

【表紙】

| | |
|--|--------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成30年2月6日提出 |
| 【発行者名】 | 三菱UFJ国際投信株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 松田 通 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 伊藤 晃 |
| 【電話番号】 | 03-6250-4740 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | バランス・タイプ（ミリオン） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

バランス・タイプ（ミリオン）
（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額とします。

基準価額は、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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1口単位

（７）【申込期間】

平成30年 2月 7日から平成31年 2月 6日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

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:営業日の9:00~17:00)

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11)【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

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】

当ファンドは、ファミリーファンド方式により、信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

信託金の限度額は、500億円です。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

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・追加型の別 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉となる資産) |
|-----------|--------|------------------------|
| 単位型投信 | 国内 | 株式 |
| | 海外 | 債券 |
| 追加型投信 | 内外 | 不動産投信 |
| | | その他資産 |
| | | 資産複合 |

(注) 該当する部分を網掛け表示しています。

該当する商品分類の定義について

| | |
|-------|---|
| 追加型投信 | 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う。 |
| 内外 | 目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。 |
| 資産複合 | 目論見書又は投資信託約款において、株式、債券および不動産投信（リート）およびその他の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ものをいう。 |

属性区分表

| 投資対象資産 (実際の組入資産) | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|---------------------|------|--------|------|-------|
|---------------------|------|--------|------|-------|

| | | | | |
|---|----------|-----------------|------------------|----|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 | グローバル (日本含む) | | |
| | 年2回 | 日本 | | |
| | 年4回 | 北米 | ファミリー ファンド | あり |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 | 年6回(隔月) | 欧州 | | |
| | 年12回(毎月) | アジア | | |
| | 日々 | オセアニア | | |
| 不動産投信 | | 中南米 | | |
| その他資産 | その他 | アフリカ | ファンド・オブ・ ファンズ | なし |
| 資産複合 資産配分変更型 (債券 一般、その他 資産(投資信託証券 (株式 一般))) | | 中近東(中東) | | |
| | | エマージング | | |
| 資産配分固定型 | | | | |

(注) 該当する部分を網掛け表示しています。

該当する属性区分の定義について

| | |
|--|--|
| 資産複合 資産配分変更型 (債券 一般 ¹ 、その他 資産(投資信託証券(株式 一般))) ² | 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 なお、組み合わせている資産を括弧内で列挙。 |
| 年1回 | 目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。 |
| グローバル(日本含む) | 目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(日本を含む)の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。 |
| ファミリーファンド | 目論見書又は投資信託約款において、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く。)を投資対象として投資するものをいう。 |
| 為替ヘッジなし | 目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう |

1 債券 一般・公債^{*1}、社債^{*2}、その他債券^{*3} 属性にあてはまらない全てのものをいう。

2 その他資産(投資信託証券(株式 一般))・投資信託証券(マザーファンド)を通じて、主として株式 一般^{*4}に投資する。

*1 公債・・・目論見書又は投資信託約款において、日本国又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、国際機関債を含む。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

*2 社債・・・目論見書又は投資信託約款において、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う。

*3 その他債券・・・目論見書又は投資信託約款において、公債又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う。

- * 4 株式 一般・・・大型株^{*5}、中小型株^{*6}属性にあてはまらない全てのものをいう。
- * 5 大型株・・・目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- * 6 中小型株・・・目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

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おります。

商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ファンドの特色

- ① 日経平均株価[※]に連動した投資成果を目指す中での売買益獲得に加え、公社債への投資による安定した利息等収益の確保をはかります。

※【日経平均株価】とは

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所第1部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。わが国の株式市場全体の動向を示す指標の1つです。

【日経平均株価】は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」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。「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」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、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

※資金動向や市況動向等によっては、①のような運用ができない場合があります。

- ② 「ミリオン」は、少額の資金でも値上がりの期待できる株式や好利回りの公社債への分散投資がはかれる投資信託の仕組みと、一定金額を定期的買い続けることで投資効果が高まるドルコスト平均法[※]の利点を生かして生まれたファンドです。

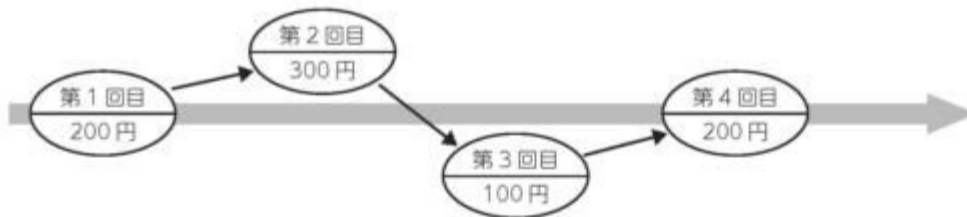
- 「ミリオン」には【バランス・タイプ】と【インデックス・タイプ】の2つのファンドがあります。ご希望に合わせて自由にお選びいただけます。

- ▶ **バランス・タイプ**・・・日経平均株価に連動した投資成果と公社債などの運用により、安定性を高めます。
- ▶ **インデックス・タイプ**・・・日経平均株価に連動した投資成果を目指します。
(くわしくは、インデックス・タイプ(ミリオン)の交付目論見書をご確認ください。)

※【ドルコスト平均法】とは

株式など値動きのある金融商品に投資する場合、一定金額を継続的に買い続けると投資効果が高まります。後記の例でわかるように、同じ金額を投資しても、長期間続けた場合、買い方によって平均購入値段が大きく違ってきます。この一定金額の継続購入法を「ドルコスト平均法」といい、広く一般に認められている投資方法の一種です。

<株式投資でみる簡単な「ドルコスト平均法」の例>



| 第1回目 | 第2回目 | 第3回目 | 第4回目 | 合計 | 1株当たりの 平均コスト |
|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 購入金額 (購入株数) | 購入金額 (購入株数) | 購入金額 (購入株数) | 購入金額 (購入株数) | 購入金額 (購入株数) | |
| 一定金額のけいぞく購入 | | | | | |
| 2万円 (100株) | 2万円 (66株) | 2万円 (200株) | 2万円 (100株) | 8万円 (466株) | 171円 |
| 一定株数のけいぞく購入 | | | | | |
| 2万円 (100株) | 3万円 (100株) | 1万円 (100株) | 2万円 (100株) | 8万円 (400株) | 200円 |

※上記はあくまでも計算例であり、投資方法をわかりやすく、強調して表したものです。
実際の値動きを示唆したものではありません。

③ 年1回の決算時(11月7日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

- 分配金額は委託会社が利子・配当収入を中心に基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、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。

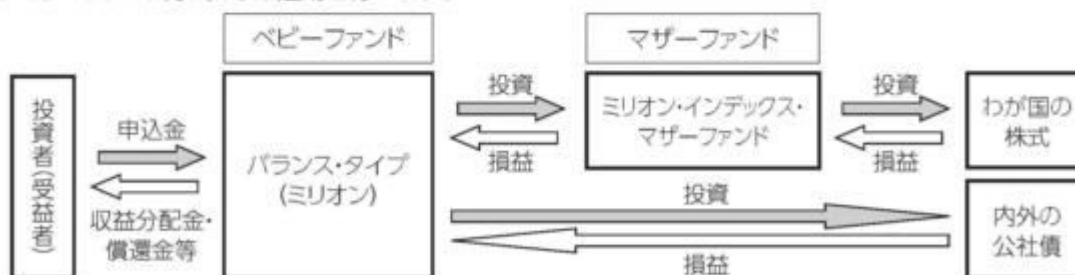
分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。
(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

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。

- 収益分配金は、税金を差引いた後、「自動けいぞく投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

■ ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式により運用を行います。



ファミリーファンド方式とは、受益者から投資された資金をまとめた投資信託をベビーファンドとし、その資金の全部又は一部をマザーファンドに投資して、マザーファンドにおいて実質的な運用を行う仕組みです。

● 主な投資制限

| | |
|-------------|---------------------------------------|
| マザーファンドへの投資 | マザーファンドへの投資は、当ファンドの純資産総額の70%未満とします。 |
| 株式以外の資産への投資 | 株式以外の資産への実質投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。 |
| 外貨建資産への投資 | 外貨建資産への投資は、当ファンドの純資産総額の30%以内とします。 |

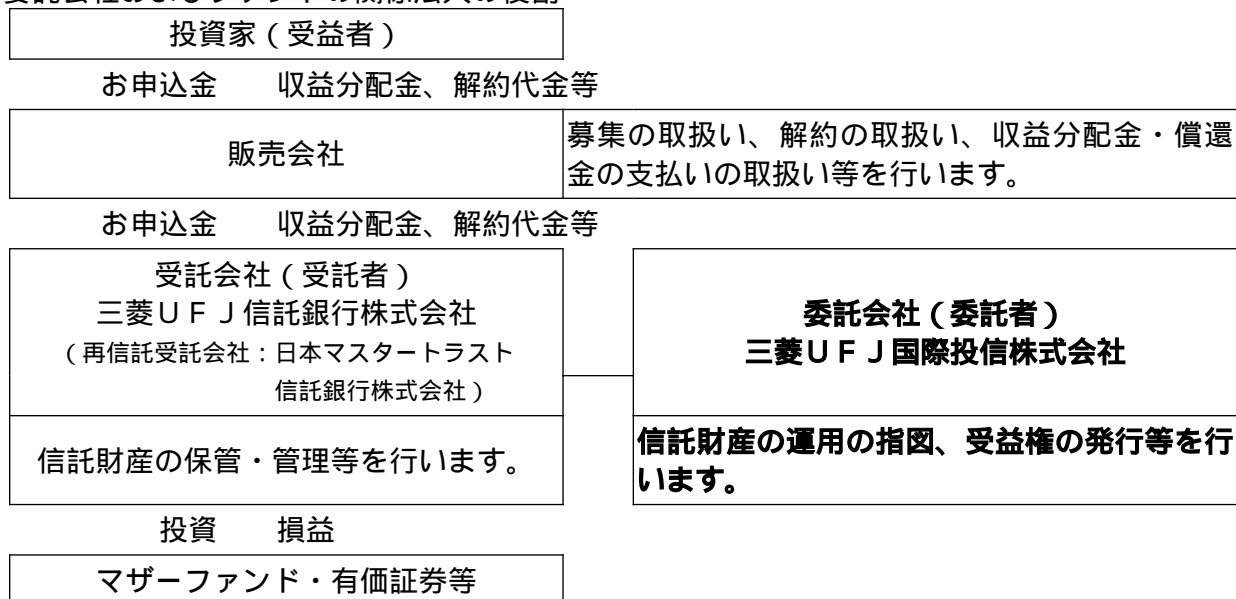
(2) 【ファンドの沿革】

- 昭和62年11月27日 証券投資信託契約締結、設定、運用開始
- 平成19年1月4日 投資信託振替制度への移行に伴う重大な約款変更の適用
- 平成27年7月1日 ファンドの委託会社としての業務を国際投信投資顧問株式会社から

三菱UFJ国際投信株式会社に承継

(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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」 | 販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払い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（平成29年11月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
昭和60年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 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

| 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】

基本方針

信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

投資態度

- a. マザーファンドへの投資により売買益をとらえることを目指し、公社債への投資により利息等収益の確保をはかります。
- b. 株式以外への資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)の投資は、原則として信託財産総額の75%以下とします。
- * 資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用ができない場合があります。

運用の形態等

ファミリーファンド方式により運用を行います。

日経平均株価

- a. 日経平均株価とは、日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。わが国の株式市場全体の動向を示す指標の1つです。

(a) 日経平均株価計算式

日経平均株価 = 日経平均採用銘柄株価合計 ÷ 除数

イ. 株価は、50円額面以外は50円額面に換算して合計します。

(注) 無額面銘柄については、日本経済新聞社がみなし額面を設定します。

(注) 平成13年10月の額面制度廃止後は、それまでの額面を「みなし額面」として算出しています。計算式に変更ありません。

ロ. 小数第3位を四捨五入して第2位まで求めます。

ハ. 株価の採用優先順は以下の通りです。

(イ) 現在の特別気配(または最終特別気配)

(ロ) 現在値(または終値)

(ハ) 基準価格(基準価格は権利落ち理論値、前日の特別気配、前日の終値の優先順で採用された値)

(b) 除数の修正

採用銘柄中に市況変動によらない株価変動があった場合、原則として除数を修正します。また、採用銘柄の入替えがあった場合に除数を修正します。

イ. 権利落ちの場合

$$\text{新除数} = \{ \text{現除数} \times (\text{権利付き最終日の株価合計} - \text{権利価格合計}) \} \div \text{権利付き最終日の株価合計}$$

権利価格 = 権利付き最終日の株価 - 権利落ち理論値

権利落ち理論値 = (権利付き最終日の株価 + 払込金 × 有償割当率)

$$\div (\text{有償割当率} + \text{分割(併合)割当率})$$

(注) 株式分割(併合)が発生しない場合は、分割(併合)割当率 = 1とします。

ロ. 銘柄入替えの場合

権利価格 = 除外銘柄の株価 - 採用銘柄の株価

(c) 銘柄の入替え

対象銘柄の入替えについては、東証第1部上場基準に抵触したものは随時、流動性が他の銘柄と比べて相対的に低くなったものなどについては、毎年見直しが行われます。

b. 日経平均株価の著作権等について

「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」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。「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」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、遅延又は中断に関して、責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

(2) 【投資対象】

ミリオン・インデックス・マザーファンド受益証券および内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類

ファンド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。以下同じ。）とします。

- a. 有価証券
- b. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、（5）投資制限 < 信託約款に定められた投資制限 > の に定めるものに限り、）に係る権利
- c. 約束手形
- d. 金銭債権

