

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／海外／株式 | |
|--------|--|--|
| 信託期間 | 2021年7月30日[当初、2016年7月31日]まで (1996年8月1日設定) | |
| 運用方針 | マザーファンドを通じて、NASDAQ市場に登録されている株式に投資し、キャピタルゲインの積極的な獲得をめざします。組入銘柄につきましては、ボトムアップ・アプローチを基本として、個別銘柄のファンダメンタルを重視した銘柄選定を行います。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | NASDAQマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。 |
| | マザーファンド | NASDAQ登録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制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 |
| | マザーファンド | 株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。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。 | |

※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。

信託期間を従来の2016年7月31日から2021年7月30日へ延長しました。

運用報告書(全体版)

三菱UFJ NASDAQオープン Aコース



第20期(決算日:2016年8月1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 NASDAQオープン Aコース」は、去る8月1日に第20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
 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. 0120-151034
 (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

三菱UFJ NASDAQオープン Aコースのご報告

| | |
|--------------------|----|
| ◇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 | 2 |
| ◇運用経過 | 3 |
| ◇今後の運用方針 | 7 |
| ◇1万口当たりの費用明細 | 8 |
| ◇売買及び取引の状況 | 9 |
| ◇株式売買比率 | 9 |
| ◇利害関係人との取引状況等 | 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 |
| ◇お知らせ | 12 |

マザーファンドのご報告

| | |
|----------------|----|
| ◇NASDAQ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 | | | (参考指数) NASDAQ総合指数 | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 | | |
|-----------------|-------|--------|--------|----------------------|--------|------------|------------|-----------|--------|-------|
| | (分配落) | 税 分 | 込 配 | み 金 | 期 騰 | | | | 中 落 | 率 |
| | 円 | | 円 | | % | | % | 百万円 | | |
| 16期(2012年7月31日) | 3,960 | | 0 | | △ 7.0 | 103.32 | 6.3 | 93.4 | — | 1,967 |
| 17期(2013年7月31日) | 4,540 | | 0 | | 14.6 | 126.44 | 22.4 | 93.9 | — | 1,836 |
| 18期(2014年7月31日) | 5,740 | | 0 | | 26.4 | 155.62 | 23.1 | 94.8 | — | 1,963 |
| 19期(2015年7月31日) | 6,114 | | 0 | | 6.5 | 178.10 | 14.4 | 95.7 | — | 2,550 |
| 20期(2016年8月1日) | 5,862 | | 0 | | △ 4.1 | 177.66 | △ 0.2 | 88.1 | — | 1,821 |

- (注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
- (注) NASDAQ総合指数とは、NASDAQ上場全銘柄の時価総額加重平均により算出され、1971年2月5日を基準値100としています。
NASDAQ総合指数(円ヘッジベース)は、NASDAQ総合指数をもとに、委託会社が計算したものです。
- (注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
- (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 | | (参 考 指 数) N A S D A Q 総 合 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---------------------|------------|--------|------------------------------------|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | (円ヘッジベース) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2015年7月31日 | 円 6,114 | % — | 178.10 | % — | % 95.7 | % — |
| 8月末 | 5,799 | △ 5.2 | 167.61 | △ 5.9 | 98.1 | — |
| 9月末 | 5,397 | △11.7 | 156.71 | △12.0 | 96.7 | — |
| 10月末 | 5,996 | △ 1.9 | 175.97 | △ 1.2 | 96.8 | — |
| 11月末 | 5,968 | △ 2.4 | 177.76 | △ 0.2 | 96.4 | — |
| 12月末 | 6,031 | △ 1.4 | 176.91 | △ 0.7 | 96.7 | — |
| 2016年1月末 | 5,370 | △12.2 | 156.00 | △12.4 | 98.7 | — |
| 2月末 | 5,303 | △13.3 | 158.79 | △10.8 | 96.3 | — |
| 3月末 | 5,518 | △ 9.7 | 168.26 | △ 5.5 | 93.0 | — |
| 4月末 | 5,446 | △10.9 | 167.91 | △ 5.7 | 91.0 | — |
| 5月末 | 5,612 | △ 8.2 | 170.20 | △ 4.4 | 95.0 | — |
| 6月末 | 5,435 | △11.1 | 164.67 | △ 7.5 | 92.6 | — |
| 7月末 | 5,849 | △ 4.3 | 177.43 | △ 0.4 | 89.2 | — |
| (期 末) 2016年8月1日 | 5,862 | △ 4.1 | 177.66 | △ 0.2 | 88.1 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(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。

