

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(2009年10月28日設定) | |
| 運用方針 | 日経225マザーファンド受益証券を通じて、原則として、日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄に等株数投資を行い、日経225と連動する投資成果をめざします。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | 日経225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 | わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄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。外貨建資産への投資は行いません。 |
| | 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は行いません。 |
| 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。



 eMAXIS
イーマクス

eMAXIS 日経225インデックス



第4期(決算日:2013年1月28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「eMAXIS 日経225インデックス」は、去る1月28日に第4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投信

MUFG

東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

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

eMAXIS専用サイト URL:<http://maxis.muam.jp/e/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

営業企画推進部

お客様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)

お客様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

eMAXIS 日経225インデックスのご報告

| | |
|--------------------------|----|
| ◇設定以来の運用実績 | 1 |
| ◇当期中の基準価額と市況等の推移 | 1 |
| ◇当期の運用経過 | 2 |
| ◇収益分配金 | 5 |
| ◇今後の運用方針 | 5 |
| ◇1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細 | 6 |
| ◇売買および取引の状況 | 6 |
| ◇株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合 | 6 |
| ◇主要な売買銘柄 | 7 |
| ◇利害関係人との取引状況等 | 7 |
| ◇組入資産の明細 | 8 |
| ◇投資信託財産の構成 | 12 |
| ◇資産、負債、元本および基準価額の状況 | 12 |
| ◇損益の状況 | 12 |
| ◇分配金のお知らせ | 13 |
| ◇お知らせ | 13 |

マザーファンドのご報告

| | |
|---------------|----|
| ◇日経225マザーファンド | 14 |
|---------------|----|

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。

設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 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 | (日経225) | 期中 騰落率 | | | |
| (設定日) 2009年10月28日 | 円 10,000 | 円 — | % — | 円 10,212.46 | % — | % — | % — | 百万円 1 |
| 1期(2010年1月26日) | 10,111 | 0 | 1.1 | 10,325.28 | 1.1 | 99.1 | 0.9 | 110 |
| 2期(2011年1月26日) | 10,321 | 0 | 2.1 | 10,401.90 | 0.7 | 97.4 | 2.6 | 706 |
| 3期(2012年1月26日) | 8,930 | 0 | △13.5 | 8,849.47 | △14.9 | 98.5 | 1.5 | 1,297 |
| 4期(2013年1月28日) | 11,114 | 0 | 24.5 | 10,824.31 | 22.3 | 98.2 | 1.7 | 1,718 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(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) 上記の株式組入比率には、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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

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 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|--------------------|------------|---------|---------------|---------|-----------|----------|
| | 騰落率 | (日経225) | 騰落率 | (日経225) | | |
| (期首) 2012年1月26日 | 円 8,930 | % — | 円 8,849.47 | % — | % 98.5 | % 1.5 |
| 1月末 | 8,883 | △0.5 | 8,802.51 | △0.5 | 98.7 | 1.3 |
| 2月末 | 9,816 | 9.9 | 9,723.24 | 9.9 | 99.0 | 1.0 |
| 3月末 | 10,266 | 15.0 | 10,083.56 | 13.9 | 97.3 | 2.7 |
| 4月末 | 9,694 | 8.6 | 9,520.89 | 7.6 | 97.3 | 2.6 |
| 5月末 | 8,696 | △2.6 | 8,542.73 | △3.5 | 97.4 | 2.6 |
| 6月末 | 9,175 | 2.7 | 9,006.78 | 1.8 | 98.0 | 2.0 |
| 7月末 | 8,855 | △0.8 | 8,695.06 | △1.7 | 97.6 | 2.4 |
| 8月末 | 9,007 | 0.9 | 8,839.91 | △0.1 | 98.1 | 1.9 |
| 9月末 | 9,104 | 1.9 | 8,870.16 | 0.2 | 97.1 | 2.9 |
| 10月末 | 9,163 | 2.6 | 8,928.29 | 0.9 | 97.9 | 2.1 |
| 11月末 | 9,691 | 8.5 | 9,446.01 | 6.7 | 97.7 | 2.3 |
| 12月末 | 10,677 | 19.6 | 10,395.18 | 17.5 | 98.5 | 1.5 |
| (期末) 2013年1月28日 | 11,114 | 24.5 | 10,824.31 | 22.3 | 98.2 | 1.7 |

(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。

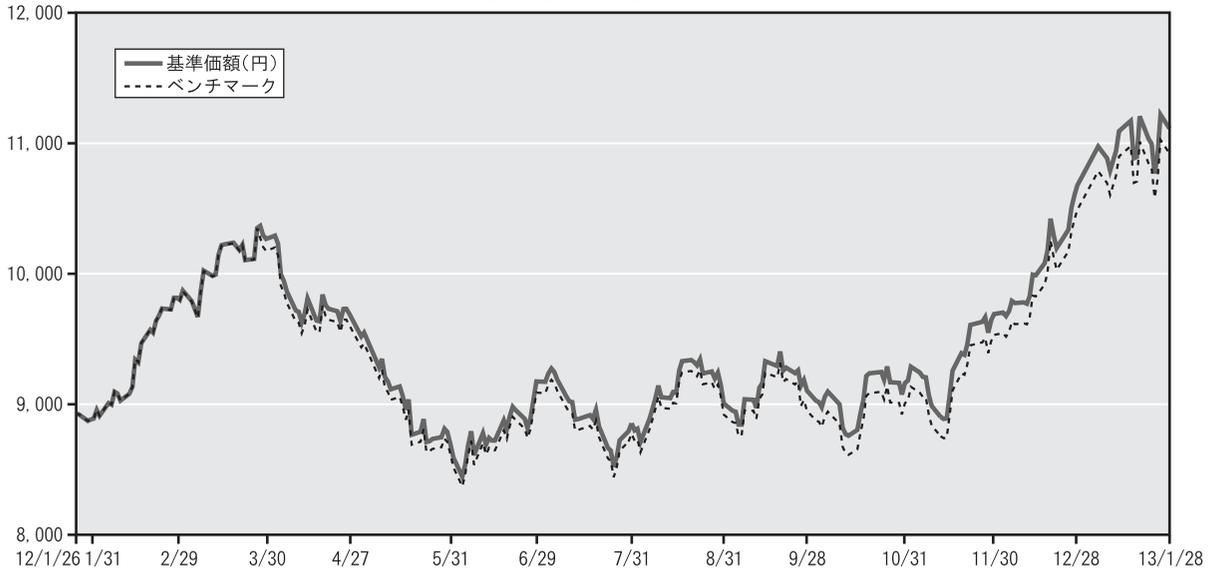
(注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

当期の運用経過

◆ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ24.5%の上昇となりました。

基準価額の推移



(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。

◆ 基準価額の変動要因

国内株式市況(日経平均株価(日経225))は期首に比べて22.3%の上昇となりました。当ファンドは日経225マザーファンド受益証券(以下、マザーファンド)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。市況動向に関しては、マザーファンドの項をご参照ください。

◆ ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は2.2%程度となりました。

| | マザーファンド 保有以外の要因 | マザーファンド 保有による要因 | 合 計 |
|----------------|--------------------|--------------------|--------|
| ベンチマーク との乖離 | △0.5%程度 | 2.7%程度 | 2.2%程度 |

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

<マザーファンド保有以外による要因>
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2.7%程度でした。

