

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成29年5月12日

【発行者名】 三菱UFJ国際投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 松田 通

【本店の所在の場所】 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【事務連絡者氏名】 伊藤 晃

連絡場所 東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資 日本配当追求株ファンド（価格変動抑制型）  
信託受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資 当初自己設定額 5,000万円  
信託受益証券の金額】 継続募集額 上限1兆円

【縦覧に供する場所】 該当ありません

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で<sup>有価証券報告書</sup>を提出致しましたので、平成28年10月7日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新等するため、提出するものです。

## 【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_は訂正部分を示し、原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とし、原届出書に追加される内容を記載する場合は<追加>とします。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## [ファンドの目的・特色]

<更新後>

(略)



株式の投資にあたっては、配当利回りに着目し、銘柄を選定します。

## ■運用プロセス

## 銘柄スクリーニング

## 投資対象:主としてTOPIX500指数採用銘柄

TOPIX500とは、東京証券取引所第一部上場銘柄(内国普通株式)の中から、時価総額および流動性の高い500銘柄で構成される株価指数であり、東京証券取引所第一部上場銘柄の時価総額の90%程度をカバーしています。

## 財務スクリーニング:財務健全性が低い銘柄の除外

## 連続増配銘柄スクリーニング:組入候補銘柄の選定

予想配当利回り等の定量評価+業績動向等の定性評価  
 予想配当利回り、財務状況および配当の持続性等といったファンダメンタルズ等の観点から総合的な銘柄評価を行い、ポートフォリオの予想配当利回りがTOPIX500を上回るポートフォリオの構築をめざします。

## ポートフォリオ構築(マザーファンド)

株価指数先物を売建て、  
 株式市場全体の値動きを抑えます。

## ポートフォリオ構築

(略)



年2回の決算時（2・8月の各15日（休業日の場合は翌営業日））に分配を行います。

- ◆ 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- ◆ 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### ■主な投資制限

---

（略）

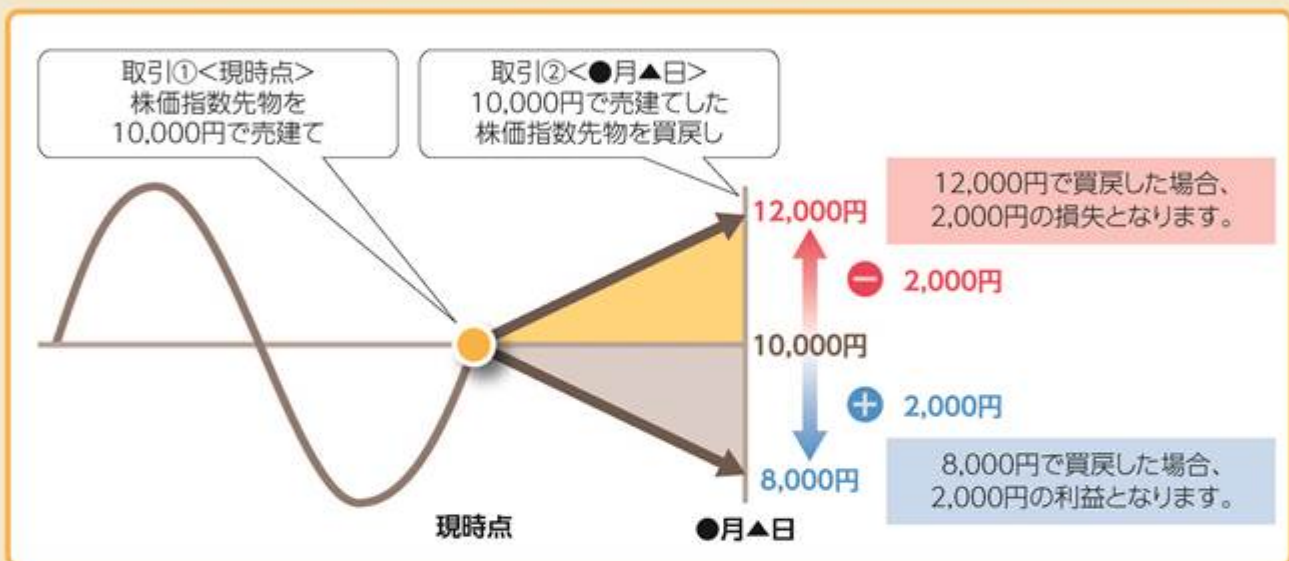
## 追加的記載事項(株価指数先物の「売建て」について)