運用の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、三菱UFJ国際投信株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結されたミリオン・インデックス・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（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。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

- a. 国債証券
- b. 地方債証券
- c. 特別の法律により法人の発行する債券
- d. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- e. コマーシャル・ペーパー
- f. 外国または外国の者の発行する証券で、a. から e. の証券の性質を有するもの
- g. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- h. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- i. 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。）

- j．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
 - k．外国の者に対する権利でj．の有価証券の性質を有するもの
- なお、a．からd．までの証券およびf．の証券のうちa．からd．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、前記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

- a．預金
- b．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c．コール・ローン
- d．手形割引市場において売買される手形
- e．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- f．外国の者に対する権利でe．の権利の性質を有するもの

特別な場合の金融商品による運用

前記の規定にかかわらず、ファンドの設定、解約、償還への対応および投資環境の変動等への対応で、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前記のa．からf．までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

その他の投資対象

先物取引等

参考 マザーファンド約款の「運用の基本方針」を以下に記載いたします。

- 運用の基本方針 -

約款第11条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次の通りとします。

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価（インデックス）をモデルとして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。）に上場されている株式の中から、日経平均株価に採用された銘柄とします。なお、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、および金融先物取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

(2) 投資態度

投資成果を日経平均株価の動きに出来るだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

(イ) 上記対象銘柄の中から200銘柄以上に原則として等株数投資を行います。

(ロ) 資金の流出入に伴う売買にあたっては、買付の場合は株価の高い銘柄から順番に、売却の場合は株価の低い銘柄から順番に行います。

(ハ) 株式の組入比率は、高位を保ちます。

（二）株式以外への資産の投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用が出来ない場合があります。

（三）投資制限

（イ）株式の組入比率については、制限を設けません。

（ロ）＜削除＞

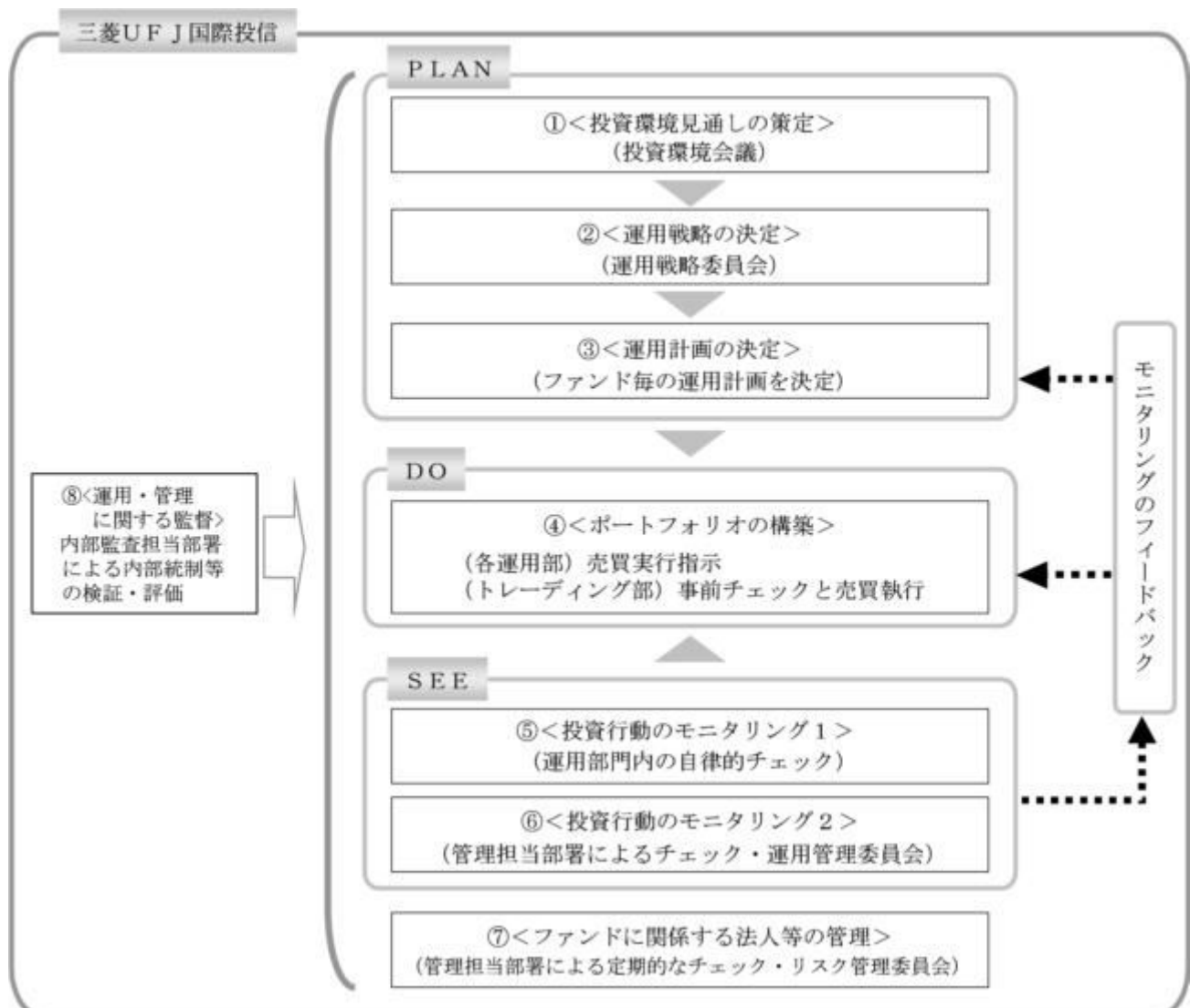
（ハ）有価証券先物取引等は、約款第14条の2の範囲で行います。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

（ホ）一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に規定す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ものとします。

以上

（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（40～60名程度）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。

ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、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信託銀行株式会社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。

なお、委託会社に関する「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でご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎年11月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）に決算を行い、原則として以下の方針により分配を行います。

a．分配対象収益額の範囲

経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

なお、前期から繰越された分配準備積立金および収益調整金中のその他調整金は、全額分配に使用することができます。

b．分配対象収益についての分配方針

委託会社が利子・配当収入を中心に基準価額水準・市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。（ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。）

c．留保益の運用方針

留保益については、特に制限を設けず、運用の基本方針に則した運用を行います。

収益分配金の交付

収益分配金は、税金を差引いた後、「自動けいぞく投資契約^{*}」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

* 販売会社によっては、当該契約または規定について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

収益の分配方式

a. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

(a) 利子およびこれに類する収益から支払利息を控除した額（「利子等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬（当該諸経費、信託報酬は、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額を含みます。）を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積立てることができます。

(b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬（当該諸経費、信託報酬は、消費税等相当額を含みます。）を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

マザーファンドへの投資

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の70以上となる投資の指図をしません。

投資する公社債の範囲

委託会社が投資することを指図する公社債のうち、外貨建公社債（外国通貨表示の公社債（利金および償還金が異なる通貨によって表示され支払われる複数通貨建公社債であって、利金または償還金のいずれかが外国通貨によって表示され支払われるものを含みます。）をいいます。以下同じ。）、外国または外国の者の発行する邦貨建公社債およびわが国またはわが国法人が外国において発行する邦貨建公社債については、金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されている銘柄およびこれに準ずるものとします。ただし、社債権者割当により取得する公社債についてはこの限りではありません。

外貨建資産への投資制限

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（外貨建有価証券、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の30を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

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、制約されることがあります。

外国為替予約の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

先物取引等の運用指図・目的・範囲

a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28

条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし(以下同じ。)、外国有価証券市場における現物オプション取引は公社債に限るものとします。

- (a) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - (b) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに余裕金の額の範囲内とします。
 - (c) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
- (a) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額の範囲内とします。
 - (b) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等の実需の範囲内とします。
 - (c) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- c. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。
- (a) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - (b) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該余裕金の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利

払金および償還金等を加えた額を限度とします。

- (c) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払プレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引に係る支払プレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

デリバティブ取引等に係る投資制限

委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に規定す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ることとなる取引等の指図をしません。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当てを目的として、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却等の代金の入金日までに限るものとし、資金借入額は当該有価証券等の売却等の代金の受取りの確定している資金の額の範囲内、かつ、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を限度とします。
- c. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）
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（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）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委託会社に指図してはならないものとされています。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

株価変動リスク

株式の価格は、国内および国際的な政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式の価格が変動すればファンドの基準価額の変動要因となります。

金利変動リスク

ファンドの主要投資対象である公社債等の価格は、一般的に金利が上昇した場合には下落し、ファンドの基準価額の下落要因となります。

信用リスク

投資している有価証券等の発行会社の倒産、財務状況または信用状況の悪化等の影響により、ファンドの基準価額は下落し、損失を被ることがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは購入しようとする際に、買い需要がなく売却不可能、あるいは売り供給がなく購入不可能等となるリスクのことをいいます。例えば、市況動向や有価証券等の流通量等の状況、あるいはファンドの解約金額の規模によっては、組入有価証券等を市場実勢より低い価格で売却しなければならないケースが考えられ、この場合にはファンドの基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

ファンドが外貨建資産を保有する場合、当該通貨と円との為替相場変動の影響を受け、損失を被ることがあります。

ファミリーファンド方式による基準価額変動リスク

同じマザーファンドに投資する他のファンドの資金動向による影響を受け、ファンドの基準価額が変動することがあります。

カウンターパーティー・リスク（取引相手先の決済不履行リスク）

証券取引、為替取引等の相対取引においては、取引相手先の決済不履行リスクが伴います。

その他の主な留意点

a．収益分配金に関する留意点

- ・ 計算期末に、基準価額水準に応じて、別に定める分配方針により収益の分配を行います。委託会社の判断により、分配が行われないこともあります。
- ・ 投資信託（ファンド）の収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、収益分配金の有無や金額は確定したものではありません。
- ・ 収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 受益者の個別元本によっては、収益分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、収益分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

b．やむを得ない事情が発生した場合等には、信託期間中であっても償還されることがあります。

c．法令、税制および会計制度等は、今後変更される可能性があります。

d．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。

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部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。この内容は運用部門にフィードバックされ、必

要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

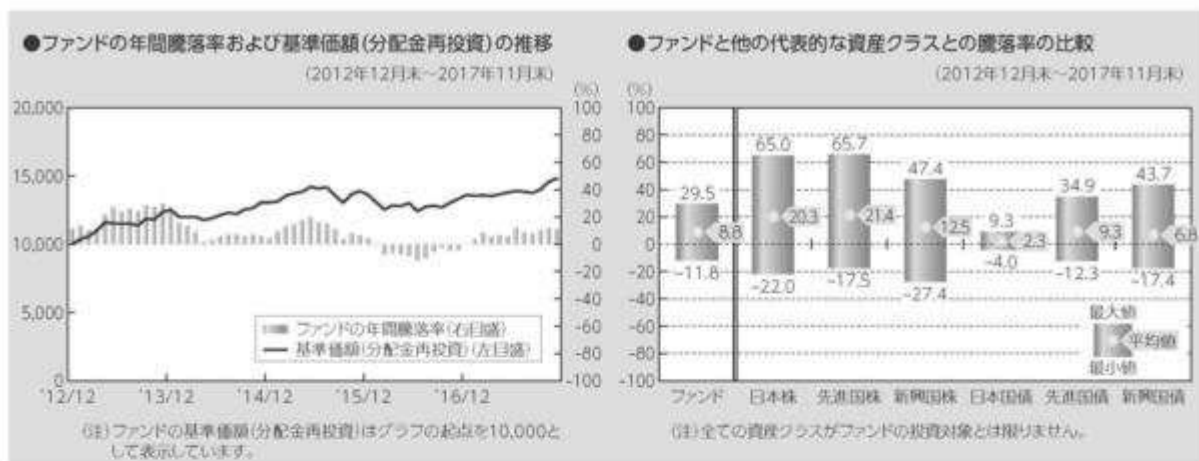
<流動性リスクに対する管理体制>

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

・年間騰落率は、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 | FTSE世界国債インデックス(除く日本) | FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債 | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド | JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。 |

(注) 海外の指数は、為替レートの異なる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンド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です。

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3) 【信託報酬等】

- a. 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.674%（税抜1.550%）以内の率を乗じて得た額とします。信託報酬は消費税等相当額を含みます。

1万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。

- b. 信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

| 支払先 | 配分（税抜） | 対価として提供する役務の内容 |
|------|--------|---|
| 委託会社 | 0.370% | 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 |
| 販売会社 | 1.100% | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等 |
| 受託会社 | 0.080% | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等 |

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償

還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

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。

解約時および償還時の損失（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。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として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、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成29年11月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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】

【バランス・タイプ（ミリオン）】

(1)【投資状況】

平成29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 | 51,579,900 | 48.07 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 55,190,056 | 51.44 |
| コール・ローン、その他資産 (負債控除後) | | 528,365 | 0.49 |
| 純資産総額 | | 107,298,321 | 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29年11月30日現在

| 国/地域 | 銘柄 | 種類 | 業種 | 数量 | 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 | ミリオン・インデックス・マ ザーファンド | 親投資信託 受益証券 | | 41,033,499 | 1.358 | 55,723,492 | | 51.44 |
| | | | | | 1.345 | 55,190,056 | | |
| 日本 | 第334回利付国債(10年) | 国債証券 | | 10,000,000 | 104.55 104.4370 | 10,455,400 10,443,700 | 0.600000 2024/06/20 | 9.73 |
| 日本 | 第325回利付国債(10年) | 国債証券 | | 10,000,000 | 104.50 104.3860 | 10,450,000 10,438,600 | 0.800000 2022/09/20 | 9.73 |
| 日本 | 第312回利付国債(10年) | 国債証券 | | 10,000,000 | 104.22 104.0640 | 10,422,100 10,406,400 | 1.200000 2020/12/20 | 9.70 |
| 日本 | 第299回利付国債(10年) | 国債証券 | | 10,000,000 | 102.04 101.8740 | 10,204,300 10,187,400 | 1.300000 2019/03/20 | 9.49 |
| 日本 | 第342回利付国債(10年) | 国債証券 | | 10,000,000 | 101.08 | 10,108,900 | 0.100000 2026/03/20 | 9.42 |
| | | | | | 101.0380 | 10,103,800 | | |

