

【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29年2月10日

【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松田 通

【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【事務連絡者氏名】 伊藤 晃

連絡場所 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【電話番号】 03-6250-4740

【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28年11月28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。）の関係情報を更新等するため、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)

■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

(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28年11月末現在）

(略)

・大株主の状況（平成28年11月末現在）

(略)

2【投資方針】

(5)【投資制限】

<訂正前>

同一銘柄の株式同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

<訂正後>

項目名および記載内容を削除、以降の項番号を繰上げ

3【投資リスク】

(2) 投資リスクに対する管理体制

<更新後>

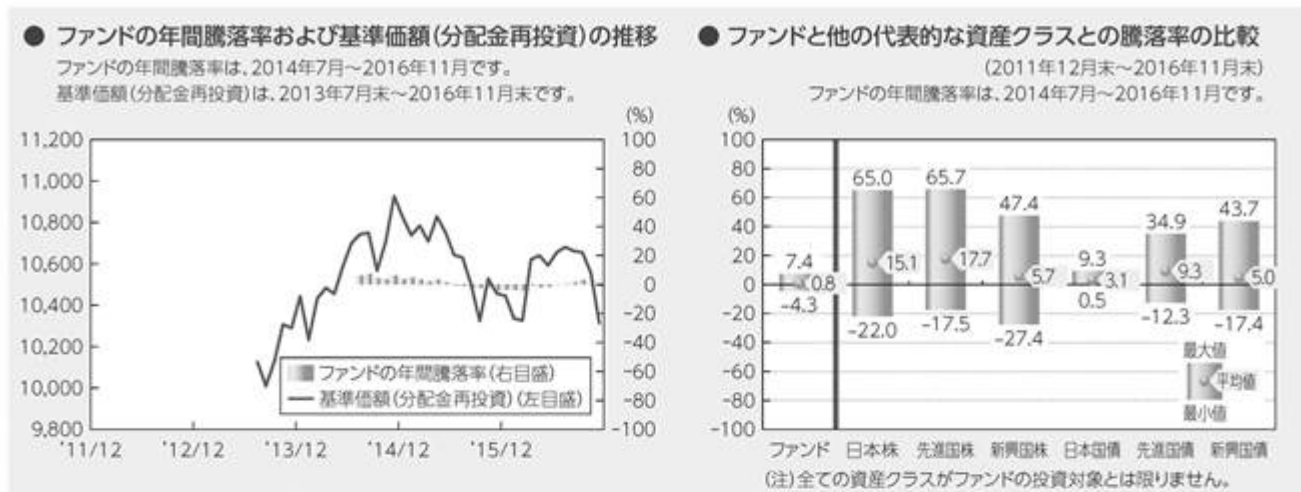
(略)

流動性リスク

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

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



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

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	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】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

(略)

上記は平成28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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,450,394	97.17
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		304,360	2.83
純資産総額		10,754,754	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28年11月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	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		1,975,643	1.9373	3,827,558		35.60
					1.9379	3,828,598		
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		2,359,349	1.3452	3,173,949		29.15
					1.3288	3,135,102		
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		1,569,869	1.1944	1,875,198		17.65
					1.2089	1,897,814		
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		481,990	1.9599	944,667		9.61
					2.1454	1,034,061		
日本	T O P I Xマザーファンド	親投資信託 受益証券		367,844	1.3505	496,798		5.16
					1.5083	554,819		

(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28年11月30日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.17
合計	97.17

(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28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)	10,474 (分配付)
	10,576,574 (分配落)	10,474 (分配落)
第2計算期間末日 (平成27年5月12日)	11,258,045 (分配付)	10,740 (分配付)
	11,258,045 (分配落)	10,740 (分配落)
第3計算期間末日 (平成28年5月12日)	11,123,088 (分配付)	10,649 (分配付)
	11,123,088 (分配落)	10,649 (分配落)
平成27年11月末日	10,921,348	10,456
12月末日	10,911,212	10,446
平成28年1月末日	10,797,767	10,337
2月末日	10,784,858	10,325
3月末日	11,094,542	10,621
4月末日	11,113,498	10,640

5月末日	11,063,511	10,592
6月末日	11,129,651	10,655
7月末日	11,156,961	10,681
8月末日	11,117,280	10,662
9月末日	11,111,600	10,656
10月末日	11,007,984	10,557
11月末日	10,754,754	10,314

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.74
第2計算期間	2.53
第3計算期間	0.84
第3計算期間末日から 平成28年11月末日までの期間	3.14

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。ただし、第3計算期間末日から平成28年11月末日までの期間については平成28年11月末日の基準価額から当該基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

(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計算期間	384,950		10,482,572
第3計算期間	12,927	50,000	10,445,499
第4計算期間期首から 平成28年11月30日までの期間		18,065	10,427,434

<参考>

「TOPIXマザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	291,995,064,320	98.82
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,473,754,769	1.18
純資産総額		295,468,819,089	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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	4,245,120,000	1.44

(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28年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	10,181,100	539.90 669.80	5,496,784,830 6,819,300,780		2.31
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	1,078,500	4,832.42 4,625.00	5,211,771,342 4,988,062,500		1.69
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	1,075,800	3,522.35 4,206.00	3,789,351,421 4,524,814,800		1.53
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	1,225,000	3,040.75 3,332.00	3,724,923,792 4,081,700,000		1.38
日本	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	604,800	5,809.81 6,712.00	3,513,776,544 4,059,417,600		1.37
日本	KDDI	株式	情報・通信業	1,329,200	3,090.09 2,999.00	4,107,357,535 3,986,270,800		1.35
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	18,241,400	172.30 202.60	3,143,088,995 3,695,707,640		1.25
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	845,400	4,405.30 3,946.00	3,724,240,648 3,335,948,400		1.13
日本	ソニー	株式	電気機器	961,100	3,025.62 3,288.00	2,907,928,210 3,160,096,800		1.07
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	544,300	3,987.45 4,899.00	2,170,370,310 2,666,525,700		0.90
日本	ファナック	株式	電気機器	138,000	17,701.35 19,305.00	2,442,786,500 2,664,090,000		0.90
日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	1,003,900	2,640.07 2,624.00	2,650,371,604 2,634,233,600		0.89
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	263,400	9,736.16 9,766.00	2,564,505,855 2,572,364,400		0.87
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	534,500	5,128.06 4,685.00	2,740,952,650 2,504,132,500		0.85
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	562,300	4,669.81 4,435.00	2,625,836,240 2,493,800,500		0.84
日本	三菱商事	株式	卸売業	1,008,100	2,046.24 2,471.50	2,062,822,316 2,491,519,150		0.84
日本	キーエンス	株式	電気機器	30,800	65,716.65 78,230.00	2,024,073,042 2,409,484,000		0.82
日本	キヤノン	株式	電気機器	732,900	3,219.54 3,261.00	2,359,605,880 2,389,986,900		0.81
日本	任天堂	株式	その他製品	83,800	19,461.49 27,775.00	1,630,873,132 2,327,545,000		0.79
日本	三菱地所	株式	不動産業	999,000	2,078.46 2,305.50	2,076,388,700 2,303,194,500		0.78
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	1,456,600	1,562.90 1,579.50	2,276,532,698 2,300,699,700		0.78
日本	三菱電機	株式	電気機器	1,452,100	1,255.57 1,576.50	1,823,226,118 2,289,235,650		0.77
日本	村田製作所	株式	電気機器	142,800	13,719.78 15,425.00	1,959,185,607 2,202,690,000		0.75
日本	信越化学工業	株式	化学	255,700	6,422.34 8,460.00	1,642,193,841 2,163,222,000		0.73
日本	東海旅客鉄道	株式	陸運業	113,200	19,452.02 18,680.00	2,201,969,200 2,114,576,000		0.72
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	481,200	4,019.53 4,367.00	1,934,199,521 2,101,400,400		0.71
日本	日立製作所	株式	電気機器	3,269,000	520.01 609.30	1,699,941,460 1,991,801,700		0.67
日本	ダイキン工業	株式	機械	185,800	8,845.24 10,715.00	1,643,447,052 1,990,847,000		0.67
日本	富士重工業	株式	輸送用機器	422,600	3,995.00 4,645.00	1,688,289,557 1,962,977,000		0.66

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年11月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.34
	建設業	3.10
	食料品	4.48
	繊維製品	0.69

パルプ・紙	0.24
化学	6.32
医薬品	4.71
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.95
ガラス・土石製品	0.93
鉄鋼	1.24
非鉄金属	0.91
金属製品	0.69
機械	5.02
電気機器	12.40
輸送用機器	9.67
精密機器	1.50
その他製品	1.90
電気・ガス業	1.81
陸運業	4.26
海運業	0.22
空運業	0.55
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.47
卸売業	4.37
小売業	4.72
銀行業	8.20
証券、商品先物取引業	1.15
保険業	2.60
その他金融業	1.31
不動産業	2.67
サービス業	3.65
合計	98.82