要因の詳細については、実質的な運用を行っているマザーファンドの項で説明します。

マザーファンドの運用経過は、以下の通りです。

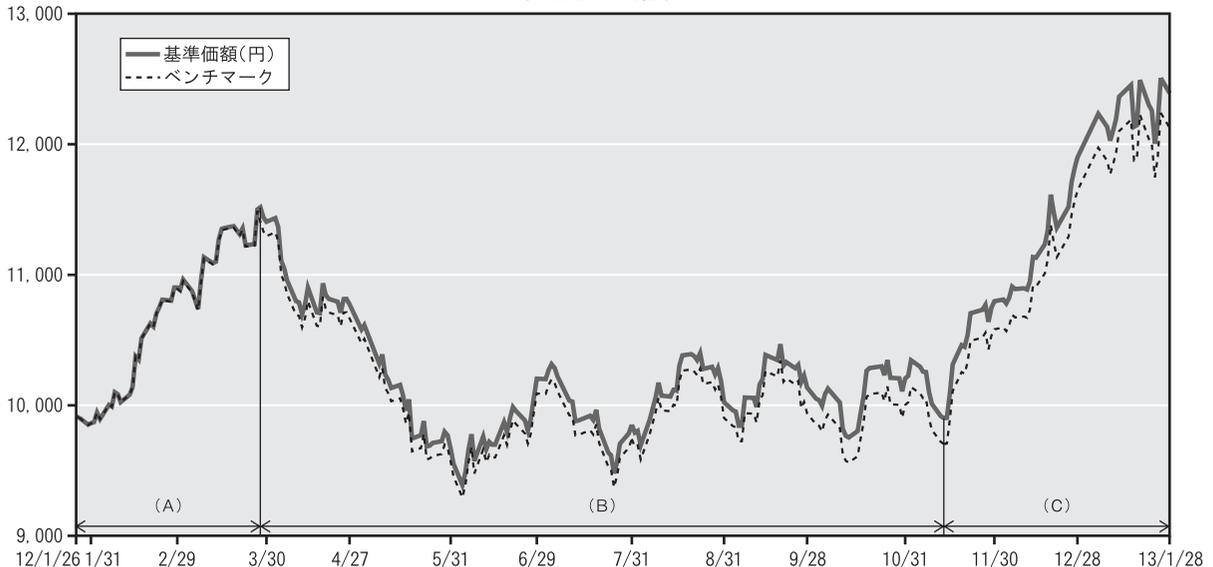
<日経225マザーファンド>

(記載文章はベビーファンドの計算期間に基づいています。)

◆ 基準価額の推移

基準価額は期首に比べ25.0%の上昇となりました。

基準価額の推移



(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。

◆ 基準価額の変動要因

国内株式市況(日経平均株価(日経225))は期首に比べて22.3%の上昇となりました。資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資したことにより、株式市況とほぼ同様の推移となりました。

- ・(A)の局面では、米国経済に対する楽観的な見方が広がったことや日銀による追加金融緩和策などを受けて上昇しました。
- ・(B)の局面では、欧州財政問題に対する懸念や円高進行による国内企業業績の悪化懸念などを受けて軟調に推移しました。
- ・(C)の局面では、衆議院選挙後の新政権によるデフレ脱却に向けた政策推進への期待や、その

期待を背景とした対ドル、対ユーロでの円安進行などにより上昇しました。

◆ ベンチマークとの比較

ベンチマークとのカイ離は2.7%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い流動性を維持しました。

| | 組入比率 要因 | 銘柄選択 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|-------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマークとのカイ離 | 0.0%程度 | 0.0%程度 | 2.6%程度 | 2.7%程度 |

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

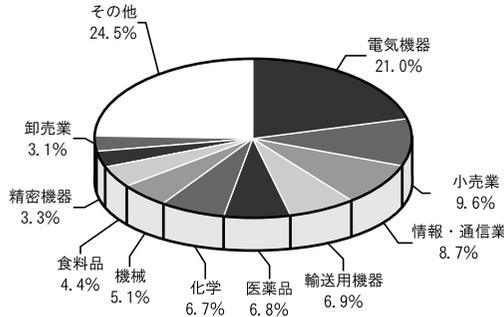
- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。

- ・期中における先物組入比率の平均は、2.1%程度となりました。

(注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからの乖離を生む可能性があります。

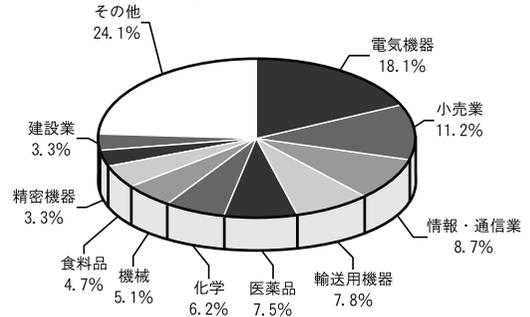
組入上位10業種

期首 (2012年1月26日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

期末 (2013年1月28日)



(注) 比率は現物株式評価額に対する割合です。

組入上位15銘柄

期首 (2012年1月26日)

(組入銘柄数: 225銘柄)

| | 銘柄 | 業種 | 比率 |
|----|-------------|--------|------|
| 1 | ファーストリテイリング | 小売業 | 6.7% |
| 2 | ファナック | 電気機器 | 5.7% |
| 3 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 3.0% |
| 4 | 京セラ | 電気機器 | 3.0% |
| 5 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 2.4% |
| 6 | キヤノン | 電気機器 | 2.3% |
| 7 | KDDI | 情報・通信業 | 2.2% |
| 8 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 1.9% |
| 9 | 信越化学工業 | 化学 | 1.8% |
| 10 | TDK | 電気機器 | 1.6% |
| 11 | テルモ | 精密機器 | 1.6% |
| 12 | セコム | サービス業 | 1.6% |
| 13 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1.5% |
| 14 | エーザイ | 医薬品 | 1.4% |
| 15 | アステラス製薬 | 医薬品 | 1.4% |

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

期末 (2013年1月28日)

(組入銘柄数: 225銘柄)

| | 銘柄 | 業種 | 比率 |
|----|-------------|--------|------|
| 1 | ファーストリテイリング | 小売業 | 8.3% |
| 2 | ファナック | 電気機器 | 4.9% |
| 3 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 3.3% |
| 4 | 京セラ | 電気機器 | 3.0% |
| 5 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 2.5% |
| 6 | KDDI | 情報・通信業 | 2.3% |
| 7 | 信越化学工業 | 化学 | 2.0% |
| 8 | キヤノン | 電気機器 | 1.8% |
| 9 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1.7% |
| 10 | アステラス製薬 | 医薬品 | 1.7% |
| 11 | セコム | サービス業 | 1.6% |
| 12 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 1.6% |
| 13 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 1.4% |
| 14 | エーザイ | 医薬品 | 1.4% |
| 15 | テルモ | 精密機器 | 1.4% |

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

- ・日経225採用全銘柄に投資することで、指

数を完全に模倣しました。

- ・日経225の採用銘柄入れ替え時には、ファンドも同様に組入銘柄を入れ替えました。

＜参考：当期の日経225銘柄入替＞

| 除外銘柄 | 新規採用銘柄 |
|--------|---------------|
| 住友金属工業 | トクヤマ |
| 日新製鋼 | 日新製鋼ホールディングス |
| 日本軽金属 | 日本軽金属ホールディングス |

◎その他の要因

その他の要因による影響は2.6%程度でした。

| | | | |
|--------|----------------|---|---------|
| プラス要因 | 配当・利子収入、再投資効果等 | 計 | 2.6%程度 |
| マイナス要因 | 売買コスト等 | 計 | △0.0%程度 |

再投資効果：配当金等を受け取った後、再投資することにより生じます。市場が上昇すればプラス、下落すればマイナスの要因となります。

◀ 収益分配金 ▶

＜eMAXIS 日経225インデックス＞

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向等を勘案しましたが、見送りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利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いたします。

