

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年5月21日提出
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三菱UFJ 外国株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三菱UFJ 外国株式インデックスファンド(「ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(注)基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

申込価額(発行価格)×2.7%(税抜2.5%)を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込みには分配金受取コース(一般コース)と分配金再投資コース(累積投資コース)があり、分配金再投資コース(累積投資コース)の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

(7)【申込期間】

平成30年5月22日から平成31年5月21日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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）

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券		
追加型	内外	不動産投信	MRF	特殊型 ()
		その他資産 ()	ETF	
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))					その他 (MSCIコク サイ インデック ス(円換算ベー ス))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
資産複合 ()						その他 ()

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源

泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われたいファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く世界の主要国の株式を実質的な主要投資対象とし、日本を除く世界の主要国の株式の指標であるMSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)と連動する投資成果をめざします。

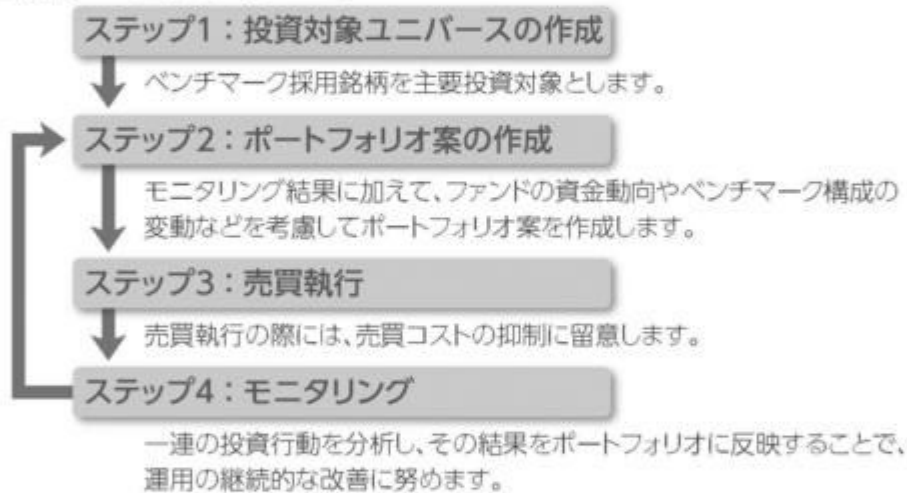
ファンドの特色

特色1

MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行い、海外の株式市場全体に投資するのと同じ投資効果をめざします。

- MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)をベンチマークとします。

<運用プロセスのイメージ>



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📄 「運用担当に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

特色2

日本を除く世界の主要国の株式へ幅広く投資を行います。

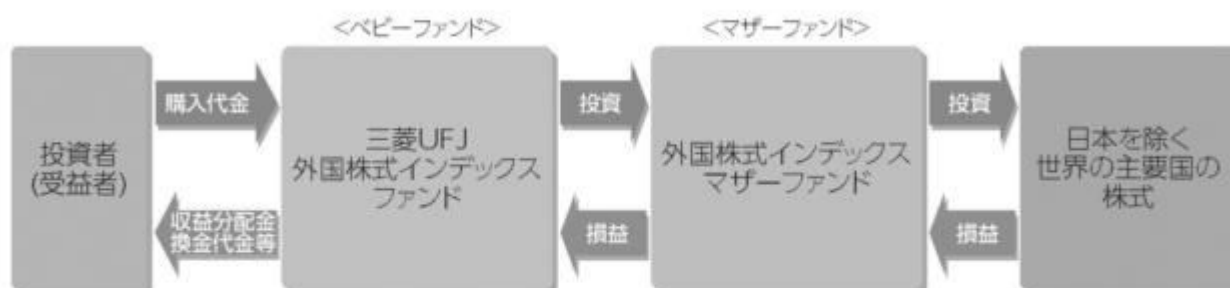
特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の主要国の株式へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年1回の決算時(2月22日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

 MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。

MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス) (米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であると問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしておりません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