(注1) 公社債の数量は券面総額、親投資信託受益証券の数量は口数です。

(注2) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成29年11月30日現在

| 種類/業種別 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 国債証券 | 48.07 |
| 親投資信託受益証券 | 51.44 |
| 合計 | 99.51 |

(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】

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29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21計算期間末日 (平成20年11月7日) | 150,483,304 (分配付) 150,368,602 (分配落) | 6,560 (分配付) 6,555 (分配落) |
| 第22計算期間末日 (平成21年11月9日) | 159,581,489 (分配付) 159,468,823 (分配落) | 7,082 (分配付) 7,077 (分配落) |
| 第23計算期間末日 (平成22年11月8日) | 148,051,388 (分配付) 147,947,467 (分配落) | 7,123 (分配付) 7,118 (分配落) |
| 第24計算期間末日 (平成23年11月7日) | 129,485,502 (分配付) 129,390,127 (分配落) | 6,788 (分配付) 6,783 (分配落) |
| 第25計算期間末日 (平成24年11月7日) | 107,698,162 (分配付) 107,620,076 (分配落) | 6,896 (分配付) 6,891 (分配落) |
| 第26計算期間末日 (平成25年11月7日) | 121,573,715 (分配付) 121,504,194 (分配落) | 8,744 (分配付) 8,739 (分配落) |
| 第27計算期間末日 (平成26年11月7日) | 117,230,734 (分配付) 117,169,191 (分配落) | 9,524 (分配付) 9,519 (分配落) |
| 第28計算期間末日 (平成27年11月9日) | 120,041,202 (分配付) 119,982,838 (分配落) | 10,284 (分配付) 10,279 (分配落) |
| 第29計算期間末日 (平成28年11月7日) | 108,457,150 (分配付) 108,400,633 (分配落) | 9,595 (分配付) 9,590 (分配落) |
| 第30計算期間末日 (平成29年11月7日) | 111,263,278 (分配付) 111,212,960 (分配落) | 11,056 (分配付) 11,051 (分配落) |
| 平成28年11月末日 | 111,685,215 | 9,872 |
| 12月末日 | 113,135,911 | 10,091 |
| 平成29年1月末日 | 112,548,693 | 10,043 |
| 2月末日 | 112,900,130 | 10,071 |
| 3月末日 | 110,932,870 | 10,032 |
| 4月末日 | 111,859,572 | 10,112 |
| 5月末日 | 112,081,134 | 10,216 |
| 6月末日 | 112,880,082 | 10,304 |
| 7月末日 | 112,451,027 | 10,262 |
| 8月末日 | 106,740,531 | 10,193 |
| 9月末日 | 107,997,986 | 10,385 |
| 10月末日 | 110,720,078 | 10,806 |
| 11月末日 | 107,298,321 | 10,979 |

【分配の推移】

| | 1万口当たりの分配金 |
|---------|------------|
| 第21計算期間 | 5円 |
| 第22計算期間 | 5円 |
| 第23計算期間 | 5円 |
| 第24計算期間 | 5円 |
| 第25計算期間 | 5円 |
| 第26計算期間 | 5円 |
| 第27計算期間 | 5円 |
| 第28計算期間 | 5円 |
| 第29計算期間 | 5円 |
| 第30計算期間 | 5円 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|--|--------|
| | |

| | |
|---------|-------|
| 第21計算期間 | 25.16 |
| 第22計算期間 | 8.03 |
| 第23計算期間 | 0.64 |
| 第24計算期間 | 4.63 |
| 第25計算期間 | 1.66 |
| 第26計算期間 | 26.89 |
| 第27計算期間 | 8.98 |
| 第28計算期間 | 8.03 |
| 第29計算期間 | 6.65 |
| 第30計算期間 | 15.28 |

（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21計算期間 | 3,689,009 | 7,952,784 | 229,404,536 |
| 第22計算期間 | 5,202,333 | 9,274,333 | 225,332,536 |
| 第23計算期間 | 3,098,041 | 20,587,053 | 207,843,524 |
| 第24計算期間 | 2,764,926 | 19,857,088 | 190,751,362 |
| 第25計算期間 | 2,281,585 | 36,859,013 | 156,173,934 |
| 第26計算期間 | 1,708,774 | 18,839,131 | 139,043,577 |
| 第27計算期間 | 1,237,940 | 17,194,929 | 123,086,588 |
| 第28計算期間 | 624,901 | 6,982,391 | 116,729,098 |
| 第29計算期間 | 618,349 | 4,311,523 | 113,035,924 |
| 第30計算期間 | 575,683 | 12,974,703 | 100,636,904 |

< 参考 >

「ミリオン・インデックス・マザーファンド」

（１）投資状況

平成29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 | 3,061,962,100 | 89.35 |
| コール・ローン、その他資産 （負債控除後） | | 365,152,429 | 10.65 |
| 純資産総額 | | 3,427,114,529 | 100.00 |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

平成29年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） | 341,400,000 | 9.96 |

（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29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 | ファーストリテイリング | 株式 | 小売業 | 5,000 | 39,910.00 43,510.00 | 199,550,000 217,550,000 | | 6.35 |
| 日本 | ソフトバンクグループ | 株式 | 情報・通信業 | 15,000 | 10,060.00 9,485.00 | 150,900,000 142,275,000 | | 4.15 |
| 日本 | ファナック | 株式 | 電気機器 | 5,000 | 28,170.00 27,945.00 | 140,850,000 139,725,000 | | 4.08 |
| 日本 | 東京エレクトロン | 株式 | 電気機器 | 5,000 | 22,490.00 20,760.00 | 112,450,000 103,800,000 | | 3.03 |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------|----|--------|--------|------------------------|--------------------------|------|
| 日本 | KDDI | 株式 | 情報・通信業 | 30,000 | 3,142.00 3,215.00 | 94,260,000 96,450,000 | 2.81 |
| 日本 | 京セラ | 株式 | 電気機器 | 10,000 | 8,144.00 7,901.00 | 81,440,000 79,010,000 | 2.31 |
| 日本 | ダイキン工業 | 株式 | 機械 | 5,000 | 13,230.00 12,920.00 | 66,150,000 64,600,000 | 1.88 |
| 日本 | 信越化学工業 | 株式 | 化学 | 5,000 | 12,510.00 11,765.00 | 62,550,000 58,825,000 | 1.72 |
| 日本 | 日東電工 | 株式 | 化学 | 5,000 | 11,685.00 11,030.00 | 58,425,000 55,150,000 | 1.61 |
| 日本 | テルモ | 株式 | 精密機器 | 10,000 | 4,875.00 5,380.00 | 48,750,000 53,800,000 | 1.57 |
| 日本 | TDK | 株式 | 電気機器 | 5,000 | 9,110.00 9,170.00 | 45,550,000 45,850,000 | 1.34 |
| 日本 | セコム | 株式 | サービス業 | 5,000 | 8,947.00 8,414.00 | 44,735,000 42,070,000 | 1.23 |
| 日本 | リクルートホールディングス | 株式 | サービス業 | 15,000 | 2,743.00 2,647.00 | 41,145,000 39,705,000 | 1.16 |
| 日本 | ユニー・ファミリーマート ホールディングス | 株式 | 小売業 | 5,000 | 6,700.00 7,570.00 | 33,500,000 37,850,000 | 1.10 |
| 日本 | 本田技研工業 | 株式 | 輸送用機器 | 10,000 | 3,837.00 3,744.00 | 38,370,000 37,440,000 | 1.09 |
| 日本 | 花王 | 株式 | 化学 | 5,000 | 7,023.00 7,438.00 | 35,115,000 37,190,000 | 1.09 |
| 日本 | アステラス製薬 | 株式 | 医薬品 | 25,000 | 1,512.00 1,426.00 | 37,800,000 35,650,000 | 1.04 |
| 日本 | トヨタ自動車 | 株式 | 輸送用機器 | 5,000 | 7,183.00 7,044.00 | 35,915,000 35,220,000 | 1.03 |
| 日本 | エヌ・ティ・ティ・データ | 株式 | 情報・通信業 | 25,000 | 1,358.00 1,321.00 | 33,950,000 33,025,000 | 0.96 |
| 日本 | キャノン | 株式 | 電気機器 | 7,500 | 4,356.00 4,298.00 | 32,670,000 32,235,000 | 0.94 |
| 日本 | エーザイ | 株式 | 医薬品 | 5,000 | 6,512.00 6,371.00 | 32,560,000 31,855,000 | 0.93 |
| 日本 | トレンドマイクロ | 株式 | 情報・通信業 | 5,000 | 6,150.00 6,350.00 | 30,750,000 31,750,000 | 0.93 |
| 日本 | デンソー | 株式 | 輸送用機器 | 5,000 | 6,474.00 6,305.00 | 32,370,000 31,525,000 | 0.92 |
| 日本 | 塩野義製薬 | 株式 | 医薬品 | 5,000 | 6,264.00 6,259.00 | 31,320,000 31,295,000 | 0.91 |
| 日本 | 武田薬品工業 | 株式 | 医薬品 | 5,000 | 6,433.00 6,184.00 | 32,165,000 30,920,000 | 0.90 |
| 日本 | スズキ | 株式 | 輸送用機器 | 5,000 | 6,320.00 6,040.00 | 31,600,000 30,200,000 | 0.88 |
| 日本 | コナミホールディングス | 株式 | 情報・通信業 | 5,000 | 6,210.00 5,930.00 | 31,050,000 29,650,000 | 0.87 |
| 日本 | 中外製薬 | 株式 | 医薬品 | 5,000 | 5,630.00 5,810.00 | 28,150,000 29,050,000 | 0.85 |
| 日本 | アサヒグループホールディングス | 株式 | 食料品 | 5,000 | 5,330.00 5,707.00 | 26,650,000 28,535,000 | 0.83 |
| 日本 | 資生堂 | 株式 | 化学 | 5,000 | 4,721.00 5,472.00 | 23,605,000 27,360,000 | 0.80 |

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成29年11月30日現在

| 種類 / 業種別 | 投資比率 (%) |
|----------|----------|
| 株式 | |
| 水産・農林業 | 0.14 |
| 鉱業 | 0.07 |
| 建設業 | 2.54 |
| 食料品 | 4.23 |
| 繊維製品 | 0.27 |
| パルプ・紙 | 0.13 |
| 化学 | 8.12 |
| 医薬品 | 6.30 |
| 石油・石炭製品 | 0.30 |
| ゴム製品 | 0.93 |
| ガラス・土石製品 | 1.43 |
| 鉄鋼 | 0.16 |
| 非鉄金属 | 1.28 |
| 金属製品 | 0.31 |
| 機械 | 4.77 |
| 電気機器 | 18.16 |
| 輸送用機器 | 5.59 |
| 精密機器 | 2.69 |
| その他製品 | 0.93 |
| 電気・ガス業 | 0.19 |
| 陸運業 | 1.83 |
| 海運業 | 0.13 |

| | | |
|----|------------|-------|
| | 空運業 | 0.07 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 0.22 |
| | 情報・通信業 | 10.03 |
| | 卸売業 | 1.93 |
| | 小売業 | 9.17 |
| | 銀行業 | 0.83 |
| | 証券、商品先物取引業 | 0.34 |
| | 保険業 | 0.82 |
| | その他金融業 | 0.31 |
| | 不動産業 | 1.43 |
| | サービス業 | 3.68 |
| 合計 | | 89.35 |

(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29年11月30日現在

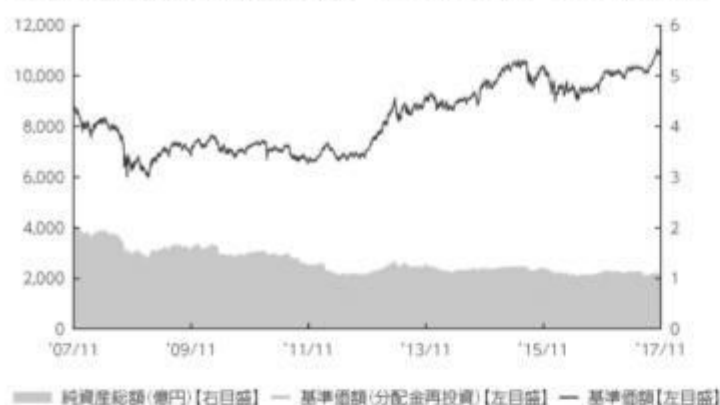
| 資産の種類 | 取引所名 | 建別 | 数量 | 簿価(円) | 評価額(円) | 投資比率 (%) |
|-----------------|-------|----|----|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | | | | | | |
| 日経225先物 17年12月限 | 大阪取引所 | 買建 | 15 | 344,850,000 | 341,400,000 | 9.96 |

(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。

参考情報

2017年11月30日現在

■ 基準価額・純資産の推移 2007年11月30日～2017年11月30日



・基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
 ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■ 基準価額・純資産

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 10,979円 |
| 純資産総額 | 1.0億円 |