なお、収益分配金の計算過程につきましては、損益の状況の＜注記事項＞をご参照ください。

◀ 今後の運用方針 ▶

＜eMAXIS 日経225インデックス＞

- ・運用の基本方針にしたがい、日経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。

＜日経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。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|--|----------------------------|
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 40円 (17) (18) (5) |
| (b) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) | 1 (0) (1) |
| (c) 保管費用等 | 0 |
| 合 計 | 41 |

- (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、下記の簡便法により算出した結果です。
- (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(b) 売買委託手数料、(c) 保管費用等は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。
- (注) 各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保管費用等は、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。

売買および取引の状況

(2012年1月27日～2013年1月28日)

◆ 設定、解約状況

| | 設 定 | | 解 約 | |
|--------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 日経225マザーファンド | 2,085,332 | 2,246,835 | 2,007,601 | 2,192,578 |

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 | |
|-------------------|---------|--------------|
| | ベビーファンド | 日経225マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | －千円 | 21,834,018千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | －千円 | 53,930,045千円 |
| (c) 売買高比率(a)/(b) | － | 0.40 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

主要な売買銘柄 (2012年1月27日～2013年1月28日)

日経225マザーファンドにおける株式の売買

| 買 付 | | | | 売 付 | | | |
|-----------------|-----|---------|--------|-----------------|------|-----------|--------|
| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| ファーストリテイリング | 36 | 608,426 | 16,900 | ファーストリテイリング | 58 | 1,046,334 | 18,040 |
| フ ァ ナ ッ ク | 36 | 475,604 | 13,211 | フ ァ ナ ッ ク | 58 | 821,328 | 14,160 |
| ソ フ ト バ ン ク | 108 | 269,694 | 2,497 | ソ フ ト バ ン ク | 174 | 491,820 | 2,826 |
| 京 セ ラ | 36 | 246,086 | 6,835 | 京 セ ラ | 58 | 420,374 | 7,247 |
| K D D I | 6.3 | 188,010 | 29,842 | K D D I | 28.3 | 329,884 | 11,656 |
| 本 田 技 研 工 業 | 72 | 187,904 | 2,609 | 本 田 技 研 工 業 | 116 | 327,540 | 2,823 |
| キ ヤ ノ ン | 54 | 171,042 | 3,167 | キ ヤ ノ ン | 87 | 274,761 | 3,158 |
| 信 越 化 学 工 業 | 36 | 153,636 | 4,267 | 信 越 化 学 工 業 | 58 | 267,928 | 4,619 |
| 東 京 エ レ ク ト ロ ン | 36 | 138,828 | 3,856 | セ コ ム | 58 | 232,098 | 4,001 |
| セ コ ム | 36 | 133,072 | 3,696 | 東 京 エ レ ク ト ロ ン | 58 | 228,334 | 3,936 |

(注) 金額は受渡代金。

利害関係人との取引状況等 (2012年1月27日～2013年1月28日)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

<日経225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 | | 売付額等C | うち利害関係人との取引状況D | |
|--------|--------------|----------------|-----------|---------------|----------------|-----------|
| | | B/A | % | | D/C | % |
| 株 式 | 百万円 8,055 | 百万円 2,241 | % 27.8 | 百万円 13,778 | 百万円 2,792 | % 20.3 |
| 株式先物取引 | 30,193 | — | — | 30,060 | — | — |

平均保有割合 2.5%

※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ペビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等
 <日経225マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 期末保有額 |
|-----|-------|-------|-------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株 式 | 13 | 22 | 103 |

(3) 期中の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) | 136千円 |
| うち利害関係人への支払額(B) | 0.007千円 |
| (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

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 |
| 日経225マザーファンド | 1,308,881 | 1,386,611 | 1,718,150 |

(注) 日経225マザーファンド全体の受益権口数は(期末:47,958,396千口)です。

〈補足情報〉

下記は、日経225マザーファンド全体の内容です。

(1) 国内株式(上場株式)

