

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年10月14日
【計算期間】	第5期（自平成28年1月17日 至平成28年7月16日）
【ファンド名】	MAXIS JPX日経インデックス400上場投信
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

（注）この有価証券報告書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第7条第4項の規定により、平成28年4月15日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書とみなされます。

有価証券報告書

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式のみに対する投資として運用することを目的とし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させるよう運用を行います。

追加信託の限度額は、5兆円相当額です。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券 不動産投信		
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	日本			TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (JPX日経 インデックス 400)	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
中小型株	年6回	欧州				
債券	(隔月)	アジア				
一般	年12回	オセアニア				
公債	(毎月)	中南米				
社債	日々	アフリカ				
その他債券	その他	中近東 (中東)				
クレジット 属性 ()	()	エマージング				その他 ()
不動産投信						
その他資産 ()						
資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

対象指数(JPX日経インデックス400)の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

投資方針

JPX日経インデックス400に連動する成果をめざして運用を行います。

JPX日経インデックス400に採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含みます。)の株式のみに対する投資として運用することを目的とし、ファンドの1口当たりの純資産額の変動率をJPX日経インデックス400の変動率に一致させるよう運用を行います。

個別銘柄の株数の比率は、JPX日経インデックス400における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

＜JPX日経インデックス400について＞

JPX日経インデックス400とは、東京証券取引所の第一部、第二部、マザーズ、JASDAQを主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、売買代金、ROE等を基に原則400銘柄を選定し算出される株価指数です。

JPX日経インデックス400は、2013年(平成25年)8月30日の時価総額を10,000ポイントとして、日本取引所グループ、東京証券取引所および日本経済新聞社が算出・公表しています。^(注1)

算出対象銘柄数の増減や増資など市況変動によらない時価総額の増減が発生する場合は、その連続性を維持するため、基準時の時価総額(基準時価総額)を修正します。^(注2)

(注1)算出方法:算出時の時価総額÷基準時価総額×10,000

(注2)基準時価総額の修正方法:

新・基準時価総額

=旧・基準時価総額×(修正日前営業日の時価総額±修正額)÷修正日前営業日の時価総額

＜運用プロセスのイメージ＞

ステップ1：投資対象ユニバースの作成

ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

ステップ2：ポートフォリオ案の作成

モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

ステップ3：売買執行

売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができ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。

■上場投信の仕組み

ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律により定められる投資信託ですが、以下の点で通常の投資信託とは異なる商品性を持っています。

受益権が上場されます。

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は1口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

<金融商品取引所>

・東京証券取引所（2014年2月6日に新規上場）

取得申込みは株式によって行われます。

金融商品取引所における買付けのほか、株式による取得申込み（追加設定）を行うことができます。

委託会社は、あらかじめ取得申込みに必要な株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。取得申込者はこれらの株式を提供することで、引換えに受益権を取得することができます。

なお、所定の条件に該当する場合を除き、金銭による取得申込みを行うことはできません。

受益権と引換えに株式を交付（交換）します。

一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する信託財産中の株式と交換することができます。

委託会社は、あらかじめ交換できる株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。

なお、通常の投資信託における換金手続きの「解約請求」は、ファンドでは行うことができません。換金は、原則として金融商品取引所を通じての売却となります。

■主な投資制限

- ・株式への投資割合に制限を設けません。
- ・同一銘柄の株式への投資割合に制限を設けません。
- ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ・デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

分配方針

年2回の決算時に分配を行います。

- ・年2回の決算時（1・7月の各16日）に分配を行います。
- ・分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- ・分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●「MAXIS(マクシス)」の由来

「MAXIS(マクシス)」は三菱UFJ国際投信が運用するETF(上場投資信託)シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高(MAX)の品質」と「お客さまの投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJ国際投信の思いが込められています。

「JPX日経インデックス400」の著作権等について

「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下、総称して「JPXグループ」といいます。)と株式会社日本経済新聞社(以下、「日本経済新聞社」といいます。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてJPXグループと日本経済新聞社に帰属しています。

ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、JPXグループと日本経済新聞社は、その運用およびファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。

JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

JPXグループと日本経済新聞社は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

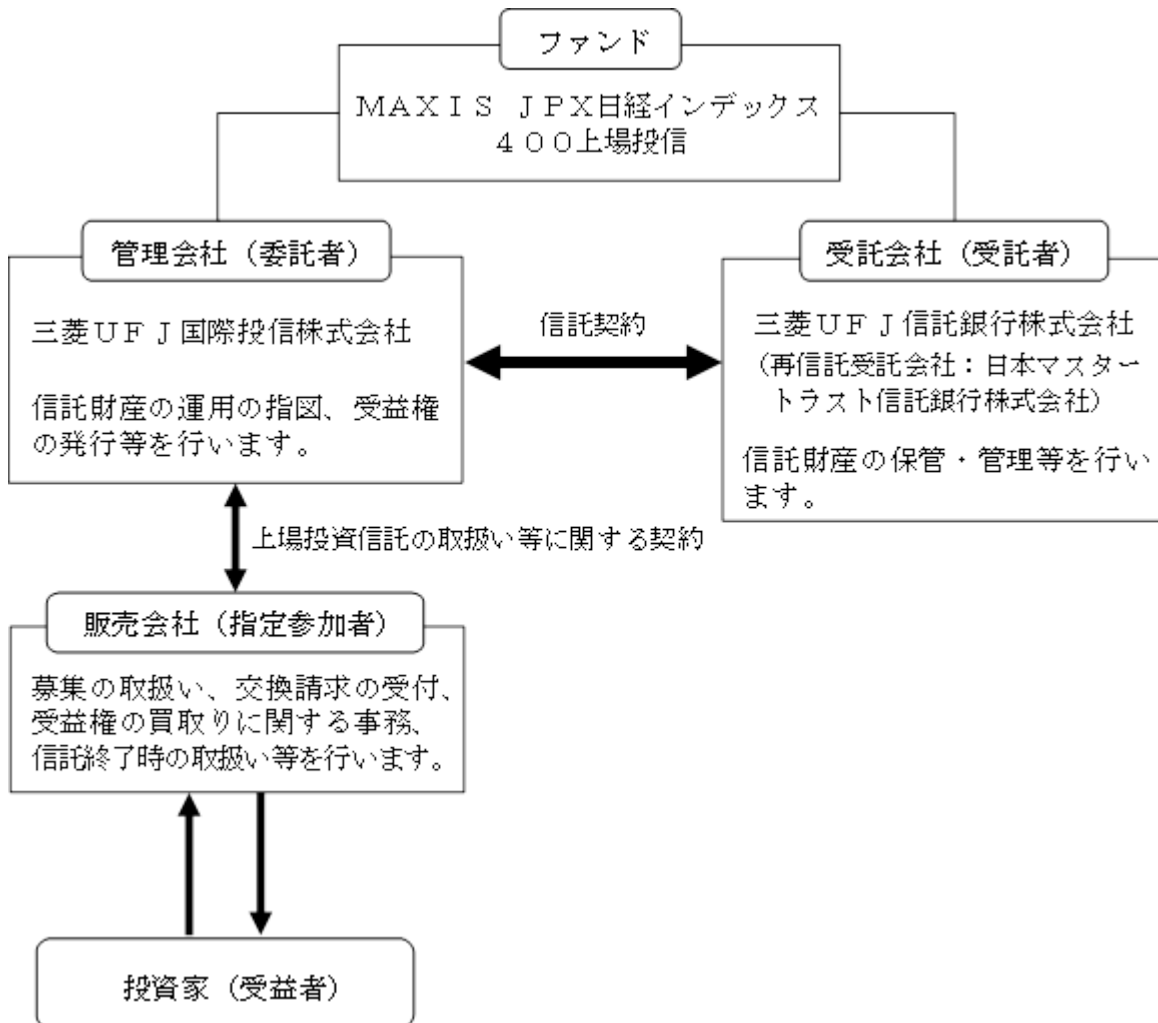
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成26年2月5日 設定日、信託契約締結、運用開始
平成26年2月6日 ファンドの受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況

・資本金

2,000百万円（平成28年7月末現在）

・沿革

- 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

・大株主の状況（平成28年7月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式のみに対する投資として運用することを目的とし、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させるよう運用を行います。

信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。

の基本方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。）とします。

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）
 - a. 有価証券先物取引等
3. 金銭債権

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、次に掲げるものとします。

1. 株式（外国または外国の者の発行する株式を含みます。）
2. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
3. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
4. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1.から3.に該当するものを除きます。）