■ 分配の推移

| | |
|----------|------|
| 2017年11月 | 5円 |
| 2016年11月 | 5円 |
| 2015年11月 | 5円 |
| 2014年11月 | 5円 |
| 2013年11月 | 5円 |
| 2012年11月 | 5円 |
| 設定来累計 | 210円 |

・分配金は1万口当たり、税引前

■ 主要な資産の状況

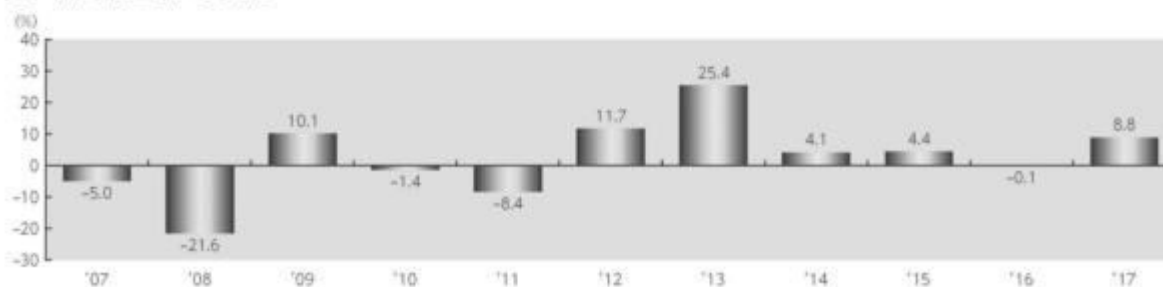
| 資産別構成 | 比率 |
|--------------------|--------|
| 国内株式 | 46.0% |
| 国内債券 | 48.1% |
| コールローン他 (負債控除後) | 5.9% |
| 合計 | 100.0% |

| その他資産の状況 | 比率 |
|---------------|------|
| 株価指数先物取引 (買建) | 5.1% |

・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)
 ・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

| 組入上位銘柄 | 種類 | 業種/種別 | 比率 |
|----------------|----|--------|------|
| ファーストリテイリング | 株式 | 小売業 | 3.3% |
| ソフトバンクグループ | 株式 | 情報・通信業 | 2.1% |
| ファナック | 株式 | 電気機器 | 2.1% |
| 東京エレクトロン | 株式 | 電気機器 | 1.6% |
| KDDI | 株式 | 情報・通信業 | 1.4% |
| 第334回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 9.7% |
| 第325回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 9.7% |
| 第312回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 9.7% |
| 第299回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 9.5% |
| 第342回利付国債(10年) | 債券 | 国債 | 9.4% |

■ 年間収益率の推移



・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
 ・2017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2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

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。

申込単位

1口単位

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、委託会社の営業日に計算されます。

申込価額の照会方法

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。

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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>**申込手数料**

ありません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得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日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

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、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付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】**解約の受付**

原則として、いつでも解約の請求ができます。

受益者の解約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。

解約単位

1口単位

解約価額

解約請求受付日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して4営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金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日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

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、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約請求を取消することがあります。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解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約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解約請求を受付けたものとします。

ファンドの資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関して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

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「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および借入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。

（資産の評価方法）

- ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。
- ・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。
- ・公社債等
原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。
残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。
- ・マザーファンド
計算日における基準価額で評価します。
- ・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）
原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
- ・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。
- ・市場デリバティブ取引
原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限（昭和62年11月27日設定）

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】

毎年11月8日から翌年11月7日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとし、ます。なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

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）

- ・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

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・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

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。

信託約款の変更

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ができます。委託会社は、信託約款を変更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。

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。

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（１ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、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。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。

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「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思

表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

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

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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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。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。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、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。

<https://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】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

- ・分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「自動けいぞく投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」を参照してください。

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11月8日から平成29年11月7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】

【バランス・タイプ（ミリオン）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第29期 [平成28年11月7日現在] | 第30期 [平成29年11月7日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 2,191,719 | 1,449,475 |
| 国債証券 | 52,296,600 | 51,640,700 |
| 親投資信託受益証券 | 54,760,720 | 59,008,148 |
| 未収利息 | 97,776 | 97,776 |
| 流動資産合計 | 109,346,815 | 112,196,099 |
| 資産合計 | 109,346,815 | 112,196,099 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 56,517 | 50,318 |
| 未払受託者報酬 | 45,804 | 48,032 |
| 未払委託者報酬 | 841,638 | 882,446 |
| 未払利息 | 3 | 2 |
| その他未払費用 | 2,220 | 2,341 |
| 流動負債合計 | 946,182 | 983,139 |
| 負債合計 | 946,182 | 983,139 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 113,035,924 | 100,636,904 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 4,635,291 | 10,576,056 |
| （分配準備積立金） | 14,254,352 | 18,276,976 |
| 元本等合計 | 108,400,633 | 111,212,960 |
| 純資産合計 | 108,400,633 | 111,212,960 |
| 負債純資産合計 | 109,346,815 | 112,196,099 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第29期 | | 第30期 | |
|---|------|------------------------------|------|------------------------------|
| | 自 | 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日 | 自 | 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 461,932 | | 400,011 |
| 有価証券売買等損益 | | 6,588,546 | | 17,191,528 |
| 営業収益合計 | | 6,126,614 | | 17,591,539 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払利息 | | 445 | | 469 |
| 受託者報酬 | | 94,304 | | 96,147 |
| 委託者報酬 | | 1,732,747 | | 1,766,509 |
| その他費用 | | 4,596 | | 4,697 |
| 営業費用合計 | | 1,832,092 | | 1,867,822 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 7,958,706 | | 15,723,717 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 7,958,706 | | 15,723,717 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 7,958,706 | | 15,723,717 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | | 268,080 | | 997,011 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 3,253,740 | | 4,635,291 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | | 534,959 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | | 529,685 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | - | | 5,274 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 141,888 | | - |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 119,617 | | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 22,271 | | - |
| 分配金 | | 56,517 | | 50,318 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 4,635,291 | | 10,576,056 |

（ 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 | 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。 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。 |
|-------------------|--|

（貸借対照表に関する注記）

| | 第 29 期 [平成28年11月7日現在] | 第 30 期 [平成29年11月7日現在] |
|-----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 1 期首元本額 | 116,729,098円 | 113,035,924円 |
| 期中追加設定元本額 | 618,349円 | 575,683円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,311,523円 | 12,974,703円 |
| 2 元本の欠損 | | |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 4,635,291円 | |
| 3 受益権の総数 | 113,035,924口 | 100,636,904口 |
| 4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 0.9590円 (9,590円) | 1.1051円 (11,051円) |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 29 期（自 平成27年11月10日 至 平成28年11月7日）

1 分配金の計算過程

| | | |
|-------------------------------|--------------|--------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額 | B | |
| 収益調整金額 | C | 23,404,159円 |
| 分配準備積立金額 | D | 14,310,869円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 37,715,028円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 113,035,924口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 3,336円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 5円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 56,517円 |

第 30 期（自 平成28年11月8日 至 平成29年11月7日）

1 分配金の計算過程

| | | |
|-------------------------------|--------------|--------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 1,210,247円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額 | B | 4,492,355円 |
| 収益調整金額 | C | 20,903,423円 |
| 分配準備積立金額 | D | 12,624,692円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 39,230,717円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 100,636,904口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 3,898円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | 5円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | 50,318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 29 期 (自 平成27年11月10日 至 平成28年11月 7日) | 第 30 期 (自 平成28年11月 8日 至 平成29年11月 7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、親投資信託受益証券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、公社債等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。 | 同 左 同 左 |

| | | |
|------------------|--|-----|
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | 親投資信託受益証券は、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あります。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あります。 | 同 左 |
| | また、親投資信託受益証券に係る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 |
| | 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。 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。 | 同 左 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 第 29 期 [平成28年11月7日現在] | 第 30 期 [平成29年11月7日現在] |
|---------------------------|---|----------------------------|
| 1 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同 左 |
| 2 時価の算定方法 | 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載してあります。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 | 同 左 同 左 |
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 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。 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 29 期 [平成28年11月7日現在] | 第 30 期 [平成29年11月7日現在] |
|-----------|----------------------------|----------------------------|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 国債証券 | 298,600 | 655,900 |
| 親投資信託受益証券 | 6,468,234 | 15,599,355 |
| 合計 | 6,169,634 | 14,943,455 |

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（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

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

| 種 類 | 銘 柄 | 数 量 | 評 価 額 | 備 考 |
|------|----------------|------------|------------|-----|
| 国債証券 | 第299回利付国債（10年） | 10,000,000 | 10,204,300 | |
| | 第312回利付国債（10年） | 10,000,000 | 10,422,100 | |
| | 第325回利付国債（10年） | 10,000,000 | 10,450,000 | |
| | 第334回利付国債（10年） | 10,000,000 | 10,455,400 | |
| | 第342回利付国債（10年） | 10,000,000 | 10,108,900 | |
| | 国債証券 小計 | 50,000,000 | 51,640,700 | |

| | | | |
|-----------|---------------------|------------|-------------|
| 親投資信託受益証券 | ミリオン・インデックス・マザーファンド | 43,452,245 | 59,008,148 |
| | 親投資信託受益証券 小計 | 43,452,245 | 59,008,148 |
| | 合計 | | 110,648,848 |

（注）公社債の数量は券面総額、親投資信託受益証券の数量は口数です。

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
該当事項はありません。

<参考>

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。

「ミリオン・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11月7日現在] | [平成29年11月7日現在] |
|-------------|----------------|----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 218,846,583 | 370,161,814 |
| 株式 | 2,686,034,700 | 3,090,610,800 |
| 派生商品評価勘定 | 4,302,980 | 30,930,820 |
| 未収配当金 | 19,946,700 | 23,343,450 |
| 前払金 | 110,000 | |
| 流動資産合計 | 2,929,240,963 | 3,515,046,884 |
| 資産合計 | 2,929,240,963 | 3,515,046,884 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | | 24,310,000 |
| 未払利息 | 307 | 606 |
| 流動負債合計 | 307 | 24,310,606 |
| 負債合計 | 307 | 24,310,606 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 2,932,141,019 | 2,571,261,462 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 2,900,363 | 919,474,816 |
| 元本等合計 | 2,929,240,656 | 3,490,736,278 |
| 純資産合計 | 2,929,240,656 | 3,490,736,278 |
| 負債純資産合計 | 2,929,240,963 | 3,515,046,884 |

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年11月8日から翌年11月7日までであります。

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|----------------------|---|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 |
| 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11月7日現在] | [平成29年11月7日現在] |
|--|----------------|----------------|
| 1 期首 | 平成27年11月10日 | 平成28年11月8日 |
| 期首元本額 | 3,091,873,048円 | 2,932,141,019円 |
| 期首からの追加設定元本額 | 8,396,329円 | 3,401,365円 |
| 期首からの一部解約元本額 | 168,128,358円 | 364,280,922円 |
| 元本の内訳* | | |
| インデックス・タイプ(ミリオン) | 2,877,325,483円 | 2,527,809,217円 |
| バランス・タイプ(ミリオン) | 54,815,536円 | 43,452,245円 |
| (合計) | 2,932,141,019円 | 2,571,261,462円 |
| 2 差入委託証拠金代用有価証券 | | |
| 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入れを行っております。 | | |
| 株式 | 149,144,000円 | 196,520,000円 |
| 3 元本の欠損 | | |
| 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。 | 2,900,363円 | |

| | | |
|-----------------------------|------------------|--------------------|
| 4 受益権の総数 | 2,932,141,019口 | 2,571,261,462口 |
| 5 1口当たり純資産額 (1千口当たり純資産額) | 0.999円 (999円) | 1.358円 (1,358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)

1 金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | (自平成27年11月10日 至平成28年11月7日) | (自平成28年11月8日 至平成29年11月7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。デリバティブ取引については、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 |
| 3 金融商品に係るリスク管理体制 | 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 |

2 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | [平成28年11月7日現在] | [平成29年11月7日現在] |
|---------------------------|--|----------------|
| 1 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているためその差額はありません。 | 同 左 |
| 2 時価の算定方法 | 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 | 同 左 |
| 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)

売買目的有価証券

| 種 類 | [平成28年11月7日現在] | [平成29年11月7日現在] |
|-----|--------------------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 372,325,335 | 763,935,400 |
| 合計 | 372,325,335 | 763,935,400 |

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(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11月7日現在] | | |
|------|----------------|----------------|-------------|-----------|
| | | 契約額等(円) | 時 価 | 評価損益 |
| | | | (円) | (円) |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 219,680,000 | 223,990,000 | 4,310,000 |
| | 合 計 | 219,680,000 | 223,990,000 | 4,310,000 |

| 区 分 | 種 類 | [平成29年11月7日現在] | | |
|------|----------------|----------------|-------------|------------|
| | | 契約額等(円) | 時 価 | 評価損益 |
| | | | (円) | (円) |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 359,890,000 | 390,830,000 | 30,940,000 |
| | 合 計 | 359,890,000 | 390,830,000 | 30,940,000 |

(注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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。