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

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28年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引						
TOPIX 16年12月限	大阪取引所	買建	288	4,002,665,520	4,245,120,000	1.44

（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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	186,253,661,154	63.87
	イギリス	20,343,975,859	6.98
	カナダ	11,399,232,168	3.91
	フランス	10,164,059,047	3.49
	ドイツ	10,065,027,738	3.45
	スイス	9,835,653,779	3.37
	オーストラリア	7,849,895,290	2.69
	オランダ	4,010,679,826	1.38
	香港	3,603,631,773	1.24
	スペイン	3,375,060,793	1.16
	スウェーデン	3,147,847,707	1.08
	イタリア	1,850,767,271	0.63
	デンマーク	1,800,121,420	0.62
	ベルギー	1,400,034,293	0.48
	シンガポール	1,342,825,068	0.46

	フィンランド	1,060,057,815	0.36
	ノルウェー	740,591,775	0.25
	アイルランド	522,211,810	0.18
	ルクセンブルグ	303,932,497	0.10
	イスラエル	240,856,148	0.08
	オーストリア	222,177,224	0.08
	ニュージーランド	213,487,439	0.07
	ポルトガル	159,037,647	0.05
投資証券	アメリカ	5,629,781,224	1.93
	オーストラリア	707,518,537	0.24
	フランス	391,121,200	0.13
	イギリス	287,396,558	0.10
	香港	147,273,600	0.05
	シンガポール	116,278,468	0.04
	カナダ	64,194,191	0.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		4,352,089,683	1.51
純資産総額		291,600,479,002	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28年11月30日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	3,276,920,920	1.12

（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28年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
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	466,391	10,609.07 12,530.33	4,948,270,552 5,844,034,631		2.00
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	635,727	5,804.24 6,867.73	3,690,314,758 4,366,006,348		1.50
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	353,127	9,993.01 9,656.87	3,529,048,002 3,410,104,357		1.17
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	234,068	12,930.54 12,645.00	3,026,694,528 2,959,790,234		1.02
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	34,136	80,983.99 85,722.49	2,764,486,692 2,926,223,205		1.00
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	311,084	7,022.87 8,872.18	2,184,854,849 2,759,995,234		0.95
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	782,771	3,414.19 3,490.64	2,673,076,911 2,732,372,546		0.94
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・サービス	196,799	13,454.42 13,588.20	2,647,899,724 2,674,145,234		0.92
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	410,365	5,500.71 5,830.10	2,257,556,621 2,392,469,478		0.82
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	523,569	4,428.22 4,438.34	2,318,726,732 2,323,778,073		0.80
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	26,331	80,919.91 86,657.83	2,130,721,027 2,281,787,395		0.78
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	24,990	82,726.50 88,748.84	2,067,354,895 2,217,833,631		0.76
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	271,450	8,129.91 7,588.81	2,207,129,657 2,059,983,288		0.71
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	217,452	9,287.01 9,318.49	2,019,713,451 2,026,325,113		0.69
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	874,067	1,607.60 2,281.00	1,406,091,186 1,993,748,400		0.68
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	346,844	5,768.27 5,728.92	2,000,927,816 1,987,042,638		0.68
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	160,515	11,408.38 12,292.00	1,831,358,083 1,973,050,829		0.68

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	515,907	3,749.20 3,588.44	1,934,647,023 1,851,304,616	0.63
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	101,438	16,116.53 17,726.38	1,634,854,482 1,798,129,102	0.62
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	235,504	6,213.45 6,991.39	1,463,342,802 1,646,502,618	0.56
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	205,766	7,040.86 7,885.13	1,448,864,587 1,622,493,470	0.56
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	349,693	5,076.88 4,626.08	1,775,529,488 1,617,708,842	0.55
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	401,701	3,456.91 3,969.55	1,389,015,159 1,594,572,284	0.55
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	249,671	5,025.17 6,241.55	1,254,681,118 1,558,336,127	0.53
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	105,823	15,039.54 14,571.88	1,591,567,870 1,542,040,099	0.53
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	59,833	27,170.83 25,155.30	1,625,752,098 1,505,117,304	0.52
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,684,956	625.04 887.42	1,053,223,558 1,495,274,233	0.51
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	190,129	8,224.36 7,783.25	1,563,863,452 1,479,822,584	0.51
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	131,180	11,400.51 11,204.90	1,495,662,453 1,469,858,965	0.50
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	161,997	8,721.54 8,898.04	1,412,890,791 1,441,456,271	0.49

（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28年11月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	7.28
	素材	4.88
	資本財	7.38
	商業・専門サービス	0.99
	運輸	1.93
	自動車・自動車部品	1.42
	耐久消費財・アパレル	1.67
	消費者サービス	1.84
	メディア	2.66
	小売	4.00
	食品・生活必需品小売り	2.01
	食品・飲料・タバコ	5.82
	家庭用品・パーソナル用品	2.08
	ヘルスケア機器・サービス	3.83
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.60
	銀行	9.23
	各種金融	4.30
	保険	4.18
	不動産	0.54
	ソフトウェア・サービス	9.09
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.59
	電気通信サービス	2.97
	公益事業	3.24
	半導体・半導体製造装置	2.44
	小計	95.99
投資証券		2.52
合計		98.51

（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28年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引								

SP EMINI (2016年12月限)	シカゴ商業取引所	買建	174	アメリカドル	18,947,161.74	19,172,625.00	2,155,386,502	0.74
FTSE100 (2016年12月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	23	イギリス ポンド	1,564,412.50	1,556,180.00	218,581,042	0.07
SP/TSE60 (2016年12月限)	モントリオール取引所	買建	9	カナダドル	1,565,613.75	1,591,560.00	133,181,740	0.05
SPI 200 (2016年12月限)	シドニー先物取引所	買建	18	オーストラリア ドル	2,385,822.00	2,457,900.00	206,807,706	0.07
EURO ST (2016年12月限)	ユーレックス・ドイツ金 融先物取引所	買建	131	ユーロ	3,986,830.25	3,975,850.00	475,909,245	0.16
SWISS IX (2016年12月限)	ユーレックス・ドイツ金 融先物取引所	買建	10	スイス フラン	785,837.50	783,500.00	87,054,685	0.03

(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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	420,036,005,930	81.38
地方債証券	日本	30,664,956,837	5.94
特殊債券	日本	39,225,875,209	7.60
社債券	日本	23,336,573,840	4.52
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,900,384,221	0.56
純資産総額		516,163,796,037	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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引 (買建)	1,204,480,000	0.23

(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28年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第113回利付国債(5年)	国債証券		5,840,000	101.18 100.7680	5,908,912,000 5,884,851,200	0.300000 2018/06/20	1.14
日本	第129回利付国債(5年)	国債証券		5,500,000	101.28 100.9880	5,570,722,000 5,554,340,000	0.100000 2021/09/20	1.08
日本	第124回利付国債(5年)	国債証券		5,430,000	101.40 100.8010	5,506,345,800 5,473,494,300	0.100000 2020/06/20	1.06
日本	第128回利付国債(5年)	国債証券		5,400,000	101.40 100.9360	5,476,119,000 5,450,544,000	0.100000 2021/06/20	1.06
日本	第329回利付国債(10年)	国債証券		5,010,000	107.24 105.7570	5,372,881,100 5,298,425,700	0.800000 2023/06/20	1.03
日本	第117回利付国債(5年)	国債証券		5,120,000	101.26 100.8520	5,184,958,000 5,163,622,400	0.200000 2019/03/20	1.00
日本	第344回利付国債(10年)	国債証券		5,090,000	101.25 100.8310	5,154,103,800 5,132,297,900	0.100000 2026/09/20	0.99
日本	第340回利付国債(10年)	国債証券		4,930,000	105.11 103.6110	5,181,923,000 5,108,022,300	0.400000 2025/09/20	0.99
日本	第343回利付国債(10年)	国債証券		5,060,000	102.28 100.9060	5,175,717,900 5,105,843,600	0.100000 2026/06/20	0.99
日本	第338回利付国債(10年)	国債証券		4,860,000	104.92 103.5330	5,099,430,000 5,031,703,800	0.400000 2025/03/20	0.97
日本	第342回利付国債(10年)	国債証券		4,870,000	102.12 100.9290	4,973,469,000 4,915,242,300	0.100000 2026/03/20	0.95
日本	第339回利付国債(10年)	国債証券		4,700,000	105.02 103.5510	4,936,183,000 4,866,897,000	0.400000 2025/06/20	0.94
日本	第334回利付国債(10年)	国債証券		4,550,000	106.58 104.8450	4,849,594,200 4,770,447,500	0.600000 2024/06/20	0.92