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | |
| 日本水産 | 238 | 216 | 39,312 |
| マルハニチロホールディングス | 238 | 216 | 33,048 |
| 鉱業 (0.2%) | | | |
| 国際石油開発帝石 | 0.238 | 0.216 | 107,028 |
| 建設業 (3.3%) | | | |
| コムシスホールディングス | 238 | 216 | 235,440 |
| 大成建設 | 238 | 216 | 57,672 |
| 大林組 | 238 | 216 | 99,360 |
| 清水建設 | 238 | 216 | 65,448 |
| 鹿島建設 | 238 | 216 | 58,536 |
| 大和ハウス工業 | 238 | 216 | 358,992 |
| 積水ハウス | 238 | 216 | 219,024 |
| 日揮 | 238 | 216 | 559,872 |
| 千代田化工建設 | 238 | 216 | 251,424 |
| 食料品 (4.7%) | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 238 | 216 | 239,760 |
| 明治ホールディングス | 23.8 | 21.6 | 85,752 |
| 日本ハム | 238 | 216 | 270,432 |
| サッポロホールディングス | 238 | 216 | 63,288 |
| アサヒグループホールディングス | 238 | 216 | 413,208 |
| キリンホールディングス | 238 | 216 | 238,680 |
| 宝ホールディングス | 238 | 216 | 167,400 |
| 味の素 | 238 | 216 | 296,136 |
| ニチレイ | 238 | 216 | 267,192 |
| 日本たばこ産業 | 238 | 216 | 95,472 |
| 1.19 | 216 | 595,512 | |
| 繊維製品 (0.6%) | | | |
| 東洋紡 | 238 | 216 | 31,320 |
| ユニチカ | 238 | 216 | 11,016 |
| 日清紡ホールディングス | 238 | 216 | 148,392 |
| 帝人 | 238 | 216 | 44,496 |
| 東レ | 238 | 216 | 113,400 |
| パルプ・紙 (0.3%) | | | |
| 王子ホールディングス | 238 | 216 | 59,400 |
| 三菱製紙 | 238 | 216 | 19,008 |
| 北越紀州製紙 | 238 | 216 | 95,904 |
| 日本製紙グループ本社 | 23.8 | 21.6 | 26,049 |
| 化学 (6.2%) | | | |
| クレール | 238 | 216 | 248,400 |
| 旭化成 | 238 | 216 | 114,048 |
| 昭和電工 | 238 | 216 | 29,160 |
| 住友化学 | 238 | 216 | 56,808 |
| 日産化学工業 | 238 | 216 | 233,712 |
| 日本曹達 | 238 | 216 | 87,264 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東ソ | 238 | 216 | 46,224 |
| トクヤマ | — | 216 | 37,800 |
| 電気化学工業 | 238 | 216 | 68,472 |
| 信越化学工業 | 238 | 216 | 1,183,680 |
| 三井化学 | 238 | 216 | 45,576 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 119 | 108 | 44,712 |
| 宇部興産 | 238 | 216 | 39,312 |
| 日本化学 | 238 | 216 | 223,560 |
| 花王 | 238 | 216 | 531,576 |
| 富士フィルムホールディングス | 238 | 216 | 399,168 |
| 資生堂 | 238 | 216 | 266,976 |
| 医薬品 (7.5%) | | | |
| 協和発酵キリン | 238 | 216 | 191,160 |
| 武田薬品工業 | 238 | 216 | 996,840 |
| アステラス製薬 | 238 | 216 | 983,880 |
| 大日本住友製薬 | 238 | 216 | 298,296 |
| 塩野義製薬 | 238 | 216 | 354,456 |
| 中外製薬 | 238 | 216 | 382,536 |
| エーザイ | 238 | 216 | 840,240 |
| 第一三共 | 238 | 216 | 324,000 |
| 石油・石炭製品 (0.4%) | | | |
| 昭和シェル石油 | 238 | 216 | 108,216 |
| JXホールディングス | 238 | 216 | 111,240 |
| ゴム製品 (1.1%) | | | |
| 横浜ゴム | 238 | 216 | 144,936 |
| ブリヂストン | 238 | 216 | 512,568 |
| ガラス・土石製品 (1.6%) | | | |
| 日東紡績 | 238 | 216 | 77,544 |
| 旭硝子 | 238 | 216 | 127,872 |
| 日本板硝子 | 238 | 216 | 21,816 |
| 日本電気硝子 | 357 | 324 | 140,940 |
| 住友大阪セメント | 238 | 216 | 64,152 |
| 太平洋セメント | 238 | 216 | 50,328 |
| 東海カーボン | 238 | 216 | 74,520 |
| TOYO | 238 | 216 | 153,792 |
| 日本碍子 | 238 | 216 | 223,560 |
| 鉄鋼 (0.4%) | | | |
| 新日鐵住金 | 238 | 216 | 49,680 |
| 住友金属工業 | 238 | — | — |
| 神戸製鋼所 | 238 | 216 | 22,248 |
| 日新製鋼 | 238 | — | — |
| ジェイエフイーホールディングス | 23.8 | 21.6 | 38,124 |
| 日新製鋼ホールディングス | — | 21.6 | 14,018 |
| 大平洋金属 | 238 | 216 | 89,424 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|---------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 非鉄金属 (1.7%) | | | |
| 日本軽金属 | 238 | — | — |
| 日本軽金属ホールディングス | — | 216 | 21,384 |
| 三井金属鉱業 | 238 | 216 | 47,736 |
| 東邦亜鉛 | 238 | 216 | 82,296 |
| 三菱マテリア | 238 | 216 | 64,152 |
| 住友金属鉱山 | 238 | 216 | 294,192 |
| DOWAホールディングス | 238 | 216 | 135,864 |
| 古河機械金属 | 238 | 216 | 20,088 |
| 古河電気工業 | 238 | 216 | 39,096 |
| 住友電気工業 | 238 | 216 | 215,568 |
| フジック | 238 | 216 | 55,080 |
| 金属製品 (0.4%) | | | |
| SUMICO | 23.8 | 21.6 | 19,072 |
| 東洋製罐 | 238 | 216 | 246,456 |
| 機械 (5.1%) | | | |
| 日本製鋼所 | 238 | 216 | 112,104 |
| オースマク | 238 | 216 | 141,912 |
| 小松製作所 | 238 | 216 | 120,960 |
| 住友重機械工業 | 238 | 216 | 88,776 |
| 日立建機 | 238 | 216 | 415,800 |
| クボタ | 238 | 216 | 224,424 |
| 荏原製作所 | 238 | 216 | 76,032 |
| ダイキン工業 | 238 | 216 | 714,960 |
| 日本精工 | 238 | 216 | 134,352 |
| NIT | 238 | 216 | 54,648 |
| ジェイテクト | 238 | 216 | 204,552 |
| 日立造船 | 238 | 216 | 30,456 |
| 三菱重工業 | 238 | 216 | 104,544 |
| IHI | 238 | 216 | 50,544 |
| 電気機器 (18.1%) | | | |
| コニカミノルタホールディングス | 238 | 216 | 158,760 |
| ミネベア | 238 | 216 | 61,344 |
| 日立製作所 | 238 | 216 | 119,232 |
| 東芝 | 238 | 216 | 85,320 |
| 三菱電機 | 238 | 216 | 157,896 |
| 富士電機 | 238 | 216 | 46,224 |
| 安川電機 | 238 | 216 | 173,664 |
| 明電舎 | 238 | 216 | 62,640 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 238 | 216 | 71,064 |
| 日本電気 | 238 | 216 | 48,168 |
| 富士通 | 238 | 216 | 77,328 |
| 沖電気工業 | 238 | 216 | 21,816 |
| パナソニック | 238 | 216 | 131,544 |
| シャープ | 238 | 216 | 69,552 |
| ソニー | 238 | 216 | 303,912 |
| TDK | 238 | 216 | 682,560 |
| 三菱電機 | 238 | 216 | 105,192 |
| アルプス電気 | 238 | 216 | 106,272 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|----------------------|---------|------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| パイオニア | 238 | 216 | 49,032 |
| 横河電機 | 238 | 216 | 211,680 |
| アドバンテック | 476 | 432 | 540,000 |
| カシオ計算機 | 238 | 216 | 178,848 |
| ファナック | 238 | 216 | 2,926,800 |
| 京セラ | 238 | 216 | 1,762,560 |
| 太陽誘電 | 238 | 216 | 173,016 |
| 大日本スクリーン製造 | 238 | 216 | 95,472 |
| キヤノン | 357 | 324 | 1,078,920 |
| リコー | 238 | 216 | 231,336 |
| 東京エレクトロン | 238 | 216 | 845,640 |
| 輸送用機器 (7.8%) | | | |
| デンソー | 238 | 216 | 709,560 |
| 三井造船 | 238 | 216 | 30,240 |
| 川崎重工業 | 238 | 216 | 56,808 |
| 日産自動車 | 238 | 216 | 193,320 |
| いすゞ自動車 | 238 | 216 | 116,856 |
| トヨタ自動車 | 238 | 216 | 932,040 |
| 日野自動車 | 238 | 216 | 204,336 |
| 三菱自動車工業 | 238 | 216 | 20,088 |
| マツダ | 238 | 216 | 50,112 |
| 本田技研工業 | 476 | 432 | 1,468,800 |
| スズキ | 238 | 216 | 506,088 |
| 富士重工 | 238 | 216 | 256,392 |
| 精密機器 (3.3%) | | | |
| テルモ | 238 | 216 | 812,160 |
| ニコン | 238 | 216 | 551,016 |
| オリコン | 238 | 216 | 428,112 |
| シチズンホールディングス | 238 | 216 | 115,128 |
| その他製品 (0.8%) | | | |
| 凸版印刷 | 238 | 216 | 121,824 |
| 大日本印刷 | 238 | 216 | 155,736 |
| ヤマハ | 238 | 216 | 203,472 |
| 電気・ガス業 (0.4%) | | | |
| 東京電力 | 23.8 | 21.6 | 4,492 |
| 中部電力 | 23.8 | 21.6 | 24,710 |
| 関西電力 | 23.8 | 21.6 | 17,755 |
| 東電 | 238 | 216 | 93,960 |
| 大坂瓦斯 | 238 | 216 | 72,144 |
| 陸運業 (2.6%) | | | |
| 東武鉄道 | 238 | 216 | 105,408 |
| 東急行電鉄 | 238 | 216 | 108,432 |
| 小田急電鉄 | 238 | 216 | 197,640 |
| 京王電鉄 | 238 | 216 | 146,016 |
| 京成電鉄 | 238 | 216 | 175,608 |
| 東日本旅客鉄道 | 23.8 | 21.6 | 131,976 |
| 西日本旅客鉄道 | 23.8 | 21.6 | 77,220 |
| 東海旅客鉄道 | 0.238 | 21.6 | 165,240 |
| 日本通運 | 238 | 216 | 80,136 |
| ヤマトホールディングス | 238 | 216 | 318,384 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 海運業 (0.2%) | | | |
| 日本郵船 | 238 | 216 | 44,928 |
| 商船三井 | 238 | 216 | 60,696 |
| 川崎汽船 | 238 | 216 | 33,696 |
| 空運業 (0.1%) | | | |
| 全日本空輸 | 238 | 216 | 38,232 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.5%) | | | |
| 三菱倉庫 | 238 | 216 | 280,800 |
| 情報・通信業 (8.7%) | | | |
| ヤフー | 0.952 | 0.864 | 27,993 |
| トレンドマイクロ | 238 | 216 | 565,488 |
| スカパーJSAATHホールディングス | 0.238 | 0.216 | 8,856 |
| 日本電信電話 | 23.8 | 21.6 | 80,784 |
| KDDI | 2.38 | 216 | 1,371,600 |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 0.238 | 0.216 | 28,641 |
| 東宝 | 23.8 | 21.6 | 36,720 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 2.38 | 2.16 | 584,280 |
| コナミ | 238 | 216 | 410,184 |
| ソフトバンク | 714 | 648 | 1,969,920 |
| 卸売業 (3.0%) | | | |
| 双日 | 23.8 | 21.6 | 2,851 |
| 伊藤忠商事 | 238 | 216 | 214,920 |
| 丸紅 | 238 | 216 | 144,072 |
| 豊田通商 | 238 | 216 | 464,616 |
| 三井物産 | 238 | 216 | 286,848 |
| 住友商事 | 238 | 216 | 250,344 |
| 三菱商事 | 238 | 216 | 414,288 |
| 小売業 (11.2%) | | | |
| J.フロントリテイリング | 238 | 216 | 108,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 238 | 216 | 193,536 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 238 | 216 | 603,504 |
| 高島屋 | 238 | 216 | 144,936 |
| 丸井グループ | 238 | 216 | 158,112 |
| イオン | 238 | 216 | 220,536 |
| ユニバー | 238 | 216 | 144,288 |
| ファーストリテイリング | 238 | 216 | 4,955,040 |
| 銀行業 (1.5%) | | | |
| 新生銀行 | 238 | 216 | 37,368 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|---------------------------|-------------------|-------------------|-----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| あおぞら銀行 | 238 | 216 | 53,136 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 238 | 216 | 103,464 |
| りそなホールディングス | 23.8 | 21.6 | 8,596 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 238 | 216 | 66,960 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 23.8 | 21.6 | 71,388 |
| 千葉銀行 | 238 | 216 | 123,768 |
| 横浜銀行 | 238 | 216 | 94,176 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 238 | 216 | 84,024 |
| 静岡銀行 | 238 | 216 | 186,192 |
| みずほフィナンシャルグループ | 238 | 216 | 36,720 |
| 証券・商品先物取引業 (0.7%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 238 | 216 | 105,192 |
| 野村ホールディングス | 238 | 216 | 106,704 |
| 松井証券 | 238 | 216 | 176,904 |
| 保険業 (1.1%) | | | |
| NK SJホールディングス | 59.5 | 54 | 101,466 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 71.4 | 64.8 | 120,916 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 47.6 | 43.2 | 68,083 |
| 第一生命保険 | 0.238 | 0.216 | 28,080 |
| 東京海上ホールディングス | 119 | 108 | 287,928 |
| T & Dホールディングス | 47.6 | 43.2 | 47,563 |
| その他金融業 (0.7%) | | | |
| クレディセゾン | 238 | 216 | 430,920 |
| 不動産業 (3.0%) | | | |
| 三井不動産 | 238 | 216 | 441,072 |
| 三菱地所 | 238 | 216 | 458,568 |
| 平和不動産 | 238 | 43.2 | 52,315 |
| 東京建物 | 238 | 216 | 91,800 |
| 東急不動産 | 238 | 216 | 137,592 |
| 住友不動産 | 238 | 216 | 584,712 |
| サービス業 (2.7%) | | | |
| 電通 | 238 | 216 | 533,736 |
| 東京ドーム | 238 | 216 | 77,328 |
| セコム | 238 | 216 | 956,880 |
| 合計 | 株数・金額 48,643 | 株数・金額 44,229 | 株数・金額 58,392,802 |
| | 銘柄数 < 比率 > 225 | 銘柄数 < 比率 > 225 | 銘柄数 < 比率 > (98.3%) |

