

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（1987年11月27日設定）	
運用方針	ファミリーファンド方式により、信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	ベビーファンド	ミリオン・インデックス・マザーファンド受益証券
	マザーファンド	日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	日経平均株価に連動した投資成果を目指します。	
主な投資制限	ベビーファンド	・マザーファンドへの投資は、制限を設けません。 ・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50%以下とします。
	マザーファンド	・株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
分配方針	毎年11月7日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益分配方針に基づいて分配を行います。分配対象額の範囲は、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。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場合もあります。）	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

インデックス・タイプ （ミリオン）

第28期（決算日：2015年11月9日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「インデックス・タイプ（ミリオン）」は、去る11月9日に第28期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

国際投信投資顧問株式会社は2015年7月1日に三菱UFJ投信株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

URL: <http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-759311

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆ 目 次

インデックス・タイプ（ミリオン）のご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	1
◇運用経過	2
◇今後の運用方針	6
◇1万口当たりの費用明細	7
◇売買及び取引の状況	8
◇株式売買比率	8
◇利害関係人との取引状況等	9
◇自社による当ファンドの設定・解約状況	9
◇組入資産の明細	10
◇投資信託財産の構成	10
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
◇損益の状況	11
◇分配金のお知らせ	12
◇お知らせ	12

マザーファンドのご報告

◇ミリオン・インデックス・マザーファンド	13
----------------------	----

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク 〔日経平均株価〕		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率				
24期 (2011年11月 7日)	円 3,007	円 5	% △ 9.5	円 8,767.09	% △ 9.9	% 97.1	% 2.7	百万円 2,188
25期 (2012年11月 7日)	3,086	5	2.8	8,972.89	2.3	93.1	6.6	2,112
26期 (2013年11月 7日)	4,894	5	58.7	14,228.44	58.6	91.5	8.1	3,111
27期 (2014年11月 7日)	5,804	5	18.7	16,880.38	18.6	88.4	10.9	3,344
28期 (2015年11月 9日)	6,738	5	16.2	19,642.74	16.4	86.8	12.5	3,398

- (注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。
 (注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
 (注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れていますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。
 (注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク 〔日経平均株価〕		株式組入 比率	株式先物 比率
	騰落率	騰落率				
(期首) 2014年11月 7日	円 5,804	% —	円 16,880.38	% —	% 88.4	% 10.9
11月末	5,994	3.3	17,459.85	3.4	89.6	10.0
12月末	5,986	3.1	17,450.77	3.4	91.9	7.7
2015年 1月末	6,056	4.3	17,674.39	4.7	92.2	7.2
2月末	6,438	10.9	18,797.94	11.4	93.1	6.3
3月末	6,605	13.8	19,206.99	13.8	94.8	4.8
4月末	6,705	15.5	19,520.01	15.6	97.2	2.2
5月末	7,060	21.6	20,563.15	21.8	98.6	1.1
6月末	6,941	19.6	20,235.73	19.9	85.2	14.5
7月末	7,046	21.4	20,585.24	21.9	86.3	13.5
8月末	6,463	11.4	18,890.48	11.9	86.6	13.0
9月末	5,984	3.1	17,388.15	3.0	86.2	13.5
10月末	6,553	12.9	19,083.10	13.0	86.6	13.0
(期末) 2015年11月 9日	6,743	16.2	19,642.74	16.4	86.8	12.5

- (注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
 (注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れていますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。
 (注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークに関して

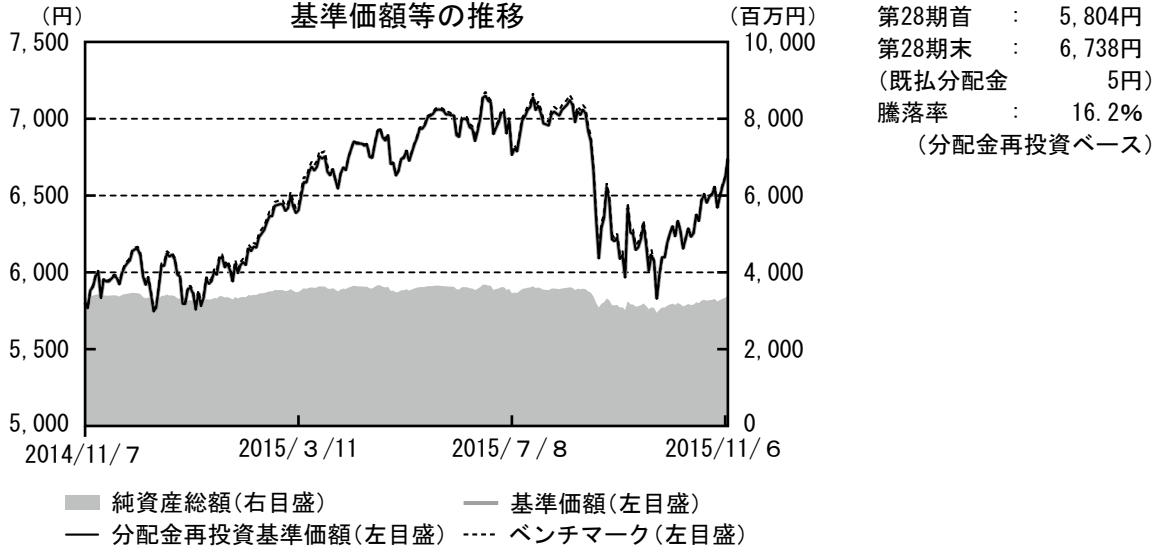
※「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。
 以下、本報告書において上記の「ベンチマークに関して」の記載を省略します。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第28期：2014/11/8～2015/11/9)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ16.2% (分配金再投資ベース) の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率 (16.4%) を0.2%下回りました。