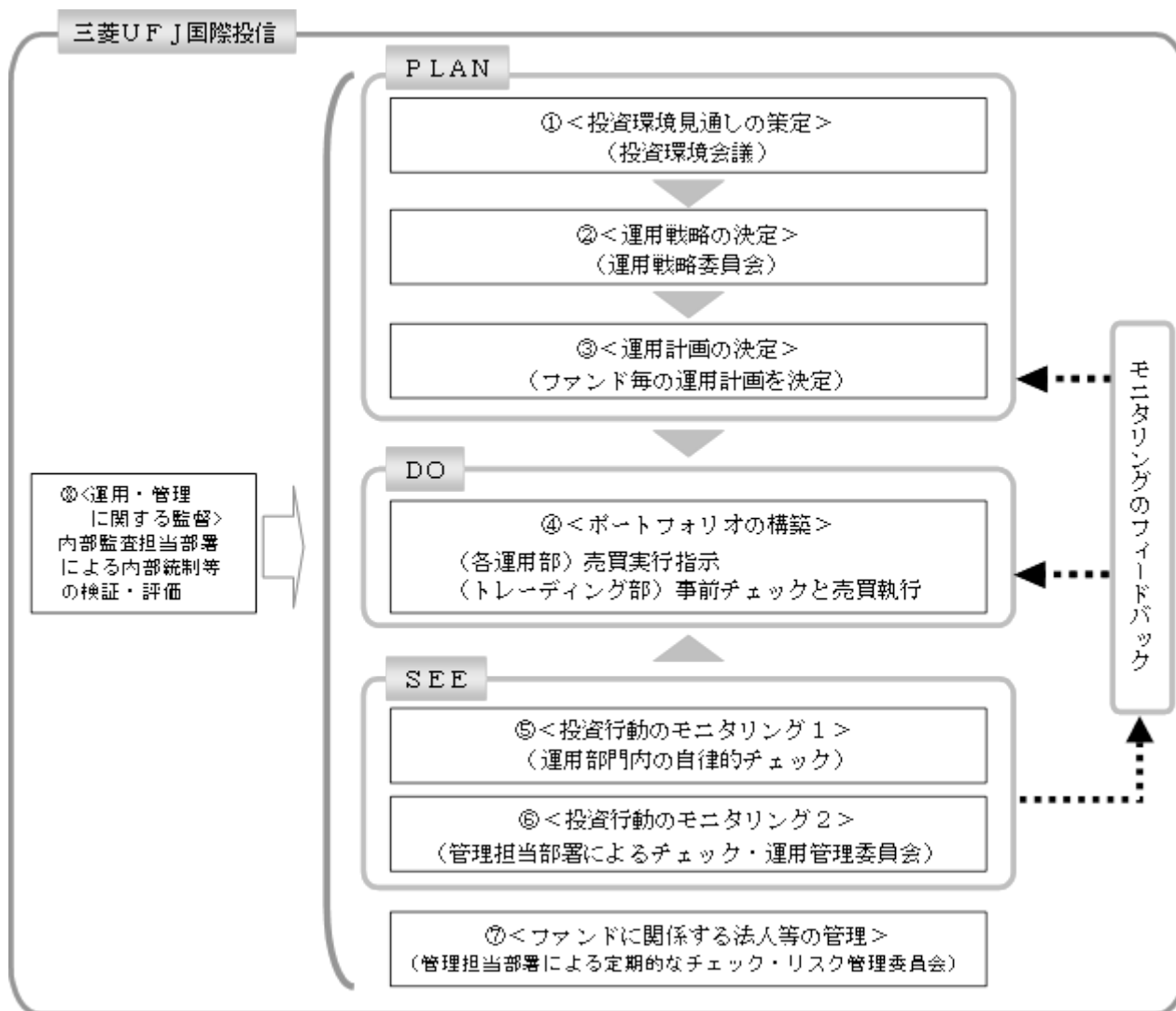
金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
- その他の投資対象
信託約款に定める次に掲げるもの。
- ・外国為替予約取引

（3）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、経費等控除後の配当等収益(配当金、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。)の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

売買益(評価益を含みます。)からの分配は行いません。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の20を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

投資信託証券

投資信託証券への投資は行いません。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への投資割合に制限を設けません。

信用取引

信用取引の指図は行いません。

外国為替予約取引

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

c. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

資金の借入れを行いません。

投資する株式の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

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な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。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<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、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、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】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

価格変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドは、交換時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・当ファンドは、JPX日経インデックス400の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数における各銘柄の構成比率と当ファンドにおける各銘柄の組入比率が完全に一致しないこと、当該指数を構成する銘柄が変更になること、取得申込みの一部が金銭にて行われた場合および組入銘柄の配当金や権利処理等によってファンド内に現金が発生すること等の要因によりカイ離を生じることがあります。
- ・当ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格は当ファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、当ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

（２）投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

価格変動リスク

価格変動リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、価格変動リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、価格変動リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

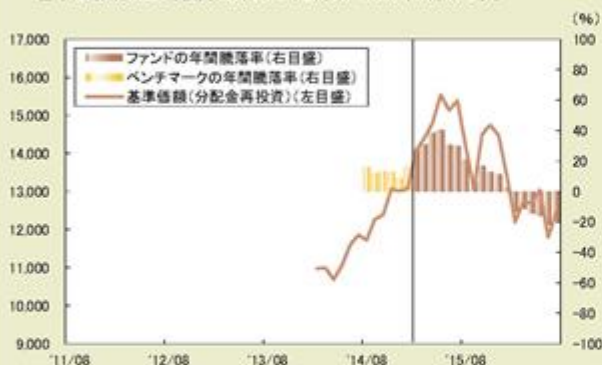
流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

■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。

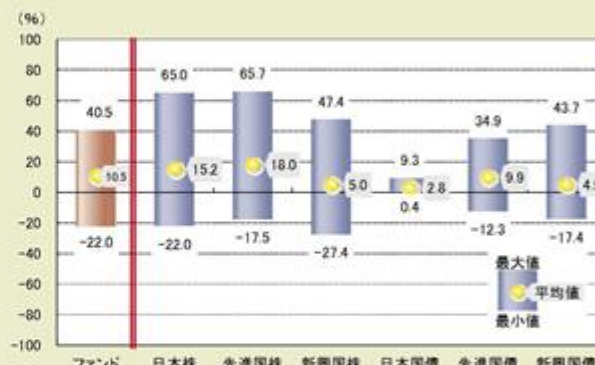
●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2015年2月～2016年7月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2014年8月～2015年1月です。
基準価額(分配金再投資)は、2014年2月末～2016年7月末です。



●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年8月末～2016年7月末)
ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2014年8月～2015年1月)の年間騰落率を含みます。



(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。

- ・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。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
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。

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ロクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIロクサイ・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ロクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定める額

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）がかかります。

申込手数料は販売会社にご確認ください。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

(2)【換金（解約）手数料】

販売会社は、受益者が交換を行うときおよび受益権の買取りを行うときは、当該受益者から、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

詳しくは販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.08424% 以内（税抜 年0.078% 以内）の率を乗じて得た額

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

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

信託報酬の配分は以下の通りです。

・上記 の配分

委託会社	受託会社
年0.054% （税抜 年0.05%）	年0.03024% （税抜 年0.028%）

・上記 の配分

委託会社と受託会社で1：3の割合で配分します。

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が含まれます。

受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.0081%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.0081%（税抜0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.0432%（税抜 年0.04%）（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

(*) 上記 から の「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

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（交換）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、交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、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 （カストディアン）	間接	外国での資産の保管等に要する費用
受益権の上場に係る費用	間接	受益権を金融商品取引所に上場するための費用
対象指数についての商標の使用料	間接	対象指数の商標を使用するための費用

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】

課税上は、特定株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

１．受益権の売却時

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

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

２．収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。

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

３．受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記１．と同様の取扱いとなります。

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

特定株式投資信託は税法上、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する(ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。)など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

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

2. 収益分配金の受取り時

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

3. 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記1.と同様の取扱いとなります。

上記は平成28年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年7月29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	132,073,899,130	99.49
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		671,277,903	0.51
純資産総額		132,745,177,033	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7月29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）	671,940,500	0.51

