

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（2002年5月27日設定）	
運用方針	三菱UFJ インデックス225マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、日経平均株価（日経225）に連動する投資成果をめざします。	
主要運用対象	ベビーファンド	三菱UFJ インデックス225マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の株式に直接投資することもできません。
	マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	<p>毎年1回決算（原則として11月5日。ただし、11月5日が休業日の場合は翌営業日とします。）を行い基準価額水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象収益等が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>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。）</p> </div>	

※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、「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。
 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）

三菱UFJ インデックス225オープン （確定拠出年金）



第17期（決算日：2018年11月5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「三菱UFJ インデックス225オープン（確定拠出年金）」は、去る11月5日に第17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。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

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、
 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、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

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 (分配落)	標準価額			日経平均株価 (日経225)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税込分配	み入金	期騰落中率	日経平均	期騰落中率			
	円	円	円	%	円	%	%	%	百万円
13期(2014年11月5日)	16,287		0	20.4	16,937.32	19.1	95.6	4.4	6,589
14期(2015年11月5日)	18,595		0	14.2	19,116.41	12.9	97.5	2.5	7,808
15期(2016年11月7日)	16,944		0	△ 8.9	17,177.21	△10.1	95.6	4.4	7,412
16期(2017年11月6日)	22,532		0	33.0	22,548.35	31.3	97.7	2.3	9,122
17期(2018年11月5日)	22,206		0	△ 1.4	21,898.99	△ 2.9	96.7	3.2	10,244

(注) 日経平均株価（日経225）とは、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として日本経済新聞社により算出、公表される株価指数です。当指数は、増資・権利落ち等の市況とは無関係の株価変動要因を修正して連続性を持たせたもので、わが国の株式市場動向を継続的に捉える指標として、広く利用されています。日経225に関する知的財産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、日経225の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。当ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。日本経済新聞社は、日経平均株価（日経225）を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(日経225) 円	騰 落 率		
(期 首) 2017年11月6日	22,532	—	22,548.35	—	97.7	2.3
11月末	22,698	0.7	22,724.96	0.8	98.2	1.8
12月末	22,760	1.0	22,764.94	1.0	99.2	0.8
2018年1月末	23,084	2.4	23,098.29	2.4	98.9	1.1
2月末	22,050	△2.1	22,068.24	△2.1	98.5	1.5
3月末	21,589	△4.2	21,454.30	△4.9	97.9	2.1
4月末	22,606	0.3	22,467.87	△0.4	98.7	1.3
5月末	22,332	△0.9	22,201.82	△1.5	98.3	1.7
6月末	22,456	△0.3	22,304.51	△1.1	98.5	1.5
7月末	22,696	0.7	22,553.72	0.0	98.8	1.2
8月末	23,032	2.2	22,865.15	1.4	98.1	1.9
9月末	24,445	8.5	24,120.04	7.0	97.5	2.5
10月末	22,227	△1.4	21,920.46	△2.8	98.1	1.9
(期 末) 2018年11月5日	22,206	△1.4	21,898.99	△2.9	96.7	3.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

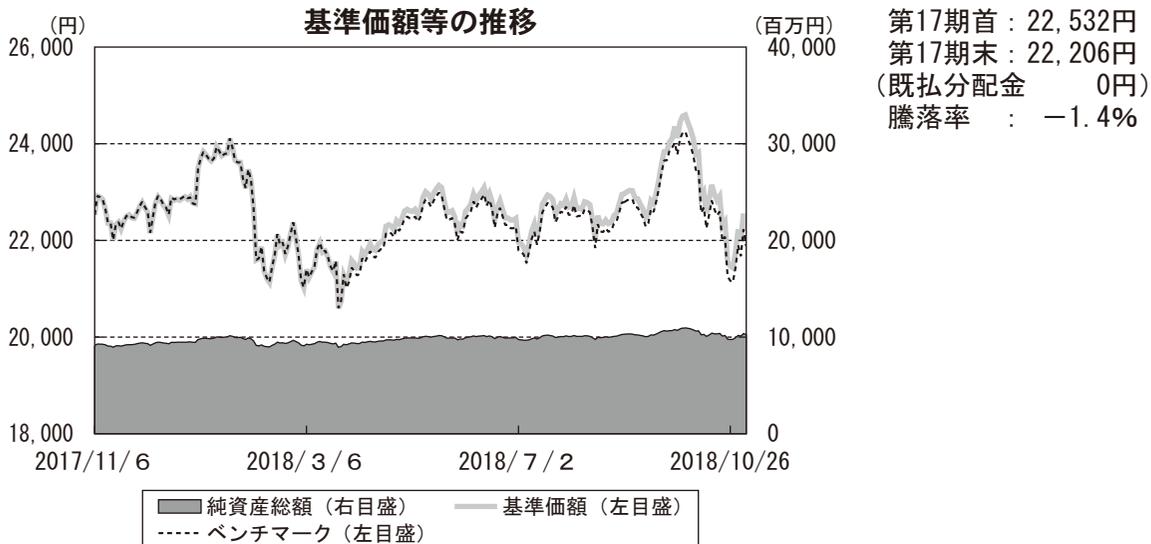
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