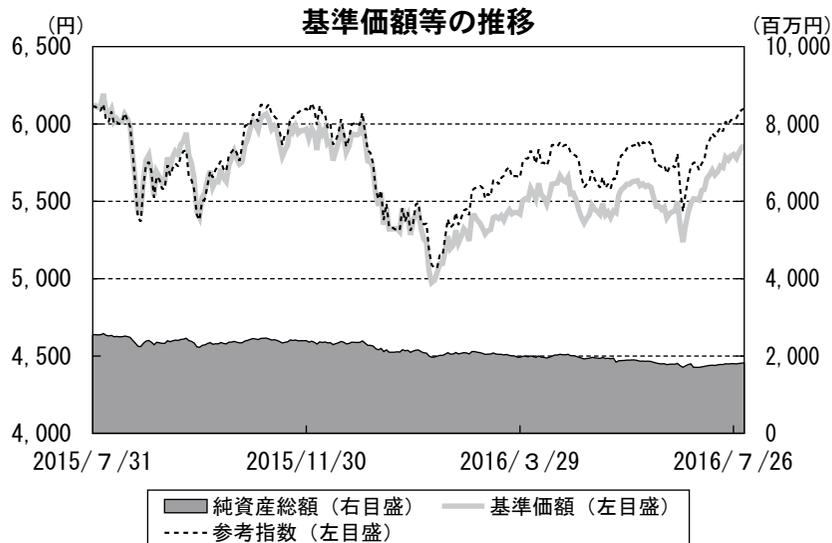
運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第20期：2015/8/1～2016/8/1)

基準価額の動き

基準価額は期首に比べ4.1%の下落となりました。



基準価額の主な変動要因

下落要因

大半の個別銘柄の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20期：2015/8/1～2016/8/1)

◎NASDAQ株式市況

- ・2015年8月には、中国景気減速への懸念から世界的に株式市況が動揺し、NASDAQ株式市況も調整局面を迎えることとなりました。また、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において利上げ開始が見送られたことが、むしろ景気不安を想起させることとなり、調整局面が続きました。その後、2015年末にかけては、ECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和に前向きな姿勢などを好感し戻り基調となりました。12月のFOMCにおいて利上げが行われましたが、概ね織り込み済みだったとみられ、大きな波乱要因とはなりませんでした。
- ・2016年初より、市況は中国株式市況下落と世界的な景気減速懸念、原油価格下落を受け、大きく調整する展開となりました。しかしその後は、原油価格の反発、各国の中央銀行より景気減速回避に向けての対策が打ち出されたことにより戻り基調となりました。2016年6月の英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が上回ったことによる混乱も一時的なものにとどまりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<三菱UFJ NASDAQオープン Aコース>

- ・当ファンドは、NASDAQマザーファンド受益証券を通じて、NASDAQ登録株式（REIT（不動産投資信託証券）含む）に投資しました。また、為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図る運用を行いました。為替市況が、期首に比べ、円高・ドル安となりましたが、為替ヘッジを行っていたため、円に対するドルの下落分を回避することができました。
- ・その結果、基準価額は期首に比べ4.1%下落しました。

<NASDAQマザーファンド>

基準価額は期首に比べ19.3%の下落となりました。

- ・NASDAQ登録株式を主要投資対象とし、値上がり益の獲得をめざして運用を行いました。インターネット、バイオ・テクノロジーなどの成長産業に注目し、特に有望と思われる企業に選別投資を行いました。銘柄選定にあたっては、フリーキャッシュフロー面からの割安感にも着目しました。
- ・銘柄数は、期首時点においては、中小型株も含めある程度の分散投資を行っていたことから、60銘柄程度としていました。
- ・当期においては、テクノロジー、ヘルスケア、消費の各業界において、規模を生かせる大手企業と中小企業の業績格差が拡大するとの見通しの下、中小型株の売却、大型株の組入比率引き上げといった変更を行いました。結果として、2015年12月末以降、期末に至るまで組入銘柄数は30銘柄程度にて推移させました。

以上の結果、個別銘柄の株価が下落したこと、および為替が対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

パフォーマンスに影響を与えた主な銘柄は以下の通りです。

(プラス要因)

◎銘柄

- ・「AMAZON.COM INC」：従来よりの主力事業であるオンライン小売業が順調に拡大することに加え、クラウド・サービスのAWS（アマゾン・ウェブ・サービス）などの新規事業も立ち上がるとの見通しから期中に組み入れを行いました。収益が期待通り順調に拡大し、業績に貢献、株価が上昇しました。
- ・「FACEBOOK INC-A」：加入者の増加と、それに伴う広告収入増を予想し組み入れを行いました。加入者数が期待通り拡大したことが好感されました。加入者への広告に対し課金する広告収入も伸び、業績が拡大し、株価の上昇につながりました。