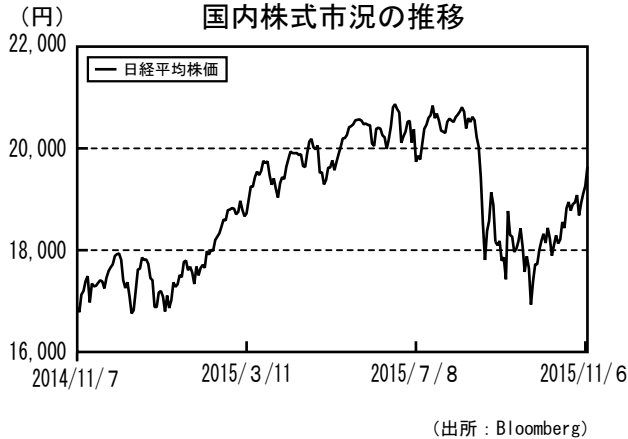
- ・分配金再投資基準価額は、収益分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- ・実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なるため、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の変動要因

上昇要因	円安や原油安による企業収益拡大への期待が高まるなか、相場の重しとなっていたギリシャ債務問題が進展するとの見方が強まったことなどから日経平均株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	中国の景気減速懸念が台頭するなか中国株式市場が急落し、周辺国への波及や世界景気の先行き不安が高まったことなどから日経平均株価が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第28期：2014/11/8～2015/11/9)



◎国内株式市況

- ・期首の日経平均株価 (以下、日経平均と
いいます。)は、16,880.38円で始まりま
した。
- ・2014年11月中旬以降、安倍首相が衆議
院解散・総選挙と消費増税の延期を表
明し、景気の下支え期待の高まりなど
から上昇する場面もあったものの、ギ
リシャの政情不安などが上値を抑えた
なか、原油価格の急落やこれを端緒と
したシアの通貨下落などを受けて下
値模索の展開となり、12月16日には、日経平均
は期中安値となる16,755.32円を付
けました。
- ・その後、米国早期利上げ懸念の後退や米
国株高などを好感して株価は持ち直し、
2015年1月以降は欧州中央銀行(ECB)の
量的金融緩和決定やギリシャ情勢不
安の後退などを受けて株価は戻りを試
す展開となりました。また、円安や原
油安ら株主による企業収益拡大への
期待感などから株価は上昇し、業績
向上・投資拡大のほか、資本効率向
上・目標に掲げた銘柄などが買われ
る展開となりました。
- ・6月に入ると、相場の重しとなってい
たギリシャ債務問題が進展すると見
方が強まったことなどから日経平均
のIT(情報技術)バブル期の高値を上
付けた回り、期中高値となる20,868.03
円を付けました。しかし、ギリシャの
債務不履行協議は難航し、ギリシャ
の債務懸念が再び高まったことから
株価は反落しました。
- ・8月中旬以降、中国の景気減速懸念が
台頭するなか中国株式市場が急落す
ると、周辺国への波及や世界景気の
先行き不安が高まったことなどから
株価がなりました。また、中国政
府が矢継ぎ早に講じた株価対策の
効果が一時的に上値戻りによる米
国の金融政策の先行き不透明感など
から、9月末にかけて株価は大幅に
調整しました。
- ・その後、売られすぎとの見方などから
株価は反発し、新興国経済への影響
が懸念されていた米国の利上げ観測
の後退や欧州の追加金融緩和期待の
高まりを背景とした投資家心理の改
善などから、株価は戻りを試す展
開となり、期末の日経平均は19,642.74
円となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<インデックス・タイプ (ミリオン)>

- ・当ファンドは、ミリオン・インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）にほぼ100%を投資し、実質的な運用はマザーファンドで行っています。

<ミリオン・インデックス・マザーファンド>

- ・基準価額は期首に比べ18.1%の上昇となりました。
- ・マザーファンドの運用については、投資成果をできるだけ日経平均に連動させるため、原則として日経平均採用銘柄の中から200銘柄以上に等株数（みなし額面調整後）投資を行い、一部日経平均先物を利用してしながら株式の組入比率を高位に保っています。また、日経平均採用銘柄の入れ替え等に伴い現物株式の売買を行っています。
- ・マザーファンドの組入比率については現物株式をおおむね85%以上組み入れ、さらに日経平均先物を買って建てることにより、実質株式組入比率をほぼ100%に維持するように調整しました。期末の現物株式組入比率86.8%、先物を含めた実質株式組入比率は99.3%となりました。
- ・結果、マザーファンドの基準価額とベンチマークの月間連動率は99.9%から100.7%の範囲であり、おおむね連動した投資成果となりました。
- ・期末現在では、日経平均採用銘柄全てを組み入れ225銘柄としています。

(ご参考)

日経平均採用銘柄の入れ替に伴う売買

	除 外	組 入
2015年10月	日東紡績	長谷エコーポレーション
	平和不動産	ディー・エヌ・エー

株式組入上位5業種

期首（2014年11月7日）

	業 種	比率
1	電気機器	17.5%
2	小売業	12.2%
3	情報・通信業	11.5%
4	化学	7.5%
5	輸送用機器	7.4%

(注) 比率はマザーファンドの株式の評価総額に対する各業種の割合です。

期末（2015年11月9日）

	業 種	比率
1	電気機器	17.4%
2	小売業	12.1%
3	情報・通信業	10.8%
4	化学	8.2%
5	医薬品	7.6%

(注) 比率はマザーファンドの株式の評価総額に対する各業種の割合です。

株式組入上位10銘柄

期首 (2014年11月7日)