（第17期：2017/11/7～2018/11/5）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ1.4%の下落となりました。
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（-2.9%）を1.5%上回りました。



- ・ 分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、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、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみな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。

基準価額の主な変動要因

下落要因	米中貿易摩擦への懸念や米国株式の下落等を受け、国内株式市況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17期：2017/11/7～2018/11/5）

◎国内株式市況

- ・国内外の堅調な景気を受けて、上昇した局面もありましたが、米中貿易摩擦への懸念や米国株式の下落等を受け、国内株式市況は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

i 期間中にどのような運用をしたかを確認できます。

＜三菱UFJ インデックス225オープン（確定拠出年金）＞

- ・三菱UFJ インデックス225マザーファンド受益証券にほぼ100%投資しています。このため基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

＜三菱UFJ インデックス225マザーファンド＞

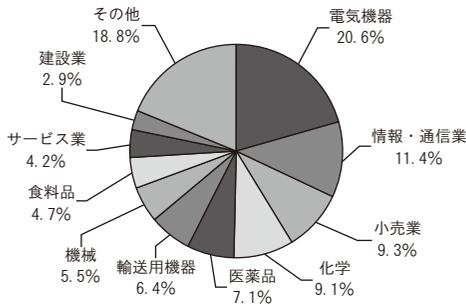
基準価額は期首に比べ0.9%の下落となりました。

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・日経225の採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

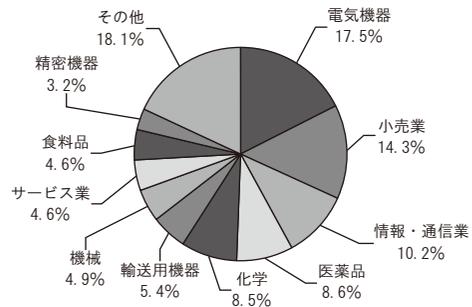
（ご参考）

組入上位10業種

期首（2017年11月6日）



期末（2018年11月5日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

i ベンチマークまたは参考指数と比較することで、期間中の運用内容を評価することができます。

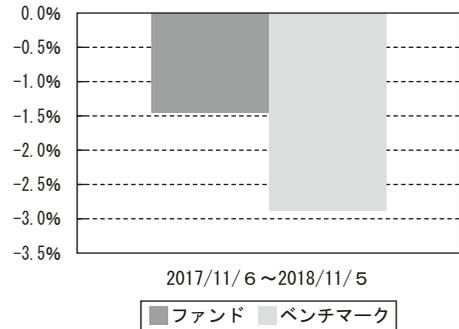
＜三菱UFJ インデックス225オープン（確定拠出年金）＞

ベンチマークとの乖離は1.5%程度となりました。

◎マザーファンド保有以外の要因
管理コスト等による影響は△0.5%程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は2.0%程度でした。

基準価額（ペビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



＜三菱UFJ インデックス225マザーファンド＞

ベンチマークは2.9%の下落となったため、乖離は2.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ 配当要因※ 2.0%
- ※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

（主なマイナス要因）

- ・ 取引コスト要因

分配金について

i 分配金の内訳および翌期繰越分配対象額（翌期に繰越す分配原資）がどの程度あるかを確認できます。

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、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17期
	2017年11月7日～2018年11月5日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	16,587