(マイナス要因)

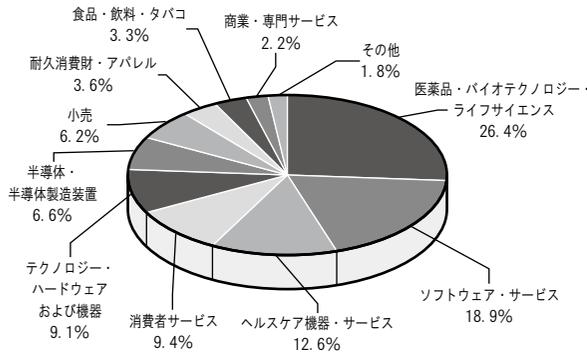
◎銘柄

- ・「GILEAD SCIENCES INC」：新しいバイオ薬の自社開発、他企業買収による新しい収益源の獲得を期待し、組み入れを行いました。しかしながら、自社における新薬開発が順調に進展せず、また既存のC型肝炎治療薬の予想を上回る価格低下により、収益が低迷、株価が下落しました。株価下落により株価水準面での割安感が高まったこと、引き続き買収実施が期待されることなどから継続保有しています。
- ・「APPLE INC」：iPhoneを始めとする主力製品の底堅い需要を予想し、組み入れを行いました。顧客による買い替えサイクルの長期化などを背景に、売上が伸び悩みとなり、株価が下落しました。株価下落により、株価水準面での割安感が高まったことから継続保有しています。

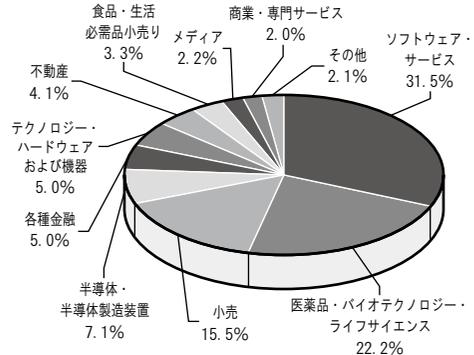
(ご参考)

組入上位10業種

期首 (2015年7月31日)



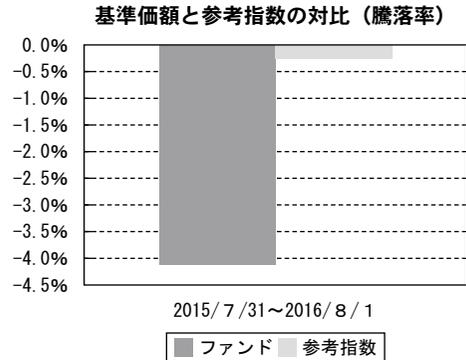
期末 (2016年8月1日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。
 (注) REITを含めて表示しています。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンド（ベビーファンド）の基準価額と参考指数の騰落率との対比です。
- ・参考指数はNASDAQ総合指数（円ヘッジベース）です。



分配金について

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20期 |
|-----------|---------------------|
| | 2015年8月1日～2016年8月1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 | 1,174 |

（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

<三菱UFJ NASDAQオープン Aコース>

◎今後の運用方針

- ・NASDAQマザーファンド受益証券を高位に組み入れる方針です。
- ・実質組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減に努めます。

<NASDAQマザーファンド>

◎運用環境の見通し

- ・米国景気は、緩やかなペースながらも方向性としては回復基調にあるとの基本的な見方に変化はありません。しかしながら、足下の強弱入り交じった景気指標、2016年6月の英国のEU離脱などに伴う国際金融市場の混乱が今後米国に与える影響など、不透明感が高まってきたことも事実です。2月の調整以降の市況の戻りのペースが速かったこともあり、不透明要因がある程度払拭されるまで、市況の上値は重いと考えられます。このような環境下、景気の影響を受け易い企業と独自の成長力を有する企業の業績格差は拡大すると思われ、個別銘柄物色の動きが強まると予想しています。

◎今後の運用方針

- ・NASDAQ市場には、インターネット、半導体、バイオなど、高い収益成長が期待される企業が存在しており、銘柄選定により、高い投資収益を得ることが可能と考えます。
- ・スマートフォン、タブレット・パソコンの普及によりインターネット関連企業は恩恵を受けます。オンライン商取引を行う企業は高成長を遂げています。ソーシャルネットワーク・サイトの運営企業も、モバイル経由のアクセス件数の増加により、確実に恩恵を受けつつあります。また、ゲノム技術を実用化することにより新薬開発件数が拡大、新たな収益拡大期を迎えつつあるバイオ企業にも引き続き注目しています。
- ・銘柄選定にあたっては、フリーキャッシュフロー面からの割安感などにも着目し、成長力のある銘柄に投資することに注力する方針です。