	銘柄	比率
1	ファーストリテイリング	8.7%
2	ソフトバンクグループ	4.8%
3	ファナック	4.1%
4	KDDI	3.0%
5	京セラ	2.1%
6	アステラス製薬	1.8%
7	東京エレクトロン	1.5%
8	信越化学工業	1.5%
9	本田技研工業	1.5%
10	ダイキン工業	1.5%

(注) 比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

期末 (2015年11月9日)

	銘柄	比率
1	ファーストリテイリング	8.1%
2	ファナック	3.8%
3	ソフトバンクグループ	3.6%
4	KDDI	3.1%
5	京セラ	2.1%
6	アステラス製薬	1.6%
7	TDK	1.5%
8	日東電工	1.5%
9	ダイキン工業	1.4%
10	セコム	1.4%

(注) 比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

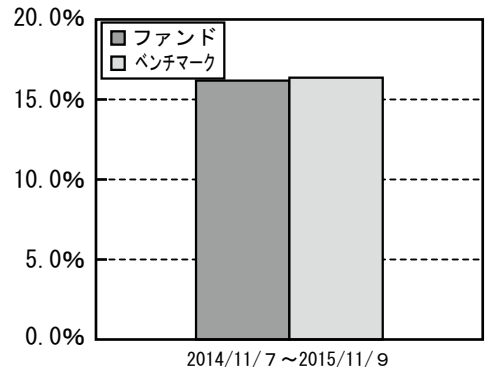
<インデックス・タイプ (ミリオン)>

- ・基準価額は期首に比べ、16.2% (分配金再投資ベース) の上昇となり、ベンチマークとの乖離は0.2%程度となりました。
- ・ファンドの騰落率はベンチマークに対して0.2%下回りました。また、月間連動率は99.8%から100.6%の範囲であり、おおむね連動した投資成果となりました。
- ◎主なプラス要因
 - ・2015年3月と9月を中心とした配当権利確定によるプラスの影響があったこと。
- ◎主なマイナス要因
 - ・信託報酬や現物・先物売買等のファンド運用上のコストの発生があったこと。

<ミリオン・インデックス・マザーファンド>

- ・基準価額は期首に比べ、18.1%の上昇となり、ベンチマークとの乖離は1.7%程度となりました。
- ・マザーファンドの騰落率はベンチマークに対して1.7%上回りました。また、月間連動率は99.9%から100.7%の範囲であり、おおむね連動した投資成果となりました。
- ◎主なプラス要因
 - ・2015年3月と9月を中心とした配当権利確定によるプラスの影響があったこと。
- ◎主なマイナス要因
 - ・現物・先物売買等のファンド運用上のコストの発生があったこと。

基準価額 (ベビーファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



・ファンドの騰落率は分配金再投資基準価額を基に計算しています。

分配金について

収益分配金につきましては、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、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第28期	
	2014年11月8日～2015年11月9日	
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.074%	
当期の収益	3	
当期の収益以外	2	
翌期繰越分配対象額	1,732	

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<インデックス・タイプ（ミリオン）>

- ・運用の基本方針に基づき、引き続きマザーファンドの組入比率をほぼ100%に維持する方針です。

<ミリオン・インデックス・マザーファンド>

- ・マザーファンドの資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資し、高位の株式組入比率を維持します。
- ・効率的な運用を行うため、先物を有効活用します。
- ・日経平均株価の採用全銘柄へ投資し、連動した投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年11月8日～2015年11月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円 109	% 1.683	(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間日数}}$
（投信会社）	(26)	(0.402)	当ファンドの運用、受託会社への運用指図、目論見書等の作成等の対価
（販売会社）	(77)	(1.194)	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の対価
（受託会社）	(6)	(0.087)	当ファンドの財産の保管および管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（株式）	(0)	(0.000)	売買委託手数料は、有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.004)	
(c) その他費用	0	0.004	(c) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}}$
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査法人に支払われる当ファンドの監査費用等
合 計	109	1.691	
期中の平均基準価額は、6,485円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年11月8日～2015年11月9日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ミリオン・インデックス・マザーファンド	千口 5,121	千円 5,148	千口 499,057	千円 534,491

(注) 口数・金額の単位未満は切り捨てです。

○株式売買比率

(2014年11月8日～2015年11月9日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
	ミリオン・インデックス・マザーファンド
(a) 当期の株式売買金額	541,346千円
(b) 当期の平均組入株式時価総額	3,167,359千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月8日～2015年11月9日)

利害関係人との取引状況

<ミリオン・インデックス・マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 5	百万円 5	% 100.0	百万円 535	百万円 535	% 100.0
株 式 先 物 取 引	1,500	1,500	100.0	1,458	1,458	100.0

平均保有割合 98.2%

(平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子投資信託の親投資信託所有口数の割合です。)

利害関係人の発行する有価証券等

<ミリオン・インデックス・マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株 式	百万円 —	百万円 0.911601	百万円 4

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	150千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	150千円
(B) / (A)	100.0%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループです。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2014年11月8日～2015年11月9日)

該当ありません。

○組入資産の明細

(2015年11月9日現在)

親投資信託残高

種 類	期首 (前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ミリオン・インデックス・マザーファンド	3,528,035	3,034,099	3,398,191

(注1) 当マザーファンド全体の受益権口数は3,091,873千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てです。

