682,618.50 | 7,786,170.00 | 920,558,879 | 2.74 |

（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」

（1）投資状況

平成26年11月28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 | 243,829,818,580 | 78.92 |
| 地方債証券 | 日本 | 17,994,828,982 | 5.82 |
| 特殊債券 | 日本 | 26,730,879,559 | 8.65 |
| 社債券 | 日本 | 17,123,868,220 | 5.54 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 3,268,821,874 | 1.07 |
| 純資産総額 | | 308,948,217,215 | 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26年11月28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） | 2,056,740,000 | 0.67 |

（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

平成26年11月28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121回利付国債(5年) | 国債証券 | | 4,220,000 | 99.90 100.0000 | 4,216,051,500 4,220,000,000 | 0.100000 2019/09/20 | 1.37 |
| 日本 | 第335回利付国債(10年) | 国債証券 | | 3,870,000 | 100.32 100.8000 | 3,882,711,700 3,900,960,000 | 0.500000 2024/09/20 | 1.26 |
| 日本 | 第113回利付国債(5年) | 国債証券 | | 3,790,000 | 100.63 100.9560 | 3,813,914,900 3,826,232,400 | 0.300000 2018/06/20 | 1.24 |
| 日本 | 第116回利付国債(5年) | 国債証券 | | 3,780,000 | 100.13 100.5850 | 3,784,914,000 3,802,113,000 | 0.200000 2018/12/20 | 1.23 |
| 日本 | 第117回利付国債(5年) | 国債証券 | | 3,750,000 | 100.12 100.5560 | 3,754,569,900 3,770,850,000 | 0.200000 2019/03/20 | 1.22 |
| 日本 | 第285回利付国債(10年) | 国債証券 | | 3,468,000 | 104.56 103.8910 | 3,626,140,800 3,602,939,880 | 1.700000 2017/03/20 | 1.17 |
| 日本 | 第334回利付国債(10年) | 国債証券 | | 3,430,000 | 100.71 101.9330 | 3,454,488,700 3,496,301,900 | 0.600000 2024/06/20 | 1.13 |
| 日本 | 第325回利付国債(10年) | 国債証券 | | 3,145,000 | 102.80 104.1680 | 3,233,138,700 3,276,083,600 | 0.800000 2022/09/20 | 1.06 |
| 日本 | 第281回利付国債(10年) | 国債証券 | | 3,143,000 | 104.03 103.0870 | 3,269,914,340 3,240,024,410 | 2.000000 2016/06/20 | 1.05 |

| | | | | | | | |
|----|----------------|------|-----------|--------------------|--------------------------------|------------------------|------|
| 日本 | 第329回利付国債(10年) | 国債証券 | 3,050,000 | 102.47 104.0800 | 3,125,359,900 3,174,440,000 | 0.800000 2023/06/20 | 1.03 |
| 日本 | 第106回利付国債(5年) | 国債証券 | 3,130,000 | 100.29 100.5310 | 3,139,285,400 3,146,620,300 | 0.200000 2017/09/20 | 1.02 |
| 日本 | 第333回利付国債(10年) | 国債証券 | 3,080,000 | 100.12 102.0210 | 3,083,785,900 3,142,246,800 | 0.600000 2024/03/20 | 1.02 |
| 日本 | 第287回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,900,000 | 105.56 104.8270 | 3,061,240,000 3,039,983,000 | 1.900000 2017/06/20 | 0.98 |
| 日本 | 第102回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,990,000 | 100.55 100.5940 | 3,006,516,000 3,007,760,600 | 0.300000 2016/12/20 | 0.97 |
| 日本 | 第284回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,866,000 | 104.19 103.4730 | 2,986,085,400 2,965,536,180 | 1.700000 2016/12/20 | 0.96 |
| 日本 | 第104回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,880,000 | 100.37 100.4360 | 2,890,700,400 2,892,556,800 | 0.200000 2017/03/20 | 0.94 |
| 日本 | 第332回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,750,000 | 100.13 102.1480 | 2,753,575,000 2,809,070,000 | 0.600000 2023/12/20 | 0.91 |
| 日本 | 第119回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,720,000 | 99.73 100.0670 | 2,712,762,800 2,721,822,400 | 0.100000 2019/06/20 | 0.88 |
| 日本 | 第115回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,490,000 | 100.19 100.6070 | 2,494,830,600 2,505,114,300 | 0.200000 2018/09/20 | 0.81 |
| 日本 | 第283回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,382,000 | 104.04 103.2300 | 2,478,232,800 2,458,938,600 | 1.800000 2016/09/20 | 0.80 |
| 日本 | 第109回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,450,000 | 99.96 100.2630 | 2,449,047,100 2,456,443,500 | 0.100000 2018/03/20 | 0.80 |
| 日本 | 第96回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,370,000 | 100.78 100.6410 | 2,388,580,800 2,385,191,700 | 0.500000 2016/03/20 | 0.77 |
| 日本 | 第305回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,128,000 | 106.03 106.0550 | 2,256,318,400 2,256,850,400 | 1.300000 2019/12/20 | 0.73 |
| 日本 | 第312回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,050,000 | 105.89 106.4540 | 2,170,745,000 2,182,307,000 | 1.200000 2020/12/20 | 0.71 |
| 日本 | 第328回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,120,000 | 100.63 102.4690 | 2,133,356,000 2,172,342,800 | 0.600000 2023/03/20 | 0.70 |
| 日本 | 第308回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,024,000 | 106.34 106.5910 | 2,152,362,080 2,157,401,840 | 1.300000 2020/06/20 | 0.70 |
| 日本 | 第100回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,140,000 | 100.50 100.5300 | 2,150,762,600 2,151,342,000 | 0.300000 2016/09/20 | 0.70 |
| 日本 | 第105回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,140,000 | 100.31 100.4830 | 2,146,683,000 2,150,336,200 | 0.200000 2017/06/20 | 0.70 |
| 日本 | 第108回利付国債(5年) | 国債証券 | 2,130,000 | 99.91 100.2590 | 2,128,083,000 2,135,516,700 | 0.100000 2017/12/20 | 0.69 |
| 日本 | 第331回利付国債(10年) | 国債証券 | 2,020,000 | 100.68 102.2650 | 2,033,878,000 2,065,753,000 | 0.600000 2023/09/20 | 0.67 |

(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26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 国債証券 | 78.92 |
| 地方債証券 | 5.82 |
| 特殊債券 | 8.65 |
| 社債券 | 5.54 |
| 合計 | 98.94 |

(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

平成26年11月28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14年12月限 | 大阪取引所 | 買建 | 14 | 2,051,295,120 | 2,056,740,000 | 0.67 |

(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」

(1) 投資状況

平成26年11月28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 | 72,290,957,976 | 38.96 |
| | イタリア | 18,843,398,784 | 10.16 |
| | フランス | 18,648,800,016 | 10.05 |
| | ドイツ | 15,344,499,974 | 8.27 |
| | イギリス | 15,239,665,522 | 8.21 |
| | スペイン | 10,234,333,920 | 5.52 |
| | オランダ | 4,996,978,528 | 2.69 |
| | ベルギー | 4,992,775,968 | 2.69 |
| | カナダ | 4,290,908,268 | 2.31 |
| | オーストリア | 3,107,030,624 | 1.67 |
| | オーストラリア | 3,065,897,207 | 1.65 |
| | メキシコ | 2,046,492,149 | 1.10 |
| | デンマーク | 1,562,424,672 | 0.84 |
| | アイルランド | 1,529,277,360 | 0.82 |
| | フィンランド | 1,228,776,288 | 0.66 |
| | ポーランド | 1,180,920,822 | 0.64 |
| | 南アフリカ | 1,004,440,125 | 0.54 |
| | マレーシア | 929,661,806 | 0.50 |
| | スウェーデン | 928,225,747 | 0.50 |
| | シンガポール | 709,407,221 | 0.38 |
| スイス | 619,576,867 | 0.33 | |
| ノルウェー | 519,995,614 | 0.28 | |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 2,229,466,112 | 1.23 |
| 純資産総額 | | 185,543,911,570 | 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。