○ 1万口当たりの費用明細

(2015年8月1日～2016年8月1日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|--------|-----------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 93 | 1.646 | (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) | (44) | (0.780) | 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) | (43) | (0.758) | 交付運用報告書等各种書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受 託 会 社) | (6) | (0.108) | 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 | 24 | 0.425 | (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) | (24) | (0.421) | |
| (投 資 信 託 証 券) | (0) | (0.004) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.004 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (0) | (0.004) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 2 | 0.028 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.024) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| (監 査 費 用) | (0) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.002) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 119 | 2.103 | |
| 期中の平均基準価額は、5,679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、有価証券取引税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

(2015年8月1日～2016年8月1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 |
| NASDAQマザーファンド | 千口 500,129 | 千円 1,187,000 | 千口 620,416 | 千円 1,492,000 |

○株式売買比率

(2015年8月1日～2016年8月1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 | |
|---------------------|---------------|--|
| | NASDAQマザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 45,134,124千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 12,485,710千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 3.61 | |

(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

(2015年8月1日～2016年8月1日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ NASDAQオープン Aコース>

| 区分 | 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 | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |

<NASDAQマザーファンド>

| 区分 | 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 | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 312 | — | — | 9,905 | 295 | 3.0 |

平均保有割合 17.0%

※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。

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) | 9,174千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1,494千円 |
| (B) / (A) | 16.3% |

(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東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2016年8月1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 |
| NASDAQマザーファンド | 千口 889,211 | 千口 768,925 | 千円 1,774,140 |

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

(2016年8月1日現在)

| 項 目 | 当 期 | 末 |
|---------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| NASDAQマザーファンド | 千円 1,774,140 | % 93.8 |
| コール・ローン等、その他 | 117,912 | 6.2 |
| 投資信託財産総額 | 1,892,052 | 100.0 |

(注) NASDAQマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (6,830,006千円) の投資信託財産総額 (6,908,288千円) に対する比率は98.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | | |
|-----------------|--|--|--|
| 1アメリカドル=102.45円 | | | |
|-----------------|--|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月1日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 3,620,537,725 |
| コール・ローン等 | 87,319,570 |
| NASDAQマザーファンド(評価額) | 1,774,140,790 |
| 未収入金 | 1,759,077,365 |
| (B) 負債 | 1,799,536,527 |
| 未払金 | 1,781,463,619 |
| 未払解約金 | 2,134,976 |
| 未払信託報酬 | 15,905,428 |
| 未払利息 | 131 |
| その他未払費用 | 32,373 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,821,001,198 |
| 元本 | 3,106,561,919 |
| 次期繰越損益金 | △1,285,560,721 |
| (D) 受益権総口数 | 3,106,561,919口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 5,862円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 4,171,447,715円
 期中追加設定元本額 184,435,656円
 期中一部解約元本額 1,249,321,452円
 また、1口当たり純資産額は、期末0.5862円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,285,560,721円です。

③分配金の計算過程

| 項 目 | 2015年8月1日～ 2016年8月1日 |
|---------------------------|-------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | －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 | 100,390,666円 |
| 分配準備積立金額 | 264,630,751円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 365,021,417円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 1,174円 |
| 1万口当たり分配金額 | －円 |
| 収益分配金金額 | －円 |

○損益の状況 (2015年8月1日～2016年8月1日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,448 |
| 受取利息 | 10,750 |
| 支払利息 | △ 7,302 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 36,456,854 |
| 売買益 | 769,733,376 |
| 売買損 | △ 806,190,230 |
| (C) 信託報酬等 | △ 35,455,797 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 71,909,203 |
| (E) 前期繰越損益金 | 264,630,751 |
| (F) 追加信託差損益金 | △1,478,282,269 |
| (配当等相当額) | (100,365,590) |
| (売買損益相当額) | (△1,578,647,859) |
| (G) 計(D+E+F) | △1,285,560,721 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △1,285,560,721 |
| 追加信託差損益金 | △1,478,282,269 |
| (配当等相当額) | (100,390,666) |
| (売買損益相当額) | (△1,578,672,935) |
| 分配準備積立金 | 264,630,751 |
| 繰越損益金 | △ 71,909,203 |

- (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信託期間を従来の2016年7月31日から2021年7月30日へ延長し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年10月31日)
- ②信託財産留保額を従来の換金申込受付日の翌営業日の基準価額×0.5%から同×0.3%へ引き下げ、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年10月31日)
- ③2014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ます。)) の税率が適用されます。