（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（作成対象期間末での見解です。）

＜三菱UFJ インデックス225オープン（確定拠出年金）＞

- ・三菱UFJ インデックス225マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持する方針です。

＜三菱UFJ インデックス225マザーファンド＞

- ・ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資し、高い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225の採用全銘柄へ投資し、指数を模倣します。

○1万口当たりの費用明細

(2017年11月7日～2018年11月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(58)	(0. 258)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(44)	(0. 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)	(19)	(0. 086)	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の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0. 004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	(1)	(0. 004)	
合 計	123	0. 542	
期中の平均基準価額は、22,586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) 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。

(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

(2017年11月7日～2018年11月5日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
三菱UFJ インデックス225マザーファンド	千口 869,444	千円 2,104,445	千口 364,817	千円 890,223

○株式売買比率

(2017年11月7日～2018年11月5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
	三菱UFJ インデックス225マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	86,615,984千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	103,893,672千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.83

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2017年11月7日～2018年11月5日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ インデックス225オープン（確定拠出年金）>

該当事項はございません。

<三菱UFJ インデックス225マザーファンド>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 64,004	百万円 28,451	% 44.5	百万円 22,611	百万円 10,065	% 44.5

平均保有割合 9.3%

※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ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<三菱UFJ インデックス225マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 78	百万円 25	百万円 132

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<三菱UFJ インデックス225マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 32

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)	406千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.128千円
(B) / (A)	0.0%

(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、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2018年11月5日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
三菱UFJ インデックス225マザーファンド	3,784,018	4,288,645	10,242,572

○投資信託財産の構成

(2018年11月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
三菱UFJ インデックス225マザーファンド	10,242,572	99.7
コール・ローン等、その他	34,548	0.3
投資信託財産総額	10,277,120	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年11月5日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,277,120,264
コール・ローン等	34,548,186
三菱UFJ インデックス225マザーファンド(評価額)	10,242,572,078
(B) 負債	32,496,286
未払解約金	5,024,677
未払信託報酬	27,471,569
未払利息	40
(C) 純資産総額(A-B)	10,244,623,978
元本	4,613,513,769
次期繰越損益金	5,631,110,209
(D) 受益権総口数	4,613,513,769口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,206円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,048,809,173円
 期中追加設定元本額 1,626,735,527円
 期中一部解約元本額 1,062,030,931円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,2206円です。

②分配金の計算過程

項 目	2017年11月7日～ 2018年11月5日
費用控除後の配当等収益額	142,038,164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	—円
収益調整金額	5,545,960,311円
分配準備積立金額	1,964,528,560円
当ファンドの分配対象収益額	7,652,527,035円
1万口当たり収益分配対象額	16,587円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

*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 (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
 (2018年1月1日)

○損益の状況（2017年11月7日～2018年11月5日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 14,304
受取利息	111
支払利息	△ 14,415
(B) 有価証券売買損益	△ 107,867,003
売買益	41,481,578
売買損	△ 149,348,581
(C) 信託報酬等	△ 52,850,951
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 160,732,258
(E) 前期繰越損益金	1,964,528,560
(F) 追加信託差損益金	3,827,313,907
(配当等相当額)	(5,540,733,993)
(売買損益相当額)	(△1,713,420,086)
(G) 計(D+E+F)	5,631,110,209
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,631,110,209
追加信託差損益金	3,827,313,907
(配当等相当額)	(5,545,960,311)
(売買損益相当額)	(△1,718,646,404)
分配準備積立金	2,106,566,724
繰越損益金	△ 302,770,422

- (注) (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。
 (注) (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。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、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。

三菱UFJ インデックス225マザーファンド

【第17期】決算日2018年11月5日

[計算期間：2017年11月7日～2018年11月5日]