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2015年11月9日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ミリオン・インデックス・マザーファンド	3,398,191	99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	32,466	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	3,430,657	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	3,430,657,090
コー ル ・ ロ ー ン 等	32,465,495
ミリオン・インデックス・マザーファンド(評価額)	3,398,191,547
未 収 利 息	48
(B) 負 債	32,582,060
未 払 収 益 分 配 金	2,521,748
未 払 解 約 金	881,534
未 払 信 託 報 酬	29,103,734
そ の 他 未 払 費 用	75,044
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	3,398,075,030
元 本	5,043,497,153
次 期 繰 越 損 益 金	△ 1,645,422,123
(D) 受 益 権 総 口 数	5,043,497,153口
1万口当たり基準価額 (C/D)	6,738円

○損益の状況 (2014年11月8日～2015年11月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	10,094
受 取 利 息	10,094
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	530,556,061
売 買 益	582,808,772
売 買 損	△ 52,252,711
(C) 信 託 報 酬 等	△ 57,860,955
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	472,705,200
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 270,508,416
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,845,097,159
(配 当 等 相 当 額)	(662,983,209)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,508,080,368)
(G) 計 (D + E + F)	△ 1,642,900,375
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,521,748
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 1,645,422,123
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,846,105,858
(配 当 等 相 当 額)	(661,985,582)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 2,508,091,440)
分 配 準 備 積 立 金	212,046,820
繰 越 損 益 金	△ 11,363,085

(注1) 損益の状況の中で

・(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

・(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

・(F)追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注2) 当ファンドの期首元本額は5,762,170,026円、期中追加設定元本額は24,039,202円、期中一部解約元本額は742,712,075円です。

(注3) 1口当たりの純資産額は、当期末0.6738円です。

(注4) 純資産総額が元本額を下回っており、その差額は当期末1,645,422,123円です。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	当 期 末
(a) 配当等収益 (費用控除後)	45,358,937円
(b) 有価証券等損益額 (費用控除後)	0
(c) 信託約款に規定する収益調整金	662,994,281
(d) 信託約款に規定する分配準備積立金	168,200,932
(e) 分配対象収益 (a + b + c + d)	876,554,150
(f) 分配金額	2,521,748
(g) 分配金額 (1万口当たり)	5

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンドの監査は終了していません。

○分配金のお知らせ

決 算 期	第 28 期
1 万 口 当 たり 分 配 金 (税 込 み)	5円

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2015年11月9日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、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。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※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。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①「運用報告書（全体版）」について電磁的方法により提供するための、所要の約款変更を2014年12月1日に行いました。
- ②デリバティブ取引等に係る投資制限を規定するための、所要の約款変更を2014年12月1日に行いました。
- ③委託者である「国際投信投資顧問株式会社」は「三菱UFJ投信株式会社」との合併により解散し、存続会社である「三菱UFJ投信株式会社」は2015年7月1日付で「三菱UFJ国際投信株式会社」と商号変更するための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。
- ④委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行うための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。
- ⑤2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われず。））の税率が適用されます。

ミリオン・インデックス・マザーファンド

《第28期》決算日2015年11月9日

【計算期間：2014年11月8日～2015年11月9日】

「ミリオン・インデックス・マザーファンド」は、11月9日に第28期の決算を行いました。以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第28期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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。
主要投資対象	日経平均株価に採用された銘柄
主な投資制限	株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク 〔日経平均株価〕		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	%	円	%			
24期(2011年11月7日)	466	△ 8.1	8,767.09	△ 9.9	97.0	2.7	2,256
25期(2012年11月7日)	487	4.5	8,972.89	2.3	92.9	6.6	2,170
26期(2013年11月7日)	786	61.4	14,228.44	58.6	91.5	8.1	3,171
27期(2014年11月7日)	948	20.6	16,880.38	18.6	88.4	10.9	3,404
28期(2015年11月9日)	1,120	18.1	19,642.74	16.4	86.8	12.5	3,462

(注1) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークに関して

※「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。

以下、本報告書において上記の「ベンチマークに関して」の記載を省略します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク 〔日経平均株価〕		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期 首) 2014年11月 7日	948	—	16,880.38	—	88.4	10.9
11月末	980	3.4	17,459.85	3.4	89.7	10.1
12月末	980	3.4	17,450.77	3.4	91.9	7.7
2015年 1月末	993	4.7	17,674.39	4.7	92.3	7.2
2月末	1,057	11.5	18,797.94	11.4	93.0	6.3
3月末	1,086	14.6	19,206.99	13.8	94.9	4.8
4月末	1,104	16.5	19,520.01	15.6	97.1	2.2
5月末	1,164	22.8	20,563.15	21.8	98.7	1.1
6月末	1,146	20.9	20,235.73	19.9	85.3	14.5
7月末	1,165	22.9	20,585.24	21.9	86.2	13.5
8月末	1,070	12.9	18,890.48	11.9	86.7	13.0
9月末	992	4.6	17,388.15	3.0	86.3	13.6
10月末	1,088	14.8	19,083.10	13.0	86.7	13.0
(期 末) 2015年11月 9日	1,120	18.1	19,642.74	16.4	86.8	12.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第28期：2014/11/8～2015/11/9)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ18.1%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（16.4%）を1.7%上回りました。