NASDAQマザーファンド

《第20期》決算日2016年8月1日

〔計算期間：2015年8月1日～2016年8月1日〕

「NASDAQマザーファンド」は、8月1日に第20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20期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|---|
| 運用方針 | NASDAQ市場に登録されている株式を投資対象とし、キャピタルゲインの積極的な獲得をめざします。組入銘柄につきましては、ボトムアップ・アプローチを基本として、個別銘柄のファンダメンタルを重視した銘柄選定を行います。外貨建資産につきましては、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主要運用対象 | NASDAQ登録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制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | (参考指数) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------|------------------------|-------|------------|------------|--------------|
| | 円 | 騰落率 | NASDAQ総合指数 (円換算ベース) | 騰落率 | | | |
| 16期(2012年7月31日) | 11,229 | △5.3 | 230,276.31 | 7.2 | 94.1 | — | 百万円 4,047 |
| 17期(2013年7月31日) | 16,375 | 45.8 | 354,703.38 | 54.0 | 94.1 | — | 4,897 |
| 18期(2014年7月31日) | 22,005 | 34.4 | 459,009.27 | 29.4 | 94.5 | — | 7,835 |
| 19期(2015年7月31日) | 28,575 | 29.9 | 636,173.87 | 38.6 | 96.1 | — | 20,186 |
| 20期(2016年8月1日) | 23,073 | △19.3 | 528,860.22 | △16.9 | 90.4 | — | 6,908 |

- (注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。
(注) NASDAQ総合指数とは、NASDAQ上場全銘柄の時価総額加重平均により算出され、1971年2月5日を基準値100としています。
NASDAQ総合指数(円換算ベース)は、NASDAQ総合指数をもとに、委託会社が計算したものです。
(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。
(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 | | (参 考 指 数) N A S D A Q 総 合 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|------------------------|---------|-------|------------------------------------|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (円換算ベース) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2015年 7月31日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 28,575 | — | 636,173.87 | — | 96.1 | — |
| 8 月 末 | 26,415 | △ 7.6 | 585,095.82 | △ 8.0 | 98.0 | — |
| 9 月 末 | 24,374 | △14.7 | 541,897.71 | △14.8 | 97.4 | — |
| 10 月 末 | 27,352 | △ 4.3 | 613,479.24 | △ 3.6 | 97.2 | — |
| 11 月 末 | 27,683 | △ 3.1 | 629,762.01 | △ 1.0 | 96.8 | — |
| 12 月 末 | 27,562 | △ 3.5 | 616,068.64 | △ 3.2 | 97.4 | — |
| 2016年 1 月 末 | 24,603 | △13.9 | 544,722.41 | △14.4 | 97.3 | — |
| 2 月 末 | 22,856 | △20.0 | 521,569.20 | △18.0 | 95.7 | — |
| 3 月 末 | 23,652 | △17.2 | 548,671.60 | △13.8 | 94.3 | — |
| 4 月 末 | 22,788 | △20.3 | 533,729.62 | △16.1 | 92.8 | — |
| 5 月 末 | 23,757 | △16.9 | 547,322.49 | △14.0 | 94.6 | — |
| 6 月 末 | 21,410 | △25.1 | 491,832.62 | △22.7 | 92.5 | — |
| 7 月 末 | 23,440 | △18.0 | 538,283.01 | △15.4 | 90.4 | — |
| (期 末) 2016年 8 月 1 日 | 23,073 | △19.3 | 528,860.22 | △16.9 | 90.4 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

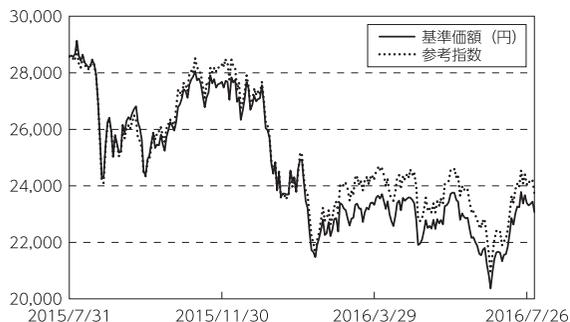
○運用経過

●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19.3%の下落となりました。

基準価額の推移



(注) 参考指数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

◎NASDAQ株式市況

- ・2015年8月には、中国景気減速への懸念から世界的に株式市況が動揺し、NASDAQ株式市況も調整局面を迎えることとなりました。また、9月のFOMC（米連邦公開市場委員会）において利上げ開始が見送られたことが、むしろ景気不安を想起させることとなり、調整局面が続きました。その後、2015年末にかけては、ECB（欧州中央銀行）の追加金融緩和に前向きな姿勢などを好感し戻り基調となりました。12月のFOMCにおいて利上げが行われましたが、概ね織り込み済みだったとみられ、大きな波乱要因とはなりませんでした。
- ・2016年初より、市況は中国株式市況下落と世界的な景気減速懸念、原油価格下落を受け、大きく調整する展開となりました。しかしその後は、原油価格の反発、各国の中央銀行より景気減速