（３）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 | |
| 1332 | 日本水産 | 5,000 | 645.00 | 3,225,000 | |
| 1333 | マルハニチロ | 500 | 3,220.00 | 1,610,000 | |
| 1605 | 国際石油開発帝石 | 2,000 | 1,319.50 | 2,639,000 | |
| 1721 | コムシスホールディングス | 5,000 | 3,015.00 | 15,075,000 | |
| 1801 | 大成建設 | 1,000 | 6,610.00 | 6,610,000 | |
| 1802 | 大林組 | 5,000 | 1,561.00 | 7,805,000 | |
| 1803 | 清水建設 | 5,000 | 1,389.00 | 6,945,000 | |
| 1808 | 長谷工コーポレーション | 1,000 | 1,684.00 | 1,684,000 | |
| 1812 | 鹿島建設 | 5,000 | 1,260.00 | 6,300,000 | |
| 1925 | 大和ハウス工業 | 5,000 | 4,274.00 | 21,370,000 | |
| 1928 | 積水ハウス | 5,000 | 2,178.50 | 10,892,500 | |
| 1963 | 日揮 | 5,000 | 2,032.00 | 10,160,000 | |
| 6366 | 千代田化工建設 | 5,000 | 745.00 | 3,725,000 | |
| 2002 | 日清製粉グループ本社 | 5,000 | 2,085.00 | 10,425,000 | |
| 2269 | 明治ホールディングス | 1,000 | 9,390.00 | 9,390,000 | |
| 2282 | 日本ハム | 5,000 | 2,901.00 | 14,505,000 | |
| 2501 | サッポロホールディングス | 1,000 | 3,410.00 | 3,410,000 | |
| 2502 | アサヒグループホールディングス | 5,000 | 5,330.00 | 26,650,000 | |
| 2503 | キリンホールディングス | 5,000 | 2,654.50 | 13,272,500 | |
| 2531 | 宝ホールディングス | 5,000 | 1,143.00 | 5,715,000 | |
| 2801 | キッコーマン | 5,000 | 4,055.00 | 20,275,000 | |
| 2802 | 味の素 | 5,000 | 2,308.50 | 11,542,500 | |
| 2871 | ニチレイ | 2,500 | 3,075.00 | 7,687,500 | |
| 2914 | 日本たばこ産業 | 5,000 | 3,840.00 | 19,200,000 | |
| 3101 | 東洋紡 | 500 | 2,202.00 | 1,101,000 | |
| 3103 | ユニチカ | 500 | 999.00 | 499,500 | |
| 3401 | 帝人 | 1,000 | 2,474.00 | 2,474,000 | |
| 3402 | 東レ | 5,000 | 1,188.00 | 5,940,000 | |
| 3861 | 王子ホールディングス | 5,000 | 678.00 | 3,390,000 | |
| 3863 | 日本製紙 | 500 | 2,352.00 | 1,176,000 | |
| 3405 | クラレ | 5,000 | 2,354.00 | 11,770,000 | |
| 3407 | 旭化成 | 5,000 | 1,407.50 | 7,037,500 | |
| 4004 | 昭和電工 | 500 | 3,940.00 | 1,970,000 | |
| 4005 | 住友化学 | 5,000 | 821.00 | 4,105,000 | |
| 4021 | 日産化学工業 | 5,000 | 4,495.00 | 22,475,000 | |
| 4042 | 東ソー | 2,500 | 2,565.00 | 6,412,500 | |
| 4043 | トクヤマ | 1,000 | 3,475.00 | 3,475,000 | |
| 4061 | デンカ | 1,000 | 3,895.00 | 3,895,000 | |
| 4063 | 信越化学工業 | 5,000 | 12,510.00 | 62,550,000 | |
| 4183 | 三井化学 | 1,000 | 3,420.00 | 3,420,000 | |
| 4188 | 三菱ケミカルホールディングス | 2,500 | 1,213.50 | 3,033,750 | |
| 4208 | 宇部興産 | 500 | 3,375.00 | 1,687,500 | |
| 4272 | 日本化薬 | 5,000 | 1,813.00 | 9,065,000 | |
| 4452 | 花王 | 5,000 | 7,023.00 | 35,115,000 | |
| 4901 | 富士フイルムホールディングス | 5,000 | 4,624.00 | 23,120,000 | |
| 4911 | 資生堂 | 5,000 | 4,721.00 | 23,605,000 | |
| 6988 | 日東電工 | 5,000 | 11,685.00 | 58,425,000 | |
| 4151 | 協和発酵キリン | 5,000 | 2,194.00 | 10,970,000 | |
| 4502 | 武田薬品工業 | 5,000 | 6,433.00 | 32,165,000 | |
| 4503 | アステラス製薬 | 25,000 | 1,512.00 | 37,800,000 | |
| 4506 | 大日本住友製薬 | 5,000 | 1,681.00 | 8,405,000 | |
| 4507 | 塩野義製薬 | 5,000 | 6,264.00 | 31,320,000 | |
| 4519 | 中外製薬 | 5,000 | 5,630.00 | 28,150,000 | |
| 4523 | エーザイ | 5,000 | 6,512.00 | 32,560,000 | |
| 4568 | 第一三共 | 5,000 | 2,704.50 | 13,522,500 | |
| 4578 | 大塚ホールディングス | 5,000 | 4,826.00 | 24,130,000 | |
| 5002 | 昭和シェル石油 | 5,000 | 1,440.00 | 7,200,000 | |
| 5020 | JXTGホールディングス | 5,000 | 630.60 | 3,153,000 | |
| 5101 | 横浜ゴム | 2,500 | 2,581.00 | 6,452,500 | |
| 5108 | ブリヂストン | 5,000 | 5,591.00 | 27,955,000 | |
| 5201 | 旭硝子 | 1,000 | 4,845.00 | 4,845,000 | |

| | | | | | |
|------|---------------------|--------|-----------|-------------|--------|
| 5202 | 日本板硝子 | 500 | 1,035.00 | 517,500 | |
| 5214 | 日本電気硝子 | 1,500 | 4,735.00 | 7,102,500 | |
| 5232 | 住友大阪セメント | 5,000 | 495.00 | 2,475,000 | |
| 5233 | 太平洋セメント | 500 | 4,595.00 | 2,297,500 | |
| 5301 | 東海カーボン | 5,000 | 1,206.00 | 6,030,000 | |
| 5332 | TOTO | 2,500 | 5,760.00 | 14,400,000 | |
| 5333 | 日本碍子 | 5,000 | 2,187.00 | 10,935,000 | |
| 5401 | 新日鐵住金 | 500 | 2,687.50 | 1,343,750 | |
| 5406 | 神戸製鋼所 | 500 | 1,082.00 | 541,000 | |
| 5411 | ジェイ エフ イー ホールディングス | 500 | 2,593.50 | 1,296,750 | |
| 5413 | 日新製鋼 | 500 | 1,653.00 | 826,500 | |
| 5541 | 大太平洋金属 | 500 | 3,330.00 | 1,665,000 | |
| 5703 | 日本軽金属ホールディングス | 5,000 | 329.00 | 1,645,000 | |
| 5706 | 三井金属鉱業 | 500 | 6,080.00 | 3,040,000 | |
| 5707 | 東邦亜鉛 | 500 | 6,060.00 | 3,030,000 | |
| 5711 | 三菱マテリアル | 500 | 4,480.00 | 2,240,000 | |
| 5713 | 住友金属鉱山 | 2,500 | 4,890.00 | 12,225,000 | |
| 5714 | DOWAホールディングス | 1,000 | 4,965.00 | 4,965,000 | |
| 5715 | 古河機械金属 | 500 | 2,122.00 | 1,061,000 | |
| 5801 | 古河電気工業 | 500 | 6,010.00 | 3,005,000 | |
| 5802 | 住友電気工業 | 5,000 | 1,934.50 | 9,672,500 | |
| 5803 | フジクラ | 5,000 | 996.00 | 4,980,000 | |
| 3436 | SUMCO | 500 | 2,587.00 | 1,293,500 | |
| 5901 | 東洋製罐グループホールディングス | 5,000 | 1,943.00 | 9,715,000 | |
| 5631 | 日本製鋼所 | 1,000 | 3,380.00 | 3,380,000 | |
| 6103 | オークマ | 1,000 | 7,230.00 | 7,230,000 | |
| 6113 | アマダホールディングス | 5,000 | 1,456.00 | 7,280,000 | |
| 6301 | 小松製作所 | 5,000 | 3,832.00 | 19,160,000 | |
| 6302 | 住友重機械工業 | 1,000 | 5,100.00 | 5,100,000 | |
| 6305 | 日立建機 | 5,000 | 4,050.00 | 20,250,000 | |
| 6326 | クボタ | 5,000 | 2,176.00 | 10,880,000 | |
| 6361 | 荏原製作所 | 1,000 | 4,300.00 | 4,300,000 | |
| 6367 | ダイキン工業 | 5,000 | 13,230.00 | 66,150,000 | |
| 6471 | 日本精工 | 5,000 | 1,691.00 | 8,455,000 | |
| 6472 | NTN | 5,000 | 566.00 | 2,830,000 | |
| 6473 | ジェイテクト | 5,000 | 2,045.00 | 10,225,000 | |
| 7004 | 日立造船 | 1,000 | 627.00 | 627,000 | |
| 7011 | 三菱重工業 | 500 | 4,449.00 | 2,224,500 | |
| 7013 | IHI | 500 | 3,695.00 | 1,847,500 | |
| 3105 | 日清紡ホールディングス | 5,000 | 1,386.00 | 6,930,000 | |
| 4902 | コニカミノルタ | 5,000 | 1,085.00 | 5,425,000 | |
| 6479 | ミネベアミツミ | 5,000 | 2,177.00 | 10,885,000 | |
| 6501 | 日立製作所 | 5,000 | 899.80 | 4,499,000 | |
| 6503 | 三菱電機 | 5,000 | 1,936.50 | 9,682,500 | |
| 6504 | 富士電機 | 5,000 | 854.00 | 4,270,000 | |
| 6506 | 安川電機 | 5,000 | 4,305.00 | 21,525,000 | |
| 6674 | ジーエス・ユアサ コーポレーション | 5,000 | 580.00 | 2,900,000 | |
| 6701 | 日本電気 | 500 | 3,025.00 | 1,512,500 | |
| 6702 | 富士通 | 5,000 | 863.10 | 4,315,500 | |
| 6703 | 沖電気工業 | 500 | 1,589.00 | 794,500 | |
| 6724 | セイコーエプソン | 10,000 | 2,729.00 | 27,290,000 | |
| 6752 | パナソニック | 5,000 | 1,729.50 | 8,647,500 | |
| 6758 | ソニー | 5,000 | 5,261.00 | 26,305,000 | |
| 6762 | TDK | 5,000 | 9,110.00 | 45,550,000 | |
| 6770 | アルプス電気 | 5,000 | 3,705.00 | 18,525,000 | |
| 6773 | パイオニア | 5,000 | 230.00 | 1,150,000 | |
| 6841 | 横河電機 | 5,000 | 2,168.00 | 10,840,000 | |
| 6857 | アドバンテスト | 10,000 | 2,603.00 | 26,030,000 | |
| 6952 | カシオ計算機 | 5,000 | 1,695.00 | 8,475,000 | |
| 6954 | ファナック | 5,000 | 28,170.00 | 140,850,000 | 2,000株 |
| 6971 | 京セラ | 10,000 | 8,144.00 | 81,440,000 | |
| 6976 | 太陽誘電 | 5,000 | 2,016.00 | 10,080,000 | |
| 7735 | S C R E E Nホールディングス | 1,000 | 10,950.00 | 10,950,000 | |
| 7751 | キヤノン | 7,500 | 4,356.00 | 32,670,000 | |
| 7752 | リコー | 5,000 | 1,023.00 | 5,115,000 | |
| 8035 | 東京エレクトロン | 5,000 | 22,490.00 | 112,450,000 | |
| 6902 | デンソー | 5,000 | 6,474.00 | 32,370,000 | |
| 7003 | 三井造船 | 500 | 1,612.00 | 806,000 | |
| 7012 | 川崎重工業 | 500 | 3,980.00 | 1,990,000 | |
| 7201 | 日産自動車 | 5,000 | 1,111.00 | 5,555,000 | |
| 7202 | いすゞ自動車 | 2,500 | 1,771.50 | 4,428,750 | |
| 7203 | トヨタ自動車 | 5,000 | 7,183.00 | 35,915,000 | |
| 7205 | 日野自動車 | 5,000 | 1,387.00 | 6,935,000 | |