(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、親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | | | 当期末 | | |
|-----|---|---|---|---|-----|-------|---|
| | | | | | 買建額 | 売建額 | |
| | | | | | 百万円 | 百万円 | |
| 国内 | 日 | 経 | 2 | 2 | 5 | 1,026 | — |

投資信託財産の構成

2013年1月28日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 日 経 2 2 5 マ ザ ー フ ァ ン ド | 1,718,150 | 86.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 280,138 | 14.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 1,998,288 | 100.0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況

2013年1月28日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,998,288,572円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 114,416,311 |
| 日経225マザーファンド(評価額) | 1,718,150,874 |
| 未 収 入 金 | 165,721,087 |
| 未 収 利 息 | 300 |
| (B) 負 債 | 279,881,815 |
| 未 払 解 約 金 | 276,721,275 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 3,140,191 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 20,349 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 1,718,406,757 |
| 元 本 | 1,546,146,559 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 172,260,198 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,546,146,559口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D) | 11,114円 |

損益の状況

(2012年1月27日～2013年1月28日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 7,218円 |
| 受 取 利 息 | 7,218 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 133,857,456 |
| 売 買 益 | 311,297,279 |
| 売 買 損 | △177,439,823 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △ 5,869,792 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | 127,994,882 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △ 446,501 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 44,711,817 |
| (配 当 等 相 当 額) | (93,949,333) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 49,237,516) |
| (G) 計 (D + E + F) | 172,260,198 |
| (H) 収 益 分 配 金 | 0 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G + H) | 172,260,198 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 44,711,817 |
| (配 当 等 相 当 額) | (99,994,757) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△ 55,282,940) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 127,548,381 |

- (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。

<注記事項>

- ①期首元本額 1,453,368,653円
 期中追加設定元本額 4,416,931,328円
 期中一部解約元本額 4,324,153,422円
- ②分配金の計算過程

| | | 第4期 |
|---------------------------|--------------|----------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 26,180,537円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 100,523,413円 |
| 収益調整金額 | C | 99,994,757円 |
| 分配準備積立金額 | D | 844,431円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 227,543,138円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,546,146,559口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F*10,000 | 1,471円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | －円 |
| 収益分配金金額 | I=F*H/10,000 | －円 |

分配金のお知らせ

◆ 収益分配金および分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税引前)

| | | 第4期 |
|-----------|--|-------|
| 当期分配金 | | － |
| 当期の収益 | | － |
| 当期の収益以外 | | － |
| 翌期繰越分配対象額 | | 1,471 |

◆「当期の収益」、「当期の収益以外」は小数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。

※三菱UFJ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委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載していますが、2013年6月21日以降は、以下の通り変更する予定です。
 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、「<http://www.am.mufg.jp/>」のアドレスに掲載します。
- ②投資信託約款に記載されていた「社団法人投資信託協会」を「一般社団法人投資信託協会」へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。(2013年1月4日)
- ③2013年1月1日から、2013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7%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、10.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%、並びに地方税3% (法人受益者は7.147%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。
 なお、復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、お申し出頂ければ再度、送付させていただきますので、その旨を販売会社までお申し出下さい。

日経225マザーファンド

《第11期》決算日2012年5月22日

【計算期間：2011年5月24日～2012年5月22日】

「日経225マザーファンド」は、5月22日に第11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11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）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果を日経225の動きにできるだけ連動させるため、原則として日経225に採用されている銘柄に等株数投資を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建て額を加算し、または株価指数先物取引等の売建て額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。 |
| 主要運用対象 | わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経225に採用されている銘柄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は行いません。 |