(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

平成26年11月28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 | 2.5 T-NOTE 240515 | 国債証券 | | 7,600,000.00 | 11,820.63 12,116.7276 | 898,368,053 920,871,301 | 2.500000 2024/05/15 | 0.50 |
| アメリカ | 2.625 T-NOTE 201115 | 国債証券 | | 7,400,000.00 | 12,242.80 12,377.2031 | 905,967,854 915,913,031 | 2.625000 2020/11/15 | 0.49 |
| アメリカ | 2.5 T-NOTE 230815 | 国債証券 | | 7,300,000.00 | 11,788.71 12,166.6059 | 860,576,070 888,162,233 | 2.500000 2023/08/15 | 0.48 |
| アメリカ | 1.625 T-NOTE 190630 | 国債証券 | | 6,200,000.00 | 11,834.58 11,905.2067 | 733,744,365 738,122,820 | 1.625000 2019/06/30 | 0.40 |
| アメリカ | 1.5 T-NOTE 180831 | 国債証券 | | 6,100,000.00 | 11,867.33 11,942.1536 | 723,907,511 728,471,373 | 1.500000 2018/08/31 | 0.39 |
| アメリカ | 2.375 T-NOTE 240815 | 国債証券 | | 6,000,000.00 | 11,794.31 11,970.7875 | 707,658,936 718,247,250 | 2.375000 2024/08/15 | 0.39 |
| フランス | 5.75 O.A.T 321025 | 国債証券 | | 2,850,000.00 | 21,666.36 24,039.9680 | 617,491,488 685,139,088 | 5.750000 2032/10/25 | 0.37 |
| フランス | 3.75 O.A.T 210425 | 国債証券 | | 3,700,000.00 | 17,200.32 17,828.1280 | 636,411,840 659,640,736 | 3.750000 2021/04/25 | 0.36 |
| アメリカ | 3.625 T-BOND 430815 | 国債証券 | | 4,900,000.00 | 12,209.61 13,412.6392 | 598,270,992 657,219,325 | 3.625000 2043/08/15 | 0.35 |
| アメリカ | 1.75 T-NOTE 230515 | 国債証券 | | 5,700,000.00 | 11,086.42 11,474.7757 | 631,926,344 654,062,214 | 1.750000 2023/05/15 | 0.35 |
| フランス | 5.5 O.A.T 290425 | 国債証券 | | 2,900,000.00 | 20,425.47 22,462.7200 | 592,338,688 651,418,880 | 5.500000 2029/04/25 | 0.35 |
| フランス | 3.25 O.A.T 211025 | 国債証券 | | 3,700,000.00 | 16,723.39 17,488.8320 | 618,765,504 647,086,784 | 3.250000 2021/10/25 | 0.35 |
| アメリカ | 2.125 T-NOTE 151231 | 国債証券 | | 5,300,000.00 | 12,185.54 12,071.0058 | 645,833,682 639,763,311 | 2.125000 2015/12/31 | 0.34 |

| | | | | | | | |
|------|------------------------|------|--------------|--------------------------|----------------------------|------------------------|------|
| フランス | 3.5 O.A.T 200425 | 国債証券 | 3,700,000.00 | 16,884.63 17,251.8400 | 624,731,372 638,318,080 | 3.500000 2020/04/25 | 0.34 |
| フランス | 4.25 O.A.T 231025 | 国債証券 | 3,300,000.00 | 17,923.07 19,119.8080 | 591,461,376 630,953,664 | 4.250000 2023/10/25 | 0.34 |
| アメリカ | 2.125 T-NOTE 210815 | 国債証券 | 5,200,000.00 | 11,773.41 11,973.5585 | 612,217,329 622,625,041 | 2.125000 2021/08/15 | 0.34 |
| イタリア | 6 ITALY GOVT 310501 | 国債証券 | 2,900,000.00 | 19,094.78 20,840.5760 | 553,748,736 604,376,704 | 6.000000 2031/05/01 | 0.33 |
| アメリカ | 2 T-NOTE 230215 | 国債証券 | 5,100,000.00 | 11,378.45 11,747.2589 | 580,301,215 599,110,203 | 2.000000 2023/02/15 | 0.32 |
| イギリス | 1.25 GILT 180722 | 国債証券 | 3,200,000.00 | 18,212.68 18,713.2261 | 582,805,881 598,823,236 | 1.250000 2018/07/22 | 0.32 |
| イタリア | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 国債証券 | 3,100,000.00 | 17,664.00 19,195.6160 | 547,584,000 595,064,096 | 5.250000 2029/11/01 | 0.32 |
| アメリカ | 1.625 T-NOTE 190831 | 国債証券 | 5,000,000.00 | 11,741.65 11,888.1188 | 587,082,888 594,405,943 | 1.625000 2019/08/31 | 0.32 |
| アメリカ | 1 T-NOTE 170915 | 国債証券 | 5,000,000.00 | 11,860.12 11,869.6454 | 593,006,211 593,482,271 | 1.000000 2017/09/15 | 0.32 |
| フランス | 3.75 O.A.T 170425 | 国債証券 | 3,700,000.00 | 16,197.88 16,035.9680 | 599,321,856 593,330,816 | 3.750000 2017/04/25 | 0.32 |
| アメリカ | 3.125 T-BOND 430215 | 国債証券 | 4,800,000.00 | 11,122.85 12,235.8813 | 533,897,122 587,322,303 | 3.125000 2043/02/15 | 0.32 |
| フランス | 3.5 O.A.T 260425 | 国債証券 | 3,200,000.00 | 17,127.52 18,337.4400 | 548,080,800 586,798,080 | 3.500000 2026/04/25 | 0.32 |
| フランス | 3.75 O.A.T 191025 | 国債証券 | 3,400,000.00 | 16,979.52 17,254.0480 | 577,303,680 586,637,632 | 3.750000 2019/10/25 | 0.32 |
| アメリカ | 1.5 T-NOTE 190131 | 国債証券 | 4,900,000.00 | 11,793.44 11,886.7333 | 577,878,682 582,449,934 | 1.500000 2019/01/31 | 0.31 |
| フランス | 2.5 O.A.T 201025 | 国債証券 | 3,500,000.00 | 16,002.11 16,568.0960 | 560,073,920 579,883,360 | 2.500000 2020/10/25 | 0.31 |
| アメリカ | 3.625 T-NOTE 200215 | 国債証券 | 4,400,000.00 | 12,985.20 13,023.3115 | 571,348,839 573,025,709 | 3.625000 2020/02/15 | 0.31 |
| フランス | 3 O.A.T 220425 | 国債証券 | 3,300,000.00 | 16,458.18 17,327.6480 | 543,120,012 571,812,384 | 3.000000 2022/04/25 | 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26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 国債証券 | 98.80 |
| 合計 | 98.80 |

(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

該当事項はありません。

< 参考 >

「新興国債券インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成26年11月28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 | トルコ | 787,984,326 | 10.91 |
| | ポーランド | 767,739,456 | 10.63 |
| | ブラジル | 721,072,270 | 9.99 |
| | マレーシア | 713,801,832 | 9.89 |
| | メキシコ | 705,196,350 | 9.77 |
| | 南アフリカ | 698,063,597 | 9.67 |
| | インドネシア | 557,457,618 | 7.72 |
| | コロンビア | 520,241,717 | 7.20 |
| | タイ | 456,378,411 | 6.32 |
| | ハンガリー | 393,603,772 | 5.45 |
| | ロシア | 357,316,945 | 4.95 |
| | ナイジェリア | 115,204,039 | 1.60 |
| | ペルー | 87,402,946 | 1.21 |
| | フィリピン | 27,654,000 | 0.38 |
| チリ | 10,356,888 | 0.14 | |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 301,221,956 | 4.17 |
| 純資産総額 | | 7,220,696,123 | 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。