<p>市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。</p>
--

(2) 【ファンドの沿革】

平成16年6月22日

設定日、信託契約締結、運用開始

平成17年10月1日

ファンドの委託会社としての業務をユーエフジェイパートナーズ投信株式会社から三菱UFJ投信株式会社に承継

名称を「UFJパートナーズ 外国株式インデックスファンド」から「三菱UFJ 外国株式インデックスファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

<p>投資家（受益者）</p>

お申込金 収益分配金、解約代金等

販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
------	--

お申込金 収益分配金、解約代金等

受託会社（受託者） 三菱UFJ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱UFJ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	

信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

投資 損益

マザーファンド

投資 損益

有価証券等

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況（平成30年2月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
昭和60年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革
平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- 大株主の状況（平成30年4月2日現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。

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。

ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、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額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合に、外国株式インデックスマザーファンドにおける株式の実質投資比率に当ファンドの当該マザーファンド受益証券への投資比率を乗じて得た割合を加算した比率）は信託財産の純資産総額を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

 a．有価証券先物取引等

 b．スワップ取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする外国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。)で16.で定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1.から23.に該当するものを除きます。)
 25. 外国の者に対する権利で23.および24.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 信託の受益権(金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1.から5.に該当するものを除きます。)
7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利(金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。)
8. 外国の者に対する権利で5.から7.の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

<外国株式インデックスマザーファンドの概要>

(基本方針)

この投資信託は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・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額を加算し、ま

たは株価指数先物取引等の売建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。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

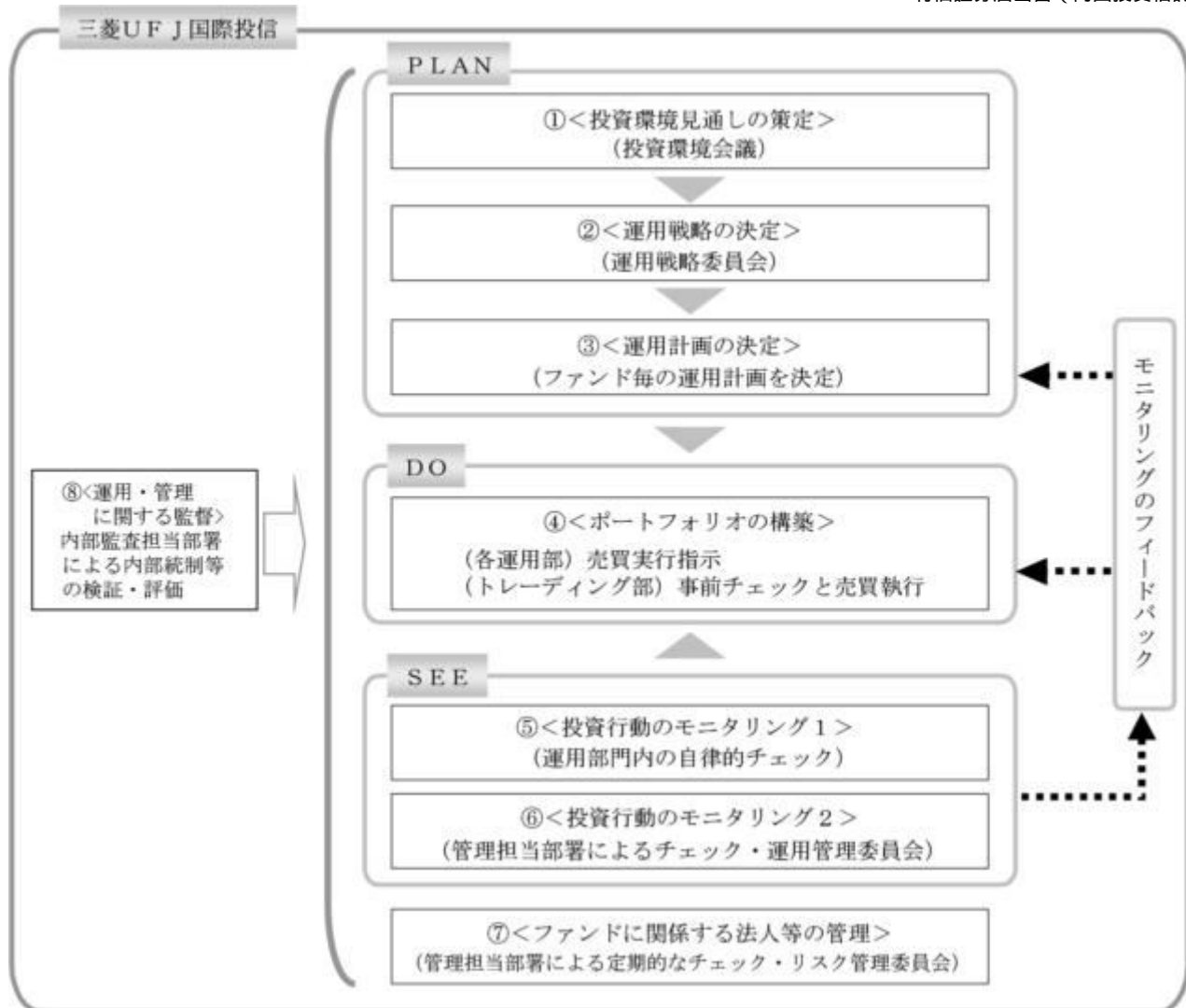
スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