基準価額等の推移



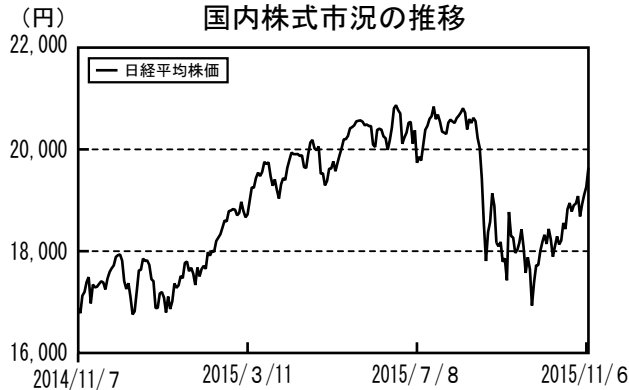
・ベンチマークは2014年11月7日の基準価額の値と等しくして指数化しています。

基準価額の主な変動要因

上昇要因	円安や原油安による企業収益拡大への期待が高まるなか、相場の重しとなっていたギリシャ債務問題が進展するとの見方が強まったことなどから日経平均株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	中国の景気減速懸念が台頭するなか中国株式市場が急落し、周辺国への波及や世界景気の先行き不安が高まったことなどから日経平均株価が下落したことが、基準価額の下落要因となりました。

投資環境について

(第28期：2014/11/8～2015/11/9)



(出所：Bloomberg)

◎国内株式市況

- ・期首の日経平均株価（以下、日経平均と
いいます。）は、16,880.38円で始まりま
した。
- ・2014年11月中旬以降、安倍首相が衆議院
解散・総選挙と消費税増税の延期を表
明し、景気の下支え期待の高まりなど
から上昇する場面もあったものの、ギリ
シャの政情不安などが上値を抑え、な
たか、原油価格の急落やこれを端緒と
し、アジアの通貨下落などを受けて下
値模索の展開となり、12月16日には、日経平均
は期中安値となる16,755.32円を付けま
した。
- ・その後、米国早期利上げ懸念の後退や米
国株高などを好感して株価は持ち直し、
2015年1月以降は欧州中央銀行（ECB）
の量的金融緩和決定やギリシャ情勢不
安の後退などを受けて株価は戻りを試
す展開となりました。また、円安や原
油安から株主による企業収益拡大への
期待感などが株主による株買を促し、
株価は上昇し、業績上方修正銘柄や
元・投資拡大のほかに、資本効率向
上や営業目標に掲げた銘柄などが買
われ、展開となりました。
- ・6月に入ると、相場の重しとなっていた
ギリシャ債務問題が進展すると見方が
強まったことなどから日経平均は2000年
のIT（情報技術）バブル期の高値を上
回りました。しかし、ギリシャの債務
を巡る協議は難航し、ギリシャの債務
不履行懸念が再び高まったことから株
価は反落しました。
- ・8月中旬以降、中国の景気減速懸念が台
頭するなか中国株式市場が急落すると、
周辺国への波及や世界景気の先行不安
が高まったことなどから世界同時株
安となりました。また、中国政府が矢
継ぎ早に講じた株価対策の効果が一時
的なことや、米国の利上げ見送りによ
り米国の金融政策の先行き不透明感
などから、9月末にかけて株価は大幅
に調整しました。
- ・その後、売られすぎとの見方などから株
価は反発し、新興国経済への影響が懸
念されていた米国の利上げ観測の後
退や欧州の追加金融緩和期待の高まり
を背景とした投資家心理の改善などか
ら、戻りを試す展開となり、期末の日
経平均は19,642.74円となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

- ・基準価額は期首に比べ18.1%の上昇となりました。
- ・マザーファンドの運用については、投資成果をできるだけ日経平均に連動させるため、原則として日経平均採用銘柄の中から200銘柄以上に等株数（みなし額面調整後）投資を行い、一部日経平均先物を利用してしながら株式の組入比率を高位に保っています。また、日経平均採用銘柄の入れ替え等に併い現物株式の売買を行っています。
- ・マザーファンドの組入比率については現物株式をおおむね85%以上組み入れ、さらに日経平均先物を買って建てることにより、実質株式組入比率をほぼ100%に維持するように調整しました。期末の現物株式組入比率86.8%、先物を含めた実質株式組入比率は99.3%となりました。
- ・結果、マザーファンドの基準価額とベンチマークの月間連動率は99.9%から100.7%の範囲であり、おおむね連動した投資成果となりました。
- ・期末現在では、日経平均採用銘柄全てを組み入れ225銘柄としています。

(ご参考)

日経平均採用銘柄の入れ替に伴う売買

	除 外	組 入
2015年10月	日東紡績	長谷エコーポレーション
	平和不動産	ディー・エヌ・エー

株式組入上位5業種

期首（2014年11月7日）

	業 種	比率
1	電気機器	17.5%
2	小売業	12.2%
3	情報・通信業	11.5%
4	化学	7.5%
5	輸送用機器	7.4%

(注) 比率はマザーファンドの株式の評価総額に対する各業種の割合です。

期末（2015年11月9日）

	業 種	比率
1	電気機器	17.4%
2	小売業	12.1%
3	情報・通信業	10.8%
4	化学	8.2%
5	医薬品	7.6%

(注) 比率はマザーファンドの株式の評価総額に対する各業種の割合です。

株式組入上位10銘柄

期首（2014年11月7日）

	銘 柄	比率
1	ファーストリテイリング	8.7%
2	ソフトバンクグループ	4.8%
3	ファナック	4.1%
4	KDDI	3.0%
5	京セラ	2.1%
6	アステラス製薬	1.8%
7	東京エレクトロン	1.5%
8	信越化学工業	1.5%
9	本田技研工業	1.5%
10	ダイキン工業	1.5%