日本	第333回利付国債(10年)	国債証券	4,520,000	106.30 104.7590	4,804,964,000 4,735,106,800	0.600000 2024/03/20	0.92
日本	第335回利付国債(10年)	国債証券	4,450,000	105.78 104.1840	4,707,574,600 4,636,188,000	0.500000 2024/09/20	0.90
日本	第126回利付国債(5年)	国債証券	4,460,000	101.55 100.8740	4,529,397,600 4,498,980,400	0.100000 2020/12/20	0.87
日本	第325回利付国債(10年)	国債証券	4,235,000	107.02 105.1580	4,532,297,000 4,453,441,300	0.800000 2022/09/20	0.86
日本	第116回利付国債(5年)	国債証券	4,280,000	101.18 100.7710	4,330,889,200 4,312,998,800	0.200000 2018/12/20	0.84
日本	第125回利付国債(5年)	国債証券	4,260,000	101.47 100.8390	4,322,664,600 4,295,741,400	0.100000 2020/09/20	0.83
日本	第127回利付国債(5年)	国債証券	4,250,000	101.62 100.9060	4,318,850,000 4,288,505,000	0.100000 2021/03/20	0.83
日本	第328回利付国債(10年)	国債証券	4,100,000	105.61 104.3020	4,330,210,000 4,276,382,000	0.600000 2023/03/20	0.83
日本	第312回利付国債(10年)	国債証券	4,030,000	106.64 105.3280	4,297,753,200 4,244,718,400	1.200000 2020/12/20	0.82
日本	第305回利付国債(10年)	国債証券	3,808,000	105.56 104.4090	4,020,029,440 3,975,894,720	1.300000 2019/12/20	0.77
日本	第341回利付国債(10年)	国債証券	3,820,000	104.01 102.7610	3,973,451,000 3,925,470,200	0.300000 2025/12/20	0.76
日本	第115回利付国債(5年)	国債証券	3,670,000	101.08 100.6950	3,709,856,200 3,695,506,500	0.200000 2018/09/20	0.72
日本	第332回利付国債(10年)	国債証券	3,410,000	106.18 104.6720	3,620,973,600 3,569,315,200	0.600000 2023/12/20	0.69
日本	第122回利付国債(5年)	国債証券	3,420,000	101.22 100.7500	3,461,806,000 3,445,650,000	0.100000 2019/12/20	0.67
日本	第313回利付国債(10年)	国債証券	2,969,000	107.49 106.0850	3,191,496,860 3,149,663,650	1.300000 2021/03/20	0.61
日本	第330回利付国債(10年)	国債証券	2,930,000	107.27 105.9440	3,143,162,200 3,104,159,200	0.800000 2023/09/20	0.60
日本	第337回利付国債(10年)	国債証券	2,990,000	104.08 102.6620	3,112,253,700 3,069,593,800	0.300000 2024/12/20	0.59

(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28年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	81.38
地方債証券	5.94
特殊債券	7.60
社債券	4.52
合計	99.44

(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28年11月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
債券先物取引						
長期国債先物16年12月限	大阪取引所	買建	8	1,207,728,640	1,204,480,000	0.23

(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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	61,387,051,125	43.72
	フランス	13,592,329,825	9.68
	イタリア	13,055,917,741	9.30
	ドイツ	10,254,535,236	7.30
	イギリス	10,020,184,997	7.14
	スペイン	7,611,028,422	5.42
	ベルギー	3,485,529,517	2.48
	オランダ	3,260,906,954	2.32
	カナダ	2,924,049,402	2.08
	オーストラリア	2,849,379,518	2.03
	オーストリア	2,104,465,911	1.50
	メキシコ	1,121,128,658	0.80
	アイルランド	1,080,613,625	0.77
	デンマーク	971,483,026	0.69
	フィンランド	830,387,508	0.59
	ポーランド	776,084,048	0.55
	南アフリカ	696,396,051	0.50
	スウェーデン	624,063,516	0.44
	マレーシア	573,841,571	0.41
	シンガポール	522,681,980	0.37
ノルウェー	365,610,739	0.26	
スイス	326,921,896	0.23	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,972,134,820	1.42
純資産総額		140,406,726,086	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28年11月30日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
アメリカ	2.5 T-NOTE 240515	国債証券		5,600,000.00	12,001.95 11,501.0929	672,109,715 644,061,206	2.500000 2024/05/15	0.46
アメリカ	0.75 T-NOTE 171031	国債証券		5,500,000.00	11,253.85 11,234.5346	618,962,122 617,899,402	0.750000 2017/10/31	0.44
アメリカ	2.25 T-NOTE 241115	国債証券		5,400,000.00	11,791.75 11,263.0787	636,754,974 608,206,252	2.250000 2024/11/15	0.43
アメリカ	2 T-NOTE 250215	国債証券		5,400,000.00	11,541.03 11,031.2125	623,216,008 595,685,475	2.000000 2025/02/15	0.42
アメリカ	2.25 T-NOTE 251115	国債証券		5,300,000.00	11,756.88 11,204.2339	623,114,830 593,824,396	2.250000 2025/11/15	0.42
アメリカ	2 T-NOTE 250815	国債証券		5,400,000.00	11,526.42 10,989.9332	622,426,820 593,456,396	2.000000 2025/08/15	0.42
アメリカ	2.125 T-NOTE 250515	国債証券		5,300,000.00	11,645.58 11,117.2840	617,216,153 589,216,054	2.125000 2025/05/15	0.42
アメリカ	2.75 T-NOTE 231115	国債証券		4,900,000.00	12,215.62 11,706.6107	598,565,450 573,623,928	2.750000 2023/11/15	0.41
アメリカ	2.375 T-NOTE 240815	国債証券		5,000,000.00	11,888.41 11,385.1598	594,420,750 569,257,991	2.375000 2024/08/15	0.41
アメリカ	1.625 T-NOTE 260215	国債証券		5,100,000.00	11,135.45 10,605.2460	567,908,066 540,867,549	1.625000 2026/02/15	0.39
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券		3,500,000.00	15,708.23 15,393.9586	549,788,085 538,788,552	4.250000 2023/10/25	0.38
アメリカ	1.625 T-NOTE 260515	国債証券		5,000,000.00	11,256.61 10,587.6804	562,830,730 529,384,022	1.625000 2026/05/15	0.38
アメリカ	1.5 T-NOTE 260815	国債証券		5,000,000.00	11,070.01 10,445.3989	553,500,864 522,269,943	1.500000 2026/08/15	0.37

フランス	5.5 O.A.T 290425	国債証券		2,700,000.00	19,090.22 18,556.9114	515,436,160 501,036,609	5.500000 2029/04/25	0.36
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券		4,200,000.00	11,962.62 11,666.2098	502,430,449 489,980,812	2.625000 2020/11/15	0.35
フランス	5.75 O.A.T 321025	国債証券		2,400,000.00	20,769.14 20,184.6519	498,459,528 484,431,645	5.750000 2032/10/25	0.35
アメリカ	1.75 T-NOTE 230515	国債証券		4,300,000.00	11,432.58 11,017.1600	491,601,241 473,737,880	1.750000 2023/05/15	0.34
フランス	4.5 O.A.T 410425	国債証券		2,350,000.00	20,260.46 19,642.7580	476,120,814 461,604,813	4.500000 2041/04/25	0.33
アメリカ	2 T-NOTE 230215	国債証券		4,100,000.00	11,621.97 11,214.7732	476,501,163 459,805,704	2.000000 2023/02/15	0.33
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券		3,200,000.00	14,331.09 14,119.2135	458,594,999 451,814,832	3.750000 2021/04/25	0.32
フランス	3 O.A.T 220425	国債証券		3,200,000.00	14,194.24 14,024.6983	454,215,894 448,790,348	3.000000 2022/04/25	0.32
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券		3,700,000.00	12,504.09 12,129.0640	462,651,335 448,775,369	3.625000 2021/02/15	0.32
フランス	3.25 O.A.T 211025	国債証券		3,200,000.00	14,200.14 14,020.4610	454,404,541 448,654,752	3.250000 2021/10/25	0.32
アメリカ	3.625 T-BOND 440215	国債証券		3,500,000.00	13,780.21 12,739.4695	482,307,656 445,881,432	3.625000 2044/02/15	0.32
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券		2,900,000.00	15,555.01 15,149.9502	451,095,435 439,348,555	3.500000 2026/04/25	0.31
アメリカ	3.375 T-BOND 440515	国債証券		3,600,000.00	13,140.77 12,175.6129	473,067,856 438,322,066	3.375000 2044/05/15	0.31
フランス	3.5 O.A.T 200425	国債証券		3,200,000.00	13,783.46 13,591.9110	441,071,038 434,941,153	3.500000 2020/04/25	0.31
フランス	2.5 O.A.T 201025	国債証券		3,200,000.00	13,451.88 13,327.7571	430,460,352 426,488,227	2.500000 2020/10/25	0.30
イタリア	6 ITALY GOVT 310501	国債証券		2,450,000.00	18,056.74 17,342.3035	442,390,252 424,886,437	6.000000 2031/05/01	0.30
フランス	4.75 O.A.T 350425	国債証券		2,200,000.00	19,554.76 19,024.3998	430,204,912 418,536,795	4.750000 2035/04/25	0.30