(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7月29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	日本電信電話	株式	情報・通信業	545,800	4,874.00 4,881.00	2,660,230,880 2,664,049,800		2.01
日本	KDDI	株式	情報・通信業	807,700	3,146.01 3,145.00	2,541,036,400 2,540,216,500		1.91
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	561,900	4,270.00 4,025.00	2,399,313,000 2,261,647,500		1.70
日本	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	364,200	6,005.25 5,703.00	2,187,112,200 2,077,032,600		1.56
日本	NTTドコモ	株式	情報・通信業	678,800	2,847.88 2,749.50	1,933,147,600 1,866,360,600		1.41
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	1,046,400	1,608.00 1,721.50	1,682,611,200 1,801,377,600		1.36
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	384,000	4,375.33 4,588.00	1,680,128,960 1,761,792,000		1.33
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	618,500	2,800.03 2,841.50	1,731,820,250 1,757,467,750		1.32
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	380,000	4,499.88 4,303.00	1,709,954,600 1,635,140,000		1.23
日本	ファナック	株式	電気機器	93,300	17,005.00 17,325.00	1,586,566,500 1,616,422,500		1.22
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	168,300	9,478.84 9,485.00	1,595,290,220 1,596,325,500		1.20
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	269,300	5,759.00 5,894.00	1,550,898,700 1,587,254,200		1.20
日本	東海旅客鉄道	株式	陸運業	82,400	19,285.00 19,220.00	1,589,084,000 1,583,728,000		1.19
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	9,426,200	163.77 167.10	1,543,772,440 1,575,118,020		1.19
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	475,200	3,232.62 3,308.00	1,536,144,720 1,571,961,600		1.18
日本	キーエンス	株式	電気機器	20,900	70,100.00 72,920.00	1,465,090,000 1,524,028,000		1.15
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	368,000	3,808.02 4,040.00	1,401,351,670 1,486,720,000		1.12
日本	キャノン	株式	電気機器	495,500	2,959.36 2,935.00	1,466,366,250 1,454,292,500		1.10
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	2,784,800	518.75 522.00	1,444,615,660 1,453,665,600		1.10
日本	花王	株式	化学	244,900	5,968.00 5,553.00	1,461,563,200 1,359,929,700		1.02
日本	三菱地所	株式	不動産業	676,000	1,923.75 1,929.00	1,300,458,200 1,304,004,000		0.98
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	1,254,800	1,043.00 1,012.00	1,308,756,400 1,269,857,600		0.96
日本	村田製作所	株式	電気機器	96,600	12,730.36 12,825.00	1,229,752,920 1,238,895,000		0.93

日本	信越化学工業	株式	化学	172,900	6,443.32 7,064.00	1,114,050,690 1,221,365,600		0.92
日本	三菱商事	株式	卸売業	681,700	1,939.69 1,778.50	1,322,287,280 1,212,403,450		0.91
日本	ダイキン工業	株式	機械	134,000	9,066.62 9,012.00	1,214,927,150 1,207,608,000		0.91
日本	三菱電機	株式	電気機器	982,000	1,278.80 1,217.50	1,255,790,600 1,195,585,000		0.90
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	325,300	3,539.01 3,601.00	1,151,242,050 1,171,405,300		0.88
日本	富士重工業	株式	輸送用機器	290,900	3,943.00 4,015.00	1,147,018,700 1,167,963,500		0.88
日本	日立製作所	株式	電気機器	2,348,000	466.20 476.50	1,094,644,600 1,118,822,000		0.84

(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7月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	鉱業	0.33
	建設業	3.30
	食料品	5.09
	繊維製品	0.50
	パルプ・紙	0.16
	化学	6.78
	医薬品	7.32
	石油・石炭製品	0.06
	ゴム製品	1.08
	ガラス・土石製品	0.92
	鉄鋼	1.12
	非鉄金属	0.90
	金属製品	0.29
	機械	5.08
	電気機器	12.59
	輸送用機器	8.28
	精密機器	1.64
	その他製品	0.63
	電気・ガス業	0.78
	陸運業	5.76
	海運業	0.11
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.02
	情報・通信業	8.71
	卸売業	4.21
	小売業	4.76
	銀行業	6.16
証券、商品先物取引業	1.24	
保険業	3.19	
その他金融業	1.49	
不動産業	3.19	
サービス業	3.43	
合計	99.49	

(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7月29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						
JPX日経インデックス400先物 16年09月限	大阪取引所	買建	563	668,744,864	671,940,500	0.51

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成28年7月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1口当たりの純資産価額)	東京証券取引所 取引価格
第1計算期間末日 (平成26年 7月16日)	36,007,845,904 (分配付) 35,814,151,774 (分配落)	11,712 (分配付) 11,649 (分配落)	11,670
第2計算期間末日 (平成27年 1月16日)	69,973,376,340 (分配付) 69,677,757,975 (分配落)	12,545 (分配付) 12,492 (分配落)	12,500
第3計算期間末日 (平成27年 7月16日)	87,383,722,995 (分配付) 86,577,144,903 (分配落)	15,276 (分配付) 15,135 (分配落)	15,130
第4計算期間末日 (平成28年 1月16日)	87,698,633,764 (分配付) 86,968,570,089 (分配落)	12,853 (分配付) 12,746 (分配落)	12,730
第5計算期間末日 (平成28年 7月16日)	134,391,648,765 (分配付) 133,389,780,825 (分配落)	12,073 (分配付) 11,983 (分配落)	11,970
平成27年 7月末日	89,382,001,031	15,098	15,070
8月末日	83,926,577,497	13,941	13,920
9月末日	79,871,462,288	12,842	12,840
10月末日	89,955,345,921	14,237	14,250
11月末日	92,893,245,246	14,472	14,490
12月末日	95,491,229,364	14,204	14,170
平成28年 1月末日	92,922,821,487	13,041	13,080
2月末日	85,786,840,694	11,871	11,890
3月末日	90,807,886,805	12,392	12,400
4月末日	100,373,865,856	12,350	12,370
5月末日	113,277,228,333	12,689	12,660
6月末日	109,432,711,860	11,481	11,500
7月末日	132,745,177,033	12,033	12,030

【分配の推移】

	1口当たりの分配金
第1計算期間	63円
第2計算期間	53円
第3計算期間	141円
第4計算期間	107円
第5計算期間	90円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.36
第2計算期間	7.69
第3計算期間	22.28
第4計算期間	15.07
第5計算期間	5.28

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額)を控除した額を当該基準価額(分配落の額)で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	3,560,674	486,164	3,074,510
第2計算期間	3,100,717	597,522	5,577,705
第3計算期間	1,900,213	1,757,506	5,720,412
第4計算期間	1,397,855	295,242	6,823,025
第5計算期間	4,998,743	689,902	11,131,866

(注)解約口数は、交換口数を表示しております。

[参考情報]

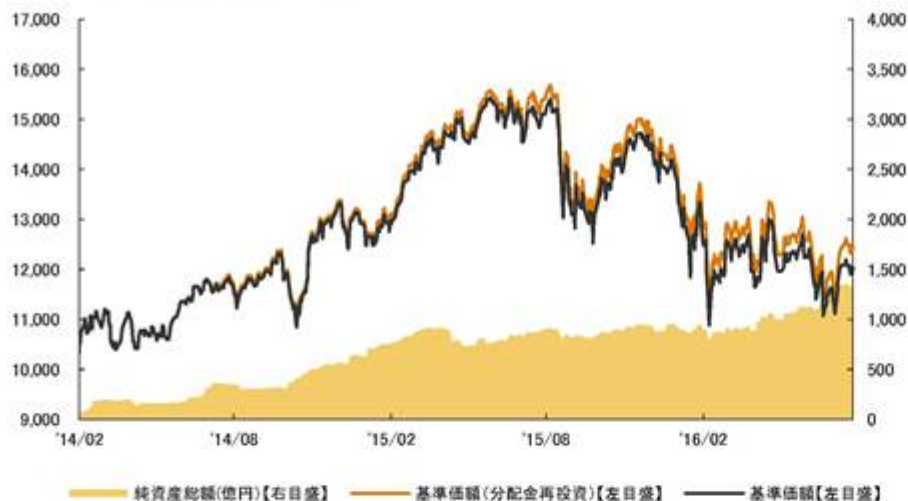


運用実績

2016年7月29日現在

■基準価額・純資産の推移

2014年2月5日(設定日)～2016年7月29日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,331(当初元本1口当たり)を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	12,033円
純資産総額	1,327億円