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 式 組入比率 | 株 式 先物比率 |
|------------|---------|-------|-----------|-------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰落率 | （日経225） | 騰落率 | | |
| (期 首) | | % | 円 | % | % | % |
| 2011年5月23日 | 10,486 | — | 9,460.63 | — | 97.3 | 2.7 |
| 5月末 | 10,744 | 2.5 | 9,693.73 | 2.5 | 97.7 | 2.3 |
| 6月末 | 10,889 | 3.8 | 9,816.09 | 3.8 | 98.1 | 1.9 |
| 7月末 | 10,908 | 4.0 | 9,833.03 | 3.9 | 98.6 | 1.4 |
| 8月末 | 9,941 | △5.2 | 8,955.20 | △5.3 | 97.2 | 2.8 |
| 9月末 | 9,733 | △7.2 | 8,700.29 | △8.0 | 96.9 | 3.1 |
| 10月末 | 10,055 | △4.1 | 8,988.39 | △5.0 | 97.9 | 2.1 |
| 11月末 | 9,436 | △10.0 | 8,434.61 | △10.8 | 96.6 | 3.4 |
| 12月末 | 9,473 | △9.7 | 8,455.35 | △10.6 | 97.2 | 2.8 |
| 2012年1月末 | 9,862 | △6.0 | 8,802.51 | △7.0 | 98.7 | 1.3 |
| 2月末 | 10,902 | 4.0 | 9,723.24 | 2.8 | 99.0 | 1.0 |
| 3月末 | 11,406 | 8.8 | 10,083.56 | 6.6 | 97.3 | 2.7 |
| 4月末 | 10,773 | 2.7 | 9,520.89 | 0.6 | 97.3 | 2.6 |
| (期 末) | | | | | | |
| 2012年5月22日 | 9,879 | △5.8 | 8,729.29 | △7.7 | 97.4 | 2.6 |

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 騰落率は期首比。

(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) 株式先物比率は買建比率－売建比率。

(注) 純資産総額は、期首53,783百万円、期末52,787百万円。

当期の運用経過

基準価額の推移

基準価額は期首に比べ5.8%の下落となりました。

基準価額の推移



(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。

基準価額の変動要因

国内株式市況(日経平均株価(日経225))は期首に比べて7.7%の下落となりました。資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資したことにより、株式市況とほぼ同様の推移となりました。

- ・(A)の局面では、欧州債務問題に加え、円高進行による企業業績悪化懸念などが嫌気され、軟調に推移しました。
- ・(B)の局面では、日銀による追加金融緩和を契機とした円安進行などを受け、反発しました。
- ・(C)の局面では、欧州債務問題に対する懸念が再度高まったことなどから、下落しました。

ベンチマークとの比較

ベンチマークとの乖離は1.9%程度となりました。配当要因を除くと低水準に抑制し、高い連動性を維持しました。

| | 組入比率 要因 | 銘柄選択 要因 | その他の 要因 | 合計 |
|------------|------------|------------|------------|--------|
| ベンチマークとの乖離 | 0.0%程度 | 0.0%程度 | 1.9%程度 | 1.9%程度 |

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎組入比率要因

組入比率や先物使用による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じて、運用資産のほぼ全額を株式(先物を含む)に投資しました。
 - ・期中における先物組入比率の平均は、2.2%程度となりました。
- (注) 先物の使用は、「利便性に優れ、売買コストが低い」利点がある反面、必ずしも指数の値動きと一致しないことから、ベンチマークからの乖離を生む可能性があります。

◎銘柄選択要因

銘柄選択による影響は0.0%程度でした。

- ・日経225採用全銘柄に投資することで、指数を完全に模倣しました。
- ・日経225の採用銘柄入れ替え時には、ファンドも同様に組入銘柄を入れ替えました。

<参考：当期の日経225銘柄入替>

| 除外銘柄 | 新規採用銘柄 |
|---------|--------------------|
| みずほ信託銀行 | あおぞら銀行 |
| みずほ証券 | ソニーフィナンシャルホールディングス |
| C SK | アマダ |

◎その他の要因

その他の要因による影響は1.9%程度でした。

| | | |
|--------|----------|-----------|
| プラス要因 | 配当・利子収入等 | 計 2.1%程度 |
| マイナス要因 | 再投資効果等 | 計 △0.2%程度 |

再投資効果：配当金等を受け取った後、再投資することにより生じます。市場が上昇すればプラス、下落すればマイナスの要因となります。

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、指数を完全に模倣します。

1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------|-----|
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 1円 |
| (株 式) | (0) |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (1) |
| 合 計 | 1 |

(a) 売買委託手数料は、期中の金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

売買および取引の状況

(2011年5月24日～2012年5月22日)

(1) 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 |
| | | 8,306 | 8,834,347 | 5,613 | 5,860,073 |
| | | (45) | (-) | (178) | (-) |

(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。

(2) 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 |
| | | 23,939 | 23,894 | - | - |

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 | 14,694,420千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 53,143,954千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a) / (b) | 0.27 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

組入資産の明細

(1) 国内株式(上場株式)