（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28年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.60
合計	98.60

（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28年11月30日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	ブラジル	1,180,122,126	9.84
	ポーランド	1,176,545,267	9.81
	南アフリカ	1,169,104,975	9.75
	インドネシア	1,138,457,121	9.50
	トルコ	1,068,776,126	8.92
	マレーシア	1,035,496,884	8.64
	メキシコ	1,032,064,662	8.61
	タイ	893,641,449	7.45
	コロンビア	846,369,065	7.06
	ロシア	678,082,904	5.66
	ハンガリー	618,394,629	5.16
	ルーマニア	362,886,743	3.03
	ペルー	214,888,356	1.79
	フィリピン	47,376,380	0.40

	チリ	8,725,725	0.07
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		516,846,217	4.31
純資産総額		11,987,778,629	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28年11月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率（%） 償還期限 （年/月/日）	投資 比率 （%）
					単価（円）	金額（円）		
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	国債証券		8,300,000.00	2,800.26 3,272.8654	232,422,112 271,647,828	10.000000 2021/01/01	2.27
南アフリカ	10.5 SOUTH AFRICA 261221	国債証券		25,100,000.00	864.03 889.7850	216,872,222 223,336,035	10.500000 2026/12/21	1.86
タイ	3.65 THAILAND 211217	国債証券		59,200,000.00	344.36 340.9895	203,862,854 201,865,840	3.650000 2021/12/17	1.68
ブラジル	BRAZIL-LTN 190101	国債証券		7,300,000.00	2,195.51 2,633.2519	160,272,409 192,227,393	2019/01/01	1.60
コロンビア	10 TITULOS DE TES 240724	国債証券		4,250,000,000.00	3.88 4.1529	165,201,817 176,500,981	10.000000 2024/07/24	1.47
タイ	3.875 THAILAND 190613	国債証券		48,000,000.00	339.72 333.2735	163,069,822 159,971,283	3.875000 2019/06/13	1.33
ブラジル	10(IN)BRAZIL NTN-F230101	国債証券		4,550,000.00	2,507.67 3,199.0210	114,099,036 145,555,458	10.000000 2023/01/01	1.21
インドネシア	8.375 INDONESIA 240315	国債証券		16,700,000,000.00	0.82 0.8345	138,286,798 139,372,355	8.375000 2024/03/15	1.16
メキシコ	6.5 MEXICAN BONOS 210610	国債証券		25,200,000.00	567.46 534.1163	143,000,670 134,597,320	6.500000 2021/06/10	1.12
メキシコ	10 MEXICAN BONOS 241205	国債証券		20,900,000.00	692.46 635.6008	144,725,309 132,840,567	10.000000 2024/12/05	1.11
インドネシア	8.375 INDONESIA 260915	国債証券		15,730,000,000.00	0.84 0.8428	133,652,490 132,582,664	8.375000 2026/09/15	1.11
タイ	4.875 THAILAND 290622	国債証券		34,400,000.00	399.62 381.7384	137,471,611 131,318,019	4.875000 2029/06/22	1.10
コロンビア	5 TITULOS DE TESO 181121	国債証券		3,700,000,000.00	3.34 3.4890	123,611,316 129,093,503	5.000000 2018/11/21	1.08
ポーランド	1.75 POLAND 210725	国債証券		5,000,000.00	2,644.46 2,570.6247	132,223,470 128,531,238	1.750000 2021/07/25	1.07
ブラジル	BRAZIL-LTN 180701	国債証券		4,500,000.00	2,308.84 2,779.1985	103,898,168 125,063,935	2018/07/01	1.04
南アフリカ	8.75 SOUTH AFRICA 480228	国債証券		16,400,000.00	703.97 732.2157	115,451,709 120,083,374	8.750000 2048/02/28	1.00
ルーマニア	5.75 ROMANIA GOVE 200429	国債証券		4,000,000.00	3,015.49 2,993.9228	120,619,685 119,756,915	5.750000 2020/04/29	1.00
メキシコ	8.5 MEXICAN BONOS 181213	国債証券		20,800,000.00	597.14 564.8832	124,205,178 117,495,712	8.500000 2018/12/13	0.98
ポーランド	2.5 POLAND 260725	国債証券		4,600,000.00	2,600.53 2,456.5272	119,624,403 113,000,252	2.500000 2026/07/25	0.94
タイ	3.85 THAILAND 251212	国債証券		31,600,000.00	358.98 349.2419	113,440,480 110,360,451	3.850000 2025/12/12	0.92
コロンビア	7.5 TITULOS DE TE 260826	国債証券		3,000,000,000.00	3.47 3.6219	104,309,352 108,659,494	7.500000 2026/08/26	0.91
インドネシア	9 INDONESIA 290315	国債証券		12,300,000,000.00	0.84 0.8719	104,249,344 107,245,545	9.000000 2029/03/15	0.89
タイ	3.625 THAILAND 230616	国債証券		31,200,000.00	346.00 341.3324	107,954,911 106,495,726	3.625000 2023/06/16	0.89
インドネシア	8.375 INDONESIA 340315	国債証券		12,600,000,000.00	0.80 0.8300	101,995,380 104,580,000	8.375000 2034/03/15	0.87
南アフリカ	8.75 SOUTH AFRICA 440131	国債証券		14,100,000.00	726.63 733.8114	102,456,161 103,467,407	8.750000 2044/01/31	0.86
トルコ	8 TURKEY GOVT 250312	国債証券		3,600,000.00	2,838.76 2,809.0440	102,195,592 101,125,584	8.000000 2025/03/12	0.84
ポーランド	5.75 POLAND 220923	国債証券		3,200,000.00	3,189.01 3,068.0612	102,048,515 98,177,960	5.750000 2022/09/23	0.82
インドネシア	8.25 INDONESIA 210715	国債証券		11,600,000,000.00	0.84 0.8387	98,430,131 97,289,495	8.250000 2021/07/15	0.81
ハンガリー	6 HUNGARY 231124	国債証券		209,000,000.00	45.90 46.5408	95,943,952 97,270,272	6.000000 2023/11/24	0.81
タイ	2.55 THAILAND 200626	国債証券		29,900,000.00	327.20 324.3604	97,832,869 96,983,763	2.550000 2020/06/26	0.81

（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28年11月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	95.69
合計	95.69

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

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。

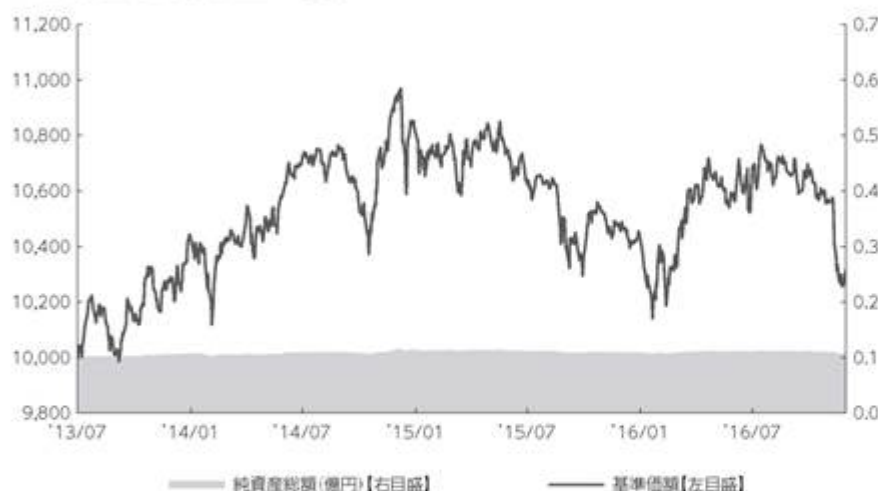
[参考情報]



運用実績

2016年11月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2013年7月1日(設定日)～2016年11月30日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	10,314円
純資産総額	0.1億円