■分配の推移

2016年7月	90円
2016年1月	107円
2015年7月	141円
2015年1月	53円
2014年7月	63円
設定来累計	454円

・分配金は1口当たり、税引前

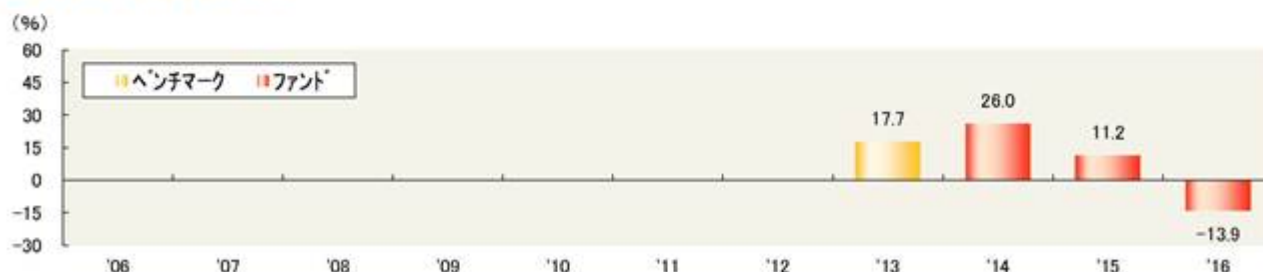
■主要な資産の状況

組入上位業種	比率	組入上位銘柄	業種	比率
1 電気機器	12.6%	1 日本電信電話	情報・通信業	2.0%
2 情報・通信業	8.7%	2 KDDI	情報・通信業	1.9%
3 輸送用機器	8.3%	3 日本たばこ産業	食料品	1.7%
4 医薬品	7.3%	4 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.6%
5 化学	6.8%	5 NTTドコモ	情報・通信業	1.4%
6 銀行業	6.2%	6 アステラス製薬	医薬品	1.4%
7 陸運業	5.8%	7 武田薬品工業	医薬品	1.3%
8 食料品	5.1%	8 本田技研工業	輸送用機器	1.3%
9 機械	5.1%	9 セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1.2%
10 小売業	4.8%	10 ファナック	電気機器	1.2%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	0.5%

- ・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2014年は設定日から年末までの、2016年は年初から7月29日までの収益率を表示
- ・2013年は対象指数(ベンチマーク)起算日(8月30日)から年末までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
 ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
 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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	<p>原則、取得申込受付日の正午までに受け付けた取得申込み（当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該取得申込受付日の申込みとします。正午過ぎに受け付けた取得申込みは翌営業日を取得申込受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。</p> <p>ただし、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内 2. 対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内 3. 対象指数の構成銘柄の株式移転および合併等に伴う新規銘柄の対象指数への採用日および存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日 4. 計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内） 5. ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間 6. 委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき <p>なお、委託会社は、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における申込みについては、申込みの受付を行うことができます。</p>
申込単位	<p>1ユニット以上1ユニット単位</p> <p>委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込受付日に適用される現物株式のポートフォリオ（「ユニット」といいます。）の銘柄および数量を申込ユニット数に応じて決定し、販売会社に提示します。</p> <p>受益権の取得申込者は、販売会社に対して、原則としてユニットを単位として取得申込みを行うものとします。</p> <p>取得に係る受益権の口数は、委託会社が定めるものとし、1口の整数倍とします。</p>
申込価額	取得申込受付日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	<p>申込単位（ユニット）および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。また、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/ MAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/</p>
申込手数料	<p>販売会社が定める額 消費税等相当額がかかります。</p> <p>申込手数料は販売会社にご確認ください。</p> <p>販売会社は、下記にてご確認いただけます。</p> <p>三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</p>

申込方法	<p>取得申込者は、販売会社に対して、原則としてユニットを単位として取得申込みを行うものとします。ただし、当該申込ユニットの評価額が、取得申込口数に受益権の価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。</p> <p>取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。）である場合には、取得申込みに係る有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うものとします。なお、この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該株式の時価総額の0.15%、なお、料率は今後変更になる可能性があります。）を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。</p> <p>委託会社は、発行会社等による大口の取得申込みに対し、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合には、制限を設けることがあります。</p> <p>当該申込ユニットに、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日またはその前営業日に取得の申込みに応じて受益権の受渡しが行われることとなる有価証券（本項において「配当落ち銘柄等」といいます。）が含まれる場合は、当該配当落ち銘柄等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うことができます。この場合において、委託会社は、当該配当落ち銘柄等の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該株式の時価総額の0.15%、なお、料率は今後変更になる可能性があります。）を徴することができるものとします。</p> <p>取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。</p>
その他	<p>金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。</p>

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	<p>解約の請求はできません。（受託会社が書面決議において重大な約款の変更等に反対した受益者からの請求により買い取った受益権を除きます。）</p>
-------	---

交換の受付	<p>受益者は自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換（「交換」といいます。）を請求できます。原則、交換請求受付日の正午までに受け付けた交換請求（当該交換請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該交換請求受付日の請求とします。正午過ぎに受け付けた交換請求は翌営業日を交換請求受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に交換請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。</p> <p>ただし、以下の日を交換請求受付日とする請求はできません。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日 2. 対象指数の銘柄変更実施日および指数用株式数変更実施日の各々前々営業日から起算して3営業日以内 3. 対象指数の構成銘柄の株式移転および合併等による当該銘柄の上場廃止日から、当該移転および当該合併等に伴う新規銘柄の対象指数への採用日および存続銘柄の指数用株式数変更日の前営業日までの間 4. 計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内） 5. ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間 6. 委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき <p>なお、委託会社は、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における交換請求については、交換請求の受付を行うことができます。</p>
交換の方法	<p>受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、販売会社所定の方法で行うものとします。</p> <p>委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、交換に要する受益権の口数（1口未満の端数があるときは、1口に切り上げます。）を計算します。</p> <p>委託会社は、受益者に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位（金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。）の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。</p> <p>交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる有価証券（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとします。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。</p> <p>委託会社は、発行会社等による大口の交換請求に対し、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合には、制限を設けることがあります。</p> <p>受益者が取得できる個別銘柄の有価証券に、その配当落ちまたは権利落ち後、当該配当を受けまたは当該権利を取得することができる者が確定する日に交換の申込みに応じて受益権の受渡しが行われることとなる有価証券（本項において「配当落ち銘柄等」といいます。）が含まれる場合は、委託会社は、交換に係る有価証券のうち当該配当落ち銘柄等の株式に相当する部分について、当該株式の個別銘柄時価総額に相当する金銭の交付をもって交換するよう指図することができます。</p>
交換単位等	<p>委託会社が定める一定口数（「交換請求口数」といいます。）</p> <p>交換に係る受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額とします。この場合において、受益者が交換によって取得する個別銘柄の有価証券の数は、交換請求受付日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位の整数倍とします。</p>

交換手数料	<p>販売会社が定める額 消費税等相当額がかかります。 交換手数料は販売会社にご確認ください。 販売会社は、下記にてご確認ください。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</p>
交付有価証券	<p>原則として交換請求受付日から起算して4営業日目から、受益者への交換有価証券の交付に際しては振替機関等の口座に交換請求を行った受益者に係る有価証券の増加の記載または記録が行われ、金銭の交付については販売会社の営業所等において行われます。</p>
その他	<p>委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた交換請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換請求を受け付けたものとします。 受益者の交換請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。</p>
買取り	<p>販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、正午までに受け付けた請求については当日を受付日としてその受益権を買取ります。正午過ぎに受け付けた場合は翌営業日を受付日とします。ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権 2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき <p>受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。 販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。 販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。 受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとします。</p>

詳しくは販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数 なお、当ファンドでは1口当たりの価額で表示されます。 (注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。 (主な評価方法) 株式：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。 外貨建資産：原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。 外国為替予約取引：原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。</p>
基準価額の算出頻度	<p>原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。</p>

基準価額等の照会方法	基準価額およびユニットは、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/ MAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/
------------	---

(2) 【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3) 【信託期間】

信託期間	平成26年2月5日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	--

(4) 【計算期間】

計算期間	原則として、毎年1月17日から7月16日まで、および7月17日から翌年1月16日まで ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	--

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	<p>委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）</p> <ul style="list-style-type: none"> ・受益権の口数が10万口を下回ることとなったとき ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき <p>このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のとき、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合、対象指数が廃止された場合、対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めたこの信託約款の変更が書面決議により否決された場合は、原則として、ファンドを償還させます。</p> <p>委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合によりファンドを償還するときには、その廃止された日にファンドを償還するための手続きを開始するものとします。</p>
信託約款の変更等	<p>委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。</p> <p>委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。</p>
ファンドの償還等に関する開示方法	<p>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。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。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。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。</p> <p>併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。</p>
金融商品取引所への上場	<p>委託会社は、ファンドの受益権について、金融商品取引所への上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとします。</p> <p>平成26年2月6日 東京証券取引所に上場</p> <p>委託会社は、ファンドの受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとします。</p>
反対者の買取請求権	<p>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。</p>