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | | 千円 |
| 水産・農林業 (0.2%) | | | | |
| 日本水産 | 222 | 236 | | 51,448 |
| マルハニチロホールディングス | 222 | 236 | | 28,320 |
| 鉱業 (0.2%) | | | | |
| 国際石油開発帝石 | 0.222 | 0.236 | | 109,858 |
| 建設業 (3.0%) | | | | |
| コムシスホールディングス | 222 | 236 | | 193,284 |
| 大成建設 | 222 | 236 | | 45,076 |
| 大林組 | 222 | 236 | | 74,576 |
| 清水建設 | 222 | 236 | | 64,664 |
| 鹿島建設 | 222 | 236 | | 49,560 |
| 大和ハウス工業 | 222 | 236 | | 233,640 |
| 積水ハウス | 222 | 236 | | 158,828 |
| 日揮 | 222 | 236 | | 505,512 |
| 千代田化工建設 | 222 | 236 | | 218,772 |
| 食料品 (4.6%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 222 | 236 | | 214,760 |
| 明治ホールディングス | 22.2 | 23.6 | | 76,818 |
| 日本ハム | 222 | 236 | | 230,336 |
| サッポロホールディングス | 222 | 236 | | 56,876 |
| アサヒグループホールディングス | 222 | 236 | | 400,256 |
| キリンホールディングス | 222 | 236 | | 213,344 |
| 宝ホールディングス | 222 | 236 | | 115,640 |
| キッコーマン | 222 | 236 | | 222,784 |
| 味の素 | 222 | 236 | | 250,868 |
| ニチレイ | 222 | 236 | | 84,016 |
| 日本たばこ産業 | 1.11 | 1.18 | | 487,340 |
| 繊維製品 (0.7%) | | | | |
| 東洋紡績 | 222 | 236 | | 24,308 |
| ユニチカ | 222 | 236 | | 9,676 |
| 日清紡ホールディングス | 222 | 236 | | 154,108 |
| 帝人 | 222 | 236 | | 56,404 |
| 東レ | 222 | 236 | | 130,744 |
| パルプ・紙 (0.4%) | | | | |
| 王子製紙 | 222 | 236 | | 71,744 |
| 三菱製紙 | 222 | 236 | | 16,992 |
| 北越紀州製紙 | 222 | 236 | | 99,828 |
| 日本製紙グループ本社 | 22.2 | 23.6 | | 30,444 |
| 化学 (6.3%) | | | | |
| クラレ | 222 | 236 | | 247,328 |
| 旭化成 | 222 | 236 | | 104,784 |
| 昭和電工 | 222 | 236 | | 40,828 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-----|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | | 千円 |
| 住友化学 | 222 | 236 | | 65,372 |
| 日産化学工業 | 222 | 236 | | 166,380 |
| 日本曹達 | 222 | 236 | | 74,104 |
| 東ソ | 222 | 236 | | 48,144 |
| 電気化学工業 | 222 | 236 | | 66,788 |
| 信越化学工業 | 222 | 236 | | 974,680 |
| 三井化学 | 222 | 236 | | 50,976 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 111 | 118 | | 43,660 |
| 宇部興産 | 222 | 236 | | 44,368 |
| 日本化薬 | 222 | 236 | | 173,460 |
| 花王 | 222 | 236 | | 479,316 |
| 富士フィルムホールディングス | 222 | 236 | | 368,396 |
| 資生堂 | 222 | 236 | | 297,832 |
| 医薬品 (6.8%) | | | | |
| 協和発酵キリン | 222 | 236 | | 187,148 |
| 武田薬品工業 | 222 | 236 | | 770,540 |
| アステラス製薬 | 222 | 236 | | 720,980 |
| 大日本住友製薬 | 222 | 236 | | 175,584 |
| 塩野義製薬 | 222 | 236 | | 233,404 |
| 中外製薬 | 222 | 236 | | 330,872 |
| エーザイ | 222 | 236 | | 751,660 |
| 第一三共 | 222 | 236 | | 309,396 |
| 石油・石炭製品 (0.4%) | | | | |
| 昭和シェル石油 | 222 | 236 | | 105,256 |
| JXホールディングス | 222 | 236 | | 97,468 |
| ゴム製品 (1.0%) | | | | |
| 横浜ゴム | 222 | 236 | | 125,080 |
| ブリヂストン | 222 | 236 | | 402,380 |
| ガラス・土石製品 (1.8%) | | | | |
| 日東紡績 | 222 | 236 | | 59,944 |
| 旭硝子 | 222 | 236 | | 134,284 |
| 日本板硝子 | 222 | 236 | | 21,004 |
| 日本電気硝子 | 333 | 354 | | 192,222 |
| 住友大阪セメント | 222 | 236 | | 54,752 |
| 太平洋セメント | 222 | 236 | | 39,412 |
| 東海カ一ボン | 222 | 236 | | 86,612 |
| TOYO | 222 | 236 | | 128,148 |
| 日本碍子 | 222 | 236 | | 203,196 |
| 鉄鋼 (0.5%) | | | | |
| 新日本製鐵 | 222 | 236 | | 42,952 |
| 住友金属工業 | 222 | 236 | | 30,916 |
| 神戸製鋼所 | 222 | 236 | | 23,364 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|---------------------|---------|------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日新製鋼 | 222 | 236 | 25,724 |
| ジェイエフイーホールディングス | 22.2 | 23.6 | 31,388 |
| 大平洋金属 | 222 | 236 | 81,420 |
| 非鉄金属 (1.7%) | | | |
| 日本軽金属 | 222 | 236 | 24,780 |
| 三井金属鉱業 | 222 | 236 | 43,896 |
| 東邦亜鉛 | 222 | 236 | 70,800 |
| 三菱マテリアル | 222 | 236 | 52,392 |
| 住友金属鉱山 | 222 | 236 | 225,616 |
| DOWAホールディングス | 222 | 236 | 118,472 |
| 古河機械金属 | 222 | 236 | 15,576 |
| 古河電気工業 | 222 | 236 | 41,772 |
| 住友電気工業 | 222 | 236 | 217,356 |
| フジクラ | 222 | 236 | 53,336 |
| 金属製品 (0.5%) | | | |
| SUMICO | 22.2 | 23.6 | 16,992 |
| 東洋製罐 | 222 | 236 | 225,144 |
| 機械 (4.8%) | | | |
| 日本製鋼所 | 222 | 236 | 106,200 |
| オークマ | 222 | 236 | 130,036 |
| アマダ | — | 236 | 113,280 |
| 小松製作所 | 222 | 236 | 461,144 |
| 住友重機械工業 | 222 | 236 | 85,196 |
| 日立建機 | 222 | 236 | 363,440 |
| クボタ | 222 | 236 | 162,132 |
| 荏原製作所 | 222 | 236 | 71,980 |
| ダイキン工業 | 222 | 236 | 488,048 |
| 日本精工 | 222 | 236 | 119,416 |
| NTN | 222 | 236 | 62,304 |
| ジェイテクト | 222 | 236 | 182,428 |
| 日立造船 | 222 | 236 | 22,656 |
| 三菱重工 | 222 | 236 | 76,700 |
| IH | 222 | 236 | 38,940 |
| 電気機器 (21.4%) | | | |
| コニカミノルタホールディングス | 222 | 236 | 142,544 |
| ミネベア | 222 | 236 | 78,588 |
| 日立製作所 | 222 | 236 | 111,628 |
| 東芝 | 222 | 236 | 73,632 |
| 三菱電機 | 222 | 236 | 147,264 |
| 富士電機 | 222 | 236 | 44,368 |
| 安川電機 | 222 | 236 | 147,028 |
| 明電舎 | 222 | 236 | 63,248 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 222 | 236 | 81,420 |
| 日本電気 | 222 | 236 | 28,792 |
| 富士通 | 222 | 236 | 84,016 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|----------------------|---------|------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 沖電気工業 | 222 | 236 | 28,556 |
| パナソニック | 222 | 236 | 127,440 |
| シャープ | 222 | 236 | 87,320 |
| ソニー | 222 | 236 | 264,084 |
| TDK | 222 | 236 | 866,120 |
| ミツミ電機 | 222 | 236 | 137,824 |
| アルプス電気 | 222 | 236 | 150,568 |
| パイオニア | 222 | 236 | 75,520 |
| 横河電機 | 222 | 236 | 161,188 |
| アドバンテスト | 444 | 472 | 574,424 |
| カシオ計算機 | 222 | 236 | 110,448 |
| ファナック | 222 | 236 | 3,193,080 |
| 京セラ | 222 | 236 | 1,642,560 |
| 太陽誘電 | 222 | 236 | 186,912 |
| 大日本スクリーン製造 | 222 | 236 | 148,680 |
| リヤノ | 333 | 354 | 1,173,510 |
| リコー | 222 | 236 | 149,624 |
| 東京エレクトロン | 222 | 236 | 909,780 |
| 輸送用機器 (7.0%) | | | |
| デンソー | 222 | 236 | 573,716 |
| 三井造船 | 222 | 236 | 25,252 |
| 川崎重工 | 222 | 236 | 48,852 |
| 日産自動車 | 222 | 236 | 183,136 |
| いすゞ自動車 | 222 | 236 | 98,176 |
| トヨタ自動車 | 222 | 236 | 726,880 |
| 日野自動車 | 222 | 236 | 124,372 |
| 三菱自動車工業 | 222 | 236 | 17,936 |
| マツダ | 222 | 236 | 25,252 |
| 本田技研工業 | 444 | 472 | 1,228,144 |
| スズキ | 222 | 236 | 395,064 |
| 富士重工 | 222 | 236 | 147,500 |
| 精密機器 (3.1%) | | | |
| テルモ | 222 | 236 | 698,088 |
| ニコン | 222 | 236 | 519,436 |
| オリオンパス | 222 | 236 | 271,400 |
| シチズンホールディングス | 222 | 236 | 106,436 |
| その他製品 (0.8%) | | | |
| 凸版印刷 | 222 | 236 | 115,640 |
| 大日本印刷 | 222 | 236 | 142,544 |
| ヤマハ | 222 | 236 | 163,312 |
| 電気・ガス業 (0.4%) | | | |
| 東京電力 | 22.2 | 23.6 | 3,846 |
| 中部電力 | 22.2 | 23.6 | 27,281 |
| 関西電力 | 22.2 | 23.6 | 25,275 |
| 東京瓦斯 | 222 | 236 | 87,556 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大阪瓦ス | 222 | 236 | 72,688 |
| 陸運業 (2.5%) | | | |
| 東武鉄道 | 222 | 236 | 91,804 |
| 東京急行電鉄 | 222 | 236 | 81,892 |
| 小田急電鉄 | 222 | 236 | 167,796 |
| 京王電鉄 | 222 | 236 | 127,440 |
| 京成電鉄 | 222 | 236 | 146,556 |
| 東日本旅客鉄道 | 22.2 | 23.6 | 110,212 |
| 西日本旅客鉄道 | 0.222 | 23.6 | 73,632 |
| 東海旅客鉄道 | 0.222 | 0.236 | 148,444 |
| 日本通運 | 222 | 236 | 71,508 |
| ヤマトホールディングス | 222 | 236 | 276,828 |
| 海運業 (0.3%) | | | |
| 日本郵船 | 222 | 236 | 48,616 |
| 商船三井 | 222 | 236 | 63,956 |
| 川崎汽船 | 222 | 236 | 32,332 |
| 空運業 (0.1%) | | | |
| 全日本空輸 | 222 | 236 | 49,560 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.4%) | | | |
| 三菱倉庫 | 222 | 236 | 186,912 |
| 情報・通信業 (8.7%) | | | |
| ヤフー | 0.888 | 0.944 | 21,863 |
| トレンドマイクロ | 222 | 236 | 533,360 |
| スカパーJSA Tホールディングス | 0.222 | 0.236 | 7,528 |
| 日本電信電話 | 22.2 | 23.6 | 80,712 |
| KDDI | 2.22 | 2.36 | 1,146,960 |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 0.222 | 0.236 | 29,972 |
| 東宝 | 22.2 | 23.6 | 30,160 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 2.22 | 2.36 | 551,296 |
| CSK | 222 | — | — |
| コナミ | 222 | 236 | 434,240 |
| ソフコ | 666 | 708 | 1,648,224 |
| 卸売業 (3.0%) | | | |
| 双日 | 22.2 | 23.6 | 2,808 |
| 伊藤忠商事 | 222 | 236 | 200,836 |
| 丸紅 | 222 | 236 | 122,720 |
| 豊田通商 | 222 | 236 | 352,348 |
| 三井物産 | 222 | 236 | 269,512 |
| 住友商事 | 222 | 236 | 249,688 |
| 三菱商事 | 222 | 236 | 372,408 |
| 小売業 (10.8%) | | | |
| J.フロントリテイリング | 222 | 236 | 87,084 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 222 | 236 | 186,440 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 222 | 236 | 556,724 |
| 高島屋 | 222 | 236 | 130,744 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | | |
|---------------------------|-----------|----------|---------------|---------------|-----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | | |
| 丸井グループ | 222 | 236 | 132,160 | | |
| イオン | 222 | 236 | 226,560 | | |
| ユニバー | 222 | 236 | 197,060 | | |
| ファーストリテイリング | 222 | 236 | 4,059,200 | | |
| 銀行業 (1.4%) | | | | | |
| 新生銀行 | 222 | 236 | 20,768 | | |
| あおぞら銀行 | — | 236 | 41,536 | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 222 | 236 | 80,712 | | |
| りそなホールディングス | 22.2 | 23.6 | 7,198 | | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 222 | 236 | 49,796 | | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 22.2 | 23.6 | 55,082 | | |
| 千葉銀行 | 222 | 236 | 108,796 | | |
| 横浜銀行 | 222 | 236 | 85,668 | | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 222 | 236 | 71,744 | | |
| 静岡銀行 | 222 | 236 | 182,900 | | |
| みずほ信託銀行 | 222 | — | — | | |
| みずほフィナンシャルグループ | 222 | 236 | 27,612 | | |
| 証券・商品先物取引業 (0.4%) | | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 222 | 236 | 61,360 | | |
| 野村ホールディングス | 222 | 236 | 63,484 | | |
| みずほ証券 | 222 | — | — | | |
| 松井証券 | 222 | 236 | 98,884 | | |
| 保険業 (1.0%) | | | | | |
| NKS Jホールディングス | 222 | 59 | 87,084 | | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 66.6 | 70.8 | 90,907 | | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | — | 47.2 | 55,601 | | |
| 第一生命保険 | 0.222 | 0.236 | 19,776 | | |
| 東京海上ホールディングス | 111 | 118 | 211,102 | | |
| T & Dホールディングス | 22.2 | 47.2 | 37,807 | | |
| その他金融業 (0.7%) | | | | | |
| クレディセゾン | 222 | 236 | 380,432 | | |
| 不動産業 (2.3%) | | | | | |
| 三井不動産 | 222 | 236 | 301,136 | | |
| 三菱地所 | 222 | 236 | 290,516 | | |
| 平和不動産 | 222 | 236 | 41,300 | | |
| 東京建物 | 222 | 236 | 59,000 | | |
| 東急不動産 | 222 | 236 | 81,656 | | |
| 住友不動産 | 222 | 236 | 395,300 | | |
| サービス業 (2.8%) | | | | | |
| 電通 | 222 | 236 | 533,124 | | |
| 東京ドーム | 222 | 236 | 54,516 | | |
| セコム | 222 | 236 | 829,540 | | |
| 合計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 45,673 225 | 48,234 225 | 51,432,763 (97.4%) |