| | | | | | |
|------|----------------------|--------|-----------|-------------|--------|
| 7211 | 三菱自動車工業 | 500 | 905.00 | 452,500 | |
| 7261 | マツダ | 1,000 | 1,585.50 | 1,585,500 | |
| 7267 | 本田技研工業 | 10,000 | 3,837.00 | 38,370,000 | |
| 7269 | スズキ | 5,000 | 6,320.00 | 31,600,000 | |
| 7270 | S U B A R U | 5,000 | 3,778.00 | 18,890,000 | |
| 7272 | ヤマハ発動機 | 5,000 | 3,540.00 | 17,700,000 | |
| 4543 | テルモ | 10,000 | 4,875.00 | 48,750,000 | |
| 7731 | ニコン | 5,000 | 2,241.00 | 11,205,000 | |
| 7733 | オリンパス | 5,000 | 4,370.00 | 21,850,000 | |
| 7762 | シチズン時計 | 5,000 | 848.00 | 4,240,000 | |
| 7911 | 凸版印刷 | 5,000 | 1,176.00 | 5,880,000 | |
| 7912 | 大日本印刷 | 2,500 | 2,849.00 | 7,122,500 | |
| 7951 | ヤマハ | 5,000 | 4,130.00 | 20,650,000 | |
| 9501 | 東京電力ホールディングス | 500 | 473.00 | 236,500 | |
| 9502 | 中部電力 | 500 | 1,508.50 | 754,250 | |
| 9503 | 関西電力 | 500 | 1,557.50 | 778,750 | |
| 9531 | 東京瓦斯 | 1,000 | 2,800.00 | 2,800,000 | |
| 9532 | 大阪瓦斯 | 1,000 | 2,230.50 | 2,230,500 | |
| 9001 | 東武鉄道 | 1,000 | 3,440.00 | 3,440,000 | |
| 9005 | 東京急行電鉄 | 2,500 | 1,767.00 | 4,417,500 | |
| 9007 | 小田急電鉄 | 2,500 | 2,309.00 | 5,772,500 | |
| 9008 | 京王電鉄 | 1,000 | 4,995.00 | 4,995,000 | |
| 9009 | 京成電鉄 | 2,500 | 3,400.00 | 8,500,000 | |
| 9020 | 東日本旅客鉄道 | 500 | 11,245.00 | 5,622,500 | |
| 9021 | 西日本旅客鉄道 | 500 | 8,342.00 | 4,171,000 | |
| 9022 | 東海旅客鉄道 | 500 | 21,010.00 | 10,505,000 | |
| 9062 | 日本通運 | 500 | 6,990.00 | 3,495,000 | |
| 9064 | ヤマトホールディングス | 5,000 | 2,299.00 | 11,495,000 | |
| 9101 | 日本郵船 | 500 | 2,770.00 | 1,385,000 | |
| 9104 | 商船三井 | 500 | 3,745.00 | 1,872,500 | |
| 9107 | 川崎汽船 | 500 | 2,988.00 | 1,494,000 | |
| 9202 | A N Aホールディングス | 500 | 4,442.00 | 2,221,000 | |
| 9301 | 三菱倉庫 | 2,500 | 3,080.00 | 7,700,000 | |
| 4689 | ヤフー | 2,000 | 508.00 | 1,016,000 | |
| 4704 | トレンドマイクロ | 5,000 | 6,150.00 | 30,750,000 | |
| 9412 | スカパーJ S A Tホールディングス | 500 | 520.00 | 260,000 | |
| 9432 | 日本電信電話 | 1,000 | 5,750.00 | 5,750,000 | |
| 9433 | K D D I | 30,000 | 3,142.00 | 94,260,000 | |
| 9437 | N T T ドコモ | 500 | 2,807.00 | 1,403,500 | |
| 9602 | 東宝 | 500 | 3,755.00 | 1,877,500 | |
| 9613 | エヌ・ティ・ティ・データ | 25,000 | 1,358.00 | 33,950,000 | |
| 9766 | コナミホールディングス | 5,000 | 6,210.00 | 31,050,000 | |
| 9984 | ソフトバンクグループ | 15,000 | 10,060.00 | 150,900,000 | 6,000株 |
| 2768 | 双日 | 500 | 336.00 | 168,000 | |
| 8001 | 伊藤忠商事 | 5,000 | 2,018.00 | 10,090,000 | |
| 8002 | 丸紅 | 5,000 | 789.10 | 3,945,500 | |
| 8015 | 豊田通商 | 5,000 | 4,345.00 | 21,725,000 | |
| 8031 | 三井物産 | 5,000 | 1,742.00 | 8,710,000 | |
| 8053 | 住友商事 | 5,000 | 1,761.00 | 8,805,000 | |
| 8058 | 三菱商事 | 5,000 | 2,896.00 | 14,480,000 | |
| 3086 | J . フロント リテイリング | 2,500 | 1,754.00 | 4,385,000 | |
| 3099 | 三越伊勢丹ホールディングス | 5,000 | 1,242.00 | 6,210,000 | |
| 3382 | セブン&アイ・ホールディングス | 5,000 | 4,649.00 | 23,245,000 | |
| 8028 | ユニー・ファミリーマートホールディングス | 5,000 | 6,700.00 | 33,500,000 | |
| 8233 | 高島屋 | 5,000 | 1,070.00 | 5,350,000 | |
| 8252 | 丸井グループ | 5,000 | 1,772.00 | 8,860,000 | |
| 8267 | イオン | 5,000 | 1,766.00 | 8,830,000 | |
| 9983 | ファーストリテイリング | 5,000 | 39,910.00 | 199,550,000 | 2,000株 |
| 7186 | コンコルディア・フィナンシャルグループ | 5,000 | 596.00 | 2,980,000 | |
| 8303 | 新生銀行 | 500 | 1,821.00 | 910,500 | |
| 8304 | あおぞら銀行 | 500 | 4,485.00 | 2,242,500 | |
| 8306 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 5,000 | 767.50 | 3,837,500 | |
| 8308 | りそなホールディングス | 500 | 617.30 | 308,650 | |
| 8309 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 500 | 4,474.00 | 2,237,000 | |
| 8316 | 三井住友フィナンシャルグループ | 500 | 4,545.00 | 2,272,500 | |
| 8331 | 千葉銀行 | 5,000 | 848.00 | 4,240,000 | |
| 8354 | ふくおかフィナンシャルグループ | 5,000 | 581.00 | 2,905,000 | |
| 8355 | 静岡銀行 | 5,000 | 1,097.00 | 5,485,000 | |
| 8411 | みずほフィナンシャルグループ | 5,000 | 206.30 | 1,031,500 | |
| 8601 | 大和証券グループ本社 | 5,000 | 729.20 | 3,646,000 | |
| 8604 | 野村ホールディングス | 5,000 | 671.00 | 3,355,000 | |
| 8628 | 松井証券 | 5,000 | 998.00 | 4,990,000 | |

| | | | | | |
|------|---------------------------|---------|----------|---------------|--|
| 8630 | SOMPOホールディングス | 1,200 | 4,607.00 | 5,528,400 | |
| 8725 | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 1,500 | 3,838.00 | 5,757,000 | |
| 8729 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 1,000 | 1,840.00 | 1,840,000 | |
| 8750 | 第一生命ホールディングス | 500 | 2,163.50 | 1,081,750 | |
| 8766 | 東京海上ホールディングス | 2,500 | 4,886.00 | 12,215,000 | |
| 8795 | T&Dホールディングス | 1,000 | 1,777.50 | 1,777,500 | |
| 8253 | クレディセゾン | 5,000 | 2,314.00 | 11,570,000 | |
| 3289 | 東急不動産ホールディングス | 5,000 | 780.00 | 3,900,000 | |
| 8801 | 三井不動産 | 5,000 | 2,750.00 | 13,750,000 | |
| 8802 | 三菱地所 | 5,000 | 2,137.00 | 10,685,000 | |
| 8804 | 東京建物 | 2,500 | 1,614.00 | 4,035,000 | |
| 8830 | 住友不動産 | 5,000 | 3,880.00 | 19,400,000 | |
| 2432 | ディー・エヌ・エー | 1,500 | 2,610.00 | 3,915,000 | |
| 4324 | 電通 | 5,000 | 4,900.00 | 24,500,000 | |
| 4755 | 楽天 | 5,000 | 1,189.50 | 5,947,500 | |
| 6098 | リクルートホールディングス | 15,000 | 2,743.00 | 41,145,000 | |
| 6178 | 日本郵政 | 5,000 | 1,308.00 | 6,540,000 | |
| 9681 | 東京ドーム | 2,500 | 1,106.00 | 2,765,000 | |
| 9735 | セコム | 5,000 | 8,947.00 | 44,735,000 | |
| | 合計 | 869,700 | | 3,090,610,800 | |

(注)備考欄の数値は、差入委託証拠金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

2【ファンドの現況】

【バランス・タイプ（ミリオン）】

【純資産額計算書】

平成29年11月30日現在
（単位：円）

| | |
|-----------------|-----------------------------|
| 資産総額 | 107,412,637 |
| 負債総額 | 114,316 |
| 純資産総額（ - ） | 107,298,321 |
| 発行済口数 | 97,727,022 口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.0979 （ 1万口当たり 10,979 ） |

（参考）

ミリオン・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

平成29年11月30日現在
（単位：円）

| | |
|-----------------|---------------------------|
| 資産総額 | 3,427,115,150 |
| 負債総額 | 621 |
| 純資産総額（ - ） | 3,427,114,529 |
| 発行済口数 | 2,548,105,984 口 |
| 1口当たり純資産価額（ / ） | 1.345 （ 1千口当たり 1,345 ） |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取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。なお、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、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

該当事項はありません。

（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）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、解約請求の受付け、解約代金および償還金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

平成29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）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部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。

2【事業の内容及び営業の概況】

「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29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 | 837 | 11,530,094 |
| 追加型公社債投資信託 | 16 | 1,412,584 |
| 単位型株式投資信託 | 54 | 348,757 |
| 単位型公社債投資信託 | 1 | 6,397 |
| 合計 | 908 | 13,297,833 |

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】

(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32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29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33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | | 第32期 (平成29年3月31日現在) | |
|--------|------------------------|------------|------------------------|------------|
| (資産の部) | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 80,707,781 | 2 | 69,212,680 |
| 有価証券 | | 2,728,127 | | 36,210 |
| 前払費用 | | 402,267 | | 337,699 |
| 未収入金 | | 14,286 | | 35,896 |

| | | | | |
|------------|---|-------------|---|-------------|
| 未収委託者報酬 | | 11,275,577 | | 10,076,022 |
| 未収収益 | 2 | 564,923 | 2 | 659,405 |
| 繰延税金資産 | | 491,700 | | 446,374 |
| 金銭の信託 | 2 | 30,000 | 2 | 30,000 |
| その他 | | 438,012 | | 113,754 |
| 流動資産合計 | | 96,652,678 | | 80,948,042 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 846,844 | 1 | 806,798 |
| 器具備品 | 1 | 768,584 | 1 | 759,446 |
| 土地 | | 1,356,000 | | 1,356,000 |
| 有形固定資産合計 | | 2,971,428 | | 2,922,245 |
| 無形固定資産 | | | | |
| 電話加入権 | | 15,822 | | 15,822 |
| ソフトウェア | | 1,813,951 | | 1,844,549 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 341,815 | | 608,066 |
| その他 | | 71 | | 10 |
| 無形固定資産合計 | | 2,171,661 | | 2,468,448 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 24,223,272 | | 24,327,081 |
| 関係会社株式 | | 320,136 | | 320,136 |
| 長期差入保証金 | | 686,446 | | 654,402 |
| 前払年金費用 | | 499,178 | | 463,105 |
| 繰延税金資産 | | 786,810 | | 711,230 |
| その他 | | 51,090 | | 50,235 |
| 貸倒引当金 | | 23,600 | | 23,600 |
| 投資その他の資産合計 | | 26,543,335 | | 26,502,592 |
| 固定資産合計 | | 31,686,425 | | 31,893,286 |
| 資産合計 | | 128,339,103 | | 112,841,328 |

(単位：千円)

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|---------|------------------------|------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 199,091 | 166,493 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 101,046 | 108,024 |
| 未払償還金 | 821,178 | 547,707 |
| 未払手数料 | 2 4,866,423 | 2 4,225,009 |
| その他未払金 | 2 2,521,849 | 2 2,355,815 |
| 未払費用 | 2 3,419,978 | 2 3,061,479 |
| 未払消費税等 | 370,110 | 351,670 |
| 未払法人税等 | 947,540 | 756,668 |

| | | |
|-----------|-------------|------------|
| 賞与引当金 | 882,523 | 843,729 |
| 役員賞与引当金 | | 100,680 |
| その他 | 670,983 | 711,633 |
| 流動負債合計 | 14,800,725 | 13,228,909 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 508,142 | 590,154 |
| 役員退職慰労引当金 | 166,789 | 166,458 |
| 時効後支払損引当金 | 257,105 | 253,070 |
| 固定負債合計 | 932,038 | 1,009,684 |
| 負債合計 | 15,732,763 | 14,238,594 |
| (純資産の部) | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,131 | 2,000,131 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 3,572,096 | 3,572,096 |
| その他資本剰余金 | 41,160,616 | 41,160,616 |
| 資本剰余金合計 | 44,732,712 | 44,732,712 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 342,589 | 342,589 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 6,998,000 | 6,998,000 |
| 繰越利益剰余金 | 57,079,782 | 43,034,713 |
| 利益剰余金合計 | 64,420,372 | 50,375,303 |
| 株主資本合計 | 111,153,216 | 97,108,147 |

(単位：千円)

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|------------------|------------------------|------------------------|
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券 評価差額金 | 1,446,576 | 1,494,586 |
| 繰延ヘッジ損益 | 6,546 | |
| 評価・換算差額等合計 | 1,453,123 | 1,494,586 |
| 純資産合計 | 112,606,339 | 98,602,734 |
| 負債純資産合計 | 128,339,103 | 112,841,328 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) |
|-------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 82,096,942 | 81,709,776 |

| | | | | |
|-------------|---|------------|---|------------|
| 投資顧問料 | | 2,226,322 | | 2,396,020 |
| その他営業収益 | | 35,063 | | 25,763 |
| 営業収益合計 | | 84,358,328 | | 84,131,560 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 2 | 34,821,751 | 2 | 33,975,255 |
| 広告宣伝費 | | 742,632 | | 731,771 |
| 公告費 | | | | 482 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 1,642,352 | | 1,713,892 |
| 委託調査費 | | 14,530,744 | | 13,961,993 |
| 事務委託費 | | 751,410 | | 984,749 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 122,574 | | 158,915 |
| 印刷費 | | 704,639 | | 699,940 |
| 協会費 | | 51,201 | | 51,995 |
| 諸会費 | | 7,730 | | 9,887 |
| 事務機器関連費 | | 1,674,745 | | 1,611,608 |
| その他営業雑経費 | | 30,382 | | 11,925 |
| 営業費用合計 | | 55,080,164 | | 53,912,419 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 280,681 | | 331,997 |
| 給料・手当 | | 5,948,603 | | 6,496,165 |
| 賞与引当金繰入 | | 882,523 | | 843,729 |
| 役員賞与引当金繰入 | | | | 100,680 |
| 福利厚生費 | | 1,091,897 | | 1,196,210 |
| 交際費 | | 17,062 | | 14,843 |
| 旅費交通費 | | 212,578 | | 233,159 |
| 租税公課 | | 264,376 | | 422,030 |
| 不動産賃借料 | | 795,415 | | 706,571 |
| 退職給付費用 | | 341,073 | | 441,736 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 34,369 | | 48,393 |
| 固定資産減価償却費 | | 1,068,796 | | 1,030,040 |
| 諸経費 | | 426,547 | | 474,521 |
| 一般管理費合計 | | 11,363,925 | | 12,340,079 |
| 営業利益 | | 17,914,238 | | 17,879,061 |