回避に向けての対策が打ち出されたことにより戻り基調となりました。2016年6月の英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が上回ったことによる混乱も一時的なものにとどまりました。

◎為替市況

・期首に比べ、対ドルで17.4%の円高・ドル安となりました。米国の景況感後退、リスク回避の動きに伴う円買いなどを背景に、円高・ドル安が進みました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・NASDAQ登録株式（REIT（不動産投資信託証券）を含む）を主要投資対象とし、値上がり益の獲得をめざして運用を行いました。インターネット、バイオ・テクノロジーなどの成長産業に注目し、特に有望と思われる企業に選別投資を行いました。銘柄選定にあたっては、フリーキャッシュフロー面からの割安感にも着目しました。
- ・銘柄数は、期首時点においては、中小型株も含めある程度の分散投資を行っていたことから、60銘柄程度としていました。
- ・当期においては、テクノロジー、ヘルスケア、消費の各業界において、規模を生かせる大手企業と中小企業の業績格差が拡大するとの見通しの下、中小型株の売却、大型株の組入比率引き上げといった変更を行いました。結果として、2015年12月末以降、期末に至るまで組入銘柄数は30銘柄程度にて推移させました。

以上の結果、個別銘柄の株価が下落したこと、および為替が対円で下落したことなどから、基準価額は下落しました。

パフォーマンスに影響を与えた主な銘柄は以下の通りです。

（プラス要因）

◎銘柄

- ・「AMAZON.COM INC」：従来よりの主力事業である

オンライン小売業が順調に拡大することに加え、クラウド・サービスのAWS（アマゾン・ウェブ・サービス）などの新規事業も立ち上がるとの見通しから期中に組み入れを行いました。収益が期待通り順調に拡大し、業績に貢献、株価が上昇しました。

- ・「FACEBOOK INC-A」：加入者の増加と、それに伴う広告収入増を予想し組み入れを行いました。加入者数が期待通り拡大したことが好感されました。加入者への広告に対し課金する広告収入も伸び、業績が拡大し、株価の上昇につながりました。

（マイナス要因）

◎銘柄

- ・「GILEAD SCIENCES INC」：新しいバイオ薬の自社開発、他企業買収による新しい収益源の獲得を期待し、組み入れを行いました。しかしながら、自社における新薬開発が順調に進展せず、また既存のC型肝炎治療薬の予想を上回る価格低下により、収益が低迷、株価が下落しました。株価下落により株価水準面での割安感が高まったこと、引き続き買収実施が期待されることなどから継続保有しています。
- ・「APPLE INC」：iPhoneを始めとする主力製品の底堅い需要を予想し、組み入れを行いました。顧客による買い替えサイクルの長期化などを背景に、売上が伸び悩みとなり、株価が下落しました。株価下落により、株価水準面での割安感が高まったことから継続保有しています。

◎今後の運用方針

◎運用環境の見通し

- ・米国景気は、緩やかなペースながらも方向性としては回復基調にあるとの基本的な見方に変化はありません。しかしながら、足下の強弱入り交じった景気指標、2016年6月の英国のEU離脱などに伴う国際金融市場の混乱が今後米国に与える影響など、不透明感が高まってきたことも事実です。2月の調整以降の市況の戻りの

ペースが速かったこともあり、不透明要因がある程度払拭されるまで、市況の上値は重いと考えられます。このような環境下、景気の影響を受け易い企業と独自の成長力を有する企業の業績格差は拡大すると思われ、個別銘柄物色の動きが強まると予想しています。

◎今後の運用方針

・NASDAQ市場には、インターネット、半導体、バイオなど、高い収益成長が期待される企業が存在しており、銘柄選定により、高い投資収益を得ることが可能と考えます。

・スマートフォン、タブレット・パソコンの普及によりインターネット関連企業は恩恵を受けず。オンライン商取引を行う企業は高成長を遂げています。ソーシャルネットワーク・サイトの運営企業も、モバイル経由のアクセス件数の増加により、確実に恩恵を受けつつあります。また、ゲノム技術を実用化することにより新薬開発件数が拡大、新たな収益拡大期を迎えつつあるバイオ企業にも引き続き注目しています。