関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「上場投資信託の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書	投資信託及び投資法人に関する法律により、当ファンドの交付運用報告書および運用報告書(全体版)の作成・交付は行いません。運用内容については、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間:毎営業日の9:00~17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権および名義登録	<p>受益者(計算期間終了日において受益者名簿に名義登録^(注)されている受益者(「名義登録受益者」といいます。))とします。)は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none">・収益分配金は、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式等により支払われます。・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 <p>(注)受託会社は、ファンドに係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号(行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律第2条に規定する個人番号をいいます。以下同じ。))または法人番号(同法同条に規定する法人番号をいいます。以下同じ。))(個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所とします。)その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権に係る受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号(個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所とします。)その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限ります。)を経由して受益者名簿に名義を登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社(受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者)に対して直接に行うことができます。名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。</p>
---------------------	---

信託終了時の 交換請求権	<p>受益者は、信託が終了するときは、持分に応じて交換を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none">・ 委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、信託財産に属する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。・ 交換は、販売会社の営業所において行うものとします。・ 交換に係る受益権の評価額は信託終了日の5営業日前の基準価額とします。この場合において、受益者が交換により取得する個別銘柄の有価証券の数は、信託終了日の5営業日前の日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位の整数倍とします。・ 信託終了時の有価証券の交換は、原則として、交換のための振替受益権の抹消の申請が振替機関に受け付けられたことを受託会社が確認した日の翌営業日から起算して3営業日目から行います。・ 次の場合には信託終了時の受益権の価額をもとに販売会社が買取りを行うことを原則とします。<ol style="list-style-type: none">1. 受益者の有する口数から有価証券の交換に要した口数を控除した後に残余の口数を生じた場合の残余の口数の振替受益権2. 一定口数に満たない振替受益権（取引所売買単位未満の振替受益権を含みます。）・ 販売会社は、信託終了時の交換および買取りを行うときは、当該受益者から販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。・ 受益者が、信託終了時における交換による有価証券、信託終了に係る金銭および買取りに係る金銭について信託終了日から10年間その受渡しを請求しないときは、その権利を失います。 <p>対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である受益者が、交換する場合には、委託会社は当該発行会社の株式の個別時価総額に相当する口数の受益権を買い取ることを受託会社に指図します。この場合の個別時価総額は、信託終了日の4営業日前の寄付き以降成行きの方法またはこれに準ずるものとして合理的な売却の方法によって当該株式を売却した額（売却するのに必要な経費を控除した後の金額）とします。信託財産が買い取った受益権については、個別時価総額が確定した日から4営業日目に金銭の交付を行います。</p>
-----------------	--

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成28年1月17日から平成28年7月16日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【MAXIS JPX日経インデックス400上場投信】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 [平成28年1月16日現在]	第5期 [平成28年7月16日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,087,664,682	1,473,191,061
株式	86,515,681,650	132,726,924,770
派生商品評価勘定	-	17,595,048
未収配当金	126,846,110	181,863,300
未収利息	3,492	-
前払金	129,662,900	-
差入委託証拠金	40,334,000	73,164,000
流動資産合計	87,900,192,834	134,472,738,179
資産合計		
	87,900,192,834	134,472,738,179
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,184,256	238,620
前受金	-	7,726,500
未払金	88,794,196	3,386,068
未払収益分配金	730,063,675	1,001,867,940
未払受託者報酬	13,386,790	14,988,345
未払委託者報酬	23,904,914	26,764,821
未払利息	-	3,658
その他未払費用	25,288,914	27,981,402
流動負債合計	931,622,745	1,082,957,354
負債合計		
	931,622,745	1,082,957,354
純資産の部		
元本等		
元本	170,488,671,275	1115,003,307,646
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	16,479,898,814	18,386,473,179
(分配準備積立金)	3,847,413	5,591,790
元本等合計	86,968,570,089	133,389,780,825
純資産合計		
	86,968,570,089	133,389,780,825
負債純資産合計		
	87,900,192,834	134,472,738,179

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自平成27年7月17日 至平成28年1月16日	第5期 自平成28年1月17日 至平成28年7月16日
営業収益		
受取配当金	793,512,905	1,073,248,456
受取利息	241,584	49,022
有価証券売買等損益	14,808,339,323	4,625,906,513
派生商品取引等損益	105,539,488	48,094,952
その他収益	576,297	522,168
営業収益合計	14,119,548,025	3,600,181,819
営業費用		
支払利息	-	112,250
受託者報酬	13,386,790	14,988,345
委託者報酬	23,904,914	26,764,821
その他費用	₁ 25,601,705	₁ 28,341,913
営業費用合計	62,893,409	70,207,329
営業利益又は営業損失()	14,182,441,434	3,670,389,148
経常利益又は経常損失()	14,182,441,434	3,670,389,148
当期純利益又は当期純損失()	14,182,441,434	3,670,389,148
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()	-	-
期首剰余金又は期首欠損金()	27,479,568,531	16,479,898,814
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,991,728,530	7,840,779,401
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,991,728,530	7,840,779,401
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,078,893,138	1,261,947,948
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,078,893,138	1,261,947,948
分配金	₂ 730,063,675	₂ 1,001,867,940
期末剰余金又は期末欠損金()	16,479,898,814	18,386,473,179

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 4 期 [平成28年1月16日現在]	第 5 期 [平成28年7月16日現在]
1 期首元本額	59,097,576,372円	70,488,671,275円
期中追加設定元本額	14,441,240,005円	51,642,013,933円
期中一部交換元本額	3,050,145,102円	7,127,377,562円
2 受益権の総数	6,823,025口	11,131,866口
3 1口当たり純資産額	12,746円	11,983円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 4 期 (自 平成27年7月17日 至 平成28年1月16日)

- 1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	794,330,786円
分配準備積立金額	B	2,473,711円
配当等収益合計額	C=A+B	796,804,497円
経費	D	62,893,409円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	733,911,088円
収益分配金金額	F	730,063,675円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	3,847,413円
当ファンドの期末残存口数	H	6,823,025口
1口当たり分配金額	I=F/H	107円

第 5 期 (自 平成28年1月17日 至 平成28年7月16日)

- 1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	1,073,707,396円
分配準備積立金額	B	3,847,413円
配当等収益合計額	C=A+B	1,077,554,809円
経費	D	70,095,079円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	1,007,459,730円
収益分配金金額	F	1,001,867,940円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	5,591,790円
当ファンドの期末残存口数	H	11,131,866口
1口当たり分配金額	I=F/H	90円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 4 期 (自 平成27年 7月17日 至 平成28年 1月16日)	第 5 期 (自 平成28年 1月17日 至 平成28年 7月16日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同 左 同 左 同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同 左
------------------	---	-----

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 4 期 [平成28年1月16日現在]	第 5 期 [平成28年7月16日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 4 期 [平成28年1月16日現在]	第 5 期 [平成28年7月16日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	14,082,137,606	4,256,859,496
合計	14,082,137,606	4,256,859,496

(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	第 4 期 [平成28年1月16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	500,858,200		450,712,500	50,145,700
	合 計	500,858,200		450,712,500	50,145,700

区 分	種 類	第 5 期 [平成28年7月16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	646,675,200		664,092,000	17,416,800
	合 計	646,675,200		664,092,000	17,416,800