(3)【運用体制】



投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに関する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、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。)等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

同一銘柄の転換社債等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債(新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「ス

ワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ 5. に定めるものを除き、）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとし、

有価証券の借入れ

有価証券の借入れを行いません。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとし、
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商

品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

< その他法令等に定められた投資制限 >

- ・ 同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、当ファンドはその影響を受け株式の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

<流動性リスクに対する管理体制>

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込価額（発行価格）× 2.7%（税抜 2.5%）を上限として販売会社が定める手数料率
申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、
分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1%）が差し引かれます。

換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.8532%（税抜0.79%）の率を乗じて得た額とします。

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）
上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.36%	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
販売会社	0.35%	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
受託会社	0.08%	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

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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。NISAおよびジュニアNISA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。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元

本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成30年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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。

5【運用状況】

【三菱UFJ 外国株式インデックスファンド】

(1)【投資状況】

平成30年 2月28日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,254,216,857	99.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		636,814	0.01
純資産総額		6,254,853,671	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成30年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,387,470,170	2.5929	6,190,608,497	2.6196	6,254,216,857	99.99

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

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成30年 2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成30年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第5計算期間末日 (平成21年 2月23日)	2,248,361,100	2,248,361,100	6,637	6,637
第6計算期間末日 (平成22年 2月22日)	2,158,130,470	2,158,130,470	9,925	9,925
第7計算期間末日 (平成23年 2月22日)	2,680,842,473	2,680,842,473	10,835	10,835
第8計算期間末日 (平成24年 2月22日)	2,620,734,359	2,620,734,359	10,215	10,215
第9計算期間末日 (平成25年 2月22日)	3,126,131,196	3,126,131,196	13,167	13,167
第10計算期間末日 (平成26年 2月24日)	3,952,455,106	3,975,043,519	17,498	17,598
第11計算期間末日 (平成27年 2月23日)	4,366,488,782	4,390,482,519	21,838	21,958
第12計算期間末日 (平成28年 2月22日)	3,723,352,779	3,723,352,779	18,228	18,228
第13計算期間末日 (平成29年 2月22日)	4,341,688,877	4,365,146,418	22,210	22,330
第14計算期間末日 (平成30年 2月22日)	6,148,298,330	6,176,190,540	24,247	24,357
平成29年 2月末日	4,322,328,403		21,954	
3月末日	4,517,670,544		22,154	
4月末日	4,705,163,889		22,296	
5月末日	4,469,247,387		22,622	
6月末日	4,993,685,963		22,960	
7月末日	4,917,954,873		23,117	
8月末日	5,006,458,070		23,014	
9月末日	5,211,730,257		24,069	
10月末日	5,472,122,206		24,609	
11月末日	5,783,091,987		24,762	
12月末日	6,040,596,473		25,512	
平成30年 1月末日	6,367,127,663		25,781	
2月末日	6,254,853,671		24,494	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
--	------------