(注) 比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

期末（2015年11月9日）

	銘 柄	比率
1	ファーストリテイリング	8.1%
2	ファナック	3.8%
3	ソフトバンクグループ	3.6%
4	KDDI	3.1%
5	京セラ	2.1%
6	アステラス製薬	1.6%
7	TDK	1.5%
8	日東電工	1.5%
9	ダイキン工業	1.4%
10	セコム	1.4%

(注) 比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・ 基準価額は期首に比べ、18.1%の上昇となり、ベンチマークとの乖離は1.7%程度となりました。
 - ・ マザーファンドの騰落率はベンチマークに対して1.7%上回りました。また、月間連動率は99.9%から100.7%の範囲であり、おおむね連動した投資成果となりました。
- ◎主なプラス要因
- ・ 2015年3月と9月を中心とした配当権利確定によるプラスの影響があったこと。
- ◎主なマイナス要因
- ・ 現物・先物売買等のファンド運用上のコストの発生があったこと。

今後の運用方針

- ・ マザーファンドの資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資し、高位の株式組入比率を維持します。
- ・ 効率的な運用を行うため、先物を有効活用します。
- ・ 日経平均株価の採用全銘柄へ投資し、連動した投資成果を目指して運用を行います。

○ 1千口当たりの費用明細

(2014年11月8日～2015年11月9日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料	円 0	% 0.004	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
合 計	0	0.004	
期中の平均基準価額は、1,068円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1千口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2014年11月8日～2015年11月9日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	内	千株	千円	千株	千円
	上 場	3 (14)	5,614 (-)	221	535,732

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 株数・金額の単位未満は切り捨てです。

(注3) () 内は増資割当・予約権行使・合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

先物取引の種類別取引状況

種 類		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	内	百万円	百万円	百万円	百万円
	日 経 2 2 5	1,500	1,458	-	-

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てです。

○株式売買比率

(2014年11月8日～2015年11月9日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 当期の株式売買金額	541,346千円
(b) 当期の平均組入株式時価総額	3,167,359千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○主要な売買銘柄

(2014年11月8日～2015年11月9日)

株式

買 付 銘柄	当 期			期 付			
	株 数	金 額	平均単価	買 付 銘柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ディー・エヌ・エー	1.8	3,994	2,219	ファーストリテイリング	1	55,584	55,584
長谷工コーポレーション	1.2	1,620	1,350	ファナック	1	26,362	26,362
—	—	—	—	ソフトバンクグループ	3	22,551	7,517
—	—	—	—	K D D I	6	17,796	2,966
—	—	—	—	京 セ ラ	2	13,400	6,700
—	—	—	—	T D K	1	10,218	10,218
—	—	—	—	日 東 電 工	1	10,083	10,083
—	—	—	—	ダイキン工業	1	9,209	9,209
—	—	—	—	アステラス製薬	5	9,150	1,830
—	—	—	—	トヨタ自動車	1	8,448	8,448

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 株数・金額の単位未満は切り捨てです。

(注3) 単位未満の株数は小数で記載しています。

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月8日～2015年11月9日)

利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株 式	百万円 5	百万円 5	% 100.0	百万円 535	百万円 535	% 100.0
株 式 先 物 取 引	1,500	1,500	100.0	1,458	1,458	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株 式	百万円 -	百万円 0.911601	百万円 4

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	153千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	153千円
(B) / (A)	100.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社、株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループです。

○組入資産の明細

(2015年11月9日現在)

国内株式

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	7	6	6	2,358
マルハニチロ	0.7	0.6	0.6	1,174
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	2.8	2.4	2.4	2,829
建設業 (2.7%)				
コムシスホールディングス	7	6	6	9,798
大成建設	7	6	6	4,662
大林組	7	6	6	6,288
清水建設	7	6	6	6,258
長谷工コーポレーション	—	1.2	1.2	1,474
鹿島建設	7	6	6	4,092
大和ハウス工業	7	6	6	19,764
積水ハウス	7	6	6	12,024
日揮	7	6	6	11,736
千代田化工建設	7	6	6	5,520
食料品 (5.0%)				
日清製粉グループ本社	7	6	6	11,304
明治ホールディングス	0.7	1.2	1.2	11,604
日本ハム	7	6	6	14,400
サッポロホールディングス	7	6	6	3,006
アサヒグループホールディングス	7	6	6	22,902
キリンホールディングス	7	6	6	10,062
宝ホールディングス	7	6	6	5,424
キッコーマン	7	6	6	23,550
味の素	7	6	6	16,647
ニチレイ	7	6	6	4,938
日本たばこ産業	7	6	6	26,730
繊維製品 (0.4%)				
東洋紡	7	6	6	1,104
ユニチカ	7	6	6	360
日清紡ホールディングス	7	—	—	—
帝人	7	6	6	2,490
東レ	7	6	6	6,588
パルプ・紙 (0.3%)				
王子ホールディングス	7	6	6	3,618