・銘柄選定にあたっては、フリーキャッシュフロー面からの割安感などにも着目し、成長力のある銘柄に投資することに注力する方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2015年8月1日～2016年8月1日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------------|----------------------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 円 112 (111) (1) | % 0.447 (0.445) (0.003) | (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 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 1 (1) | 0.004 (0.004) | (b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 6 (6) (0) | 0.024 (0.023) (0.001) | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 119 | 0.475 | |
| 期中の平均基準価額は、24,959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

(2015年8月1日～2016年8月1日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------|--------|---------|--------|---------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 | 千アメリカドル | 百株 | 千アメリカドル |
| | | 18,809 | 148,330 | 43,551 | 232,537 |

(注) 金額は受渡代金。

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----|-------------|----|---------|----|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| | EQUINIX INC | 6 | 2,426 | - | - |

(注) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2015年8月1日～2016年8月1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 | 45,134,124千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 12,485,710千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 3.61 |

(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

(2015年8月1日～2016年8月1日)

利害関係人との取引状況

| 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 17,808 | 百万円 2,178 | % 12.2 | 百万円 27,325 | 百万円 4,528 | % 16.6 |
| 為替直物取引 | 312 | - | - | 9,905 | 295 | 3.0 |

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) | 59,380千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 8,723千円 |
| (B) / (A) | 14.7% |

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信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2016年8月1日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|-------|---------|---------|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| CME GROUP INC | — | 313 | 3,200 | 327,851 | 各種金融 |
| RR DONNELLEY & SONS CO | 1,485 | — | — | — | 商業・専門サービス |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 638 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 3,339 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 150 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| STERICYCLE INC | — | 62 | 559 | 57,338 | 商業・専門サービス |
| INTEL CORP | — | 846 | 2,949 | 302,141 | 半導体・半導体製造装置 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | — | 126 | 2,111 | 216,373 | 食品・生活必需品小売り |
| ELECTRONIC ARTS INC | 679 | 136 | 1,039 | 106,494 | ソフトウェア・サービス |
| SYMANTEC CORP | 512 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ROSS STORES INC | — | 158 | 980 | 100,401 | 小売 |
| MICROSOFT CORP | 1,056 | 1,036 | 5,872 | 601,591 | ソフトウェア・サービス |
| AMSURG CORP | 372 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| STARBUCKS CORP | 740 | 113 | 655 | 67,203 | 消費者サービス |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | — | 68 | 1,993 | 204,256 | 小売 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 934 | 226 | 907 | 92,985 | ソフトウェア・サービス |
| WYNN RESORTS LTD | 166 | — | — | — | 消費者サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A | — | 208 | 1,398 | 143,307 | メディア |
| XILINX INC | 151 | 78 | 398 | 40,818 | 半導体・半導体製造装置 |
| GILEAD SCIENCES INC | 752 | 374 | 2,972 | 304,581 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MAGELLAN HEALTH INC | 394 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | — | 189 | 770 | 78,962 | 半導体・半導体製造装置 |
| AMAZON.COM INC | — | 78 | 5,956 | 610,259 | 小売 |
| KLA-TENCOR CORP | 239 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| VERISIGN INC | 344 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| NVIDIA CORP | 330 | 72 | 411 | 42,119 | 半導体・半導体製造装置 |
| AMDOCS LTD | 146 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| NETAPP INC | 292 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| INCYTE CORP | 215 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC | 124 | 47 | 1,377 | 141,090 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PDL BIOPHARMA INC | 238 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE SYSTEMS INC | — | 36 | 352 | 36,092 | ソフトウェア・サービス |
| APOLLO EDUCATION GROUP INC | 460 | — | — | — | 消費者サービス |
| BED BATH & BEYOND INC | 239 | — | — | — | 小売 |
| CELGENE CORP | 690 | 336 | 3,770 | 386,251 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 443 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| FOSSIL GROUP INC | 269 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| SILICON LABORATORIES INC | 243 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| LIFEPOINT HEALTH INC | 205 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| APPLE INC | 826 | 304 | 3,167 | 324,559 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 246 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| EXPEDIA INC | 302 | 76 | 888 | 91,065 | 小売 |
| STEVEN MADDEN LTD | 158 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| COMMVAULT SYSTEMS INC | 204 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ICONIX BRAND GROUP INC | 740 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| NATIONAL CINEMEDIA INC | 442 | — | — | — | メディア |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|-------------------------------|---------|--------|---------|---------|------------------------|-------|
| | | 株数 | 評 価 額 | | 評 価 額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | | |
| ERICSSON (LM) TEL-SP ADR | 625 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 234 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| SANDERSON FARMS INC | 312 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ | |
| JACK IN THE BOX INC | 324 | — | — | — | 消費者サービス | |
| CRACKER BARREL OLD COUNTRY | 189 | — | — | — | 消費者サービス | |
| VERISK ANALYTICS INC | — | 84 | 716 | 73,390 | 商業・専門サービス | |
| FORTINET INC | 173 | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| QKL STORES INC | 71 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| GREEN PLAINS INC | 219 | — | — | — | エネルギー | |
| VERA BRADLEY INC | 1,354 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 90 | 68 | 2,903 | 297,470 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| FACEBOOK INC-A | 917 | 400 | 4,961 | 508,350 | ソフトウェア・サービス | |
| SCHULMAN (A.) INC | 205 | — | — | — | 素材 | |
| BLOOMIN' BRANDS INC | 907 | — | — | — | 消費者サービス | |
| ALPHABET INC-CL C | — | 78 | 6,058 | 620,648 | ソフトウェア・サービス | |
| LANDS' END INC | 342 | — | — | — | 小売 | |
| LHC GROUP INC | 816 | 73 | 330 | 33,849 | ヘルスケア機器・サービス | |
| FIREEYE INC | 87 | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| JD.COM INC-ADR | 969 | — | — | — | 小売 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 664 | 207 | 831 | 85,210 | ソフトウェア・サービス | |
| PREMIER INC-CLASS A | 704 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス | |
| ONCOMED PHARMACEUTICALS INC | 715 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| SURGICAL CARE AFFILIATES INC | 870 | 67 | 348 | 35,700 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SHIRE PLC-ADR | 181 | 157 | 3,057 | 313,229 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| MATTHEWS INTL CORP-CLASS A | 156 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| FTD COS INC | 279 | — | — | — | 小売 | |
| OPHTHOTECH CORP | 235 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| INGLES MARKETS INC-CLASS A | 172 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| ENANTA PHARMACEUTICALS INC | 170 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| 合 計 | 株数・金額 | 30,763 | 6,020 | 60,942 | 6,243,595 | |
| | 銘柄数<比率> | 63 | 29 | — | <90.4%> | |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | | |
|-------------|---------|-------|---------|---------|---------|-----|
| | | 口数 | 口数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカドル | 千円 | % | |
| EQUINIX INC | — | 6 | 2,572 | 263,583 | 3.8 | |
| 合 計 | 口数・金額 | — | 6 | 2,572 | 263,583 | |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | — | <3.8%> | |