■分配の推移

2016年5月	0円
2015年5月	0円
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

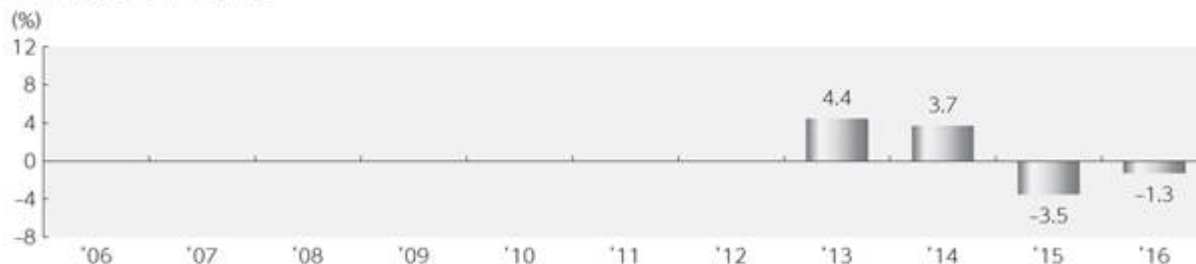
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	5.1%	円	101.0%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.2%
国内債券	29.0%	ユーロ	15.3%	APPLE INC	株式	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.2%
外国株式	9.5%	イギリスポンド	3.3%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.1%
外国債券	52.0%	南アフリカランド	2.0%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.1%
		ポーランドズロチ	2.0%	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	アメリカ	0.1%
		メキシコペソ	2.0%	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	債券	国債	ブラジル	0.4%
		ブラジルレアル	1.8%	10.5 SOUTH AFRICA 261221	債券	国債	南アフリカ	0.4%
コールローン他 (負債控除後)	4.4%	その他	14.3%	第113回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%
合計	100.0%	米ドル	-41.7%	第129回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%
		合計	100.0%	第124回利付国債(5年)	債券	国債	日本	0.3%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	0.2%
債券先物取引(買建)	0.1%

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

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2013年は設定日から年末までの、2016年は年初から11月30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。

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

第3【ファンドの経理状況】

<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、当中間計算期間（平成28年5月13日から平成28年11月12日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

コアバランス

(1) 【中間貸借対照表】

	第3期	第4期中間計算期間末
	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月12日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,740,624	195,968
親投資信託受益証券	9,499,211	10,816,410
未収入金	52,791	44,935
流動資産合計	11,292,626	11,057,313
資産合計	11,292,626	11,057,313
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	93,156	121,091
未払受託者報酬	2,923	3,007
未払委託者報酬	73,273	75,495
未払利息	3	
その他未払費用	183	184
流動負債合計	169,538	199,777
負債合計	169,538	199,777
純資産の部		
元本等		
元本	10,445,499	10,427,434
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	677,589	430,102
(分配準備積立金)	(791,192)	(789,823)
元本等合計	11,123,088	10,857,536
純資産合計	11,123,088	10,857,536
負債純資産合計	11,292,626	11,057,313

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	第3期中間計算期間	第4期中間計算期間
	自平成27年5月13日 至平成27年11月12日	自平成28年5月13日 至平成28年11月12日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	562	4
有価証券売買等損益	80,566	176,596
為替差損益	116,798	20,067
その他収益	2,655	
営業収益合計	194,147	156,525
営業費用		
支払利息		282
受託者報酬	2,995	3,007
委託者報酬	75,092	75,495
その他費用	10,984	10,984
営業費用合計	89,071	89,768
営業利益又は営業損失()	283,218	246,293
経常利益又は経常損失()	283,218	246,293
中間純利益又は中間純損失()	283,218	246,293
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ()	1,538	21
期首剰余金又は期首欠損金()	775,473	677,589
剰余金増加額又は欠損金減少額	558	
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	558	
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,698	1,173
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	3,698	1,173
分配金		
中間剰余金又は中間欠損金()	490,653	430,102

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第3期	第4期中間計算期間末
	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月12日現在]
1 期首元本額	10,482,572円	10,445,499円
期中追加設定元本額	12,927円	
期中一部解約元本額	50,000円	18,065円
2 受益権の総数	10,445,499口	10,427,434口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0649円 (10,649円)	1.0412円 (10,412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3期	第4期中間計算期間末
	[平成28年5月12日現在]	[平成28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。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同 左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	第3期 [平成28年5月12日現在]			
		契約額等(円)		時 価 (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	5,148,564		5,241,720	93,156
	合 計	5,148,564		5,241,720	93,156

区 分	種 類	第4期中間計算期間末 [平成28年11月12日現在]			
		契約額等(円)		時 価 (円)	
		うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	6,825,202		6,946,293	121,091
	合 計	6,825,202		6,946,293	121,091

(注) 時価の算定方法

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

<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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	48,850,807,116	43,747,991,694
株式 2	227,318,263,090	254,294,188,590
派生商品評価勘定	62,709,040	104,347,460
未収入金	2,000,986,629	9,743,955,958
未収配当金	1,925,381,042	1,917,357,252
前払金	57,100,000	
その他未収収益	237,674,947	154,112,365
差入委託証拠金	252,630,000	209,190,000
流動資産合計	280,705,551,864	310,171,143,319
資産合計	280,705,551,864	310,171,143,319
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	76,732,048	1,020,520
前受金		98,040,000
未払金	3,137,280	
未払解約金	493,346,449	12,215,178,430
未払利息	99,187	62,086
受入担保金	45,316,636,512	38,880,090,144
その他未払費用	53,099	
流動負債合計	45,890,004,575	51,194,391,180
負債合計	45,890,004,575	51,194,391,180
純資産の部		
元本等		
元本 1	172,879,052,524	183,060,150,221
剰余金		
剰余金又は欠損金()	61,936,494,765	75,916,601,918
元本等合計	234,815,547,289	258,976,752,139
純資産合計	234,815,547,289	258,976,752,139
負債純資産合計	280,705,551,864	310,171,143,319

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

(注2) 平成28年11月12日が休業日のため、前営業日の平成28年11月11日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 期首	平成27年5月13日	平成28年5月13日
期首元本額	154,041,423,983円	172,879,052,524円
期首からの追加設定元本額	108,393,854,813円	85,053,920,967円
期首からの一部解約元本額	89,556,226,272円	74,872,823,270円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内株式)	4,700,156,062円	10,170,597,270円
eMAXIS TOPIXインデックス	21,701,512,199円	19,823,335,157円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,670,142,129円	1,790,337,680円
eMAXIS バランス(波乗り型)	174,750,003円	586,261,319円
コアバランス	656,704円	390,901円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	175,589円	822,896円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	259,972円	570,321円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	302,174円	1,677,180円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)		3,830,109,081円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)		7,479,661,673円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)		166,204,720円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)		90,075,827円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)		892,165,391円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	115,629,375円	90,095,931円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	646,408,386円	511,499,882円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	23,242,958円	33,203,925円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	1,131,101円	3,607,699円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	6,625,886円	5,136,899円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	2,489,801円	15,285,511円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	7,344,848円	18,520,870円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	2,909,678円	8,963,984円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	19,270,364,755円	10,443,389,645円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,544,185,458円	13,701,845,917円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	513,671,324円	470,914,432円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	4,249,025,728円	3,916,872,020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)	25,958,320,124円	27,436,616,649円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	6,539,465,218円	6,074,290,201円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,633,259,528円	2,445,951,421円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	627,678,236円	558,171,578円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	317,432,037円	298,249,153円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	173,242,993円	151,986,328円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	590,219,297円	566,322,141円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	1,372,626,924円	1,308,508,356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)	25,913,175円	5,305,864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)	1,293,496円	1,942,612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)	132,656,726円	200,935,864円
MUAM インデックスファンドTOPIXi(適格機関投資家限定)	8,726,654円	8,726,654円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)		695,225,545円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)		45,481,139円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)		1,118,063円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)		2,297,266,076円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	7,484,400,171円	7,282,318,680円
三菱UFJ TOPIX・ライト	373,042,691円	350,962,851円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	21,063,326円	12,733,440円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	65,732,574円	43,488,745円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	132,494,459円	94,053,607円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	110,996,803円	59,886,496円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	3,067,883,392円	2,790,553,130円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	816,751,944円	716,131,878円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	106,666,326円	90,720,113円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	859,989,737円	714,205,498円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	95,460,134円	85,431,011円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	766,692,658円	608,526,329円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	2,108,596,388円	2,105,803,396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）	578,150,731円	560,340,403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）	2,261,379,678円	2,193,399,849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）	1,772,715,286円	1,763,509,211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）	1,368,975,533円	1,364,621,728円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド （合計）	44,876,242,155円 172,879,052,524円	46,075,820,081円 183,060,150,221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	43,081,481,280円	38,873,952,690円
3 受益権の総数	172,879,052,524口	183,060,150,221口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3583円 （13,583円）	1.4147円 （14,147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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 貸借対照表計上額、時 価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補 足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区 分	種 類	[平成28年5月12日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建			
		5,343,405,000	5,329,725,000	13,680,000
	合 計	5,343,405,000	5,329,725,000	13,680,000

区 分	種 類	[平成28年11月11日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建			
		4,583,165,000	4,686,675,000	103,510,000
	合 計	4,583,165,000	4,686,675,000	103,510,000