### 株価指数先物の「売建て」とは…

先物取引とは、将来のあらかじめ定められた期日に、特定の商品(原資産)を、現時点で取り決めた価格(先物価格)で売買する事を約束する取引で、値動きのある資産の不確実な値動きに備えるための手段の一つとして、広く活用されています。

株価指数先物の「売建て」とは、将来時点の株価指数について、現時点の先物価格で「売る」取引のことです。

例えば、原資産を保有していた場合、株価指数先物の「売建て」を行っておけば仮に将来、資産の価格が下落した場合でも、値下がりした時点で株価指数先物を買戻すことによって、損失を回避することが期待されます。



株価指数先物を売建てた場合、株価指数先物の価格が上昇すればファンドにとってマイナス、下落すればファンドにとってプラスの影響が期待されます。

- ❗ 上記は株価指数先物の概要を説明するために表したものであり、将来の市場環境の変動や運用状況・成果を示唆・保証するものではありません。
- ❗ 株価指数先物は、買う約束をすることも可能です。また、期日まで待たずに反対売買を行うことにより、損益を確定することもできます。

(略)

## (2) 【ファンドの沿革】

<更新後>

平成28年10月24日 設定日、信託契約締結、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金  
2,000百万円（平成29年2月末現在）  
（略）
- ・大株主の状況（平成29年2月末現在）  
（略）

## 3 【投資リスク】

### (2) 投資リスクに対する管理体制

<更新後>

（略）

流動性リスク

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



## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村証券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (5)【課税上の取扱い】

<更新後>

(略)

上記は平成29年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

## 5【運用状況】

&lt;更新後&gt;

## (1)【投資状況】

平成29年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,722,764,236	74.36
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,662,846,935	25.64
純資産総額		10,385,611,171	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2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (売建)	7,593,300,000	73.11

(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2月28日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	ジャパン株式インカム マ ザーファンド	親投資信託 受益証券		4,527,887,099	1.7254 1.7056	7,812,791,016 7,722,764,236		74.36

(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2月28日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	74.36
合計	74.36

(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2月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引						
TOPIX 17年03月限	大阪取引所	売建	491	7,632,523,660	7,531,940,000	72.52
ミニTOPIX先物 17年03月限	大阪取引所	売建	40	61,952,652	61,360,000	0.59

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

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成29年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成29年2月15日)	9,932,731,431 (分配付) 9,922,907,530 (分配落)	10,111 (分配付) 10,101 (分配落)
平成28年10月末日	50,178,329	10,036
11月末日	1,861,227,811	10,134
12月末日	6,955,010,167	10,194
平成29年1月末日	9,404,437,784	10,152



2月末日	10,385,611,171	10,109
------	----------------	--------

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	10円

## 【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	1.11

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

## （4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	10,003,670,773	179,768,855	9,823,901,918

&lt;参考&gt;