(注)時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1605	国際石油開発帝石	547,800	812.10	444,868,380	
1719	安藤・間	68,900	591.00	40,719,900	
1721	コムシスホールディングス	44,600	1,714.00	76,444,400	
1722	ミサワホーム	12,200	737.00	8,991,400	
1801	大成建設	541,000	862.00	466,342,000	
1802	大林組	311,300	1,093.00	340,250,900	
1803	清水建設	319,000	1,007.00	321,233,000	
1808	長谷工コーポレーション	121,200	1,068.00	129,441,600	
1812	鹿島建設	482,000	731.00	352,342,000	
1821	三井住友建設	397,900	92.00	36,606,800	
1878	大東建託	37,700	16,795.00	633,171,500	
1881	N I P P O	22,000	1,830.00	40,260,000	
1911	住友林業	71,100	1,516.00	107,787,600	
1925	大和ハウス工業	307,000	2,905.00	891,835,000	
1928	積水ハウス	348,000	1,823.50	634,578,000	
1951	協和エクシオ	41,000	1,337.00	54,817,000	
1963	日揮	104,700	1,550.00	162,285,000	
6366	千代田化工建設	78,000	725.00	56,550,000	
2229	カルビー	38,100	4,410.00	168,021,000	
2267	ヤクルト本社	55,600	5,130.00	285,228,000	
2269	明治ホールディングス	62,000	10,550.00	654,100,000	
2282	日本ハム	79,000	2,539.00	200,581,000	
2502	アサヒグループホールディングス	195,300	3,403.00	664,605,900	
2503	キリンホールディングス	420,700	1,742.00	732,859,400	
2593	伊藤園	31,000	3,845.00	119,195,000	
2801	キッコーマン	82,000	3,785.00	310,370,000	
2802	味の素	218,600	2,513.00	549,341,800	
2809	キューピー	53,100	3,250.00	172,575,000	
2871	ニチレイ	111,000	923.00	102,453,000	
2875	東洋水産	51,500	4,260.00	219,390,000	
2897	日清食品ホールディングス	44,000	5,530.00	243,320,000	
2914	日本たばこ産業	604,000	4,270.00	2,579,080,000	
3402	東レ	700,000	952.60	666,820,000	
3861	王子ホールディングス	374,000	421.00	157,454,000	
3880	大王製紙	43,100	1,163.00	50,125,300	
3405	クラレ	153,400	1,305.00	200,187,000	
3407	旭化成	613,000	765.20	469,067,600	
4005	住友化学	711,000	451.00	320,661,000	
4021	日産化学工業	57,700	3,205.00	184,928,500	
4042	東ソー	258,000	513.00	132,354,000	
4061	デンカ	203,000	460.00	93,380,000	
4063	信越化学工業	174,400	6,443.00	1,123,659,200	
4088	エア・ウォーター	83,000	1,629.00	135,207,000	
4091	大陽日酸	75,000	978.00	73,350,000	
4095	日本パーカライジング	50,200	1,251.00	62,800,200	
4185	J S R	90,800	1,492.00	135,473,600	
4188	三菱ケミカルホールディングス	650,500	527.10	342,878,550	
4201	日本合成化学工業	20,000	579.00	11,580,000	
4202	ダイセル	131,000	1,137.00	148,947,000	
4204	積水化学工業	220,400	1,457.00	321,122,800	
4205	日本ゼオン	85,000	719.00	61,115,000	
4206	アイカ工業	29,500	2,445.00	72,127,500	
4208	宇部興産	523,000	182.00	95,186,000	
4217	日立化成	47,600	2,052.00	97,675,200	
4272	日本化薬	68,000	985.00	66,980,000	
4403	日油	76,000	856.00	65,056,000	
4452	花王	261,600	5,968.00	1,561,228,800	
4612	日本ペイントホールディングス	75,200	2,764.00	207,852,800	
4613	関西ペイント	109,900	2,114.00	232,328,600	
4631	D I C	37,800	2,377.00	89,850,600	
4901	富士フイルムホールディングス	222,000	4,037.00	896,214,000	
4911	資生堂	184,600	2,885.00	532,571,000	

4922	コーセー	15,200	9,000.00	136,800,000	
4924	シーズ・ホールディングス	12,100	2,546.00	30,806,600	
4967	小林製薬	29,800	4,490.00	133,802,000	
6988	日東電工	75,200	6,871.00	516,699,200	
7988	ニフコ	18,900	5,610.00	106,029,000	
8113	ユニ・チャーム	196,700	2,181.50	429,101,050	
4151	協和発酵キリン	116,800	1,785.00	208,488,000	
4502	武田薬品工業	386,700	4,375.00	1,691,812,500	
4503	アステラス製薬	1,087,800	1,608.00	1,749,182,400	
4507	塩野義製薬	141,700	5,570.00	789,269,000	
4508	田辺三菱製薬	112,800	1,819.00	205,183,200	
4519	中外製薬	96,900	3,800.00	368,220,000	
4521	科研製薬	17,300	6,810.00	117,813,000	
4523	エーザイ	119,700	5,983.00	716,165,100	
4527	ロート製薬	47,200	1,582.00	74,670,400	
4528	小野薬品工業	220,500	3,924.00	865,242,000	
4530	久光製薬	30,500	5,850.00	178,425,000	
4534	持田製薬	7,100	8,360.00	59,356,000	
4536	参天製薬	178,600	1,658.00	296,118,800	
4540	ツムラ	30,800	2,793.00	86,024,400	
4555	沢井製薬	15,900	7,920.00	125,928,000	
4568	第一三共	327,000	2,608.00	852,816,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	25,500	2,149.00	54,799,500	
4578	大塚ホールディングス	208,800	4,859.00	1,014,559,200	
4581	大正製薬ホールディングス	23,300	10,950.00	255,135,000	
5002	昭和シェル石油	97,800	942.00	92,127,600	
5101	横浜ゴム	58,300	1,387.00	80,862,100	
5105	東洋ゴム工業	44,000	1,223.00	53,812,000	
5108	ブリヂストン	328,100	3,539.00	1,161,145,900	
5110	住友ゴム工業	90,600	1,466.00	132,819,600	
5201	旭硝子	516,000	587.00	302,892,000	
5233	太平洋セメント	613,000	280.00	171,640,000	
5332	TOTO	70,800	4,335.00	306,918,000	
5333	日本碍子	121,800	2,229.00	271,492,200	
5334	日本特殊陶業	84,100	1,701.00	143,054,100	
5401	新日鐵住金	438,100	2,167.00	949,362,700	
5406	神戸製鋼所	1,781,000	94.00	167,414,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	265,300	1,515.50	402,062,150	
5486	日立金属	111,000	1,114.00	123,654,000	
5706	三井金属鉱業	244,000	201.00	49,044,000	
5711	三菱マテリアル	613,000	281.00	172,253,000	
5713	住友金属鉱山	263,000	1,201.00	315,863,000	
5714	DOWAホールディングス	124,000	585.00	72,540,000	
5802	住友電気工業	388,200	1,426.00	553,573,200	
5857	アサヒホールディングス	14,300	1,675.00	23,952,500	
5929	三和ホールディングス	96,600	980.00	94,668,000	
5932	三協立山	12,600	1,470.00	18,522,000	
5947	リンナイ	18,400	9,720.00	178,848,000	
5991	日本発條	91,000	884.00	80,444,000	
6136	オーエスジー	44,200	1,722.00	76,112,400	
6146	ディスコ	12,300	9,930.00	122,139,000	
6256	ニューフレアテクノロジー	1,600	5,130.00	8,208,000	
6268	ナブテスコ	50,900	2,639.00	134,325,100	
6273	S M C	29,500	25,875.00	763,312,500	
6301	小松製作所	475,500	1,995.00	948,622,500	
6302	住友重機械工業	288,000	478.00	137,664,000	
6305	日立建機	43,500	1,597.00	69,469,500	
6326	クボタ	465,600	1,495.50	696,304,800	
6361	荏原製作所	215,000	578.00	124,270,000	
6367	ダイキン工業	134,700	9,067.00	1,221,324,900	
6371	椿本チエイン	61,000	686.00	41,846,000	
6395	タダノ	44,600	930.00	41,478,000	
6412	平和	29,200	2,116.00	61,787,200	
6425	ユニバーサルエンターテインメント	9,400	2,373.00	22,306,200	
6460	セガサミーホールディングス	99,600	1,167.00	116,233,200	
6463	T P R	11,300	2,130.00	24,069,000	
6465	ホシザキ	26,600	9,320.00	247,912,000	
6471	日本精工	190,200	877.00	166,805,400	
6473	ジェイテクト	98,900	1,292.00	127,778,800	
6474	不二越	89,000	320.00	28,480,000	