「三菱UFJ インデックス225マザーファンド」は、11月5日に第17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17期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	日経平均株価（日経225）に連動する投資成果をめざした運用を行います。株式への投資にあたっては、原則として日経平均株価採用銘柄のうち180銘柄以上に等株数投資を行います。株式（株価指数先物取引等を含む）の組入比率は、高位を保ちます。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	率	(日経225)	期騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
13期(2014年11月5日)	17,143	21.1	16,937.32	19.1	95.7	4.4	98,314
14期(2015年11月5日)	19,678	14.8	19,116.41	12.9	97.5	2.5	85,974
15期(2016年11月7日)	18,028	△ 8.4	17,177.21	△10.1	95.6	4.4	80,513
16期(2017年11月6日)	24,104	33.7	22,548.35	31.3	97.7	2.3	77,094
17期(2018年11月5日)	23,883	△ 0.9	21,898.99	△ 2.9	96.8	3.2	119,732

(注) 日経平均株価（日経225）とは、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として日本経済新聞社により算出、公表される株価指数です。当指数は、増資・権利落ち等の市況とは無関係の株価変動要因を修正して連続性を持たせたもので、わが国の株式市場動向を継続的に捉える指標として、広く利用されています。日経225に関する知的財産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、日経225の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。当ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。日本経済新聞社は、日経平均株価（日経225）を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

(注) 上記指数は、配当相当分を含まないインデックスです。このためファンドとベンチマークの騰落率との差異には、ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる「配当金要因」が含まれている点にご留意ください。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	率	(日経225)	騰 落 率		
(期 首) 2017年11月6日	円	%	円	%	%	%
	24,104	—	22,548.35	—	97.7	2.3
11月末	24,290	0.8	22,724.96	0.8	98.2	1.8
12月末	24,367	1.1	22,764.94	1.0	99.2	0.8
2018年1月末	24,726	2.6	23,098.29	2.4	98.9	1.1
2月末	23,628	△2.0	22,068.24	△2.1	98.5	1.5
3月末	23,144	△4.0	21,454.30	△4.9	97.9	2.1
4月末	24,245	0.6	22,467.87	△0.4	98.7	1.3
5月末	23,963	△0.6	22,201.82	△1.5	98.3	1.7
6月末	24,106	0.0	22,304.51	△1.1	98.5	1.5
7月末	24,375	1.1	22,553.72	0.0	98.8	1.2
8月末	24,748	2.7	22,865.15	1.4	98.1	1.9
9月末	26,277	9.0	24,120.04	7.0	97.5	2.5
10月末	23,904	△0.8	21,920.46	△2.8	98.1	1.9
(期 末) 2018年11月5日	円	%	円	%	%	%
	23,883	△0.9	21,898.99	△2.9	96.8	3.2

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.9%の下落となりました。

◎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(−2.9%)を2.0%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・国内外の堅調な景気を受けて、上昇した局面もありましたが、米中貿易摩擦への懸念や米国株式の下落等を受け、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・日経225の採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・ 配当要因※ 2.0%

※ベンチマークが配当相当分を含まないインデックスであることによって生じるプラス要因です。

（主なマイナス要因）

- ・ 取引コスト要因

○今後の運用方針

- ・ ファンドの資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資し、高い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225の採用全銘柄へ投資し、指数を模倣します。

○1万口当たりの費用明細

(2017年11月7日～2018年11月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	1	0.004	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
	(1)	(0.004)	
合 計	1	0.004	
期中の平均基準価額は、24,228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

(2017年11月7日～2018年11月5日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株	千円	千株	千円
		18,643	64,004,473	6,232	22,611,511
		(△ 1,239)	()		

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		90,917	88,466	—	—

○株式売買比率

(2017年11月7日～2018年11月5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) 期中の株式売買金額	86,615,984千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	103,893,672千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.83

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2017年11月7日～2018年11月5日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 64,004	百万円 28,451	% 44.5	百万円 22,611	百万円 10,065	% 44.5

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 78	百万円 25	百万円 132

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 32

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)	4,366千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.0%