(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。

(2) 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 | | 百万円 | 百万円 |
| 内 | 日 経 2 2 5 | 1,353 | — |

◀ 投資信託財産の構成 ▶

2012年5月22日現在

| 項目 | 当期末 | |
|-------------------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株 式 | 51,432,763 | 96.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 1,826,526 | 3.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 53,259,289 | 100.0 |

資産、負債、元本および基準価額の状況

2012年5月22日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 53,255,388,043円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,198,748,890 |
| 株 式 (評 価 額) | 51,432,763,840 |
| 未 收 配 当 金 | 521,032,560 |
| 未 收 利 息 | 2,753 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 102,840,000 |
| (B) 負 債 | 468,043,090 |
| 未 払 金 | 466,479,090 |
| 未 払 解 約 金 | 1,564,000 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A - B) | 52,787,344,953 |
| 元 本 | 53,432,945,317 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 645,600,364 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 53,432,945,317口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D) | 9,879円 |

損益の状況

(2011年5月24日～2012年5月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,133,938,170円 |
| 受 取 配 当 金 息 | 1,132,697,140 |
| 受 取 利 息 | 746,116 |
| そ の 他 収 益 金 | 494,914 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △ 3,873,712,684 |
| 売 買 損 益 | 2,840,642,779 |
| 売 買 損 益 | △ 6,714,355,463 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △ 145,571,400 |
| 取 引 損 益 | 321,737,700 |
| 取 引 損 益 | △ 467,309,100 |
| (D) 当 期 損 益 金 (A + B + C) | △ 2,885,345,914 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 2,492,324,580 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 293,326,153 |
| (G) 解 約 差 損 益 金 | △ 545,905,183 |
| (H) 計 (D + E + F + G) | △ 645,600,364 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | △ 645,600,364 |

(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まず。

(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。

＜注記事項＞

- ①期首元本額 51,291,561,464円
 期中追加設定元本額 14,062,660,788円
 期中一部解約元本額 11,921,276,935円
- ②期末における元本の内訳
- | | |
|---|-----------------|
| eMAXIS 日経225インデックス | 1,313,155,167円 |
| 三菱UFJ 償還条件付利回り積極追求型ファンド／ダブルバリア08-02 1年半判定 | 1,274,043,181円 |
| インデックスファンド225VA2 (適格機関投資家限定) | 369,508,955円 |
| インデックスファンド225 | 41,918,765,807円 |
| インデックスファンド225VA | 5,678,750,262円 |
| MUAM インデックスファンド225i (適格機関投資家限定) | 61,117,833円 |
| <DC>インデックスファンド225 | 2,817,604,112円 |
| 合計 | 53,432,945,317円 |
- ③純資産総額が元本額を下回っており、その差額は645,600,364円です。

[お 知 ら せ]

- ①現物拠出にかかる参照条文の記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。(2012年4月1日)
- ②委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載していますが、2013年6月21日以降は、以下の通り変更する予定です。委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、「<http://www.am.mufg.jp/>」のアドレスに掲載します。



三菱UFJ投信より
基準価額・分配金をメール配信
<http://k.m-muam.jp/a/1/3>

*メール配信対象外ファンドもあります。