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本製紙	0.7	0.6	0.6	1,235
北越紀州製紙	7	6	6	5,148
化学 (8.2%)				
クラレ	7	6	6	9,258
旭化成	7	6	6	4,530
昭和電工	7	6	6	912
住友化学	7	6	6	4,146
日産化学工業	7	6	6	18,750
日本曹達	7	6	6	4,968
東ソー	7	6	6	3,984
トクヤマ	7	6	6	1,638
デーンカ	7	6	6	3,432
信越化学工業	7	6	6	43,956
三井化学	7	6	6	2,934
三菱ケミカルホールディングス	3.5	3	3	2,388
宇部興産	7	6	6	1,512
日本化薬	7	6	6	8,190
花王	7	6	6	36,774
富士フィルムホールディングス	7	6	6	29,832
資生堂	7	6	6	16,440
日東電工	7	6	6	52,932
医薬品 (7.6%)				
協和発酵キリン	7	6	6	12,558
武田薬品工業	7	6	6	36,858
アステラス製薬	35	30	30	54,060
大日本住友製薬	7	6	6	8,292
塩野義製薬	7	6	6	31,116
中外製薬	7	6	6	24,420
エーザイ	7	6	6	45,948
第一三共	7	6	6	14,682
石油・石炭製品 (0.3%)				
昭和シェル石油	7	6	6	6,552
JXホールディングス	7	6	6	2,874
ゴム製品 (1.2%)				
横浜ゴム	7	3	3	7,116
ブリヂストン	7	6	6	27,360

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.6%)			
日東紡績	7	—	—
旭硝子	7	6	4,374
日本板硝子	7	6	654
日本電気硝子	11	9	6,012
住友大阪セメント	7	6	3,054
太平洋セメント	7	6	2,388
東海カーボン	7	6	2,160
ＴＯＴＯ	7	3	13,095
日本碍子	7	6	17,046
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	7	0.6	1,491
神戸製鋼所	7	6	882
ジェイエフイーホールディングス	0.7	0.6	1,152
日新製鋼	0.7	0.6	792
大平洋金属	7	6	2,052
非鉄金属 (1.3%)			
日本軽金属ホールディングス	7	6	1,296
三井金属鉱業	7	6	1,434
東邦亜鉛	7	6	1,950
三菱マテリアル	7	6	2,490
住友金属鉱山	7	6	9,084
DOWAホールディングス	7	6	5,478
古河機械金属	7	6	1,542
古河電気工業	7	6	1,488
住友電気工業	7	6	10,173
フジクラ	7	6	3,840
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	0.7	0.6	651
東洋製罐グループホールディングス	7	6	13,518
機械 (4.7%)			
日本製鋼所	7	6	2,838
オークマ	7	6	6,366
アマダホールディングス	7	6	6,798
小松製作所	7	6	12,243
住友重機械工業	7	6	3,384
日立建機	7	6	11,904
クボタ	7	6	11,967
荏原製作所	7	6	3,198
ダイキン工業	7	6	50,196

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気機器 (17.4%)			
日本精工	7	6	8,742
NTN	7	6	3,504
ジェイテクト	7	6	13,404
日立造船	1.4	1.2	774
三菱重工業	7	6	3,692
IHI	7	6	2,130
日清紡ホールディングス	—	6	9,840
コニカミノルタ	7	6	7,752
ミネベア	7	6	9,222
日立製作所	7	6	4,377
東芝	7	6	1,860
三菱電機	7	6	7,929
富士電機	7	6	3,342
安川電機	7	6	9,204
明電舎	7	6	2,448
ジーエス・ユアサコーポレーション	7	6	2,736
日本電気	7	6	2,340
富士通	7	6	3,625
沖電気工業	7	6	966
パナソニック	7	6	8,565
シャープ	7	6	780
ソニー	7	6	20,868
TDK	7	6	53,040
三菱電機	7	6	3,828
アルプス電気	7	6	23,880
パイオニア	7	6	2,028
横河電機	7	6	8,826
アドバンテスト	14	12	12,048
カシオ計算機	7	6	14,862
ファナック	7	6	132,210
京セラ	14	12	72,024
太陽誘電	7	6	11,214
SCREENホールディングス	7	6	4,506
キヤノン	10.5	9	33,975
リコー	7	6	8,142
東京エレクトロン	7	6	46,008
輸送用機器 (7.1%)			
デンソー	7	6	35,136
三井造船	7	6	1,170

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
川崎重工業	7	6	6	2,952
日産自動車	7	6	6	7,710
いすゞ自動車	3.5	3	3	4,452
トヨタ自動車	7	6	6	45,750
日野自動車	7	6	6	8,832
三菱自動車工業	0.7	0.6	0.6	659
マツダ	1.4	1.2	1.2	3,031
本田技研工業	14	12	12	48,756
スズキ	7	6	6	23,760
富士重工業	7	6	6	30,084
精密機器 (3.0%)				
テルモ	14	12	12	46,800
ニコン	7	6	6	9,972
オリンパス	7	6	6	28,980
シチズンホールディングス	7	6	6	5,718
その他製品 (1.1%)				
凸版印刷	7	6	6	6,564
大日本印刷	7	6	6	7,638
ヤマハ	7	6	6	19,050
電気・ガス業 (0.3%)				
東京電力	0.7	0.6	0.6	484
中部電力	0.7	0.6	0.6	1,090
関西電力	0.7	0.6	0.6	915
東京瓦斯	7	6	6	3,581
大阪瓦斯	7	6	6	2,724
陸運業 (2.5%)				
東武鉄道	7	6	6	3,504
東京急行電鉄	7	6	6	5,862
小田急電鉄	7	6	6	6,930
京王電鉄	7	6	6	5,760
京成電鉄	7	6	6	8,958
東日本旅客鉄道	0.7	0.6	0.6	7,032
西日本旅客鉄道	0.7	0.6	0.6	4,929
東海旅客鉄道	0.7	0.6	0.6	13,323
日本通運	7	6	6	3,432
ヤマトホールディングス	7	6	6	14,232
海運業 (0.2%)				
日本郵船	7	6	6	1,992
商船三井	7	6	6	1,968
川崎汽船	7	6	6	1,512