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、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2018年11月5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 (0.2%)				
日本水産	124	196	136,024	
マルハニチロ	12.4	19.6	79,772	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	49.6	78.4	99,489	
建設業 (2.5%)				
コムシスホールディングス	124	196	588,980	
大成建設	24.8	39.2	200,704	
大林組	124	196	205,212	
清水建設	124	196	194,236	
長谷工コーポレーション	24.8	39.2	56,212	
鹿島建設	124	98	149,352	
大和ハウス工業	124	196	658,560	
積水ハウス	124	196	324,674	
日揮	124	196	404,348	
千代田化工建設	124	196	76,244	
食料品 (4.6%)				
日清製粉グループ本社	124	196	433,748	
明治ホールディングス	24.8	39.2	294,000	
日本ハム	124	98	383,670	
サッポロホールディングス	24.8	39.2	93,100	
アサヒグループホールディングス	124	196	971,376	
キリンホールディングス	124	196	521,654	
宝ホールディングス	124	196	305,956	
キッコーマン	124	196	1,144,640	
味の素	124	196	353,584	
ニチレイ	62	98	254,702	
日本たばこ産業	124	196	558,306	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	12.4	19.6	32,202	
ユニチカ	12.4	19.6	11,524	
帝人	24.8	39.2	76,636	
東レ	124	196	158,622	

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
パルプ・紙 (0.2%)				
王子ホールディングス	124	196	140,728	
日本製紙	12.4	19.6	38,200	
化学 (8.5%)				
クラレ	124	196	310,464	
旭化成	124	196	244,314	
昭和電工	12.4	19.6	100,940	
住友化学	124	196	116,228	
日産化学	124	196	1,091,720	
東ソー	62	98	150,626	
トクヤマ	24.8	39.2	104,036	
デンカ	24.8	39.2	145,824	
信越化学工業	124	196	1,931,776	
三井化学	24.8	39.2	110,583	
三菱ケミカルホールディングス	62	98	89,307	
宇部興産	12.4	19.6	49,058	
日本化薬	124	196	268,324	
花王	124	196	1,458,044	
富士フィルムホールディングス	124	196	942,172	
資生堂	124	196	1,483,328	
日東電工	124	196	1,264,984	
医薬品 (8.6%)				
協和発酵キリン	124	196	428,652	
武田薬品工業	124	196	893,760	
アステラス製薬	620	980	1,641,500	
大日本住友製薬	124	196	507,836	
塩野義製薬	124	196	1,395,128	
中外製薬	124	196	1,309,280	
エーザイ	124	196	1,902,180	
第一三共	124	196	802,228	
大塚ホールディングス	124	196	1,062,712	
石油・石炭製品 (0.5%)				
昭和シェル石油	124	196	415,324	
J X T Gホールディングス	124	196	145,902	

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
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	62	98	223,734	
ブリヂストン	124	196	842,016	
ガラス・土石製品 (1.4%)				
AGC	24.8	39.2	147,000	
日本板硝子	12.4	19.6	19,502	
日本電気硝子	37.2	58.8	170,814	
住友大阪セメント	124	19.6	83,986	
太平洋セメント	12.4	19.6	63,896	
東海カーボン	124	196	357,700	
TOTO	62	98	408,660	
日本碍子	124	196	323,400	
鉄鋼 (0.2%)				
新日鐵住金	12.4	19.6	41,708	
神戸製鋼所	12.4	19.6	19,110	
ジェイ エフ イー ホールディングス	12.4	19.6	42,326	
日新製鋼	12.4	19.6	29,478	
大太平洋金属	12.4	19.6	63,014	
非鉄金属 (1.1%)				
日本軽金属ホールディングス	124	196	48,608	
三井金属鉱業	12.4	19.6	64,190	
東邦亜鉛	12.4	19.6	76,440	
三菱マテリアル	12.4	19.6	63,798	
住友金属鉱山	62	98	362,404	
DOWAホールディングス	24.8	39.2	135,436	
古河機械金属	12.4	—	—	
古河電気工業	12.4	19.6	62,426	
住友電気工業	124	196	303,408	
フジクラ	124	196	98,588	
金属製品 (0.4%)				
SUMCO	12.4	19.6	31,595	
東洋製織グループホールディングス	124	196	450,604	
機械 (4.9%)				
日本製鋼所	24.8	39.2	101,214	
オークマ	24.8	39.2	235,984	
アマダホールディングス	124	196	216,580	
小松製作所	124	196	614,264	
住友重機械工業	24.8	39.2	138,572	
日立建機	124	196	621,320	