第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	100円
第11計算期間	120円
第12計算期間	0円
第13計算期間	120円
第14計算期間	110円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第5計算期間	53.36
第6計算期間	49.54
第7計算期間	9.16
第8計算期間	5.72
第9計算期間	28.89
第10計算期間	33.65
第11計算期間	25.48
第12計算期間	16.53
第13計算期間	22.50
第14計算期間	9.66

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第5計算期間	1,169,336,181	302,679,106	3,387,863,656
第6計算期間	467,748,464	1,681,219,816	2,174,392,304
第7計算期間	636,857,682	337,071,201	2,474,178,785
第8計算期間	562,663,486	471,237,557	2,565,604,714
第9計算期間	819,306,133	1,010,702,405	2,374,208,442
第10計算期間	1,977,294,504	2,092,661,644	2,258,841,302
第11計算期間	761,851,347	1,021,214,541	1,999,478,108
第12計算期間	663,910,004	620,787,130	2,042,600,982
第13計算期間	512,957,144	600,762,981	1,954,795,145
第14計算期間	1,770,910,835	1,190,050,445	2,535,655,535

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株式	アメリカ	227,337,379,755	61.38
	イギリス	24,224,165,785	6.54
	フランス	13,885,834,321	3.75
	ドイツ	13,727,225,054	3.71
	カナダ	12,844,436,380	3.47
	スイス	11,327,150,534	3.06
	オーストラリア	9,057,346,115	2.45
	オランダ	6,036,983,613	1.63
	香港	4,621,893,655	1.25
	スペイン	4,607,242,783	1.24
	スウェーデン	3,864,557,291	1.04
	イタリア	2,855,639,500	0.77
	デンマーク	2,620,576,359	0.71
	シンガポール	1,764,854,826	0.48
	ベルギー	1,582,988,389	0.43
	フィンランド	1,469,676,247	0.40
	ノルウェー	975,377,357	0.26
	アイルランド	642,589,953	0.17
	ルクセンブルグ	441,530,407	0.12
	イスラエル	384,282,172	0.10
	オーストリア	379,474,901	0.10
ニュージーランド	238,304,532	0.06	
ポルトガル	216,286,007	0.06	
小計		345,105,795,936	93.18
投資証券	アメリカ	5,878,879,538	1.59
	オーストラリア	715,382,600	0.19
	フランス	451,746,656	0.12
	イギリス	299,364,372	0.08
	香港	174,905,325	0.05
	シンガポール	150,873,602	0.04
	カナダ	61,735,627	0.02
小計		7,732,887,720	2.09

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		17,541,312,224	4.73
純資産総額		370,379,995,880	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,257,211,566	3.31
	買建	カナダ	655,766,176	0.18
	買建	ドイツ	2,841,429,571	0.77
	買建	オーストラリア	896,324,874	0.24
	買建	イギリス	1,279,297,011	0.35
	買建	スイス	580,415,883	0.16

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成30年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	454,060	16,603.69	7,539,074,569	19,153.73	8,696,944,596	2.35
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	643,345	7,510.53	4,831,862,888	10,114.25	6,506,954,740	1.76
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	35,891	103,620.63	3,719,048,376	162,341.29	5,826,591,333	1.57
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	208,371	16,556.45	3,449,884,876	19,483.36	4,059,767,248	1.10
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	309,474	9,536.60	2,951,330,801	12,600.94	3,899,664,296	1.05
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	235,984	13,464.19	3,177,335,301	14,137.40	3,336,202,066	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	27,520	100,806.47	2,774,194,107	120,070.79	3,304,348,342	0.89
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	26,189	103,291.01	2,705,088,357	119,987.04	3,142,340,818	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	372,655	8,826.88	3,289,383,836	8,321.17	3,100,927,470	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	881,195	2,616.60	2,305,740,917	3,471.27	3,058,867,618	0.83

アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	414,734	5,788.31	2,400,611,738	6,357.37	2,636,620,683	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	111,468	18,019.90	2,008,643,005	22,511.19	2,509,277,795	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	273,729	9,256.82	2,533,861,122	8,678.41	2,375,533,914	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	413,048	3,874.98	1,600,554,102	5,358.83	2,213,456,781	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	539,862	4,098.31	2,212,523,399	3,958.73	2,137,168,921	0.58
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	160,946	10,153.98	1,634,242,610	13,246.23	2,131,928,844	0.58
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	439,487	3,604.41	1,584,091,733	4,835.94	2,125,334,872	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	85,035	19,242.85	1,636,315,869	24,965.67	2,122,955,953	0.57
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	522,951	3,588.30	1,876,507,897	3,951.21	2,066,292,358	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	103,681	16,919.36	1,754,216,641	19,861.30	2,059,239,715	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	166,726	11,574.48	1,929,767,753	12,198.30	2,033,774,716	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	239,592	6,728.87	1,612,185,313	8,200.92	1,964,874,968	0.53
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	224,210	9,351.92	2,096,795,553	8,647.57	1,938,873,867	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	49,393	21,048.81	1,039,664,109	39,151.39	1,933,804,942	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,767,636	1,029.89	1,820,477,710	1,073.47	1,897,518,216	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	358,817	4,981.96	1,787,614,812	5,158.05	1,850,797,749	0.50
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	195,557	9,088.78	1,777,376,134	9,126.51	1,784,752,994	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,102	7,421.41	1,039,755,000	12,697.57	1,778,955,821	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	356,570	4,732.86	1,687,599,314	4,683.47	1,669,988,250	0.45
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	413,657	4,214.27	1,743,263,320	3,936.18	1,628,230,148	0.44

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.07
	素材	4.85
	資本財	7.29
	商業・専門サービス	0.95
	運輸	1.92
	自動車・自動車部品	1.51

耐久消費財・アパレル	1.70
消費者サービス	1.76
メディア	2.16
小売	4.17
食品・生活必需品小売り	1.57
食品・飲料・タバコ	4.81
家庭用品・パーソナル用品	1.79
ヘルスケア機器・サービス	4.03
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.62
銀行	9.54
各種金融	4.55
保険	3.91
不動産	0.59
ソフトウェア・サービス	10.36
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.05
電気通信サービス	2.28
公益事業	2.76
半導体・半導体製造装置	2.96
小計	93.18
投資証券	2.09
合計	95.26

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成30年 2月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1803	買建	831	アメリカドル	111,906,973.31	12,015,451,724	114,158,625	12,257,211,566	3.31
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE601803	買建	42	カナダドル	7,632,457.5	641,660,701	7,800,240	655,766,176	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 1803	買建	627	ユーロ	21,303,024.25	2,796,661,023	21,644,040	2,841,429,571	0.77
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1803	買建	71	オーストラリアドル	10,397,459	869,851,420	10,713,900	896,324,874	0.24
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1803	買建	118	イギリスポンド	8,470,160	1,264,256,081	8,570,930	1,279,297,011	0.35

	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS 1X1803	買建	57	スイスフラン	5,020,093.75	573,846,916	5,077,560	580,415,883	0.16
--	-----	------------------	--------------	----	----	--------	--------------	-------------	-----------	-------------	------

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

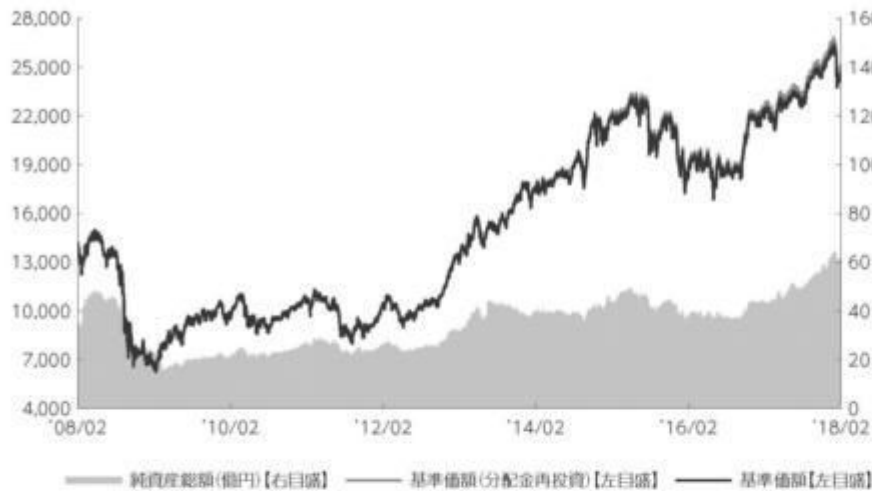
参考情報



運用実績

2018年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2008年2月29日～2018年2月28日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	24,494円
純資産総額	62.5億円