6481	THK	62,100	1,921.00	119,294,100	
6486	イーグル工業	11,400	1,282.00	14,614,800	
6586	マキタ	60,100	6,760.00	406,276,000	
7011	三菱重工業	1,651,000	471.80	778,941,800	
7013	IHI	707,000	309.00	218,463,000	
4902	コニカミノルタ	231,500	797.00	184,505,500	
6448	ブラザー工業	119,900	1,141.00	136,805,900	
6479	ミネベア	150,000	754.00	113,100,000	
6501	日立製作所	2,362,000	466.20	1,101,164,400	
6503	三菱電機	989,000	1,279.00	1,264,931,000	
6504	富士電機	285,000	452.00	128,820,000	
6506	安川電機	114,600	1,361.00	155,970,600	
6594	日本電産	111,500	8,395.00	936,042,500	
6645	オムロン	105,400	3,530.00	372,062,000	
6701	日本電気	1,281,000	283.00	362,523,000	
6702	富士通	893,000	396.30	353,895,900	
6703	沖電気工業	405,000	136.00	55,080,000	
6724	セイコーエプソン	138,700	1,803.00	250,076,100	
6727	ワコム	72,500	411.00	29,797,500	
6752	パナソニック	1,059,200	986.30	1,044,688,960	
6754	アンリツ	55,600	626.00	34,805,600	
6755	富士通ゼネラル	25,000	2,221.00	55,525,000	
6756	日立国際電気	21,300	1,643.00	34,995,900	
6762	TDK	55,800	6,060.00	338,148,000	
6770	アルプス電気	79,600	2,064.00	164,294,400	
6806	ヒロセ電機	14,600	12,710.00	185,566,000	
6807	日本航空電子工業	24,000	1,467.00	35,208,000	
6841	横河電機	92,300	1,279.00	118,051,700	
6849	日本光電工業	39,300	3,075.00	120,847,500	
6856	堀場製作所	17,700	4,635.00	82,039,500	
6861	キーエンス	21,200	70,100.00	1,486,120,000	
6869	シスメックス	72,500	7,400.00	536,500,000	
6923	スタンレー電気	66,300	2,345.00	155,473,500	
6952	カシオ計算機	92,400	1,581.00	146,084,400	
6954	ファナック	95,300	17,005.00	1,620,576,500	
6961	エンブラス	4,200	2,892.00	12,146,400	
6965	浜松ホトニクス	72,800	2,919.00	212,503,200	
6971	京セラ	152,400	5,146.00	784,250,400	
6981	村田製作所	97,400	12,730.00	1,239,902,000	
7276	小糸製作所	55,500	4,915.00	272,782,500	
7280	ミツバ	15,300	1,258.00	19,247,400	
7751	キヤノン	498,900	2,959.50	1,476,494,550	
7752	リコー	299,900	923.00	276,807,700	
8035	東京エレクトロン	76,200	8,762.00	667,664,400	
3116	トヨタ紡織	32,500	2,193.00	71,272,500	
5949	ユニプレス	19,500	1,726.00	33,657,000	
6201	豊田自動織機	84,800	4,410.00	373,968,000	
6902	デンソー	229,300	3,880.00	889,684,000	
6995	東海理化電機製作所	26,600	1,614.00	42,932,400	
7003	三井造船	356,000	152.00	54,112,000	
7012	川崎重工業	727,000	284.00	206,468,000	
7014	名村造船所	28,400	553.00	15,705,200	
7201	日産自動車	1,294,800	1,043.00	1,350,476,400	
7202	いすゞ自動車	268,200	1,308.50	350,939,700	
7203	トヨタ自動車	271,700	5,759.00	1,564,720,300	
7205	日野自動車	132,300	1,068.00	141,296,400	
7211	三菱自動車工業	367,700	501.00	184,217,700	
7240	NOK	44,700	1,790.00	80,013,000	
7248	カルソニックカンセイ	75,000	827.00	62,025,000	
7259	アイシン精機	92,800	4,295.00	398,576,000	
7261	マツダ	294,000	1,499.50	440,853,000	
7262	ダイハツ工業	110,600	1,495.00	165,347,000	
7267	本田技研工業	623,600	2,800.00	1,746,080,000	
7269	スズキ	169,200	3,089.00	522,658,800	
7270	富士重工業	293,500	3,943.00	1,157,270,500	
7272	ヤマハ発動機	131,000	1,740.00	227,940,000	
7278	エクセディ	12,500	2,274.00	28,425,000	
7282	豊田合成	33,600	1,960.00	65,856,000	
7287	日本精機	22,000	1,680.00	36,960,000	
7309	シマノ	36,900	15,230.00	561,987,000	

7313	テイ・エス テック	21,600	2,598.00	56,116,800	
4543	テルモ	142,300	4,660.00	663,118,000	
7731	ニコン	173,500	1,494.00	259,209,000	
7732	トプコン	31,300	1,014.00	31,738,200	
7733	オリンパス	138,700	3,850.00	533,995,000	
7741	HOYA	209,600	3,790.00	794,384,000	
8050	セイコーホールディングス	65,000	336.00	21,840,000	
7832	パナダイナムコホールディングス	96,200	2,601.00	250,216,200	
7846	パイロットコーポレーション	15,600	4,435.00	69,186,000	
7936	アシックス	86,500	1,889.00	163,398,500	
7951	ヤマハ	67,900	2,918.00	198,132,200	
7956	ビジョン	52,800	2,633.00	139,022,400	
9513	電源開発	78,900	2,591.00	204,429,900	
9531	東京瓦斯	1,031,000	441.10	454,774,100	
9532	大阪瓦斯	963,000	406.90	391,844,700	
9001	東武鉄道	502,000	571.00	286,642,000	
9003	相鉄ホールディングス	213,000	567.00	120,771,000	
9005	東京急行電鉄	541,000	866.00	468,506,000	
9007	小田急電鉄	300,000	1,238.00	371,400,000	
9008	京王電鉄	255,000	966.00	246,330,000	
9009	京成電鉄	136,000	1,334.00	181,424,000	
9020	東日本旅客鉄道	169,100	9,479.00	1,602,898,900	
9021	西日本旅客鉄道	89,200	6,597.00	588,452,400	
9022	東海旅客鉄道	83,600	19,285.00	1,612,226,000	
9031	西日本鉄道	155,000	549.00	85,095,000	
9041	近鉄グループホールディングス	928,000	443.00	411,104,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	626,000	775.00	485,150,000	
9044	南海電気鉄道	283,000	586.00	165,838,000	
9045	京阪ホールディングス	283,000	730.00	206,590,000	
9048	名古屋鉄道	449,000	571.00	256,379,000	
9062	日本通運	356,000	498.00	177,288,000	
9064	ヤマトホールディングス	165,700	2,478.00	410,604,600	
9065	山九	121,000	574.00	69,454,000	
9101	日本郵船	837,000	188.00	157,356,000	
9202	ANAホールディングス	1,726,000	300.40	518,490,400	
9375	近鉄エクスプレス	17,200	1,383.00	23,787,600	
3632	グリー	55,500	495.00	27,472,500	
3659	ネクソン	87,800	1,550.00	136,090,000	
3738	ティーガイア	9,300	1,484.00	13,801,200	
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	212,800	285.00	60,648,000	
4307	野村総合研究所	64,300	3,720.00	239,196,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	95,600	1,331.00	127,243,600	
4684	オービック	31,700	5,710.00	181,007,000	
4689	ヤフー	656,500	455.00	298,707,500	
4704	トレンドマイクロ	44,400	3,560.00	158,064,000	
4716	日本オラクル	14,300	5,910.00	84,513,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	20,800	2,363.00	49,150,400	
4768	大塚商会	24,300	4,905.00	119,191,500	
4842	USEN	42,000	316.00	13,272,000	
7860	エイバックス・グループ・ホールディングス	17,400	1,218.00	21,193,200	
9404	日本テレビホールディングス	84,000	1,801.00	151,284,000	
9432	日本電信電話	550,000	4,874.00	2,680,700,000	
9433	KDDI	814,000	3,146.00	2,560,844,000	
9435	光通信	11,000	8,370.00	92,070,000	
9437	NTTドコモ	683,800	2,848.00	1,947,462,400	
9449	GMOインターネット	33,300	1,240.00	41,292,000	
9602	東宝	65,400	3,025.00	197,835,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	56,400	5,080.00	286,512,000	
9719	SCSK	21,800	3,860.00	84,148,000	
9984	ソフトバンクグループ	366,500	6,007.00	2,201,565,500	
2768	双日	576,100	260.00	149,786,000	
2784	アルフレッサ ホールディングス	114,500	2,218.00	253,961,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	18,900	3,230.00	61,047,000	
7458	第一興商	21,600	4,400.00	95,040,000	
7459	メディカルホールディングス	91,200	1,664.00	151,756,800	
8001	伊藤忠商事	718,000	1,323.50	950,273,000	
8002	丸紅	901,000	503.70	453,833,700	
8015	豊田通商	101,600	2,420.00	245,872,000	