(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

平成26年11月28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) | | |
| コロンビア | 7.75 COLOMBI (GL) 210414 | 国債証券 | | 4,610,000,000.00 | 6.13 6.1811 | 282,766,860 284,948,710 | 7.750000 2021/04/14 | 3.95 |
| 南アフリカ | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 国債証券 | | 11,000,000.00 | 1,255.39 1,310.8047 | 138,093,250 144,188,519 | 10.500000 2026/12/21 | 2.00 |
| ブラジル | BRAZIL-LTN 160701 | 国債証券 | | 2,700,000.00 | 3,766.74 3,885.3923 | 101,702,144 104,905,594 | 2016/07/01 | 1.45 |
| タイ | 3.875 THAILAND 190613 | 国債証券 | | 24,200,000.00 | 372.05 382.8672 | 90,038,084 92,653,862 | 3.875000 2019/06/13 | 1.28 |
| コロンビア | 9.85 COLOMBI (GL) 270628 | 国債証券 | | 1,290,000,000.00 | 7.09 7.1793 | 91,567,136 92,613,937 | 9.850000 2027/06/28 | 1.28 |
| ブラジル | BRAZIL-LTN 170101 | 国債証券 | | 2,500,000.00 | 3,287.47 3,673.0929 | 82,186,889 91,827,324 | 2017/01/01 | 1.27 |
| ポーランド | 4 POLAND 231025 | 国債証券 | | 2,000,000.00 | 3,614.26 4,001.8880 | 72,285,312 80,037,760 | 4.000000 2023/10/25 | 1.11 |
| ロシア | 7.85 RUSSIA (GL) 180310 | 国債証券 | | 35,000,000.00 | 245.02 221.7920 | 85,757,980 77,627,200 | 7.850000 2018/03/10 | 1.08 |
| トルコ | 10.4 TURKEY GOVT 240320 | 国債証券 | | 1,200,000.00 | 5,958.56 6,229.8350 | 71,502,720 74,758,020 | 10.400000 2024/03/20 | 1.04 |
| 南アフリカ | 8 SOUTH AFRICA 181221 | 国債証券 | | 6,600,000.00 | 1,099.02 1,121.7407 | 72,535,509 74,034,890 | 8.000000 2018/12/21 | 1.03 |
| ブラジル | BRAZIL-LTN 160101 | 国債証券 | | 1,800,000.00 | 3,742.03 4,111.1432 | 67,356,637 74,000,577 | 2016/01/01 | 1.02 |
| 南アフリカ | 6.75 SOUTH AFRICA 210331 | 国債証券 | | 7,000,000.00 | 1,007.51 1,052.8552 | 70,526,215 73,699,866 | 6.750000 2021/03/31 | 1.02 |
| コロンビア | 12 COLOMBIA (GL) 151022 | 国債証券 | | 1,250,000,000.00 | 6.03 5.8105 | 75,411,408 72,631,343 | 12.000000 2015/10/22 | 1.01 |
| インドネシア | 8.375 INDONESIA 240315 | 国債証券 | | 7,100,000,000.00 | 0.98 1.0226 | 70,205,641 72,610,904 | 8.375000 2024/03/15 | 1.01 |
| トルコ | 10.5 TURKEY GOVT 200115 | 国債証券 | | 1,200,000.00 | 5,468.81 5,985.5697 | 65,625,795 71,826,837 | 10.500000 2020/01/15 | 0.99 |
| コロンビア | 4.375 COLOMBI (GL) 230321 | 国債証券 | | 1,400,000,000.00 | 4.84 5.0034 | 67,778,040 70,047,726 | 4.375000 2023/03/21 | 0.97 |
| ブラジル | 10(IN)BRAZIL NTN- F210101 | 国債証券 | | 1,500,000.00 | 4,348.35 4,502.8349 | 65,225,385 67,542,524 | 10.000000 2021/01/01 | 0.94 |
| 南アフリカ | 7.25 SOUTH AFRICA 200115 | 国債証券 | | 6,200,000.00 | 1,046.41 1,087.6315 | 64,877,910 67,433,156 | 7.250000 2020/01/15 | 0.93 |

| | | | | | | | | |
|--------|---------------------------|------|--|------------------|------------------------|--------------------------|-------------------------|------|
| ポーランド | 5 POLAND 160425 | 国債証券 | | 1,800,000.00 | 3,676.67 3,676.1120 | 66,180,224 66,170,016 | 5.000000 2016/04/25 | 0.92 |
| ブラジル | 10(IN)BRAZIL NTN-F170101 | 国債証券 | | 1,400,000.00 | 4,420.06 4,685.6356 | 61,880,946 65,598,899 | 10.000000 2017/01/01 | 0.91 |
| ブラジル | 12.5 BRAZIL (GL) 160105 | 国債証券 | | 1,350,000.00 | 4,848.05 4,825.4115 | 65,448,758 65,143,055 | 12.500000 2016/01/05 | 0.90 |
| ポーランド | 5.75 POLAND 220923 | 国債証券 | | 1,400,000.00 | 4,018.18 4,409.1520 | 56,254,528 61,728,128 | 5.750000 2022/09/23 | 0.85 |
| トルコ | 7.1 TURKEY GOVT 230308 | 国債証券 | | 1,200,000.00 | 4,283.25 5,095.5321 | 51,399,002 61,146,385 | 7.100000 2023/03/08 | 0.85 |
| ブラジル | BRAZIL-LTN 180101 | 国債証券 | | 1,850,000.00 | 3,197.11 3,296.3093 | 59,146,564 60,981,722 | 2018/01/01 | 0.84 |
| インドネシア | 9 INDONESIA 290315 | 国債証券 | | 5,700,000,000.00 | 1.03 1.0649 | 58,890,160 60,701,944 | 9.000000 2029/03/15 | 0.84 |
| トルコ | 9 TURKEY GOVT 170308 | 国債証券 | | 1,100,000.00 | 5,174.29 5,499.1264 | 56,917,235 60,490,391 | 9.000000 2017/03/08 | 0.84 |
| タイ | 3.625 THAILAND 230616 | 国債証券 | | 15,700,000.00 | 358.24 381.6468 | 56,244,022 59,918,547 | 3.625000 2023/06/16 | 0.83 |
| ポーランド | 4.75 POLAND 161025 | 国債証券 | | 1,600,000.00 | 3,676.57 3,715.5360 | 58,825,184 59,448,576 | 4.750000 2016/10/25 | 0.82 |
| 南アフリカ | 6.5 SOUTH AFRICA 410228 | 国債証券 | | 6,900,000.00 | 807.80 855.5921 | 55,738,389 59,035,859 | 6.500000 2041/02/28 | 0.82 |
| マレーシア | 3.26 MALAYSIA GOVT 180301 | 国債証券 | | 1,700,000.00 | 3,452.78 3,468.9118 | 58,697,382 58,971,501 | 3.260000 2018/03/01 | 0.82 |

(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26年11月28日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 国債証券 | 95.83 |
| 合計 | 95.83 |

(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

該当事項はありません。

< 参考 >

「マネー・マーケット・マザーファンド」

当ファンドは、当該マザーファンドへの投資を行っていないため記載を省略しております。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2014年11月28日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算

2 分配の推移

| | |
|----------|----|
| 2014年 5月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