銘柄	期首 (前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
空運業 (0.1%)				
ANAホールディングス	7	6	6	2,253
倉庫・運輸関連業 (0.3%)				
三菱倉庫	7	6	6	10,314
情報・通信業 (10.8%)				
フー	2.8	2.4	2.4	1,183
トレンドマイクロ	7	6	6	28,320
スカパーJSATホールディングス	0.7	0.6	0.6	370
日本電信電話	0.7	1.2	1.2	5,775
KDDI	14	36	36	108,252
NTTドコモ	0.7	0.6	0.6	1,496
東宝	0.7	0.6	0.6	1,917
エヌ・ティ・ティ・データ	7	6	6	35,400
コナミホールディングス	7	6	6	17,436
ソフトバンクグループ	21	18	18	124,488
卸売業 (2.0%)				
双日	0.7	0.6	0.6	167
伊藤忠商事	7	6	6	9,411
丸紅	7	6	6	4,211
豊田通商	7	6	6	17,268
三井物産	7	6	6	9,243
住友商事	7	6	6	8,061
三菱商事	7	6	6	12,588
小売業 (12.1%)				
J.フロントリテイリング	3.5	3	3	6,021
三越伊勢丹ホールディングス	7	6	6	11,898
セブン&アイホールディングス	7	6	6	34,410
高島屋	7	6	6	6,744
丸井グループ	7	6	6	10,320
イオン	7	6	6	10,932
ユニグループホールディングス	7	6	6	4,176
ファーストリテイリング	7	6	6	280,320
銀行業 (1.3%)				
新生銀行	7	6	6	1,482
あおぞら銀行	7	6	6	2,670
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7	6	6	4,933
りそなホールディングス	0.7	0.6	0.6	395
三井住友トラスト・ホールディングス	7	6	6	3,011
三井住友フィナンシャルグループ	0.7	0.6	0.6	3,070
千葉銀行	7	6	6	5,280

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横浜銀行	7	6	4,531
ふくおかフィナンシャルグループ	7	6	3,858
静岡岡銀	7	6	7,422
みずほフィナンシャルグループ	7	6	1,539
証券・商品先物取引業 (0.6%)			
大和証券グループ本社	7	6	5,216
野村ホールディングス	7	6	4,797
松井証券	7	6	6,696
保険業 (1.1%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	1.8	1.5	6,045
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2.1	1.8	6,867
ソニーフィナンシャルホールディングス	1.4	1.2	2,701
第一生命保険	0.7	0.6	1,405
東京海上ホールディングス	3.5	3	14,892
T&Dホールディングス	1.4	1.2	2,154
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	7	6	14,790

銘柄	期首 (前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
不動産業 (2.2%)				
東急不動産ホールディングス	7	6	4,866	
三井不動産	7	6	18,762	
三菱地所	7	6	15,276	
平和不動産	1.4	—	—	
東京建物	7	3	4,380	
住友不動産	7	6	22,482	
サービス業 (3.2%)				
ディー・エヌ・エー	—	1.8	3,448	
電通	7	6	41,700	
東京ドーム	7	6	3,414	
セコム	7	6	48,900	
合計	株数・金額	1,466	1,263	3,004,395
	銘柄数<比率>	225	225	<86.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3) 株数合計・評価額の単位未満は切り捨てです。ただし、単位未満の株数は小数で記載しています。
(注4) 一印は組み入れがありません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経 2 2 5	431	—

(注1) 単位未満は切り捨てです。
(注2) 一印は組み入れがありません。

○投資信託財産の構成

(2015年11月9日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円	%
株	3,004,395	86.8
コール・ローン等、その他	458,506	13.2
投資信託財産総額	3,462,901	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てです。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月9日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	3,594,521,604
コーポレーション等	430,347,462
株式(評価額)	3,004,395,780
未収入金	30,861,264
未収配当金	19,898,460
未収利息	638
差入委託証拠金	109,018,000
(B) 負 債	131,620,000
差入委託証拠金代用有価証券	131,620,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,462,901,604
元 本	3,091,873,048
次期繰越損益金	371,028,556
(D) 受益権総口数	3,091,873,048口
千口当たり基準価額(C/D)	1,120円

○損益の状況 (2014年11月8日～2015年11月9日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	54,166,704
受 取 配 当 金	54,005,678
受 取 利 息	155,115
そ の 他 収 益 金	5,911
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	524,152,631
売 買 損 益	585,816,231
売 買 損	△ 61,663,600
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	16,772,072
取 引 損 益	75,111,728
取 引 損	△ 58,339,656
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	595,091,407
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 187,964,452
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	185,278
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 36,283,677
(H) 計 (D+E+F+G)	371,028,556
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	371,028,556

(注1) 損益の状況の中で

- ・(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- ・(F)追加信託差損益金とは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
- ・(G)解約差損益金とは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注2) 当マザーファンドの期首元本額は3,592,617,382円、期中追加設定元本額は7,963,618円、期中一部解約元本額は508,707,952円です。

(注3) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、インデックス・タイプ(ミリオン)3,034,099,596円、バランス・タイプ(ミリオン)57,773,452円、合計3,091,873,048円です。

(注4) 1口当たり純資産額は、当期末1,1200円です。

[お知らせ]

- ①デリバティブ取引等に係る投資制限を規定するための、所要の約款変更を2014年12月1日に行いました。
- ②委託者である「国際投信投資顧問株式会社」は「三菱UFJ投信株式会社」との合併により解散し、存続会社である「三菱UFJ投信株式会社」は2015年7月1日付で「三菱UFJ国際投信株式会社」と商号変更するための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。
- ③委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行うための、所要の約款変更を2015年7月1日に行いました。