「ジャパン株式インカム マザーファンド」

## （1）投資状況

平成29年2月28日現在  
（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	11,156,513,420	97.82
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		249,090,295	2.18
純資産総額		11,405,603,715	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2月28日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	イオンフィナンシャルサービス	株式	その他金融業	113,100	2,112.86	238,965,078		2.16
					2,174.00	245,879,400		
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	54,500	4,245.28	231,367,818		2.14
					4,481.00	244,214,500		
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	46,700	4,942.84	230,830,688		2.14
					5,222.00	243,867,400		
日本	りそなホールディングス	株式	銀行業	375,100	622.25	233,408,287		2.06
					627.00	235,187,700		
日本	大日本印刷	株式	その他製品	192,000	1,200.31	230,460,174		2.06
					1,222.00	234,624,000		
日本	デンカ	株式	化学	401,000	529.05	212,150,893		2.06
					585.00	234,585,000		
日本	奥村組	株式	建設業	330,000	680.20	224,467,165		2.05
					710.00	234,300,000		
日本	日清紡ホールディングス	株式	電気機器	204,000	1,131.32	230,789,685		2.05
					1,146.00	233,784,000		
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	47,300	4,875.88	230,629,508		2.04
					4,919.00	232,668,700		
日本	島忠	株式	小売業	81,400	2,941.27	239,419,598		2.03
					2,851.00	232,071,400		
日本	住友ゴム工業	株式	ゴム製品	124,900	1,869.44	233,493,621		2.03
					1,854.00	231,564,600		
日本	ソニーフィナンシャルホールディングス	株式	保険業	117,000	1,872.74	219,110,580		2.02
					1,974.00	230,958,000		
日本	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	310,700	736.61	228,866,030		2.01
					738.40	229,420,880		
日本	第一三共	株式	医薬品	89,500	2,492.72	223,098,584		2.01
					2,560.50	229,164,750		
日本	JXホールディングス	株式	石油・石炭製品	421,700	513.22	216,427,069		1.98
					535.10	225,651,670		
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	1,069,100	213.33	228,072,351		1.97
					209.70	224,190,270		

日本	デンソー	株式	輸送用機器	44,900	5,081.05 4,992.00	228,139,547 224,140,800	1.97
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	64,000	3,491.25 3,489.00	223,440,171 223,296,000	1.96
日本	オリックス	株式	その他金融業	127,300	1,829.25 1,747.50	232,863,622 222,456,750	1.95
日本	大和ハウス工業	株式	建設業	72,000	3,284.21 3,084.00	236,463,392 222,048,000	1.95
日本	サンリオ	株式	卸売業	99,200	2,306.60 2,225.00	228,815,122 220,720,000	1.94
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	50,400	4,523.55 4,377.00	227,987,217 220,600,800	1.93
日本	野村不動産ホールディングス	株式	不動産業	115,500	1,980.42 1,906.00	228,739,661 220,143,000	1.93
日本	ワコールホールディングス	株式	繊維製品	156,000	1,378.27 1,411.00	215,010,733 220,116,000	1.93
日本	エーザイ	株式	医薬品	34,700	6,626.44 6,301.00	229,937,564 218,644,700	1.92
日本	大東建託	株式	建設業	13,900	17,522.11 15,720.00	243,557,429 218,508,000	1.92
日本	科研製薬	株式	医薬品	36,100	6,034.50 6,040.00	217,845,659 218,044,000	1.91
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	143,700	1,568.26 1,512.00	225,359,747 217,274,400	1.90
日本	KDDI	株式	情報・通信業	73,800	3,047.99 2,939.00	224,941,909 216,898,200	1.90
日本	ユー・エス・エス	株式	サービス業	112,300	1,929.96 1,924.00	216,735,515 216,065,200	1.89

（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2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	建設業	9.32
	繊維製品	1.93
	化学	5.87
	医薬品	10.01
	石油・石炭製品	1.98
	ゴム製品	4.17
	ガラス・土石製品	0.89
	機械	3.21
	電気機器	6.77
	輸送用機器	7.75
	精密機器	1.08
	その他製品	2.06
	電気・ガス業	1.75
	情報・通信業	8.43
	卸売業	3.80
	小売業	2.03
	銀行業	9.87
	証券、商品先物取引業	1.62
	保険業	5.48
	その他金融業	5.98
不動産業	1.93	
サービス業	1.89	
合計	97.82	