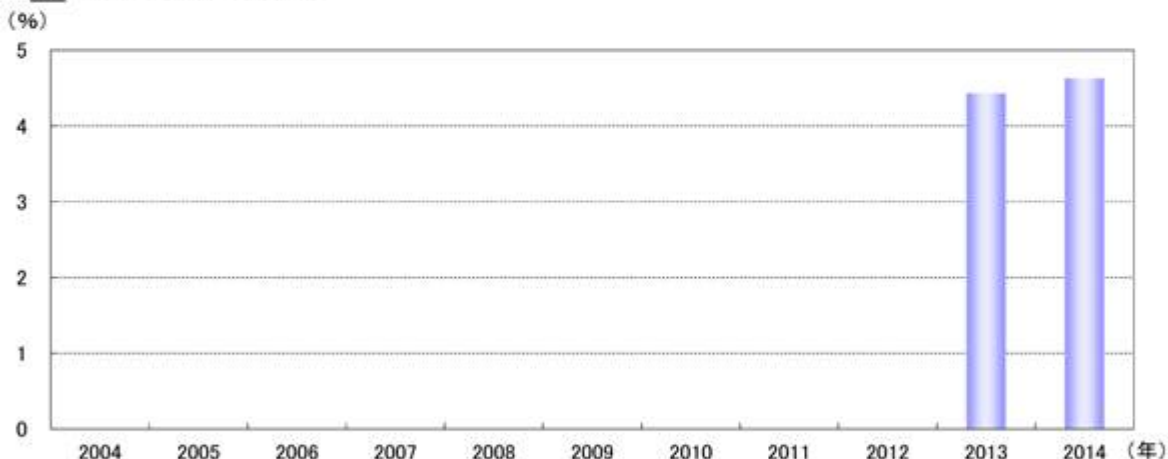
3 主要な資産の状況(2014年11月28日現在)

| 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 | 22.7% | 円 | 72.6% | トヨタ自動車 | 株式 | 輸送用機器 | 日本 | 1.1% |
| 国内債券 | 18.8% | ユーロ | 12.1% | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 銀行業 | 日本 | 0.6% |
| 外国株式 | 12.4% | イギリスポンド | 2.9% | ソフトバンク | 株式 | 情報・通信業 | 日本 | 0.5% |
| 外国債券 | 39.8% | メキシコペソ | 2.0% | 三井住友フィナンシャルグループ | 株式 | 銀行業 | 日本 | 0.4% |
| | | 南アフリカランド | 2.0% | 本田技研工業 | 株式 | 輸送用機器 | 日本 | 0.4% |
| | | ブラジルリアル | 1.9% | 7.75 COLOMBI (GL) 210414 | 債券 | 国債 | コロンビア | 0.6% |
| | | ポーランドズロチ | 1.9% | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 債券 | 国債 | 南アフリカ | 0.3% |
| | | その他 | 14.8% | 第121回利付国債(5年) | 債券 | 国債 | 日本 | 0.3% |
| コールローン他 (負債控除後) | 6.3% | 米ドル | -10.2% | 第335回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 日本 | 0.2% |
| 合計 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 第113回利付国債(5年) | 債券 | 国債 | 日本 | 0.2% |

| その他資産の状況 | 比率 |
|--------------|------|
| 株価指数先物取引(買建) | 0.5% |
| 債券先物取引(買建) | 0.1% |

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・投資信託証券(REITを含む)の組み入れがある場合、株式に含めて表示

4 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
- ・2013年は設定日から年末までの、2014年は11月28日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<更新後>

(略)

| | |
|------------------|---|
| ファンドの償還等に関する開示方法 | 委託会社は、ファンドの任意償還、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。（略）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。（略） |
| 反対者の買取請求権 | 委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。 |

(略)

| | |
|---------|--|
| 交付運用報告書 | 委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。 |
|---------|--|

(略)

第3【ファンドの経理状況】

<追加>

【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、第2期中間計算期間（平成26年5月13日から平成26年11月12日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

コアバランス

(1) 【中間貸借対照表】

| | 第2期中間計算期間末 [平成26年11月12日現在] | |
|-----------------|-------------------------------|------------|
| | 金額(円) | |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 612,622 |
| 親投資信託受益証券 | | 10,499,807 |
| 未収入金 | | 27,799 |
| 流動資産合計 | | 11,140,228 |
| 資産合計 | | 11,140,228 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 50,825 |
| 未払金 | | 53,367 |
| 未払受託者報酬 | | 2,947 |
| 未払委託者報酬 | | 73,768 |
| その他未払費用 | | 184 |
| 流動負債合計 | | 181,091 |
| 負債合計 | | 181,091 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 10,216,053 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 743,084 |
| (分配準備積立金) | | (472,844) |
| 元本等合計 | | 10,959,137 |
| 純資産合計 | | 10,959,137 |
| 負債純資産合計 | | 11,140,228 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

| | 第2期中間計算期間 自平成26年5月13日 至平成26年11月12日 | |
|-------------------------|--|-----------|
| | 金額(円) | |
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | | 389 |
| 有価証券売買等損益 | | 1,069,785 |
| 為替差損益 | | 715,033 |
| 営業収益合計 | | 355,141 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | | 2,947 |
| 委託者報酬 | | 73,768 |
| その他費用 | | 21,784 |
| 営業費用合計 | | 98,499 |
| 営業利益 | | 256,642 |
| 経常利益 | | 256,642 |
| 中間純利益 | | 256,642 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | | |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | | 478,952 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 7,490 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 7,490 |
| 分配金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 743,084 |

(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移動平均法に基づき、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。 |
| 2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引は個別法に基づき、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。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第2期中間計算期間末 [平成26年11月12日現在] |
|-----------------------------|-------------------------------|
| 1 期首元本額 | 10,097,622円 |
| 期中追加設定元本額 | 118,431円 |
| 期中一部解約元本額 | |
| 2 受益権の総数 | 10,216,053口 |
| 3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.0727円 (10,727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2期中間計算期間末 [平成26年11月12日現在] |
|---------------------------|---|
| 1 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 |
| 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、(デリバティブ取引等関係に関する注記)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。 |
| 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。 |

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

| 区 分 | 種 類 | 第2期中間計算期間末 [平成26年11月12日現在] | | |
|-----------|------------------------|----------------------------|-----------|-------------|
| | | 契 約 額 等 (円) | 時 価 (円) | 評 価 損 益 (円) |
| | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカドル | 2,843,675 | 2,894,500 | 50,825 |
| | 合 計 | 2,843,675 | 2,894,500 | 50,825 |

(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。

<参考>

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。

[次へ](#)

「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26年11月12日現在] |
|-------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 38,436,145,122 |
| 株式 | 2 | 230,638,376,039 |
| 派生商品評価勘定 | | 4,062,496 |
| 未収入金 | | 3,022,192,108 |
| 未収配当金 | | 1,595,066,232 |
| 未収利息 | | 50,177 |
| その他未収収益 | | 137,696,085 |
| 差入委託証拠金 | | 102,000,000 |
| 流動資産合計 | | 273,935,588,259 |
| 資産合計 | | 273,935,588,259 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 7,586,216 |
| 前受金 | | 12,400,000 |
| 未払解約金 | | 2,009,323,708 |
| 未払利息 | | 383,658 |
| 受入担保金 | | 36,807,365,187 |
| 流動負債合計 | | 38,837,058,769 |
| 負債合計 | | 38,837,058,769 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 173,267,439,142 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 61,831,090,348 |
| 元本等合計 | | 235,098,529,490 |
| 純資産合計 | | 235,098,529,490 |
| 負債純資産合計 | | 273,935,588,259 |

(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 | 株式は移動平均法に基づき、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 | 先物取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|---------------------------------|--|-------------------|
| 1 期首 | | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | | 197,945,748,241円 |
| 期首からの追加設定元本額 | | 27,800,726,379円 |
| 期首からの一部解約元本額 | | 52,479,035,478円 |
| 元本の内訳* | | |
| ファンド・マネジャー(国内株式) | | 3,460,155,913円 |
| eMAXIS TOPIXインデックス | | 8,314,640,394円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | | 691,709,483円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | | 88,101,040円 |
| コアバランス | | 1,869,780円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型) | | 480,319,753円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型) | | 1,050,539,735円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型) | | 86,648,668円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN) | | 695,596円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | | 37,948,300,927円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | | 17,529,032,675円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定) | | 646,559,982円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定) | | 5,221,315,432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) | | 12,509,162,506円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定) | | 13,100,143,776円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定) | | 4,860,146,550円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | | 1,018,454,447円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定) | | 566,074,390円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定) | | 259,265,756円 |

| | |
|---|----------------------|
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 719,046,108円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定) | 1,582,463,081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) | 40,700,564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) | 73,660,992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) | 363,598,429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 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンド | 9,882,521,859円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ライト | 496,587,688円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA | 49,436,883円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA | 196,318,929円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA | 288,803,416円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA | 234,612,149円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1 | 4,417,596,592円 |
| 三菱UFJ TOPIX・ファンドVA | 1,670,846,923円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定) | 189,397,243円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定) | 2,017,531,820円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定) | 236,912,795円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定) | 1,570,216,710円 |
| 三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド | 2,021,112,554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) | 501,666,230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) | 2,131,215,980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) | 1,638,013,844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) | 1,251,194,109円 |
| 三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド | 33,852,120,787円 |
| (合計) | 173,267,439,142円 |
| 2 貸付有価証券 株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式 | 35,463,096,225円 |
| 3 受益権の総数 | 173,267,439,142口 |
| 4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.3569円 (13,569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26年11月12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。 |
| 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、(デリバティブ取引等関係に関する注記)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。 |
| 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。 |