(単位：千円)

| | 第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) |
|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 235,697 | 243,048 |
| 有価証券利息 | 523 | 0 |
| 受取利息 | 2 15,142 | 2 4,601 |
| 投資有価証券償還益 | 9,315 | 260,190 |
| 収益分配金等時効完成分 | 71,619 | 278,148 |

| | | | | |
|--------------|---|------------|---|------------|
| その他 | | 17,393 | | 4,383 |
| 営業外収益合計 | | 349,691 | | 790,372 |
| 営業外費用 | | | | |
| 投資有価証券償還損 | | 152,298 | | 11,552 |
| 時効後支払損引当金繰入 | | 98,891 | | |
| 事務過誤費 | | 421 | | 218 |
| その他 | | 5,862 | | 4,357 |
| 営業外費用合計 | | 257,473 | | 16,128 |
| 経常利益 | | 18,006,455 | | 18,653,304 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 424,605 | | 259,137 |
| ゴルフ会員権売却益 | | 1,300 | | |
| 特別利益合計 | | 425,905 | | 259,137 |
| 特別損失 | | | | |
| 投資有価証券売却損 | | 52,623 | | 42,248 |
| デリバティブ解約損 | | | | 126,228 |
| 有価証券評価損 | | 67,284 | | |
| 投資有価証券評価損 | | 18,539 | | 157,482 |
| 固定資産除却損 | 1 | 1,305 | 1 | 13,540 |
| 減損損失 | 3 | 42,073 | 3 | 48,575 |
| 合併関連費用 | | 829,181 | | |
| 特別損失合計 | | 1,011,007 | | 388,075 |
| 税引前当期純利益 | | 17,421,353 | | 18,524,367 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2 | 5,796,941 | 2 | 5,658,953 |
| 法人税等調整額 | | 1,035,591 | | 103,169 |
| 法人税等合計 | | 4,761,350 | | 5,762,122 |
| 当期純利益 | | 12,660,003 | | 12,762,244 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

| | 株主資本 | | | | | | | | 株主資本合計 |
|---------------------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 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 | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| | | | | | | | | | |
| 当期首残高 | 2,000,131 | 222,096 | | 222,096 | 342,589 | 6,998,000 | 48,527,422 | 55,868,012 | 58,090,240 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 4,107,643 | 4,107,643 | 4,107,643 |
| 当期純利益 | | | | | | | 12,660,003 | 12,660,003 | 12,660,003 |
| 合併による増加 | | 3,350,000 | 41,160,616 | 44,510,616 | | | | | 44,510,616 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | 3,350,000 | 41,160,616 | 44,510,616 | | | 8,552,359 | 8,552,359 | 53,062,976 |

| | | | | | | | | | |
|-------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|-------------|
| 当期末残高 | 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 |
|-------|-----------|-----------|------------|------------|---------|-----------|------------|------------|-------------|

| | 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 | 2,300,727 | | 2,300,727 | 60,390,967 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 4,107,643 |
| 当期純利益 | | | | 12,660,003 |
| 合併による増加 | 903,495 | 148,745 | 754,749 | 45,265,365 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | 1,757,645 | 155,292 | 1,602,353 | 1,602,353 |
| 当期変動額合計 | 854,150 | 6,546 | 847,604 | 52,215,371 |
| 当期末残高 | 1,446,576 | 6,546 | 1,453,123 | 112,606,339 |

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31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 準備金 | その他利益剰余金 | | 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 | | 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 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 26,807,312 | 26,807,312 | 26,807,312 |
| 当期純利益 | | | | | | | 12,762,244 | 12,762,244 | 12,762,244 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | | | 14,045,068 | 14,045,068 | 14,045,068 |
| 当期末残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |

| | 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 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 26,807,312 |
| 当期純利益 | | | | 12,762,244 |
| 株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額) | 48,009 | 6,546 | 41,462 | 41,462 |
| 当期変動額合計 | 48,009 | 6,546 | 41,462 | 14,003,605 |
| 当期末残高 | 1,494,586 | | 1,494,586 | 98,602,734 |

[注記事項]

（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

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. 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、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期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。

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

税抜方式を採用しており、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)を当事業年度に適用し、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期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)を当事業年度から適用しております。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|------|------------------------|------------------------|
| 建物 | 467,206千円 | 539,649千円 |
| 器具備品 | 897,207千円 | 1,029,950千円 |

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 預金 | 43,128,360千円 | 47,798,472千円 |
| 未収収益 | 52,753千円 | 46,963千円 |
| 金銭の信託 | 30,000千円 | 30,000千円 |
| 未払手数料 | 2,612,168千円 | 1,993,055千円 |
| その他未払金 | 2,296,632千円 | 2,071,256千円 |
| 未払費用 | 442,340千円 | 456,748千円 |

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

| | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 建物 | 254千円 | 2,392千円 |
| 器具備品 | 1,051千円 | 7,791千円 |
| ソフトウェア | - | 3,356千円 |
| 計 | 1,305千円 | 13,540千円 |

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

| | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 支払手数料 | 15,120,269千円 | 13,862,465千円 |
| 受取利息 | 12,609千円 | 4,375千円 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 3,980,844千円 | 4,204,969千円 |

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|-------------|-----------|------|----------|
| 静岡県裾野市 | 遊休資産（不動産） | 土地 | 35,031千円 |
| 東京都千代田区（本社） | 遊休資産（美術品） | 器具備品 | 7,041千円 |

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

| 場所 | 用途 | 種類 | 減損損失 |
|-------------|----------------------|---------------|----------|
| 東京都千代田区（本社） | 自社利用ソフトウェア （遊休資産） | ソフトウェア 仮勘定 | 48,575千円 |

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループ

ングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31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） | 当事業年度増加 株式数（株） | 当事業年度減少 株式数（株） | 当事業年度末 株式数（株） |
|---------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 発行済株式 | | | | |
| 普通株式（注） | 124,098 | 87,483 | - | 211,581 |
| 合計 | 124,098 | 87,483 | - | 211,581 |

（注）普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30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 | 4,107,643千円 |
| 1株当たり配当額 | 33,100円 |
| 基準日 | 平成27年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成27年6月30日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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 |

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31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） | 当事業年度増加 株式数（株） | 当事業年度減少 株式数（株） | 当事業年度末 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

(1) 配当金支払額

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 |
| 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 |

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29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 | 26,595,731千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 125,700円 |
| 基準日 | 平成29年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成29年6月29日 |

(リース取引関係)

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

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 1年内 | 678,116千円 | 678,116千円 |
| 1年超 | 2,651,815千円 | 1,973,699千円 |
| 合計 | 3,329,932千円 | 2,651,815千円 |

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4)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。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2.金融商品の時価等に関する事項

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）。

第31期(平成28年3月31日現在)

| | 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 | 80,707,781 | 80,707,781 | - |
| (2)有価証券 | 2,728,127 | 2,728,127 | - |
| (3)未収委託者報酬 | 11,275,577 | 11,275,577 | - |
| (4)投資有価証券 | 24,054,542 | 24,054,542 | - |
| 資産計 | 118,766,029 | 118,766,029 | - |
| (1)未払手数料 | 4,866,423 | 4,866,423 | - |
| 負債計 | 4,866,423 | 4,866,423 | - |

| | | | |
|-------------|---------|---------|---|
| デリバティブ取引() | (3,459) | (3,459) | - |
|-------------|---------|---------|---|

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。

第32期(平成29年3月31日現在)

| | 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 | 69,212,680 | 69,212,680 | - |
| (2) 有価証券 | 36,210 | 36,210 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 10,076,022 | 10,076,022 | - |
| (4) 投資有価証券 | 24,189,921 | 24,189,921 | - |
| 資産計 | 103,514,834 | 103,514,834 | - |
| (1) 未払手数料 | 4,225,009 | 4,225,009 | - |
| 負債計 | 4,225,009 | 4,225,009 | - |

(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

(単位：千円)

| 区分 | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 168,730 | 137,160 |
| 子会社株式 | 160,600 | 160,600 |
| 関連会社株式 | 159,536 | 159,536 |

非上場株式は、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) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|------------|-------------|--------------|------|
| 現金及び預金 | 80,707,781 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 11,275,577 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |

| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
|-------------------|------------|-----------|-----------|-------|
| 投資信託 | 2,728,127 | 9,234,321 | 9,756,778 | 5,050 |
| 合計 | 94,711,487 | 9,234,321 | 9,756,778 | 5,050 |

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|-------------|--------------|--------|
| 現金及び預金 | 69,212,680 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 10,076,022 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券のうち満期があるもの | | | | |
| 投資信託 | 36,210 | 10,703,761 | 8,324,138 | 45,606 |
| 合計 | 79,324,912 | 10,703,761 | 8,324,138 | 45,606 |

(有価証券関係)

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（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）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

第31期(平成28年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | 株式 | 113,875 | 30,541 | 83,333 |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 19,085,937 | 16,697,402 | 2,388,535 |
| | 小計 | 19,199,812 | 16,727,944 | 2,471,868 |
| 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 | 7,582,857 | 7,969,134 | 386,277 |
| | 小計 | 7,582,857 | 7,969,134 | 386,277 |
| 合計 | | 26,782,669 | 24,697,079 | 2,085,590 |

第32期(平成29年3月31日現在)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額(千円) |
|--------------------------|-----|------------------|--------------|-----------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 17,778,798 | 15,302,336 | 2,476,461 |
| | 小計 | 17,778,798 | 15,302,336 | 2,476,461 |
| 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 | 6,447,333 | 6,769,569 | 322,236 |
| | 小計 | 6,447,333 | 6,769,569 | 322,236 |
| 合計 | | 24,226,131 | 22,071,906 | 2,154,225 |

3. 売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

| 種類 | 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式 | - | - | - |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 5,649,814 | 424,605 | 52,623 |
| 合計 | 5,649,814 | 424,605 | 52,623 |

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

| 種類 | 売却額（千円） | 売却益の合計額（千円） | 売却損の合計額（千円） |
|-----|-----------|-------------|-------------|
| 株式 | 122,688 | 82,146 | 21,570 |
| 債券 | - | - | - |
| その他 | 3,439,009 | 176,991 | 20,678 |
| 合計 | 3,561,698 | 259,137 | 42,248 |

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）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。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

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 | 945,410 | - | 3,459 |
| 合計 | | | 945,410 | - | 3,459 |

（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。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けておりません。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | 第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 退職給付債務の期首残高 | 263,476 千円 | 2,997,931 千円 |
| 勤務費用 | 135,457 | 199,166 |
| 利息費用 | 19,818 | 22,711 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 113,714 | 40,934 |
| 退職給付の支払額 | 159,115 | 183,403 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | 653,618 |
| 合併による増加 | 2,624,579 | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 2,997,931 | 3,649,089 |

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

| | 第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 年金資産の期首残高 | 196,439 千円 | 2,678,827 千円 |
| 期待運用収益 | 35,926 | 47,553 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 111,449 | 7,066 |
| 事業主からの拠出額 | 210,960 | 107,823 |
| 退職給付の支払額 | 139,379 | 142,532 |
| 合併による増加 | 2,486,329 | - |
| 年金資産の期末残高 | 2,678,827 | 2,698,738 |

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|-------------------------|------------------------|------------------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | 2,422,447 千円 | 3,471,120 千円 |
| 年金資産 | 2,678,827 | 2,698,738 |
| | 256,380 | 772,381 |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 575,484 | 177,969 |
| 未積立退職給付債務 | 319,103 | 950,350 |
| 未認識数理計算上の差異 | 310,139 | 207,810 |
| 未認識過去勤務費用 | - | 615,490 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産 の純額 | 8,964 | 127,049 |
| 退職給付引当金 | 508,142 | 590,154 |
| 前払年金費用 | 499,178 | 463,105 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産 の純額 | 8,964 | 127,049 |

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) | 第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日) |
|------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 勤務費用 | 135,457 千円 | 199,166 千円 |

| | | |
|-----------------|---------|---------|
| 利息費用 | 19,818 | 22,711 |
| 期待運用収益 | 35,926 | 47,553 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 13,847 | 54,327 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | - | 38,127 |
| その他 | 65,395 | 28,533 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 198,592 | 295,314 |

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|-----|------------------------|------------------------|
| 債券 | 58.1 % | 62.9 % |
| 株式 | 35.5 | 33.3 |
| その他 | 6.3 | 3.7 |
| 合計 | 100 | 100 |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 割引率 | 0.077～0.71% | 0.061～0.90% |
| 長期期待運用収益率 | 1.5～1.8% | 1.5～1.8% |