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

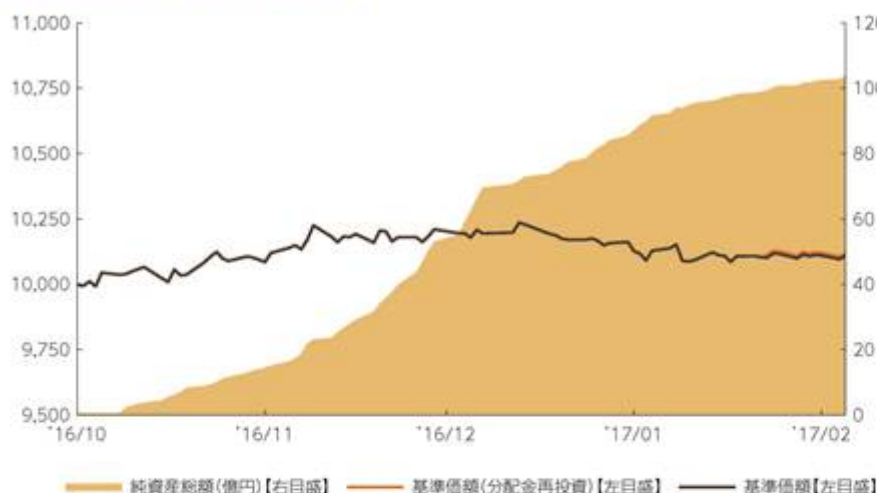
[ 参考情報 ]



## 運用実績

2017年2月28日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2016年10月24日(設定日)～2017年2月28日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- 基準価額、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	10,109円
純資産総額	103.8億円

### ■分配の推移

2017年 2月	10円
設定来累計	10円

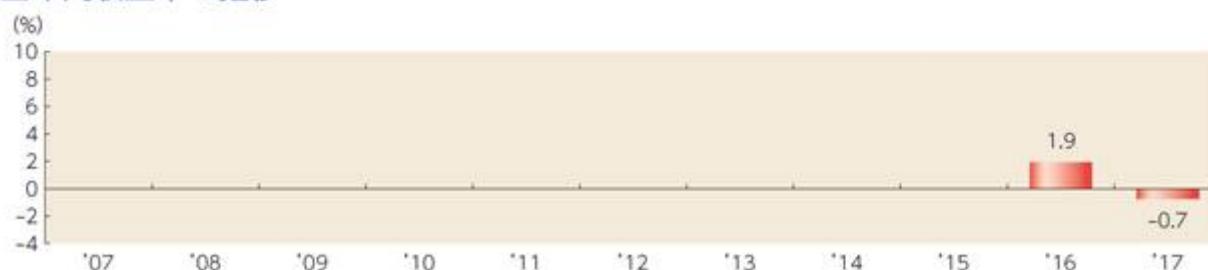
•分配金は1万口当たり、税引前

### ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位銘柄	業種	比率
現物株式	72.7%	1 イオンフィナンシャルサービス	その他金融業	1.6%
株価指数先物等	-73.1%	2 プリヂストーン	ゴム製品	1.6%
		3 武田薬品工業	医薬品	1.6%
		4 りそなホールディングス	銀行業	1.5%
		5 大日本印刷	その他製品	1.5%
		6 デンカ	化学	1.5%
		7 奥村組	建設業	1.5%
		8 日清紡ホールディングス	電気機器	1.5%
		9 東京海上ホールディングス	保険業	1.5%
株式(実質)	-0.4%	10 島忠	小売業	1.5%

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

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2016年は設定日から年末までの、2017年は年初から2月28日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- 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 当ファンドの第1期計算期間は、約款第39条により、平成28年10月24日から平成29年2月15日までとしております。
- 3 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10月24日から平成29年2月15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】

## 【日本配当追求株ファンド（価格変動抑制型）】

## (1)【貸借対照表】

	第 1 期 [ 平成29年2月15日現在 ]	
	金 額 (円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,200,091,141
親投資信託受益証券		7,512,791,016
派生商品評価勘定		34,460
前払金		112,403,250
差入委託証拠金		298,746,000
流動資産合計		10,124,065,867
資産合計		10,124,065,867
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		171,642,852
未払金		327,978
未払収益分配金		9,823,901
未払解約金		5,870,664
未払受託者報酬		640,456
未払委託者報酬		12,809,151
未払利息		1,746
その他未払費用		41,589
流動負債合計		201,158,337
負債合計		201,158,337
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,823,901,918
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		99,005,612
元本等合計		9,922,907,530
純資産合計		9,922,907,530
負債純資産合計		10,124,065,867