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

| 区分 | 種類 | [平成26年11月12日現在] | | |
|------|----------------|-----------------|---------------|-----------|
| | | 契約額等(円) | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 3,161,225,000 | 3,157,900,000 | 3,325,000 |
| | 合計 | 3,161,225,000 | 3,157,900,000 | 3,325,000 |

(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ぬ。

「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26年11月12日現在] |
|-------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 650,235,429 |
| コール・ローン | | 916,122,194 |
| 株式 | | 216,638,374,905 |
| 投資証券 | | 4,891,425,783 |
| 派生商品評価勘定 | | 24,384,496 |
| 未収入金 | | 1,688,558,047 |
| 未収配当金 | | 306,284,593 |
| 未収利息 | | 1,195 |
| 差入委託証拠金 | | 622,751,043 |
| 流動資産合計 | | 225,738,137,685 |
| 資産合計 | | 225,738,137,685 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 5,878,410 |
| 未払金 | | 45,428,122 |
| 未払解約金 | | 1,389,477,897 |
| 流動負債合計 | | 1,440,784,429 |
| 負債合計 | | 1,440,784,429 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 105,535,443,542 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 118,761,909,714 |
| 元本等合計 | | 224,297,353,256 |
| 純資産合計 | | 224,297,353,256 |
| 負債純資産合計 | | 225,738,137,685 |

(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 | 株式は移動平均法に基づき、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。 投資証券は移動平均法に基づき、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 | 先物取引は個別法に基づき、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。 為替予約取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|--------------------------------|--|-------------------|
| 1 期首 | | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | | 108,538,790,996円 |
| 期首からの追加設定元本額 | | 11,332,658,186円 |
| 期首からの一部解約元本額 | | 14,336,005,640円 |
| 元本の内訳* | | |
| ファンド・マネジャー(海外株式) | | 313,881,212円 |
| eMAXIS 先進国株式インデックス | | 11,234,157,567円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | | 448,530,517円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | | 167,083,170円 |
| コアバランス | | 433,741円 |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド | | 3,266,247,605円 |
| eMAXIS 全世界株式インデックス | | 1,792,142,318円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型) | | 676,458,522円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型) | | 1,235,775,132円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型) | | 42,661,511円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN) | | 1,003,687円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | | 31,634,050,464円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | | 18,822,110,355円 |

| | |
|---------------------------------------|----------------------|
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定) | 422,286,575円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定) | 3,352,460,034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) | 9,345,096,293円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定) | 459,638,674円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定) | 168,691,754円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 2,272,821,300円 |
| MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 2,336,044,734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) | 78,885,889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) | 7,060,739,943円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド | 1,896,136,255円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA | 16,430,445円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA | 64,091,425円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA | 106,013,926円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA | 94,186,006円 |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA | 609,705,134円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定) | 60,820,228円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定) | 649,321,708円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定) | 152,388,108円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定) | 1,008,435,609円 |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド | 3,779,244,923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) | 161,200,328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) | 693,256,967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) | 607,662,933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) | 505,348,550円 |
| (合計) | 105,535,443,542円 |
| 2 受益権の総数 | 105,535,443,542口 |
| 3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.1253円 (21,253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26年11月12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。 |
| 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、(デリバティブ取引等関係に関する注記)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。 |
| 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。 |

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

| 区分 | 種類 | [平成26年11月12日現在] | | |
|------|----------------|-----------------|---------------|------------|
| | | 契約額等(円) | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 1,987,444,139 | 2,011,778,875 | 24,334,736 |
| | 合計 | 1,987,444,139 | 2,011,778,875 | 24,334,736 |

(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。

通貨関連

| 区 分 | 種 類 | [平成26年11月12日現在] | | | |
|-----------|------------|-------------------|-------|---------------|----------------|
| | | 契 約 額 等 (円) | | 時 価 (円) | 評 価 損 益 (円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | アメリカドル | 698,046,730 | | 700,590,000 | 2,543,270 |
| | カナダドル | 50,783,810 | | 51,015,000 | 231,190 |
| | オーストラリアドル | 74,043,630 | | 74,379,800 | 336,170 |
| | イギリスポンド | 100,751,950 | | 101,348,500 | 596,550 |
| | スイスフラン | 47,693,700 | | 47,960,000 | 266,300 |
| | 香港ドル | 10,457,860 | | 10,451,000 | 6,860 |
| | シンガポールドル | 12,539,520 | | 12,538,400 | 1,120 |
| | スウェーデンクローネ | 15,449,900 | | 15,640,000 | 190,100 |
| | ノルウェークローネ | 7,586,550 | | 7,654,500 | 67,950 |
| | ユーロ | 221,966,900 | | 223,572,000 | 1,605,100 |
| 合 計 | | 1,239,320,550 | | 1,245,149,200 | 5,828,650 |

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「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26年11月12日現在] |
|-------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 336,313,852 |
| コール・ローン | | 222,818,681 |
| 株式 | | 31,700,054,300 |
| 投資証券 | | 146,862,303 |
| 未収入金 | | 155,818 |
| 未収配当金 | | 24,058,111 |
| 未収利息 | | 290 |
| 差入委託証拠金 | | 80,310,233 |
| 流動資産合計 | | 32,510,573,588 |
| 資産合計 | | 32,510,573,588 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 5,718,119 |
| 未払金 | | 69,373,497 |
| 未払解約金 | | 201,565,538 |
| 流動負債合計 | | 276,657,154 |
| 負債合計 | | 276,657,154 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 14,585,389,216 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 17,648,527,218 |
| 元本等合計 | | 32,233,916,434 |
| 純資産合計 | | 32,233,916,434 |
| 負債純資産合計 | | 32,510,573,588 |

(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 | 株式は移動平均法に基づき、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。 投資証券は移動平均法に基づき、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。 新株予約権証券は移動平均法に基づき、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 | 先物取引は個別法に基づき、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。 為替予約取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|-------------------------------------|-------------------|
| 1 期首 | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | 12,660,631,564円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 2,901,071,714円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 976,314,062円 |
| 元本の内訳* | |
| F Pバランスファンド(安定型) | 6,305,380円 |
| F Pバランスファンド(安定成長型) | 28,876,038円 |
| e M A X I S 新興国株式インデックス | 10,413,898,985円 |
| e M A X I S バランス(8資産均等型) | 424,655,128円 |
| e M A X I S バランス(波乗り型) | 54,237,983円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 18,339,482円 |
| コアバランス | 201,647円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 2,333,083,092円 |
| 新興国株式インデックスオープン | 179,407,135円 |
| e M A X I S 全世界株式インデックス | 221,217,365円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型) | 10,100,887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) | 24,821,769円 |
| M U A M 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 870,244,325円 |

| | |
|-----------------------------|----------------------|
| （ 合 計 ） | 14,585,389,216円 |
| 2 受益権の総数 | 14,585,389,216口 |
| 3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 2.2100円 (22,100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26年11月12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。 |
| 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、（デリバティブ取引等関係に関する注記）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> |
| 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。 |