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
クボタ	124	196	350,154	
荏原製作所	24.8	39.2	128,772	
ダイキン工業	124	196	2,573,480	
日本精工	124	196	216,972	
NTN	124	196	73,696	
ジェイテクト	124	196	267,148	
日立造船	24.8	39.2	15,836	
三菱重工業	12.4	19.6	83,633	
I H I	12.4	19.6	80,556	
電気機器 (17.5%)				
日清紡ホールディングス	124	196	221,872	
コニカミノルタ	124	196	209,524	
ミネベアミツミ	124	196	352,408	
日立製作所	124	39.2	137,631	
三菱電機	124	196	292,236	
富士電機	124	39.2	144,256	
安川電機	124	196	686,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	124	39.2	94,393	
日本電気	12.4	19.6	65,758	
富士通	124	19.6	134,534	
神電気工業	12.4	19.6	29,556	
セイコーエプソン	248	392	725,200	
パナソニック	124	196	230,986	
ソニー	124	196	1,177,568	
TDK	124	196	2,001,160	
アルプス電気	124	196	513,520	
パイオニア	124	196	19,796	
横河電機	124	196	436,492	
アドバンテスト	248	392	944,720	
カシオ計算機	124	196	339,080	
ファナック	124	196	4,100,320	
京セラ	248	392	2,446,080	
太陽誘電	124	196	500,192	
S C R E E Nホールディングス	24.8	39.2	248,920	
キャノン	186	294	951,678	
リコー	124	196	221,872	
東京エレクトロン	124	196	3,093,860	
輸送用機器 (5.4%)				
デンソー	124	196	990,584	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井E&Sホールディングス	12.4	19.6	27,734
川崎重工業	12.4	19.6	53,076
日産自動車	124	196	199,234
いすゞ自動車	62	98	149,254
トヨタ自動車	124	196	1,272,824
日野自動車	124	196	214,032
三菱自動車工業	12.4	19.6	14,092
マツダ	24.8	39.2	47,588
本田技研工業	248	392	1,260,672
スズキ	124	196	1,042,524
SUBARU	124	196	567,518
ヤマハ発動機	124	196	446,880
精密機器 (3.2%)			
テルモ	248	392	2,439,808
ニコン	124	196	387,884
オリンパス	124	196	752,640
シチズン時計	124	196	131,516
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	124	98	156,114
大日本印刷	62	98	248,920
ヤマハ	124	196	1,036,840
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	12.4	19.6	11,172
中部電力	12.4	19.6	30,889
関西電力	12.4	19.6	32,898
東京瓦斯	24.8	39.2	104,036
大阪瓦斯	24.8	39.2	79,223
陸運業 (2.2%)			
東武鉄道	24.8	39.2	119,364
東京急行電鉄	62	98	177,674
小田急電鉄	62	98	226,576
京王電鉄	24.8	39.2	227,360
京成電鉄	62	98	331,240
東日本旅客鉄道	12.4	19.6	191,825
西日本旅客鉄道	12.4	19.6	145,510
東海旅客鉄道	12.4	19.6	412,874
日本通運	12.4	19.6	139,944
ヤマトホールディングス	124	196	568,792

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.1%)			
日本郵船	12.4	19.6	36,985
商船三井	12.4	19.6	54,370
川崎汽船	12.4	19.6	31,791
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	12.4	19.6	75,381
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	62	98	255,192
情報・通信業 (10.2%)			
ヤフー	49.6	78.4	25,715
トレンドマイクロ	124	196	1,301,440
スカパーJ S A Tホールディングス	12.4	19.6	10,113
日本電信電話	24.8	39.2	165,620
KDDI	744	1,176	2,850,036
NTTドコモ	12.4	19.6	49,029
東宝	12.4	19.6	70,462
エヌ・ティ・ティ・データ	620	980	1,328,880
コナミホールディングス	124	196	908,460
ソフトバンクグループ	372	588	5,143,236
卸売業 (2.3%)			
双日	12.4	19.6	7,781
伊藤忠商事	124	196	395,920
丸紅	124	196	168,383
豊田通商	124	196	765,380
三井物産	124	196	359,562
住友商事	124	196	335,650
三菱商事	124	196	615,244
小売業 (14.3%)			
J. フロント リテイリング	62	98	151,214
三越伊勢丹ホールディングス	124	196	265,384
セブン&アイ・ホールディングス	124	196	947,464
ユニー・ファミリーマートホールディングス	124	196	2,704,800
高島屋	124	98	176,400
丸井グループ	124	196	466,088
イオン	124	196	502,348
ファーストリテイリング	124	196	11,299,400
銀行業 (0.9%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	124	196	102,900
新生銀行	12.4	19.6	34,339