■分配の推移

2018年2月	110円
2017年2月	120円
2016年2月	0円
2015年2月	120円
2014年2月	100円
2013年2月	0円
設定来累計	450円

●分配金は1万口当たり、税引前

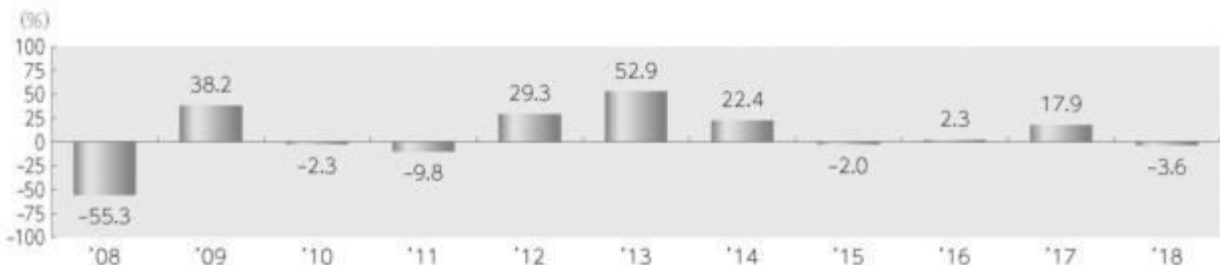
■主要な資産の状況

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	66.3%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.3%
ユーロ	13.2%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.8%
イギリスポンド	7.0%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.6%
カナダドル	3.7%	4 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.1%
スイスフラン	3.2%	5 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	1.1%
オーストラリアドル	2.8%	6 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.9%
香港ドル	1.4%	7 ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
スウェーデンクローネ	1.1%	8 ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
その他	1.3%	9 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.8%
合計	100.0%	10 BANK OF AMERICA CORP	銀行	アメリカ	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	5.0%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2018年は年初から2月28日までの収益率を表示

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

申込価額（発行価格）×2.7%（税抜 2.5%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。
ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されません。

解約単位

販売会社が定める単位（ただし、1万口を上回らないものとします。）

なお、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合等は1口単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%をかけた額

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限（平成16年6月22日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年2月23日から翌年2月22日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

信託約款の変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由

を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します(ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。)

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱いに関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

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、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース(一般コース)

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日以内)から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

分配金再投資コース(累積投資コース)

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日以内)から、販売会社において、受益者に支払います。ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成29年2月23日から平成30年2月22日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三菱UFJ 外国株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 [平成29年 2月22日現在]	第14期 [平成30年 2月22日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,331,522	27,433,100
親投資信託受益証券	4,340,720,666	6,146,072,497
未収入金	24,851,000	28,875,000
流動資産合計	4,382,903,188	6,202,380,597
資産合計	4,382,903,188	6,202,380,597
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	23,457,541	27,892,210
未払解約金	498,878	1,783,782
未払受託者報酬	1,740,812	2,461,870
未払委託者報酬	15,449,666	21,849,030
未払利息	21	40
その他未払費用	67,393	95,335
流動負債合計	41,214,311	54,082,267
負債合計	41,214,311	54,082,267
純資産の部		
元本等		
元本	1,954,795,145	2,535,655,535
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,386,893,732	3,612,642,795
(分配準備積立金)	825,468,807	728,685,770
元本等合計	4,341,688,877	6,148,298,330
純資産合計	4,341,688,877	6,148,298,330
負債純資産合計	4,382,903,188	6,202,380,597