（有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

| 区 分 | 種 類 | [平成26年11月12日現在] | | | |
|------|----------------|-------------------|-------|-------------|-----------|
| | | 契 約 額 等 (円) | | 時 価 | 評 価 損 益 |
| | | | うち1年超 | (円) | (円) |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 373,827,152 | | 368,109,033 | 5,718,119 |
| | 合 計 | 373,827,152 | | 368,109,033 | 5,718,119 |

（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。

[前へ](#) [次へ](#)

「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26年11月12日現在] |
|-------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 4,008,805,069 |
| 国債証券 | | 230,628,049,500 |
| 地方債証券 | | 16,998,994,643 |
| 特殊債券 | | 25,488,163,632 |
| 社債券 | | 16,359,653,940 |
| 未収入金 | | 165,732,000 |
| 未収利息 | | 831,906,300 |
| 前払金 | | 4,050,000 |
| 前払費用 | | 29,996,020 |
| 差入委託証拠金 | | 7,200,000 |
| 流動資産合計 | | 294,522,551,104 |
| 資産合計 | | 294,522,551,104 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 10,066,200 |
| 未払金 | | 740,873,900 |
| 未払解約金 | | 1,737,923,002 |
| 流動負債合計 | | 2,488,863,102 |
| 負債合計 | | 2,488,863,102 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 234,365,345,218 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 57,668,342,784 |
| 元本等合計 | | 292,033,688,002 |
| 純資産合計 | | 292,033,688,002 |
| 負債純資産合計 | | 294,522,551,104 |

(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 | 公社債は個別法に基づき、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 | 先物取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|---------------------------------|--|-------------------|
| 1 期首 | | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | | 230,228,174,698円 |
| 期首からの追加設定元本額 | | 27,626,922,062円 |
| 期首からの一部解約元本額 | | 23,489,751,542円 |
| 元本の内訳* | | |
| ファンド・マネジャー(国内債券) | | 8,499,929,135円 |
| eMAXIS 国内債券インデックス | | 9,236,285,389円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | | 675,600,318円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | | 532,436,248円 |
| コアバランス | | 1,710,309円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型) | | 3,809,839,834円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型) | | 2,133,796,864円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型) | | 104,384,483円 |
| 三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN) | | 5,356,265円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | | 59,669,837,426円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | | 18,354,458,206円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定) | | 2,703,053,842円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定) | | 8,203,638,532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) | | 70,530,777,717円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定) | | 13,884,321,354円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定) | | 5,131,380,521円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | | 3,202,999,515円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定) | | 1,046,118,814円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定) | | 270,024,801円 |

| | |
|---------------------------------------|----------------------|
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定） | 6,674,303,536円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定） | 4,963,937,691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） | 61,166,125円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA | 148,303,779円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA | 295,602,227円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA | 282,688,617円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA | 169,546,450円 |
| 三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA | 34,190,172円 |
| 三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定） | 505,555,215円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定） | 1,587,757,981円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定） | 664,350,913円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定） | 1,392,330,115円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド | 2,355,939,326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） | 1,531,377,540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） | 3,194,974,247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） | 1,603,273,148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） | 904,098,563円 |
| （合計） | 234,365,345,218円 |
| 2 受益権の総数 | 234,365,345,218口 |
| 3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 1.2461円 (12,461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26年11月12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。 |
| 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、（デリバティブ取引等関係に関する注記）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。 |
| 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。 |

（有価証券関係に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

債券関連

| 区分 | 種類 | [平成26年11月12日現在] | | | |
|------|--------------|-----------------|-------|---------------|-------------|
| | | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 2,197,800,000 | | 2,187,750,000 | 10,050,000 |
| | 合計 | 2,197,800,000 | | 2,187,750,000 | 10,050,000 |

（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。

[前へ](#) [次へ](#)

「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26年11月12日現在] |
|-----------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 232,924,097 |
| 国債証券 | | 185,799,057,757 |
| 派生商品評価勘定 | | 31,976 |
| 未収入金 | | 2,095,334,155 |
| 未収利息 | | 1,732,047,005 |
| 前払費用 | | 67,693,874 |
| 流動資産合計 | | 189,927,088,864 |
| 資産合計 | | |
| 189,927,088,864 | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 19,453,809 |
| 未払解約金 | | 1,913,399,110 |
| 流動負債合計 | | 1,932,852,919 |
| 負債合計 | | |
| 1,932,852,919 | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 90,086,740,528 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 97,907,495,417 |
| 元本等合計 | | 187,994,235,945 |
| 純資産合計 | | |
| 187,994,235,945 | | |
| 負債純資産合計 | | |
| 189,927,088,864 | | |

(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 | 公社債は個別法に基づき、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 | 為替予約取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|-------------------------------------|--|-------------------|
| 1 期首 | | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | | 98,907,969,030円 |
| 期首からの追加設定元本額 | | 7,037,853,068円 |
| 期首からの一部解約元本額 | | 15,859,081,570円 |
| 元本の内訳* | | |
| ファンド・マネジャー(海外債券) | | 1,598,286,377円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス | | 4,179,714,255円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | | 447,934,763円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | | 167,497,953円 |
| コアバランス | | 1,347,339円 |
| 三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド | | 5,303,396,322円 |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定) | | 31,443,249,288円 |
| 三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | | 3,807,330,645円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定) | | 2,530,866,327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) | | 7,241,209,486円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定) | | 17,038,700,284円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定) | | 4,740,867,731円 |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | | 1,012,692,089円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定) | | 365,837,212円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定) | | 113,359,901円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定) | | 3,095,208,669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) | | 66,541,914円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA | | 16,348,789円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA | | 42,965,492円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA | | 53,662,170円 |
| インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA | | 19,072,214円 |
| 三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA | | 680,786,537円 |

| | |
|---------------------------------------|----------------------|
| 三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定) | 123,103,402円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定) | 327,905,880円 |
| 三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定) | 308,088,856円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定) | 510,370,452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) | 1,768,643,783円 |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド | 2,048,904,630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) | 163,187,379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) | 462,755,595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) | 305,076,181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) | 101,828,613円 |
| (合計) | 90,086,740,528円 |
| 2 受益権の総数 | 90,086,740,528口 |
| 3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.0868円 (20,868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26年11月12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。 |
| 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、(デリバティブ取引等関係に関する注記)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。 |
| 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。 |

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

| 区 分 | 種 類 | [平成26年11月12日現在] | | | |
|-----------|--------------|-----------------|---------------|-------------|----------------|
| | | 契約額等(円) | | 時 価 (円) | 評 価 損 益 (円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | アメリカドル | 832,633,166 | | 839,550,000 | 6,916,834 |
| | カナダドル | 49,542,048 | | 49,994,700 | 452,652 |
| | オーストラリアドル | 35,770,399 | | 36,186,400 | 416,001 |
| | イギリスポンド | 174,964,381 | | 176,899,200 | 1,934,819 |
| | スイスフラン | 8,295,015 | | 8,393,000 | 97,985 |
| | シンガポールドル | 9,782,850 | | 9,851,600 | 68,750 |
| | マレーシアリング | 23,013,494 | | 23,195,400 | 181,906 |
| | スウェーデンクローネ | 10,814,090 | | 10,948,000 | 133,910 |
| | ノルウェークローネ | 5,900,650 | | 5,953,500 | 52,850 |
| | デンマーククローネ | 18,249,485 | | 18,420,500 | 171,015 |
| | メキシコペソ | 24,504,640 | | 24,650,000 | 145,360 |
| | ポーランドズロチ | 12,481,084 | | 12,635,500 | 154,416 |
| | 南アフリカランド | 9,158,325 | | 9,270,000 | 111,675 |
| | ユーロ | 908,782,740 | | 917,366,400 | 8,583,660 |
| | 合 計 | | 2,123,892,367 | | 2,143,314,200 |