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円であります。

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生時の主な原因別の内訳

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 減損損失 | 475,116 千円 | 455,165 千円 |
| 投資有価証券評価損 | 238,391 | 242,551 |
| ゴルフ会員権評価損 | 295 | 295 |
| 未払事業税 | 185,473 | 124,367 |
| 賞与引当金 | 272,346 | 260,374 |
| 役員賞与引当金 | - | 11,509 |
| 役員退職慰労引当金 | 51,071 | 50,969 |
| 退職給付引当金 | 155,593 | 180,726 |
| 減価償却超過額 | 29,059 | 19,277 |
| 委託者報酬 | 204,395 | 217,902 |
| 長期差入保証金 | 6,344 | 14,803 |
| 時効後支払損引当金 | 78,725 | 77,490 |

| | | |
|---------------|-----------|-----------|
| 連結納税適用による時価評価 | 309,675 | 236,450 |
| その他 | 69,525 | 68,614 |
| 繰延税金資産 小計 | 2,076,013 | 1,960,499 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産 合計 | 2,076,013 | 1,960,499 |
| 繰延税金負債 | | |
| 未収配当金 | 1,228 | - |
| 前払年金費用 | 152,848 | 141,802 |
| 連結納税適用による時価評価 | 1,516 | 1,447 |
| その他有価証券評価差額金 | 639,013 | 659,638 |
| 繰延ヘッジ損益 | 2,889 | - |
| その他 | 6 | 3 |
| 繰延税金負債 合計 | 797,502 | 802,893 |
| 繰延税金資産の純額 | 1,278,511 | 1,157,605 |

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

| | 第31期 (平成28年3月31日現在) | 第32期 (平成29年3月31日現在) |
|--------------------------|------------------------|--|
| 法定実効税率 (調整) | 33.06 % | 法定実効税率と税効果会計 適用後の法人税等の負担率 との差が法定実効税率の100 分の5以下であるため注記を 省略しております。 |
| 評価性引当額の減少 | 6.34 | |
| 税率変更による期末繰延税金資産 の減額修正 | 0.59 | |
| その他 | 0.02 | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負 担率 | 27.33 | |

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31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31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31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]

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。

[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]

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。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

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。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-----|----------------------|---------|------------------|---------|---------------------|---|---------------------------------|-------------------------------------|-----------------|-------------------------------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513 百万円 | 銀行持株会社業 | 被所有 間接 100.0% | 連結納税 役員の兼任 | 連結納税に伴う支払 | 3,980,844 千円 | その他未払金 | 2,296,632 千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、銀行業 | 被所有 直接 51.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料 | 5,895,622 千円 223,695 千円 | 未払手数料 | 805,721 千円 |
| 主要株 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 15.0% | 当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入 | 9,224,647 千円 35,000,000 千円 | 未払手数料 現金及び預金 | 1,806,446 千円 35,000,000 千円 |

| | | | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--------------------|-------------|------|-------------|
| 主 | | | | | | コーラブル預金 に係る受取利息 | 9,263 千円 | 未収収益 | 2,372 千円 |
|---|--|--|--|--|--|--------------------|-------------|------|-------------|

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

| 種類 | 会社等の 名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の 内容 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|------|----------------------|---------|------------------|-------------|----------------------------|---|-------------------------------|-----------------|------------|-----------------|
| 親会社 | (株)三菱UFJフィナンシャル・グループ | 東京都千代田区 | 2,141,513 百万円 | 銀行持株 会社業 | 被所有 間接 100.0% | 連結納税 役員の兼任 | 連結納税に伴う支払 | 4,204,969 千円 | その他未払 金 | 2,071,256 千円 |
| 親会社 | 三菱UFJ 信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 324,279 百万円 | 信託業、 銀行業 | 被所有 直接 51.0% | 当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等 | 投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 | 5,983,874 千円 | 未払手数料 | 716,117 千円 |
| | | | | | | 投資の助言 役員の兼任 | 投資助言料 | 662,992 千円 | 未払費用 | 352,297 千円 |
| 主要株主 | (株)三菱東京UFJ銀行 | 東京都千代田区 | 1,711,958 百万円 | 銀行業 | 被所有 直接 15.0% | 当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等 | 投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 | 7,878,591 千円 | 未払手数料 | 1,276,937 千円 |

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|------------------------|---------|---------------|-------|----------------|--------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 6,398,782 千円 | 未払手数料 | 898,096 千円 |

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|-------------|------------------------|---------|---------------|-------|----------------|--------------------------------|-------------------|-----------------|-------|---------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱ | 東京都千代田区 | 40,500 百万円 | 証券業 | なし | 当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 | 6,532,238 千円 | 未払手数料 | 933,908 千円 |

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

| | 第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日） | 第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日） |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 532,213.85円 | 466,028.30円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 66,691.34円 | 60,318.47円 |

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期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。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) | 第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日) |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益金額 (千円) | 12,660,003 | 12,762,244 |
| 普通株主に帰属しない金額 (千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益金額 (千円) | 12,660,003 | 12,762,244 |
| 普通株式の期中平均株式数 (株) | 189,829 | 211,581 |

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

| 第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在) | |
|------------------------------|------------|
| (資産の部) | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 46,287,102 |
| 有価証券 | 78,897 |
| 前払費用 | 496,625 |
| 未収入金 | 87,286 |
| 未収委託者報酬 | 9,160,402 |
| 未収収益 | 681,527 |
| 繰延税金資産 | 471,973 |
| 金銭の信託 | 30,000 |
| その他 | 95,228 |
| 流動資産合計 | 57,389,043 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 建物 | 1 780,721 |
| 器具備品 | 1 764,182 |
| 土地 | 1,356,000 |
| 有形固定資産合計 | 2,900,904 |
| 無形固定資産 | |
| 電話加入権 | 15,822 |
| ソフトウェア | 1,938,735 |
| ソフトウェア仮勘定 | 1,212,251 |
| 無形固定資産合計 | 3,166,809 |
| 投資その他の資産 | |
| 投資有価証券 | 28,266,735 |
| 関係会社株式 | 320,136 |
| 長期差入保証金 | 640,950 |
| 前払年金費用 | 448,902 |
| 繰延税金資産 | 451,891 |
| その他 | 45,230 |
| 貸倒引当金 | 23,600 |
| 投資その他の資産合計 | 30,150,247 |
| 固定資産合計 | 36,217,960 |
| 資産合計 | 93,607,004 |

(単位：千円)

第33期中間会計期間
(平成29年9月30日現在)

| | |
|-----------|------------|
| (負債の部) | |
| 流動負債 | |
| 預り金 | 196,841 |
| 未払金 | |
| 未払収益分配金 | 174,797 |
| 未払償還金 | 514,622 |
| 未払手数料 | 3,754,874 |
| その他未払金 | 2,503,473 |
| 未払費用 | 4,229,858 |
| 未払消費税等 | 2 305,160 |
| 未払法人税等 | 792,896 |
| 賞与引当金 | 863,522 |
| 役員賞与引当金 | 66,649 |
| その他 | 776,417 |
| 流動負債合計 | 14,179,114 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 651,492 |
| 役員退職慰労引当金 | 163,557 |
| 時効後支払損引当金 | 252,546 |
| 固定負債合計 | 1,067,596 |
| 負債合計 | 15,246,710 |

(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 | 22,251,535 |
| 利益剰余金合計 | 29,592,124 |
| 株主資本合計 | 76,324,968 |

(単位：千円)

第33期中間会計期間
(平成29年9月30日現在)

| | |
|------------|------------|
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券 | 2,035,325 |
| 評価差額金 | |
| 評価・換算差額等合計 | 2,035,325 |
| 純資産合計 | 78,360,294 |
| 負債純資産合計 | 93,607,004 |

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自平成29年4月1日

至平成29年9月30日)

| | | |
|-------------|---|------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 38,184,632 |
| 投資顧問料 | | 1,346,730 |
| その他営業収益 | | 26,405 |
| 営業収益合計 | | 39,557,767 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | | 15,720,488 |
| 広告宣伝費 | | 318,084 |
| 公告費 | | 500 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | | 861,247 |
| 委託調査費 | | 6,711,776 |
| 事務委託費 | | 436,601 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | | 85,593 |
| 印刷費 | | 251,837 |
| 協会費 | | 24,207 |
| 諸会費 | | 7,746 |
| 事務機器関連費 | | 821,139 |
| その他営業雑経費 | | 13,599 |
| 営業費用合計 | | 25,252,824 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | | 178,839 |
| 給料・手当 | | 2,821,754 |
| 賞与引当金繰入 | | 863,522 |
| 役員賞与引当金繰入 | | 66,649 |
| 福利厚生費 | | 619,913 |
| 交際費 | | 6,009 |
| 旅費交通費 | | 93,328 |
| 租税公課 | | 222,435 |
| 不動産賃借料 | | 341,770 |
| 退職給付費用 | | 210,625 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 23,884 |
| 固定資産減価償却費 | 1 | 512,328 |
| 諸経費 | | 199,624 |
| 一般管理費合計 | | 6,160,685 |
| 営業利益 | | 8,144,257 |

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自平成29年4月1日

至平成29年9月30日)

| | | |
|-----------|--|---------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | | 134,154 |
| 受取利息 | | 277 |
| 投資有価証券償還益 | | 29,656 |

| | |
|--------------|-----------|
| 収益分配金等時効完成分 | 34,222 |
| その他 | 9,043 |
| 営業外収益合計 | 207,354 |
| 営業外費用 | |
| 投資有価証券償還損 | 20,261 |
| 時効後支払損引当金繰入 | 26,116 |
| その他 | 5,612 |
| 営業外費用合計 | 51,990 |
| 経常利益 | 8,299,622 |
| 特別利益 | |
| 投資有価証券売却益 | 196,888 |
| ゴルフ会員権売却益 | 2,495 |
| 特別利益合計 | 199,383 |
| 特別損失 | |
| 投資有価証券売却損 | 60,319 |
| 固定資産除却損 | 0 |
| 特別損失合計 | 60,319 |
| 税引前中間純利益 | 8,438,686 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,631,045 |
| 法人税等調整額 | 4,911 |
| 法人税等合計 | 2,626,133 |
| 中間純利益 | 5,812,552 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至 平成29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 | | | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 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 | | 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 | 43,034,713 | 50,375,303 | 97,108,147 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 26,595,731 | 26,595,731 | 26,595,731 |
| 中間純利益 | | | | | | | 5,812,552 | 5,812,552 | 5,812,552 |
| 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 | | | | | | | 20,783,178 | 20,783,178 | 20,783,178 |
| 当中間期末残高 | 2,000,131 | 3,572,096 | 41,160,616 | 44,732,712 | 342,589 | 6,998,000 | 22,251,535 | 29,592,124 | 76,324,968 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------|--------------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 1,494,586 | 1,494,586 | 98,602,734 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 26,595,731 |
| 中間純利益 | | | 5,812,552 |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|-----------|------------|
| 株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額) | 540,738 | 540,738 | 540,738 |
| 当中間期変動額合計 | 540,738 | 540,738 | 20,242,440 |
| 当中間期末残高 | 2,035,325 | 2,035,325 | 78,360,294 |

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。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。

3. 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。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(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。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(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。

[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33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在) |
|------|------------------------------|
| 建物 | 571,713千円 |
| 器具備品 | 1,115,446千円 |

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33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日) |
|--------|---|
| 有形固定資産 | 114,767千円 |
| 無形固定資産 | 397,560千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29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29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 | 26,595,731千円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 125,700円 |
| 基準日 | 平成29年3月31日 |
| 効力発生日 | 平成29年6月29日 |

(リース取引関係)

第33期中間会計期間(平成29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 | 1,634,641千円 |
| 合 計 | 2,312,757千円 |

(金融商品関係)

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成29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 | 46,287,102 | 46,287,102 | - |
| (2) 有価証券 | 78,897 | 78,897 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 9,160,402 | 9,160,402 | - |
| (4) 投資有価証券 | 28,129,575 | 28,129,575 | - |
| 資産計 | 83,655,978 | 83,655,978 | - |
| (1) 未払手数料 | 3,754,874 | 3,754,874 | - |
| 負債計 | 3,754,874 | 3,754,874 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、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。

(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137,160千円）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33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

| | 種類 | 中間貸借対照表 計上額（千円） | 取得原価 （千円） | 差額（千円） |
|--------------------------------|-----|--------------------|--------------|-----------|
| 中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの | 株式 | - | - | - |
| | 債券 | - | - | - |
| | その他 | 21,493,708 | 18,316,441 | 3,177,266 |
| | 小計 | 21,493,708 | 18,316,441 | 3,177,266 |
| 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 | 6,714,765 | 6,958,415 | 243,650 |
| | 小計 | 6,714,765 | 6,958,415 | 243,650 |
| 合計 | | 28,208,473 | 25,274,857 | 2,933,616 |

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29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33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区別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33期中間会計期間 （平成29年9月30日現在） |
|-----------|------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 370,356.00円 |
| （算定上の基礎） | |

| | |
|--------------------------------------|------------|
| 純資産の部の合計額（千円） | 78,360,294 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額（千円） | 78,360,294 |
| 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33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日) |
| 1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎) | 27,471.99円 |
| 中間純利益金額（千円） | 5,812,552 |
| 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） | 5,812,552 |
| 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。

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。)

通常の取引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29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29年3月末現在） | 事業の内容 |
|-----------------------|-----------------------|-------------------------------|
| 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：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払い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29年11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【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、また使用開始日、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（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- （3）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- （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29年6月28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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績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

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。

独立監査人の監査報告書

平成29年12月13日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランス・タイプ（ミリオン）の平成28年11月8日から平成29年11月7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、バランス・タイプ（ミリオン）の平成29年11月7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。

その他の事項

ファンドの平成28年11月7日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成28年12月20日付けで無限定適正意見を表明している。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1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 | 青木 裕晃 | 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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。