（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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

[次へ](#)

「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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	5,504,636,470	3,254,535,559
コール・ローン	485,919,254	1,883,059,931
株式	255,005,772,397	259,246,251,197
投資証券	7,251,695,005	6,690,966,139
派生商品評価勘定	24,970,236	123,269,190
未収入金	21,072,632	50,497,469
未収配当金	509,853,785	373,670,588
差入委託証拠金	1,360,722,056	1,494,557,068
流動資産合計	270,164,641,835	273,116,807,141
資産合計	270,164,641,835	273,116,807,141
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	86,957,631	18,142,996
未払解約金	11,915,982	401,936,837
未払利息	986	2,672
その他未払費用	5,842	
流動負債合計	98,880,441	420,082,505
負債合計	98,880,441	420,082,505
純資産の部		
元本等		
元本	136,910,588,935	135,199,380,190
剰余金		
剰余金又は欠損金()	133,155,172,459	137,497,344,446
元本等合計	270,065,761,394	272,696,724,636
純資産合計	270,065,761,394	272,696,724,636
負債純資産合計	270,164,641,835	273,116,807,141

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

(注2) 平成28年11月12日が休業日のため、前営業日の平成28年11月11日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 期首	平成27年5月13日	平成28年5月13日
期首元本額	98,648,858,071円	136,910,588,935円
期首からの追加設定元本額	105,675,196,642円	54,550,578,833円
期首からの一部解約元本額	67,413,465,778円	56,261,787,578円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	2,448,719,365円	5,105,143,733円
eMAXIS 先進国株式インデックス	16,378,104,804円	16,767,079,333円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,138,768,930円	1,267,806,399円
eMAXIS バランス(波乗り型)	120,737,094円	79,147,552円
コアバランス	219,720円	512,055円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	59,237円	291,569円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	85,793円	201,906円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	102,421円	578,923円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,850,610,646円	6,896,559,363円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,408,019,604円	2,538,791,592円

三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	823,810,399円	819,769,534円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	1,882,465,423円	2,485,700,352円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	85,978,515円	89,536,305円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	13,474,781円	18,118,254円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	416,410,090円	78,488,850円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	15,891,218円	23,564,323円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	464,062円	1,556,683円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	3,556,879円	2,820,756円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	1,527,502円	9,491,970円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	4,840,689円	12,346,082円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	2,003,954円	6,259,635円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,118,943,652円	9,502,071,802円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,679,805,595円	16,437,208,651円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	347,095,316円	337,461,042円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,909,896,008円	2,800,595,002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)	46,542,204,119円	45,676,996,634円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	271,114,613円	266,803,774円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	119,808,786円	109,831,755円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,054,265,694円	2,031,564,705円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,180,423,248円	3,320,859,339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)	52,918,604円	11,331,787円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	6,872,839,069円	7,219,294,895円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	92,997,552円	89,413,403円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	530,050,843円	517,443,617円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	89,261,136円	135,691,486円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	18,817円	9,074,163円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)		1,016,854円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)		1,140,279,749円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,903,425,272円	1,892,782,042円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,173,466円	4,524,885円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	22,285,032円	15,547,217円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	51,267,580円	39,326,303円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	47,118,237円	26,149,848円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	166,480,868円	122,178,076円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	36,705,073円	32,930,750円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	291,823,087円	255,999,181円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	65,215,077円	61,248,455円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	523,982,813円	436,414,314円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,096,664,594円	4,191,589,887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)	196,823,527円	201,378,388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)	767,070,036円	780,572,393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)	695,163,101円	716,436,620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)	581,896,994円	611,598,004円

(合計)	136,910,588,935円	135,199,380,190円
2 受益権の総数	136,910,588,935口	135,199,380,190口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9726円 (19,726円)	2.0170円 (20,170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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	[平成28年5月12日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,650,317,344	7,590,565,279	59,752,065
	合計	7,650,317,344	7,590,565,279	59,752,065

区分	種類	[平成28年11月11日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,367,616,530	10,460,381,304	92,764,774
	合計	10,367,616,530	10,460,381,304	92,764,774

(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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

通貨関連

区分	種類	[平成28年5月12日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 香港ドル 買建 アメリカドル カナダドル イギリスポンド スイスフラン ユーロ	27,938,200 261,928,800 25,352,160 15,769,750 39,163,600 49,644,720	27,920,000 260,064,000 25,296,000 15,651,000 39,070,500 49,524,000	18,200 1,864,800 56,160 118,750 93,100 120,720
	合計	419,797,230	417,525,500	2,235,330

区 分	種 類	[平成28年11月11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	162,830,600		165,354,000	2,523,400
	オーストラリアドル	40,766,000		40,440,000	326,000
	イギリスポンド	13,001,250		13,376,000	374,750
	ユーロ	34,706,250		34,830,000	123,750
	買建				
	アメリカドル	3,595,223,600		3,605,548,000	10,324,400
	カナダドル	228,947,600		229,187,000	239,400
	オーストラリアドル	169,897,200		169,848,000	49,200
	イギリスポンド	425,448,300		428,032,000	2,583,700
	スイスフラン	204,778,200		205,238,000	459,800
	香港ドル	75,467,000		75,625,000	158,000
	シンガポールドル	22,649,730		22,647,000	2,730
	スウェーデンクローネ	52,949,250		53,055,000	105,750
	デンマーククローネ	31,200,200		31,200,000	200
	ユーロ	683,751,600		684,990,000	1,238,400
合 計		5,741,616,780		5,759,370,000	12,361,420

(注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

[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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,989,676,014	3,275,736,477
国債証券	430,939,878,680	438,204,543,220
地方債証券	30,032,413,644	31,399,488,631
特殊債券	43,410,636,172	40,351,350,874
社債券	22,919,698,460	23,188,144,270
未収入金		152,331,000
未収利息	1,167,439,286	1,223,462,534
前払金		630,000
前払費用	117,259,045	50,980,543
差入委託証拠金		5,040,000
流動資産合計	531,577,001,301	537,851,707,549
資産合計	531,577,001,301	537,851,707,549
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,247,560
未払金	1,319,510,540	
未払解約金	800,861,372	579,368,773
未払利息	6,070	4,648
その他未払費用	1,266	
流動負債合計	2,120,379,248	581,620,981
負債合計	2,120,379,248	581,620,981
純資産の部		
元本等		
元本	1 392,963,515,092	402,546,980,268
剰余金		
剰余金又は欠損金()	136,493,106,961	134,723,106,300
元本等合計	529,456,622,053	537,270,086,568
純資産合計	529,456,622,053	537,270,086,568
負債純資産合計	531,577,001,301	537,851,707,549

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

(注2) 平成28年11月12日が休業日のため、前営業日の平成28年11月11日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 期首	平成27年5月13日	平成28年5月13日
期首元本額	273,489,284,775円	392,963,515,092円
期首からの追加設定元本額	230,928,667,279円	76,359,885,536円
期首からの一部解約元本額	111,454,436,962円	66,776,420,360円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(国内債券)	24,560,538,321円	45,680,464,059円
eMAXIS 国内債券インデックス	16,932,463,018円	17,656,470,094円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,513,899,345円	1,693,193,980円
eMAXIS バランス(波乗り型)	318,764,587円	97,358,140円
コアバランス	2,495,021円	2,509,045円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	420,126円	2,318,080円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	272,141円	639,993円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	191,413円	1,181,253円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	24,663,146,879円	24,007,528,318円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	28,138,690,875円	22,332,635,433円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	227,589,648円	161,376,773円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	406,651,573円	566,973,413円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	6,129,391,967円	6,988,295,164円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	617,588,982円	522,448,165円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	713,503,002円	596,597,231円
eMAXIS 債券バランス(2資産均等型)	49,079,772円	63,707,383円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	22,122,406円	32,613,919円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	5,351,778円	17,798,183円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	16,871,400円	13,228,305円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	3,342,258円	20,363,455円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	2,016,780円	5,044,179円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	54,241円	165,809円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	29,184,652,524円	16,684,651,809円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,740,056,498円	14,216,746,738円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	2,087,892,777円	1,961,295,039円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	6,373,050,568円	6,047,912,453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)	199,687,055,080円	193,473,087,355円
三菱UFJ バランスファンドVA50型(適格機関投資家限定)	6,632,302,396円	6,288,919,906円
三菱UFJ バランスファンドVA75型(適格機関投資家限定)	2,642,591,636円	2,555,918,913円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,901,143,295円	1,783,972,808円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	552,810,923円	537,162,556円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	174,759,098円	157,942,444円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,411,642,373円	5,305,441,471円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	4,201,886,464円	4,090,214,821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)	35,492,792円	7,430,028円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	2,670,099,620円	4,378,401,982円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)	466,044円	285,754,222円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)		78,824,583円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)		3,137,020円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)		11,775,700,935円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	58,782,800円	37,379,258円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	90,216,225円	63,601,603円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	118,748,080円	89,726,105円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	73,430,230円	40,344,875円
三菱UFJ 日本債券インデックスファンドVA	23,134,363円	21,374,302円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	267,175,876円	237,946,879円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	641,170,860円	555,772,208円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	261,546,394円	236,860,861円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	645,178,699円	527,417,559円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	2,887,689,697円	3,175,030,150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)	1,614,469,539円	1,658,695,786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)	3,107,456,915円	3,179,818,331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)	1,646,858,018円	1,665,839,689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)	907,309,775円	961,747,205円