## (2)【損益及び剰余金計算書】

	第 1 期 自 平成28年10月24日 至 平成29年 2月15日	
	金 額 (円)	
営業収益		
受取利息		7,475
有価証券売買等損益		220,074,379
派生商品取引等損益		248,757,436
営業収益合計		28,675,582
営業費用		
支払利息		148,054
受託者報酬		640,456
委託者報酬		12,809,151
その他費用		41,589
営業費用合計		13,639,250
営業利益又は営業損失 ( )		42,314,832
経常利益又は経常損失 ( )		42,314,832
当期純利益又は当期純損失 ( )		42,314,832
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 ( )		121,999
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		
剰余金増加額又は欠損金減少額		153,441,774
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		153,441,774
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,419,428
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,419,428
分配金	1	9,823,901
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		99,005,612

## (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。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第 1 期 [ 平成29年2月15日現在 ]
1 期首元本額	50,000,000円
期中追加設定元本額	9,953,670,773円
期中一部解約元本額	179,768,855円
2 受益権の総数	9,823,901,918口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0101円 (10,101円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期 (自 平成28年10月24日 至 平成29年2月15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	108,829,513円
分配準備積立金額	D	
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	108,829,513円
当ファンドの期末残存口数	F	9,823,901,918口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	110円
1万口当たり分配金額	H	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	9,823,901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 1 期 (自 平成28年10月24日 至 平成29年 2月15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。
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、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3 金融商品に係るリスク管理体制	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。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 1 期 [ 平成29年2月15日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。



（有価証券に関する注記）  
 売買目的有価証券

種 類	第 1 期 [ 平成29年2月15日現在 ]	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	220,074,379	
合計	220,074,379	

（デリバティブ取引に関する注記）  
 取引の時価等に関する事項  
 株式関連

区 分	種 類	第 1 期 [ 平成29年2月15日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 売建	7,190,018,000		7,361,370,000	171,352,000
	合 計	7,190,018,000		7,361,370,000	171,352,000

（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。

#### （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	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	ジャパン株式インカム マザーファンド	4,352,970,054	7,512,791,016	
	親投資信託受益証券 小計	4,352,970,054	7,512,791,016	
	合計	4,352,970,054	7,512,791,016	

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。

< 参考 >

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

[次へ](#)

「ジャパン株式インカム マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

		[ 平成29年2月15日現在 ]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		274,890,006
株式		10,754,970,090
未収配当金		12,674,500
流動資産合計		11,042,534,596
資産合計		11,042,534,596
負債の部		
流動負債		
未払利息		218
流動負債合計		218
負債合計		218
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,398,135,798
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		4,644,398,580
元本等合計		11,042,534,378
純資産合計		11,042,534,378
負債純資産合計		11,042,534,596

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月7日から7月6日まで、および7月7日から翌年1月6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。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		[ 平成29年2月15日現在 ]
1 期首		平成28年10月24日
期首元本額		2,403,873,150円
期首からの追加設定元本額		4,704,862,951円
期首からの一部解約元本額		710,600,303円
元本の内訳*		
ジャパン株式インカム(3ヵ月決算型)		149,556,378円
好配当優良株ジャパン・オープン		1,895,609,366円
日本配当追求株ファンド(価格変動抑制型)		4,352,970,054円
(合計)		6,398,135,798円
2 受益権の総数		6,398,135,798口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		1.7259円 (17,259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28年10月24日 至平成29年2月15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。
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。
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[ 平成29年2月15日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載してあります。デリバティブ取引は、該当事項はありません。

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。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。
---------------------------	--

（有価証券に関する注記）  
売買目的有価証券

種 類	[平成29年2月15日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	61,709,177	
合計	61,709,177	

（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  
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。