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「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26年11月12日現在] |
|-------------|---|-------------------|
| | | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 117,601,060 |
| コール・ローン | | 65,582,704 |
| 国債証券 | | 6,505,518,903 |
| 派生商品評価勘定 | | 369,320 |
| 未収入金 | | 26,419,655 |
| 未収利息 | | 92,857,347 |
| 前払費用 | | 26,723,346 |
| 流動資産合計 | | 6,835,072,335 |
| 資産合計 | | |
| | | |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 155,700 |
| 未払金 | | 16,078,747 |
| 未払解約金 | | 25,499,487 |
| 流動負債合計 | | 41,733,934 |
| 負債合計 | | |
| | | |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 4,685,877,924 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 2,107,460,477 |
| 元本等合計 | | 6,793,338,401 |
| 純資産合計 | | |
| | | |
| 負債純資産合計 | | |
| | | |

(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 | 公社債は個別法に基づき、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 | 為替予約取引は個別法に基づき、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26年11月12日現在] |
|-------------------------------------|--|-------------------|
| 1 期首 | | 平成26年5月13日 |
| 期首元本額 | | 3,127,511,681円 |
| 期首からの追加設定元本額 | | 1,704,333,884円 |
| 期首からの一部解約元本額 | | 145,967,641円 |
| 元本の内訳* | | |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | | 643,035,479円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | | 240,365,654円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | | 27,648,252円 |
| コアバランス | | 1,139,817円 |
| eMAXIS 新興国債券インデックス | | 2,814,685,256円 |
| 三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド | | 780,283,312円 |
| 新興国債券インデックスオープン | | 73,849,888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) | | 38,007,888円 |
| 三菱UFJ 新興国債券ファンドVA(適格機関投資家限定) | | 66,862,378円 |
| (合計) | | 4,685,877,924円 |
| 2 受益権の総数 | | 4,685,877,924口 |
| 3 1口当たり純資産額 | | 1.4497円 |
| (1万口当たり純資産額) | | (14,497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26年11月12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。 |
| 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、（デリバティブ取引等関係に関する注記）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。 |
| 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。 |

(有価証券関係に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

| 区 分 | 種 類 | [平成26年11月12日現在] | | | |
|-----------|------------|-------------------|-------|------------|----------------|
| | | 契 約 額 等 (円) | | 時 価 (円) | 評 価 損 益 (円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | | | | |
| | トルコリラ | 15,228,300 | | 15,384,000 | 155,700 |
| | 買建 | | | | |
| | タイバーツ | 4,553,770 | | 4,563,000 | 9,230 |
| | メキシコペソ | 15,185,600 | | 15,300,000 | 114,400 |
| | ハンガリーフォリント | 2,324,250 | | 2,345,000 | 20,750 |
| | ポーランドズロチ | 18,557,560 | | 18,782,500 | 224,940 |
| | 合 計 | 55,849,480 | | 56,374,500 | 213,620 |

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

「マネー・マーケット・マザーファンド」の状況
該当事項はありません。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

<更新後>

【純資産額計算書】

平成26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 11,572,411 |
| 負債総額 | 118,652 |
| 純資産総額(-) | 11,453,759 |
| 発行済口数 | 10,482,572 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.0926 (1万口当たり 10,926) |

<参考>

「TOPIXマザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 272,817,282,398 |
| 負債総額 | 36,577,630,697 |
| 純資産総額(-) | 236,239,651,701 |
| 発行済口数 | 169,980,895,915 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.3898 (1万口当たり 13,898) |

<参考>

「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26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 233,440,807,837 |
| 負債総額 | 3,191,914,896 |
| 純資産総額(-) | 230,248,892,941 |
| 発行済口数 | 104,274,920,898 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 2.2081 (1万口当たり 22,081) |

<参考>

「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26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 33,795,087,595 |
| 負債総額 | 174,905,018 |
| 純資産総額(-) | 33,620,182,577 |
| 発行済口数 | 14,643,164,183 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 2.2960 (1万口当たり 22,960) |

<参考>

「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26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 317,238,242,537 |
| 負債総額 | 8,290,025,322 |
| 純資産総額(-) | 308,948,217,215 |
| 発行済口数 | 245,879,521,456 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.2565 (1万口当たり 12,565) |

<参考>

「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26年11月28日現在

(単位：円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 187,109,581,656 |
| 負債総額 | 1,565,670,086 |
| 純資産総額(-) | 185,543,911,570 |
| 発行済口数 | 86,300,304,276 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 2.1500 (1万口当たり 21,500) |

<参考>

「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26年11月28日現在

(単位:円)

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 7,362,011,823 |
| 負債総額 | 141,315,700 |
| 純資産総額(-) | 7,220,696,123 |
| 発行済口数 | 4,817,827,909 口 |
| 1口当たり純資産価額(/) | 1.4987 (1万口当たり 14,987) |

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」の現況

当ファンドは、当該マザーファンドへの投資を行っていないため記載を省略しております。

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】

（1）資本金の額等

<更新後>

平成26年11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、124,098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

<更新後>

（略）

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】

<更新後>

「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」に定める投資助言業務を行っています。

平成26年11月28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 | 504 | 7,095,153 |
| 追加型公社債投資信託 | 18 | 840,192 |
| 単位型株式投資信託 | 27 | 453,783 |
| 単位型公社債投資信託 | 5 | 186,862 |
| 合計 | 554 | 8,575,990 |

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。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ投信株式会社（以下「当社」という。）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）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第30期事業年度に係る中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（第29期事業年度の財務諸表は省略）

<追加>

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| | | 第30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在) | |
|------------|---|------------------------------|------------|
| (資産の部) | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金及び預金 | | | 31,370,051 |
| 有価証券 | | | 3,000,000 |
| 前払費用 | | | 258,701 |
| 未収入金 | | | 15,796 |
| 未収委託者報酬 | | | 7,923,271 |
| 未収収益 | | | 225,606 |
| 繰延税金資産 | | | 392,212 |
| 金銭の信託 | | | 30,000 |
| その他 | | | 54,398 |
| 流動資産合計 | | | 43,270,038 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | | | |
| 建物 | 1 | | 250,210 |
| 器具備品 | 1 | | 186,996 |
| 土地 | | | 1,205,031 |
| 有形固定資産合計 | | | 1,642,238 |
| 無形固定資産 | | | |
| 電話加入権 | | | 15,822 |
| ソフトウェア | | | 1,092,868 |
| ソフトウェア仮勘定 | | | 169,950 |
| 無形固定資産合計 | | | 1,278,641 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | | 21,524,909 |
| 関係会社株式 | | | 320,136 |
| 長期差入保証金 | | | 807,645 |
| その他 | | | 15,035 |
| 投資その他の資産合計 | | | 22,667,726 |
| 固定資産合計 | | | 25,588,606 |
| 資産合計 | | | 68,858,645 |

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(平成26年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

| | | |
|---------|---|-------------------|
| 預り金 | | 70,972 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | | 87,713 |
| 未払償還金 | | 902,004 |
| 未払手数料 | | 3,402,471 |
| その他未払金 | | 157,192 |
| 未払費用 | | 3,862,968 |
| 未払消費税等 | 2 | 491,404 |
| 未払法人税等 | | 2,031,120 |
| 賞与引当金 | | 569,627 |
| その他 | | 431,272 |
| 流動負債合計 | | <u>12,006,746</u> |

固定負債

| | | |
|-----------|--|----------------|
| 退職給付引当金 | | 164,100 |
| 役員退職慰労引当金 | | 42,648 |
| 時効後支払損引当金 | | 180,936 |
| 繰延税金負債 | | 573,410 |
| 固定負債合計 | | <u>961,095</u> |

負債合計

12,967,842

(純資産の部)

株主資本

| | | |
|----------|--|-------------------|
| 資本金 | | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | 222,096 |
| 資本剰余金合計 | | <u>222,096</u> |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | | 44,080,146 |
| 利益剰余金合計 | | <u>51,420,736</u> |
| 株主資本合計 | | <u>53,642,963</u> |