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
あおぞら銀行	12.4	19.6	76,342	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	124	196	132,045	
りそなホールディングス	12.4	19.6	11,869	
三井住友トラスト・ホールディングス	12.4	19.6	88,317	
三井住友フィナンシャルグループ	12.4	19.6	86,377	
千葉銀行	124	196	143,276	
ふくおかフィナンシャルグループ	124	39.2	111,210	
静岡銀行	124	196	194,824	
みずほフィナンシャルグループ	124	196	38,043	
証券、商品先物取引業 (0.4%)				
大和証券グループ本社	124	196	126,929	
野村ホールディングス	124	196	103,801	
松井証券	124	196	233,436	
保険業 (1.0%)				
SOMPOホールディングス	31	49	230,594	
MS&ADインシュアランスグループホール	37.2	58.8	199,273	
ソニーフィナンシャルホールディングス	24.8	39.2	104,076	
第一生命ホールディングス	12.4	19.6	42,875	
東京海上ホールディングス	62	98	531,356	
T&Dホールディングス	24.8	39.2	73,068	

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
その他金融業 (0.3%)				
クレディセゾン	124	196	348,488	
不動産業 (1.6%)				
東急不動産ホールディングス	124	196	125,048	
三井不動産	124	196	498,036	
三菱地所	124	196	353,682	
東京建物	62	98	119,952	
住友不動産	124	196	775,180	
サービス業 (4.6%)				
ディー・エヌ・エー	37.2	58.8	114,189	
電通	124	196	1,032,920	
サイバーエージェント	—	39.2	200,312	
楽天	124	196	168,560	
リクルートホールディングス	372	588	1,759,296	
日本郵政	124	196	259,896	
東京ドーム	62	98	97,020	
セコム	124	196	1,750,672	
合 計	株 数・金 額	21,569	32,741	115,859,384
	銘柄数<比率>	225	225	<96.8%>

(注) 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。
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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	株式先物取引	日経225	百万円 3,870	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2018年11月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 115,859,384	% 96.6
コール・ローン等、その他	4,018,040	3.4
投資信託財産総額	119,877,424	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	119,732,372,448
コール・ローン等	2,890,246,028
株式(評価額)	115,859,384,760
未収入金	73,684,420
未収配当金	902,217,240
差入委託証拠金	6,840,000
(B) 負債	3,395
未払利息	3,395
(C) 純資産総額(A-B)	119,732,369,053
元本	50,133,432,038
次期繰越損益金	69,598,937,015
(D) 受益権総口数	50,133,432,038口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,883円

<注記事項>

- ①期首元本額 31,984,333,284円
 期中追加設定元本額 27,935,779,815円
 期中一部解約元本額 9,786,681,061円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,3883円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

三菱UFJ インデックス225オープン	45,844,786,525円
三菱UFJ インデックス225オープン(確定拠出年金)	4,288,645,513円
合計	50,133,432,038円

【お知らせ】

当社ホームページアドレス変更に伴う記載変更を行うため電子公告のアドレスを変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (変更前(旧) <http://www.am.mufg.jp/> → 変更後(新) <https://www.am.mufg.jp/>)
 (2018年1月1日)

○損益の状況 (2017年11月7日～2018年11月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,166,756,221
受取配当金	2,073,074,660
受取利息	12,277
その他収益金	95,118,813
支払利息	△ 1,449,529
(B) 有価証券売買損益	△ 885,667,846
売買益	11,157,617,846
売買損	△12,043,285,692
(C) 先物取引等取引損益	△ 319,961,320
取引益	1,027,812,260
取引損	△ 1,347,773,580
(D) 当期損益金(A+B+C)	961,127,055
(E) 前期繰越損益金	45,109,820,714
(F) 追加信託差損益金	38,225,325,185
(G) 解約差損益金	△14,697,335,939
(H) 計(D+E+F+G)	69,598,937,015
次期繰越損益金(H)	69,598,937,015

- (注) (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。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、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) (G)解約差損益金とあるのは、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。