（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	
1833	奥村組	314,000	707.00	221,998,000	
1878	大東建託	13,200	15,980.00	210,936,000	
1925	大和ハウス工業	68,600	3,132.00	214,855,200	
1928	積水ハウス	114,400	1,848.00	211,411,200	
1951	協和エクシオ	105,100	1,585.00	166,583,500	
3591	ワコールホールディングス	149,000	1,427.00	212,623,000	
3405	クラレ	43,300	1,717.00	74,346,100	
4061	デンカ	382,000	615.00	234,930,000	
4185	J S R	74,600	2,086.00	155,615,600	
4206	アイカ工業	68,800	2,964.00	203,923,200	
4502	武田薬品工業	44,500	5,193.00	231,088,500	
4503	アステラス製薬	136,800	1,545.00	211,356,000	
4508	田辺三菱製薬	6,300	2,315.00	14,584,500	
4521	科研製薬	34,400	5,870.00	201,928,000	
4523	エーザイ	33,000	6,197.00	204,501,000	
4568	第一三共	85,300	2,595.00	221,353,500	
5020	J Xホールディングス	401,600	539.10	216,502,560	
5108	ブリヂストン	51,900	4,281.00	222,183,900	
5110	住友ゴム工業	119,000	1,769.00	210,511,000	
5214	日本電気硝子	138,000	706.00	97,428,000	
6113	アマダホールディングス	158,100	1,316.00	208,059,600	
6301	小松製作所	24,800	2,854.00	70,779,200	
7011	三菱重工業	182,000	455.80	82,955,600	
3105	日清紡ホールディングス	194,300	1,137.00	220,919,100	
4902	コニカミノルタ	179,400	1,119.00	200,748,600	
6845	アズビル	37,000	3,575.00	132,275,000	
6952	カシオ計算機	121,700	1,554.00	189,121,800	
6902	デンソー	42,700	5,076.00	216,745,200	
7201	日産自動車	185,600	1,127.00	209,171,200	
7202	いすゞ自動車	15,400	1,560.00	24,024,000	
7267	本田技研工業	61,000	3,631.00	221,491,000	
7270	富士重工業	44,500	4,383.00	195,043,500	
7762	シチズン時計	160,700	724.00	116,346,800	
7912	大日本印刷	183,000	1,212.00	221,796,000	
9532	大阪瓦斯	439,000	432.90	190,043,100	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	63,700	3,100.00	197,470,000	
9432	日本電信電話	42,100	4,767.00	200,690,700	
9433	K D D I	70,300	2,967.00	208,580,100	
9435	光通信	10,100	10,690.00	107,969,000	
9437	N T T ドコモ	76,700	2,681.00	205,632,700	
8130	サンゲツ	104,500	1,935.00	202,207,500	
8136	サンリオ	94,400	2,269.00	214,193,600	
8184	島忠	76,400	2,873.00	219,497,200	

8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	295,900	768.50	227,399,150	
8308	りそなホールディングス	357,200	623.50	222,714,200	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	51,000	4,219.00	215,169,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	48,000	4,576.00	219,648,000	
8411	みずほフィナンシャルグループ	1,018,200	210.90	214,738,380	
8473	SBIホールディングス	111,700	1,575.00	175,927,500	
8725	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	40,600	3,936.00	159,801,600	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	111,400	2,042.00	227,478,800	
8766	東京海上ホールディングス	45,000	5,018.00	225,810,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	107,700	2,088.00	224,877,600	
8586	日立キャピタル	69,900	2,944.00	205,785,600	
8591	オリックス	121,200	1,742.50	211,191,000	
3231	野村不動産ホールディングス	110,000	1,954.00	214,940,000	
4732	ユー・エス・エス	107,000	2,010.00	215,070,000	
	合 計	7,546,000		10,754,970,090	

(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  
該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## &lt;更新後&gt;

## 【純資産額計算書】

平成29年2月28日現在

(単位:円)