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期		第14期	
	自	平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	自	平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
営業収益				
受取利息		157		109
有価証券売買等損益		845,783,910		488,798,831
営業収益合計		845,784,067		488,798,940
営業費用				
支払利息		5,032		11,973
受託者報酬		3,386,097		4,460,546
委託者報酬		30,051,552		39,587,269
その他費用		131,089		172,722
営業費用合計		33,573,770		44,232,510
営業利益又は営業損失()		812,210,297		444,566,430
経常利益又は経常損失()		812,210,297		444,566,430
当期純利益又は当期純損失()		812,210,297		444,566,430
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		96,928,895		164,645,466
期首剰余金又は期首欠損金()		1,680,751,797		2,386,893,732
剰余金増加額又は欠損金減少額		516,785,065		2,455,231,546
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		516,785,065		2,455,231,546
剰余金減少額又は欠損金増加額		502,466,991		1,481,511,237
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		502,466,991		1,481,511,237
分配金		23,457,541		27,892,210
期末剰余金又は期末欠損金()		2,386,893,732		3,612,642,795

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 [平成29年 2月22日現在]	第14期 [平成30年 2月22日現在]
1. 期首元本額	2,042,600,982円	1,954,795,145円
期中追加設定元本額	512,957,144円	1,770,910,835円
期中一部解約元本額	600,762,981円	1,190,050,445円
2. 受益権の総数	1,954,795,145口	2,535,655,535口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日			第14期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	83,428,734円	費用控除後の配当等収益額	A	93,428,204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	52,919,398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	186,492,760円
収益調整金額	C	1,775,055,435円	収益調整金額	C	2,902,559,552円
分配準備積立金額	D	712,578,216円	分配準備積立金額	D	476,657,016円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,623,981,783円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,659,137,532円
当ファンドの期末残存口数	F	1,954,795,145口	当ファンドの期末残存口数	F	2,535,655,535口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	13,423円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	14,430円
1万口当たり分配金額	H	120円	1万口当たり分配金額	H	110円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	23,457,541円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	27,892,210円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第13期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	第14期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第13期 [平成29年 2月22日現在]	第14期 [平成30年 2月22日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券</p> <p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品</p> <p>同左</p>

区分	第13期	第14期
	[平成29年 2月22日現在]	[平成30年 2月22日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期	第14期
	[平成29年 2月22日現在]	[平成30年 2月22日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	770,844,114	401,891,985
合計	770,844,114	401,891,985

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第13期	第14期
	[平成29年 2月22日現在]	[平成30年 2月22日現在]
1口当たり純資産額	2.2210円	2.4247円
(1万口当たり純資産額)	(22,210円)	(24,247円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,370,346,908	6,146,072,497	
合計		2,370,346,908	6,146,072,497	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月22日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	8,749,648,276
コール・ローン	1,142,894,877
株式	341,802,979,337
投資証券	7,675,575,992
派生商品評価勘定	139,111,243
未収入金	97,529
未収配当金	494,205,507
差入委託証拠金	2,740,776,339
流動資産合計	362,745,289,100
資産合計	362,745,289,100
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,672,516
未払解約金	45,794,855

[平成30年 2月22日現在]

未払利息	1,687
流動負債合計	63,469,058
負債合計	63,469,058
純資産の部	
元本等	
元本	139,872,281,848
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	222,809,538,194
元本等合計	362,681,820,042
純資産合計	362,681,820,042
負債純資産合計	362,745,289,100

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成30年 2月22日現在]
1. 期首	平成29年 2月23日
期首元本額	147,237,907,926円
期中追加設定元本額	112,254,824,660円
期中一部解約元本額	119,620,450,738円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外株式）	7,471,881,290円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,362,489,361円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,205,194,218円
eMAXIS バランス（波乗り型）	63,110,957円
コアバランス	346,403円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	6,967,980円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	9,854,755円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	8,498,194円

	[平成30年 2月22日現在]
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	2,348,669,810円
海外株式セレクション(ラップ向け)	853,679,452円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	433,706,146円
つみたて先進国株式	101,274,579円
つみたて8資産均等バランス	15,045,620円
つみたて4資産均等バランス	3,994,842円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	852,320円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,153,880円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,421,441円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	535,148円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	758,892円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	868,637円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	9,586,386,010円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,521,934,576円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,680,248,305円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,194,614,111円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	472,625,595円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	152,032,277円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	923,354,747円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	72,796,383円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	18,531,684円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	31,299,435円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	114,511,727円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	90,746,272円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	263,786,830円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	48,257,386円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,859,016,623円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	197,907,841円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,029,250,119円
MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	54,206,283,604円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	169,042,990円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	71,401,935円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,543,879,443円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,142,183,960円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	7,164,002,415円