(合計)	392,963,515,092円	402,546,980,268円
2 受益権の総数	392,963,515,092口	402,546,980,268口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3473円 (13,473円)	1.3347円 (13,347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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[平成28年5月12日現在]

該当事項はありません。

区分	種類	[平成28年11月11日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引 買建	1,061,480,000	1,059,240,000	2,240,000
	合計	1,061,480,000	1,059,240,000	2,240,000

(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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。

[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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	639,732,059	212,863,649
コール・ローン	43,251,440	70,980,257
国債証券	154,462,427,243	136,465,530,211
派生商品評価勘定		426,998
未収入金		476,741,670
未収利息	1,211,101,821	1,087,953,246
前払費用	115,796,731	32,553,213
流動資産合計	156,472,309,294	138,347,049,244
資産合計	156,472,309,294	138,347,049,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,080	3,586,476
未払金	289,932,187	
未払解約金	26,725,867	396,807,879
未払利息	87	100
その他未払費用	125	
流動負債合計	316,659,346	400,394,455
負債合計	316,659,346	400,394,455
純資産の部		
元本等		
元本	1 79,369,567,734	73,930,314,133
剰余金		
剰余金又は欠損金()	76,786,082,214	64,016,340,656
元本等合計	156,155,649,948	137,946,654,789
純資産合計	156,155,649,948	137,946,654,789
負債純資産合計	156,472,309,294	138,347,049,244

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

(注2) 平成28年11月12日が休業日のため、前営業日の平成28年11月11日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 期首	平成27年5月13日	平成28年5月13日
期首元本額	76,187,578,939円	79,369,567,734円
期首からの追加設定元本額	20,858,565,795円	4,643,079,059円
期首からの一部解約元本額	17,676,577,000円	10,082,332,660円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外債券）	1,807,611,362円	1,368,138,078円
eMAXIS 先進国債券インデックス	11,534,490,043円	12,314,978,690円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,137,218,484円	1,322,368,502円
eMAXIS バランス（波乗り型）	226,352,324円	241,803,942円
コアバランス	1,700,783円	2,099,299円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定 拠出年金）	24,926円	138,130円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定 拠出年金）	24,156円	58,750円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定 拠出年金）	23,736円	144,614円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	6,437,009,006円	6,813,535,675円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	15,888,517円	24,499,887円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	2,317,658円	8,059,316円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	6,470,155円	5,393,946円

eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	954,709円	6,234,075円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	1,152,296円	3,089,509円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	37,163円	121,841円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,634,896,304円	10,016,915,902円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,373,592,301円	3,422,578,541円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,212,693,687円	2,193,802,608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)	13,634,758,617円	14,131,597,508円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型(適格機関投資家限定)	9,105,298,351円	9,137,524,620円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型(適格機関投資家限定)	2,745,502,453円	2,776,752,018円
三菱UFJ バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	650,178,523円	642,455,957円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	218,583,584円	222,941,541円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	80,427,144円	76,807,761円
三菱UFJ バランスファンド20VA(適格機関投資家限定)	2,835,690,297円	2,953,679,826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)	43,989,417円	9,887,623円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	240,934,647円	283,586,393円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	294,341,698円	332,297,308円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)		11,320,967円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)		267,931円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,156,437円	4,704,062円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	14,999,999円	10,841,462円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	25,991,372円	20,144,401円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	9,528,671円	5,468,695円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	164,114,246円	128,922,779円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	72,157,907円	69,186,996円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	148,729,507円	133,884,761円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	134,129,874円	127,913,580円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	267,768,500円	227,845,764円
外国債券インデックスファンドi(適格機関投資家限定)	2,079,264,410円	1,581,261,970円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,023,133,189円	2,038,619,321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)	197,198,794円	210,228,313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)	514,854,998円	544,671,610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)	351,395,677円	375,586,355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)	116,981,812円	127,953,306円
(合計)	79,369,567,734円	73,930,314,133円
2 受益権の総数	79,369,567,734口	73,930,314,133口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9674円 (19,674円)	1.8659円 (18,659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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
通貨関連

区 分	種 類	[平成28年5月12日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	10,835,800		10,835,000	800
	イギリスポンド	1,565,080		1,565,000	80
	ユーロ	9,905,000		9,904,800	200
	合 計	22,305,880		22,304,800	1,080

区 分	種 類	[平成28年11月11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	213,271,415		215,484,400	2,212,985
	カナダドル	10,272,365		10,273,900	1,535
	オーストラリアドル	10,566,870		10,514,100	52,770
	イギリスポンド	35,396,150		36,115,200	719,050
	スイスフラン	2,143,780		2,160,400	16,620
	シンガポールドル	2,264,625		2,264,400	225
	マレーシアリングット	2,444,700		2,455,000	10,300
	スウェーデンクローネ	2,122,110		2,122,200	90
	ノルウェークローネ	2,292,750		2,287,800	4,950
	デンマーククローネ	4,045,820		4,056,000	10,180
	メキシコペソ	4,257,823		3,980,900	276,923
	ポーランドズロチ	2,656,850		2,656,000	850
	南アフリカランド	1,588,500		1,510,000	78,500
	ユーロ	195,606,064		196,209,000	602,936
合 計	488,929,822		492,089,300	3,159,478	

（注）時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

[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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	347,463,058	217,539,565
コール・ローン	50,198,981	17,770,847
国債証券	10,717,402,608	11,184,757,788
派生商品評価勘定	447,440	1,313
未収入金	50,513,287	7,217,517
未収利息	167,457,320	179,528,482
前払費用	30,042,807	14,648,603
流動資産合計	11,363,525,501	11,621,464,115
資産合計	11,363,525,501	11,621,464,115
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	77,560	200,700
未払解約金	151,727,418	9,059,340
未払利息	101	25
その他未払費用	29	
流動負債合計	151,805,108	9,260,065
負債合計	151,805,108	9,260,065
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,331,333,720	9,833,441,883
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,880,386,673	1,778,762,167
元本等合計	11,211,720,393	11,612,204,050
純資産合計	11,211,720,393	11,612,204,050
負債純資産合計	11,363,525,501	11,621,464,115

(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。

(注2) 平成28年11月12日が休業日のため、前営業日の平成28年11月11日現在における親投資信託の状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 期首	平成27年5月13日	平成28年5月13日
期首元本額	6,768,133,113円	9,331,333,720円
期首からの追加設定元本額	4,133,469,891円	1,091,864,306円
期首からの一部解約元本額	1,570,269,284円	589,756,143円
元本の内訳*		
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,863,973,760円	2,057,948,788円
eMAXIS バランス(波乗り型)	363,469,678円	369,863,901円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	212,946,774円	249,038,582円
コアバランス	1,132,246円	1,663,719円
eMAXIS 新興国債券インデックス	4,856,377,280円	5,011,420,228円
三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド	1,609,469,241円	2,070,900,570円
新興国債券インデックスオープン	931,694円	926,935円
新興国債券インデックスファンド(ラップ向け)	184,884,979円	2,651,975円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	2,116,874円	1,651,602円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	1,256,913円	7,631,691円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	4,551,365円	11,343,792円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	122,274円	372,858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)	28,819,798円	6,121,698円

三菱UFJ 新興国債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	46,301,336円	27,226,091円
アドバンス・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	63,878,156円	7,437,903円
アドバンス・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	91,101,352円	6,911,309円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）		330,241円
（合計）	9,331,333,720円	9,833,441,883円
2 受益権の総数	9,331,333,720口	9,833,441,883口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2015円 （12,015円）	1.1809円 （11,809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28年5月12日現在]	[平成28年11月11日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	[平成28年5月12日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	アメリカドル	13,049,460	13,002,600	46,860
	マレーシアリング	16,119,840	16,182,000	62,160
	タイバーツ	4,338,600	4,298,000	40,600
	インドネシアルピア	11,464,600	11,480,000	15,400
	メキシコペソ	19,985,110	19,866,000	119,110
	ブラジルリアル	18,855,600	18,834,000	21,600
	ハンガリーフォリント	7,838,000	7,838,000	
	ポーランドズロチ	19,647,210	19,572,000	75,210
	南アフリカランド	17,322,400	17,280,000	42,400
	ルーマニアレイ	5,518,000	5,510,000	8,000
	トルコリラ	22,098,660	22,005,000	93,660
	合 計	156,237,480	155,867,600	369,880