資産総額	10,487,554,586
負債総額	101,943,415
純資産総額( - )	10,385,611,171
発行済口数	10,273,837,258 口
1口当たり純資産価額( / )	1.0109 ( 1万口当たり 10,109 )

## &lt;参考&gt;

## 「ジャパン株式インカム マザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成29年2月28日現在

(単位:円)

資産総額	11,594,454,977
負債総額	188,851,262
純資産総額( - )	11,405,603,715
発行済口数	6,687,244,072 口
1口当たり純資産価額( / )	1.7056 ( 1万口当たり 17,056 )

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### （1）資本金の額等

<更新後>

平成29年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成29年2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	801	10,561,100
追加型公社債投資信託	16	1,463,930
単位型株式投資信託	57	483,850
単位型公社債投資信託	2	58,722
合計	876	12,567,602

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。



### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ国際投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度に係る中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

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

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

(第31期事業年度の財務諸表は省略)

[次へ](#)

<追加>  
 中間財務諸表  
 (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間  
 (平成28年9月30日現在)

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

(単位：千円)

第32期中間会計期間  
(平成28年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

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

## 固定負債

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

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

## (純資産の部)

## 株主資本

資本金		2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712

利益剰余金		
利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		36,691,609
利益剰余金合計		44,032,199

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

(単位：千円)

---

第32期中間会計期間  
(平成28年9月30日現在)

---

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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



## (3)中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						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
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
中間純利益							6,419,139	6,419,139	6,419,139
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計							20,388,172	20,388,172	20,388,172
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	36,691,609	44,032,199	90,765,043

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

## [重要な会計方針]

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## （追加情報）

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

## (5) 役員退職慰労引当金

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

## (6) 時効後支払損引当金

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

## 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 6. ヘッジ会計の方法

## (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

## (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

## (3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

## (4) ヘッジの有効性評価の方法

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

## 7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

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

## (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## [会計方針の変更]

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

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

なお、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

## [追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

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

## [注記事項]

（中間貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

## 2. 配当に関する事項

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

## （リース取引関係）

第32期中間会計期間(平成28年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

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

## （金融商品関係）

第32期中間会計期間(平成28年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	62,058,580	62,058,580	-
(2) 有価証券	954,855	954,855	-
(3) 未収委託者報酬	10,268,553	10,268,553	-
(4) 投資有価証券	24,010,186	24,010,186	-
資産計	97,292,175	97,292,175	-
(1) 未払手数料	4,391,508	4,391,508	-
負債計	4,391,508	4,391,508	-
デリバティブ取引( )	10,893	10,893	-

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

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

資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

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

負 債

## (1)未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(中間貸借対照表計上額168,730千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間(平成28年9月30日現在)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上 額が取得原価を超え るもの	株式	90,395	30,541	59,853
	債券	-	-	-
	その他	18,293,929	16,451,094	1,842,834
	小 計	18,384,325	16,481,636	1,902,688
中間貸借対照表計上 額が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,411,985	6,921,318	509,332
	小 計	6,411,985	6,921,318	509,332
合 計		24,796,311	23,402,955	1,393,355

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

(注2) 非上場株式(中間貸借対照表計上額168,730千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(単位：千円)

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

(注) 時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
1株当たり純資産額	433,625.21円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	91,746,856
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	91,746,856
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	30,338.92円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	6,419,139
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	6,419,139
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

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



**第2【その他の関係法人の概況】****1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

&lt;更新後&gt;

(略)

資本金の額：324,279百万円（平成28年9月末現在）

(略)

**(2) 販売会社**

&lt;更新後&gt;

名称	資本金の額 (平成28年9月末現在)	事業の内容
株式会社岩手銀行	12,089 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社百五銀行	20,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
八十二証券株式会社	800 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
篠山証券株式会社	100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ふくおか証券株式会社	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

**3【資本関係】**

&lt;更新後&gt;

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2月末現在）

(略)

## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月15日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 柴 毅 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本配当追求株ファンド（価格変動抑制型）の平成28年10月24日から平成29年2月15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、日本配当追求株ファンド（価格変動抑制型）の平成29年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月30日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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