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 比率および合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2016年8月1日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 6,243,595 | 90.4 |
| 投資証券 | 263,583 | 3.8 |
| コール・ローン等、その他 | 401,110 | 5.8 |
| 投資信託財産総額 | 6,908,288 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(6,830,006千円)の投資信託財産総額(6,908,288千円)に対する比率は98.9%です。
 (注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

| | | |
|-----------------|--|--|
| 1アメリカドル=102.45円 | | |
|-----------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年8月1日現在)

○損益の状況 (2015年8月1日～2016年8月1日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 6,908,288,695 |
| コール・ローン等 | 287,274,693 |
| 株式(評価額) | 6,243,595,356 |
| 投資証券(評価額) | 263,583,667 |
| 未収入金 | 113,834,979 |
| (B) 負債 | 117 |
| 未払利息 | 117 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 6,908,288,578 |
| 元本 | 2,994,140,447 |
| 次期繰越損益金 | 3,914,148,131 |
| (D) 受益権総口数 | 2,994,140,447口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,073円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 87,517,422 |
| 受取配当金 | 87,470,008 |
| 受取利息 | 60,920 |
| 支払利息 | △ 13,506 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 3,628,872,947 |
| 売買益 | 1,257,660,563 |
| 売買損 | △ 4,886,533,510 |
| (C) 保管費用等 | △ 2,776,885 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 3,544,132,410 |
| (E) 前期繰越損益金 | 13,122,126,180 |
| (F) 追加信託差損益金 | 839,922,305 |
| (G) 解約差損益金 | △ 6,503,767,944 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 3,914,148,131 |
| 次期繰越損益金(H) | 3,914,148,131 |

<注記事項>

- ①期首元本額 7,064,294,808円
 期中追加設定元本額 597,077,695円
 期中一部解約元本額 4,667,232,056円
 また、1口当たり純資産額は、期末23,073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 NASDAQオープン Aコース | 768,925,060円 |
| 三菱UFJ NASDAQオープン Bコース | 2,225,215,387円 |
| 合計 | 2,994,140,447円 |

【お知らせ】

- ①信託期間を従来の2016年7月30日から信託約款に定める第39条第1項および第2項、第42条第1項、第43条第1項および第45条第2項の規定による信託期間終了日へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2015年10月31日)
- ②信用リスクを適正に管理する方法を新たに定めるため(分散型に分類)、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行うための、所要の約款変更を行いました。
 (2016年7月1日)