区 分	種 類	[平成28年11月11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			
	タイバーツ	1,505,550	1,510,000	4,450
	トルコリラ	4,267,913	4,266,600	1,313
	買建			
	南アフリカランド	3,971,250	3,775,000	196,250
	合 計	9,744,713	9,551,600	199,387

（注）時価の算定方法

1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

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

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

- (イ)当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- (ロ)当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

[前へ](#)

【ファンドの現況】

<更新後>

【純資産額計算書】

平成28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	11,251,021
負債総額	496,267
純資産総額(-)	10,754,754
発行済口数	10,427,434 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0314 (1万口当たり 10,314)

<参考>

「TOPIXマザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	360,749,480,415
負債総額	65,280,661,326
純資産総額(-)	295,468,819,089
発行済口数	195,890,056,441 口
1口当たり純資産価額(/)	1.5083 (1万口当たり 15,083)

<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28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	293,211,173,813
負債総額	1,610,694,811
純資産総額(-)	291,600,479,002
発行済口数	135,921,934,004 口
1口当たり純資産価額(/)	2.1454 (1万口当たり 21,454)

<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28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	529,626,812,672
負債総額	13,463,016,635
純資産総額(-)	516,163,796,037
発行済口数	388,445,336,269 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3288 (1万口当たり 13,288)

<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28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	141,274,090,625
負債総額	867,364,539
純資産総額(-)	140,406,726,086
発行済口数	72,454,549,845 口
1口当たり純資産価額(/)	1.9379 (1万口当たり 19,379)

<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28年11月30日現在
(単位：円)

資産総額	12,052,556,207
負債総額	64,777,578
純資産総額(-)	11,987,778,629
発行済口数	9,916,676,374 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2089 (1万口当たり 12,089)

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28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、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

2【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28年11月30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	788	10,467,348
追加型公社債投資信託	16	1,275,977
単位型株式投資信託	60	564,325
単位型公社債投資信託	2	58,485
合計	866	12,366,134

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国際投信株式会社（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31期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28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32期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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。

三菱UFJ投信株式会社は、平成27年7月1日をもって、国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更いたしました。

当社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、合併非存続会社である国際投信投資顧問株式会社の第18期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

(第31期事業年度の財務諸表は省略)

[次へ](#)

<追加>
中間財務諸表
(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間
(平成28年9月30日現在)

(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	62,058,580
有価証券	954,855
前払費用	349,921
未収入金	3,561
未収委託者報酬	10,268,553
未収収益	530,697
繰延税金資産	456,768
金銭の信託	30,000
その他	419,605
流動資産合計	75,072,544
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 830,169
器具備品	1 795,745
土地	1,356,000
有形固定資産合計	2,981,915
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,804,771
ソフトウェア仮勘定	401,194
その他	40
無形固定資産合計	2,221,828
投資その他の資産	
投資有価証券	24,010,186
関係会社株式	320,136
長期差入保証金	668,522
前払年金費用	479,512
繰延税金資産	1,026,692
その他	50,280
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	26,531,729
固定資産合計	31,735,474
資産合計	106,808,018

(単位：千円)

第32期中間会計期間
(平成28年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金		120,395
未払金		
未払収益分配金		107,575
未払償還金		809,484
未払手数料		4,391,508
その他未払金		2,524,333
未払費用		3,157,907
未払消費税等	2	456,015
未払法人税等		870,337
賞与引当金		875,123
役員賞与引当金		62,925
その他		764,005
流動負債合計		14,139,611

固定負債

退職給付引当金		531,090
役員退職慰労引当金		142,018
時効後支払損引当金		248,442
固定負債合計		921,551

負債合計		15,061,162
------	--	------------

(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		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712

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		36,691,609
利益剰余金合計		44,032,199

株主資本合計		90,765,043
--------	--	------------

(単位：千円)

第32期中間会計期間
(平成28年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券 評価差額金	966,353
繰延ヘッジ損益	15,459
評価・換算差額等合計	981,813
純資産合計	91,746,856
負債純資産合計	106,808,018

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	41,758,968
投資顧問料	1,136,073
その他営業収益	12,186
営業収益合計	42,907,228
営業費用	
支払手数料	17,457,103
広告宣伝費	360,786
公告費	114
調査費	
調査費	843,985
委託調査費	7,067,784
事務委託費	512,633
営業雑経費	
通信費	81,384
印刷費	373,878
協会費	25,997
諸会費	4,946
事務機器関連費	829,924
その他営業雑経費	8,961
営業費用合計	27,567,501
一般管理費	
給料	
役員報酬	158,250
給料・手当	2,845,172
賞与引当金繰入	875,123
役員賞与引当金繰入	62,925
福利厚生費	580,859
交際費	9,091
旅費交通費	123,837
租税公課	217,242
不動産賃借料	356,305
退職給付費用	203,811
役員退職慰労引当金繰入	23,953
固定資産減価償却費	1 506,535
諸経費	256,387
一般管理費合計	6,219,495
営業利益	9,120,232

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	136,620
有価証券利息	0
受取利息	4,221
投資有価証券償還益	93,861
収益分配金等時効完成分	13,737
その他	8,799
営業外収益合計	257,240
営業外費用	
投資有価証券償還損	11,538
その他	1,363
営業外費用合計	12,901
経常利益	9,364,571
特別利益	
投資有価証券売却益	29,030
特別利益合計	29,030
特別損失	
投資有価証券売却損	6,586
投資有価証券評価損	33,795
固定資産除却損	5,617
特別損失合計	45,999
税引前中間純利益	9,347,602
法人税、住民税及び事業税	2,925,334
法人税等調整額	3,128
法人税等合計	2,928,462
中間純利益	6,419,139

(3)中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	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	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
中間純利益							6,419,139	6,419,139	6,419,139
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							20,388,172	20,388,172	20,388,172
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	36,691,609	44,032,199	90,765,043

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当中間期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
中間純利益				6,419,139
株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	480,223	8,913	471,310	471,310
当中間期変動額合計	480,223	8,913	471,310	20,859,483
当中間期末残高	966,353	15,459	981,813	91,746,856

[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. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 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。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

(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。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 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。

(3) 役員賞与引当金

役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。

(4) 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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

（追加情報）

当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行することとしております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準委員会 平成14年1月31日 企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（企業会計基準委員会 平成19年2月7日 実務対応報告第2号）を適用しております。なお、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に与える影響は軽微であります。

(5) 役員退職慰労引当金

役員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。

(6) 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。

5. 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。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ開始から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして判断しております。

7. 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。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

(平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、この変更による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に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

[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32期中間会計期間 （平成28年9月30日現在）	
建物	502,913千円
器具備品	963,520千円

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32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）	
有形固定資産	123,766千円
無形固定資産	382,769千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

平成28年6月28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	26,807,312千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

（リース取引関係）

第32期中間会計期間(平成28年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	678,116千円
1年超	2,312,757千円
合計	2,990,874千円

（金融商品関係）

第32期中間会計期間(平成28年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成28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	62,058,580	62,058,580	-
(2) 有価証券	954,855	954,855	-
(3) 未収委託者報酬	10,268,553	10,268,553	-
(4) 投資有価証券	24,010,186	24,010,186	-
資産計	97,292,175	97,292,175	-
(1) 未払手数料	4,391,508	4,391,508	-
負債計	4,391,508	4,391,508	-
デリバティブ取引()	10,893	10,893	-

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については()で表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

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、(4)投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(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168,730千円)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32期中間会計期間(平成28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	90,395	30,541	59,853
	債券	-	-	-
	その他	18,293,929	16,451,094	1,842,834
	小 計	18,384,325	16,481,636	1,902,688
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	6,411,985	6,921,318	509,332
	小 計	6,411,985	6,921,318	509,332
合 計		24,796,311	23,402,955	1,393,355

(注1) 取得原価は減損処理後の金額で記載しております。その他有価証券について、当中間会計期間において33,795千円減損処理を行っております。なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(注2) 非上場株式(中間貸借対照表計上額168,730千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難である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)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(単位：千円)

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち 1年超	時価
原則的処理 方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	965,600	-	10,893
合計			965,600	-	10,893

(注) 時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28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32期中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
1株当たり純資産額	433,625.21円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	91,746,856
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	91,746,856
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)	211,581

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32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	30,338.92円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	6,419,139
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)	6,419,139
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

(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】

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28年11月末現在）
（略）

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月30日

三菱UFJ国際投信株式会社

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	弥永 めぐみ	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国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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国際投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28年12月21日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 柴 毅 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコアバランスの平成28年5月13日から平成28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28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28年5月13日から平成28年11月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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