8020	兼松	197,000	171.00	33,687,000	
8031	三井物産	827,500	1,262.00	1,044,305,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	31,800	2,982.00	94,827,600	
8053	住友商事	575,800	1,086.00	625,318,800	
8058	三菱商事	686,300	1,940.00	1,331,422,000	
8088	岩谷産業	109,000	600.00	65,400,000	
8129	東邦ホールディングス	29,600	2,306.00	68,257,600	
8136	サンリオ	28,700	1,915.00	54,960,500	
9810	日鉄住金物産	84,000	353.00	29,652,000	
9962	ミスミグループ本社	102,400	1,724.00	176,537,600	
2651	ローソン	34,500	7,860.00	271,170,000	
2670	エービーシー・マート	11,800	6,630.00	78,234,000	
2681	ゲオホールディングス	14,900	1,454.00	21,664,600	
2782	セリア	9,900	7,480.00	74,052,000	
3064	MonotaRO	32,400	3,200.00	103,680,000	
3086	J.フロントリテイリング	116,500	1,115.00	129,897,500	
3088	マツモトキヨシホールディングス	19,200	4,920.00	94,464,000	
3092	スタートトゥデイ	28,400	5,100.00	144,840,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	182,700	1,000.00	182,700,000	
3141	ウエルシアホールディングス	10,600	6,740.00	71,444,000	
3349	コスモス薬品	4,100	21,150.00	86,715,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	383,200	4,500.00	1,724,400,000	
3391	ツルハホールディングス	21,200	11,700.00	248,040,000	
7453	良品計画	10,600	22,690.00	240,514,000	
7532	ドンキホーテホールディングス	58,800	3,895.00	229,026,000	
7593	V Tホールディングス	41,600	521.00	21,673,600	
7606	ユナイテッドアローズ	12,900	3,025.00	39,022,500	
7649	スギホールディングス	15,800	5,190.00	82,002,000	
8028	ファミリーマート	28,600	6,090.00	174,174,000	
8174	日本瓦斯	13,600	2,322.00	31,579,200	
8214	AOKIホールディングス	20,900	1,099.00	22,969,100	
8227	しまむら	10,700	14,710.00	157,397,000	
8233	高島屋	131,000	784.00	102,704,000	
8267	イオン	376,300	1,498.00	563,697,400	
8273	イズミ	18,500	4,170.00	77,145,000	
8279	ヤオコー	10,500	4,680.00	49,140,000	
8282	ケーズホールディングス	39,200	1,983.00	77,733,600	
9627	アインホールディングス	11,000	6,820.00	75,020,000	
9843	ニトリホールディングス	40,000	12,670.00	506,800,000	
9956	パローホールディングス	19,900	2,825.00	56,217,500	
9983	ファーストリテイリング	14,900	32,660.00	486,634,000	
9989	サンドラッグ	19,600	8,960.00	175,616,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	614,200	439.70	270,063,740	
8303	新生銀行	790,000	158.00	124,820,000	
8304	あおぞら銀行	576,000	378.00	217,728,000	
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,805,900	518.80	1,455,700,920	
8308	りそなホールディングス	1,070,400	407.90	436,616,160	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,907,000	362.50	691,287,500	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	478,400	3,233.00	1,546,667,200	
8327	西日本シティ銀行	302,000	197.00	59,494,000	
8331	千葉銀行	351,000	512.00	179,712,000	
8333	常陽銀行	331,000	406.00	134,386,000	
8334	群馬銀行	205,000	409.00	83,845,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	400,000	372.00	148,800,000	
8355	静岡銀行	263,000	767.00	201,721,000	
8356	十六銀行	149,000	286.00	42,614,000	
8358	スルガ銀行	87,000	2,417.00	210,279,000	
8359	八十二銀行	220,600	485.00	106,991,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	626,000	132.00	82,632,000	
8379	広島銀行	265,000	376.00	99,640,000	
8382	中国銀行	86,600	1,128.00	97,684,800	
8385	伊予銀行	130,600	660.00	86,196,000	
8410	セブン銀行	342,800	337.00	115,523,600	
8411	みずほフィナンシャルグループ	9,468,600	163.80	1,550,956,680	
8418	山口フィナンシャルグループ	114,000	1,000.00	114,000,000	
8524	北洋銀行	138,500	314.00	43,489,000	
8544	京葉銀行	101,000	434.00	43,834,000	
8473	SBIホールディングス	109,900	1,097.00	120,560,300	
8595	ジャフコ	14,900	2,886.00	43,001,400	
8601	大和証券グループ本社	859,000	612.90	526,481,100	

8604	野村ホールディングス	1,761,200	422.00	743,226,400	
8609	岡三証券グループ	82,000	517.00	42,394,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	105,700	494.00	52,215,800	
8628	松井証券	44,700	920.00	41,124,000	
8703	カブドットコム証券	77,700	341.00	26,495,700	
8630	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	202,700	3,021.00	612,356,700	
8725	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	273,600	2,790.00	763,344,000	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	87,700	1,219.00	106,906,300	
8750	第一生命保険	586,100	1,252.50	734,090,250	
8766	東京海上ホールディングス	371,200	3,808.00	1,413,529,600	
8795	T & Dホールディングス	333,200	990.90	330,167,880	
8253	クレディセゾン	69,100	1,778.00	122,859,800	
8424	芙蓉総合リース	10,500	4,555.00	47,827,500	
8425	興銀リース	17,700	1,933.00	34,214,100	
8439	東京センチュリーリース	21,600	3,545.00	76,572,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	59,500	2,383.00	141,788,500	
8572	アコム	184,100	516.00	94,995,600	
8586	日立キャピタル	21,600	2,072.00	44,755,200	
8591	オリックス	648,300	1,460.00	946,518,000	
8593	三菱UFJリース	232,000	404.00	93,728,000	
8697	日本取引所グループ	268,300	1,379.00	369,985,700	
3003	ヒューリック	190,500	1,064.00	202,692,000	
3231	野村不動産ホールディングス	61,300	1,841.00	112,853,300	
3254	プレサンスコーポレーション	2,800	3,970.00	11,116,000	
3289	東急不動産ホールディングス	221,300	638.00	141,189,400	
3291	飯田グループホールディングス	85,100	2,080.00	177,008,000	
4666	パーク24	46,000	3,305.00	152,030,000	
8801	三井不動産	481,000	2,349.50	1,130,109,500	
8802	三菱地所	679,000	1,923.50	1,306,056,500	
8804	東京建物	99,800	1,286.00	128,342,800	
8830	住友不動産	219,000	2,806.50	614,623,500	
8840	大京	175,000	160.00	28,000,000	
8848	レオバレス21	108,000	755.00	81,540,000	
8850	スターツコーポレーション	13,700	1,987.00	27,221,900	
8870	住友不動産販売	7,000	2,179.00	15,253,000	
8897	タカラレーベン	40,300	884.00	35,625,200	
8905	イオンモール	58,700	1,361.00	79,890,700	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	56,700	1,097.00	62,199,900	
2121	ミクシィ	19,700	3,585.00	70,624,500	
2127	日本M & Aセンター	14,600	6,700.00	97,820,000	
2181	テンプホールディングス	67,700	1,773.00	120,032,100	
2193	クックパッド	21,600	1,412.00	30,499,200	
2331	総合警備保障	32,400	5,050.00	163,620,000	
2371	カカクコム	69,200	2,065.00	142,898,000	
2413	エムスリー	84,300	3,700.00	311,910,000	
2432	ディー・エヌ・エー	43,500	2,678.00	116,493,000	
2433	博報堂D Yホールディングス	134,000	1,211.00	162,274,000	
4324	電通	108,200	5,020.00	543,164,000	
4544	みらかホールディングス	24,400	4,615.00	112,606,000	
4661	オリエンタルランド	105,400	6,426.00	677,300,400	
4681	リゾートトラスト	40,900	2,266.00	92,679,400	
4732	ユー・エス・エス	117,600	1,719.00	202,154,400	
4751	サイバーエージェント	25,200	5,990.00	150,948,000	
4755	楽天	453,100	1,168.00	529,220,800	
8876	リログループ	4,300	16,900.00	72,670,000	
9603	エイチ・アイ・エス	15,300	3,000.00	45,900,000	
9678	カナモト	13,200	2,179.00	28,762,800	
9735	セコム	100,600	7,795.00	784,177,000	
9783	ベネッセホールディングス	32,500	2,474.00	80,405,000	
9787	イオンディライト	9,500	2,971.00	28,224,500	
	合計	98,111,700		132,726,924,770	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

2【ファンドの現況】
【純資産額計算書】平成28年7月29日現在
(単位:円)

資産総額	134,294,971,293
負債総額	1,549,794,260
純資産総額(-)	132,745,177,033
発行済口数	11,031,876 口
1口当たり純資産価額(/)	12,033

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、交換請求の受付け、交換有価証券の交付および信託終了に係る金銭の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

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

2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

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

（1）【貸借対照表】

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

（2）【損益計算書】

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

（3）【株主資本等変動計算書】

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

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

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成28年3月末現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
J P モルガン証券株式会社	73,272 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	30,765 百万円 (平成28年6月20日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
シティグループ証券株式会社	96,307 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大和証券株式会社	100,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東海東京証券株式会社	6,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ドイツ証券株式会社	72,728 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
B N P パリバ証券株式会社	102,025 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	4,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
-----------------------	------------	-------------------------------

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- (2) 販売会社：募集の取扱い、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱い等を行います。

3【資本関係】

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7月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%(107,855株)を所有しています。

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

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成28年4月15日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・交換時期については制限がありますのでご注意ください。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、特定株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成28年8月15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MAXIS JPX日経インデックス400上場投信の平成28年1月17日から平成28年7月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MAXIS JPX日経インデックス400上場投信の平成28年7月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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