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(平成26年9月30日現在)

| | |
|------------|------------|
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券 | 2,247,838 |
| 評価差額金 | |
| 評価・換算差額等合計 | 2,247,838 |
| 純資産合計 | 55,890,802 |
| 負債純資産合計 | 68,858,645 |

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| 第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日) | |
|---|------------|
| 営業収益 | |
| 委託者報酬 | 27,998,542 |
| 投資顧問料 | 344,009 |
| その他営業収益 | 35,954 |
| 営業収益合計 | 28,378,506 |
| 営業費用 | |
| 支払手数料 | 11,811,245 |
| 広告宣伝費 | 252,822 |
| 公告費 | 159 |
| 調査費 | |
| 調査費 | 508,246 |
| 委託調査費 | 5,680,687 |
| 事務委託費 | 180,803 |
| 営業雑経費 | |
| 通信費 | 47,982 |
| 印刷費 | 249,444 |
| 協会費 | 18,745 |
| 諸会費 | 3,937 |
| 事務機器関連費 | 557,009 |
| その他営業雑経費 | 13,783 |
| 営業費用合計 | 19,324,870 |
| 一般管理費 | |
| 給料 | |
| 役員報酬 | 106,776 |
| 給料・手当 | 1,651,106 |
| 賞与引当金繰入 | 569,627 |
| 福利厚生費 | 307,409 |
| 交際費 | 11,742 |
| 旅費交通費 | 73,065 |
| 租税公課 | 69,920 |
| 不動産賃借料 | 340,014 |
| 退職給付費用 | 65,265 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 15,609 |
| 固定資産減価償却費 | 1 247,581 |
| 諸経費 | 150,294 |
| 一般管理費合計 | 3,608,412 |
| 営業利益 | 5,445,223 |

(単位：千円)

| 第30期中間会計期間 | |
|--------------|-----------|
| (自平成26年4月1日 | |
| 至平成26年9月30日) | |
| 営業外収益 | |
| 受取配当金 | 175,572 |
| 有価証券利息 | 443 |
| 受取利息 | 7,838 |
| 投資有価証券償還益 | 8,854 |
| 収益分配金等時効完成分 | 39,308 |
| 時効後支払損引当金戻入益 | 35,205 |
| その他 | 3,581 |
| 営業外収益合計 | 270,804 |
| 営業外費用 | |
| 事務過誤費 | 11,794 |
| その他 | 917 |
| 営業外費用合計 | 12,712 |
| 経常利益 | 5,703,315 |
| 特別利益 | |
| 投資有価証券売却益 | 114,871 |
| 特別利益合計 | 114,871 |
| 特別損失 | |
| 投資有価証券売却損 | 11,429 |
| 特別損失合計 | 11,429 |
| 税引前中間純利益 | 5,806,758 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,036,037 |
| 法人税等調整額 | 18,471 |
| 法人税等合計 | 2,054,508 |
| 中間純利益 | 3,752,249 |

(3)中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日 ）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | | | |
|-----------------------|-----------|-----------|-----------------|-----------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益 準備金 | 利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | 株主資本合計 |
| | | 資本 準備金 | 資本 剰余金 合計 | | その他利益剰余金 | | | |
| | | | | | 別途 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,131 | 222,096 | 222,096 | 342,589 | 6,998,000 | 43,710,993 | 51,051,583 | 53,273,811 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | | | | 7,631 | 7,631 | 7,631 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 2,000,131 | 222,096 | 222,096 | 342,589 | 6,998,000 | 43,703,362 | 51,043,952 | 53,266,179 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | 3,375,465 | 3,375,465 | 3,375,465 |
| 中間純利益 | | | | | | 3,752,249 | 3,752,249 | 3,752,249 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | | | | | | 376,783 | 376,783 | 376,783 |
| 当中間期末残高 | 2,000,131 | 222,096 | 222,096 | 342,589 | 6,998,000 | 44,080,146 | 51,420,736 | 53,642,963 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------|----------------------|----------------|------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | 評価・換算 差額等合計 | |
| 当期首残高 | 1,669,167 | 1,669,167 | 54,942,978 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | 7,631 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 1,669,167 | 1,669,167 | 54,935,347 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 3,375,465 |
| 中間純利益 | | | 3,752,249 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 578,670 | 578,670 | 578,670 |
| 当中間期変動額合計 | 578,670 | 578,670 | 955,454 |
| 当中間期末残高 | 2,247,838 | 2,247,838 | 55,890,802 |

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異の費用処理方法

数理計算上の差異は、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

[会計方針の変更]

(退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の繰延税金資産は4,225千円増加し、退職給付引当金は11,857千円増加し、繰越利益剰余金は7,631千円減少しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ1,853千円増加しております。

なお、当中間会計期間の1株当たり純資産額は51.88円減少し、1株当たり中間純利益金額は、9.61円増加しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

| | 第30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在) |
|------|------------------------------|
| 建物 | 269,353千円 |
| 器具備品 | 401,909千円 |

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

| | 第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日) |
|--------|---|
| 有形固定資産 | 38,738千円 |
| 無形固定資産 | 208,843千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| | 当事業年度期首 株式数 (株) | 当中間会計期間 増加株式数 (株) | 当中間会計期間 減少株式数 (株) | 当中間会計期間末 株式数 (株) |
|-------|--------------------|----------------------|----------------------|---------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式 | 124,098 | - | - | 124,098 |
| 合計 | 124,098 | - | - | 124,098 |

2. 配当に関する事項

平成26年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

| | |
|----------|-------------|
| 配当金の総額 | 3,375,465千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 27,200円 |
| 基準日 | 平成26年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成26年6月30日 |

(金融商品関係)

第30期中間会計期間(平成26年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成26年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

| | 中間貸借対照表 計上額(千円) | 時価(千円) | 差額(千円) |
|-------------|--------------------|------------|--------|
| (1) 現金及び預金 | 31,370,051 | 31,370,051 | - |
| (2) 有価証券 | 3,000,000 | 3,000,000 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 7,923,271 | 7,923,271 | - |
| (4) 投資有価証券 | 21,486,009 | 21,486,009 | - |
| 資産計 | 63,779,332 | 63,779,332 | - |
| (1) 未払手数料 | 3,402,471 | 3,402,471 | - |
| (2) 未払法人税等 | 2,031,120 | 2,031,120 | - |
| 負債計 | 5,433,591 | 5,433,591 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっており、投資信託は基準価額によっております。

(4) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負債

(1) 未払手数料、(2) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(中間貸借対照表計上額38,900千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間(平成26年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

| | 種類 | 中間貸借対照表 計上額(千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 18,500,144 | 15,274,309 | 3,225,835 |
| | 小計 | 18,500,144 | 15,274,309 | 3,225,835 |
| 中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 2,985,864 | 3,020,230 | 34,365 |
| | 小計 | 2,985,864 | 3,020,230 | 34,365 |
| 合計 | | 21,486,009 | 18,294,539 | 3,191,469 |

(注)非上場株式(中間貸借対照表計上額38,900千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

重要な取引はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在) |
|--------------------------------------|------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 450,376.33円 |
| (算定上の基礎) | |
| 純資産の部の合計額(千円) | 55,890,802 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円) | 55,890,802 |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株) | 124,098 |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日) |
|--------------------|---|
| 1株当たり中間純利益金額 | 30,236.17円 |
| (算定上の基礎) | |
| 中間純利益金額(千円) | 3,752,249 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 3,752,249 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 124,098 |

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりませ
ん。

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26年9月末現在）

(略)

(2) 販売会社

<更新後>

| 名称 | 資本金の額 (平成26年9月末現在) | 事業の内容 |
|-----------|-----------------------|-------------------------------|
| 株式会社SBI証券 | 47,937 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。 |

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26年11月末現在）

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月9日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

| | | | |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 樋口 誠之 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

| | | | |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山田 信之 | 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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績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

会社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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月10日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

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」に掲げられているコアバランスの平成26年5月13日から平成26年11月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コアバランスの平成26年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年5月13日から平成26年11月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ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。