	[平成30年 2月22日現在]
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	38,467,093円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	217,764,971円
MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	1,663,036,021円
MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	618,624,495円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	130,567,796円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	23,134,466円
MUKAM下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,518,421,716円
MUKAMバランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	416,359円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,370,346,908円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,427,893円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	9,132,547円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	11,306,022円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,314,546円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	70,754,982円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	19,381,697円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	132,263,965円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	24,329,224円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	190,247,426円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,335,271,354円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	168,363,251円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	664,335,315円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	638,462,399円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	567,513,209円
合計	139,872,281,848円
2. 受益権の総数	139,872,281,848口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。</p> <p>また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月22日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月22日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	24,041,645,861	
投資証券	570,031,434	
合計	23,471,614,427	

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

[平成30年 2月22日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	16,298,101,585		16,422,436,122	124,334,537
合計		16,298,101,585		16,422,436,122	124,334,537

（注）時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[平成30年 2月22日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	2,865,116,080		2,864,731,500	384,580
	カナダドル	156,734,850		156,533,000	201,850
	オーストラリアドル	134,728,200		134,102,000	626,200
	イギリスポンド	306,996,500		306,418,500	578,000
	スイスフラン	148,952,680		148,808,000	144,680
	香港ドル	61,828,800		61,785,000	43,800
	スウェーデンクローネ	59,554,800		59,445,000	109,800
	ノルウェークローネ	13,659,200		13,650,000	9,200

	デンマーククローネ	35,424,000		35,420,000	4,000
	ユーロ	568,006,700		567,213,000	793,700
	合計	4,351,001,810		4,348,106,000	2,895,810

(注) 時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[平成30年 2月22日現在]
1口当たり純資産額	2.5929円
(1万口当たり純資産額)	(25,929円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	49,276	57.27	2,822,036.52	
	ANDEAVOR	12,665	92.55	1,172,145.75	
	ANTERO RESOURCES CORP	19,804	18.32	362,809.28	
	APACHE CORP	34,095	37.20	1,268,334.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,628	26.76	953,405.28	
	CABOT OIL & GAS CORP	41,640	23.25	968,130.00	
	CHENIERE ENERGY INC	16,914	56.73	959,531.22	
	CHEVRON CORP	166,726	109.06	18,183,137.56	

CIMAREX ENERGY CO	7,817	95.13	743,631.21
CONCHO RESOURCES INC	12,743	149.16	1,900,745.88
CONOCOPHILLIPS	107,132	53.75	5,758,345.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,468	52.57	445,162.76
DEVON ENERGY CORP	42,370	30.57	1,295,250.90
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,962	120.98	963,242.76
EOG RESOURCES INC	50,924	105.81	5,388,268.44
EQT CORP	22,138	49.81	1,102,693.78
EXXON MOBIL CORP	372,655	74.89	27,908,132.95
HALLIBURTON CO	76,557	46.55	3,563,728.35
HELMERICH & PAYNE	9,896	64.46	637,896.16
HESS CORP	25,885	45.23	1,170,778.55
HOLLYFRONTIER CORP	15,538	44.41	690,042.58
KINDER MORGAN INC	176,383	16.75	2,954,415.25
MARATHON OIL CORP	71,531	15.30	1,094,424.30
MARATHON PETROLEUM CORP	44,409	66.27	2,942,984.43
NATIONAL OILWELL VARCO INC	34,105	34.96	1,192,310.80
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,967	23.20	416,834.40
NOBLE ENERGY INC	38,488	29.13	1,121,155.44
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67,340	67.21	4,525,921.40
ONEOK INC	34,145	56.10	1,915,534.50
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,264	23.10	468,098.40
PHILLIPS 66	38,182	89.58	3,420,343.56
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,865	174.73	2,597,361.45
RANGE RESOURCES CORP	22,261	12.92	287,612.12
SCHLUMBERGER LTD	122,054	64.40	7,860,277.60
TARGA RESOURCES CORP	19,368	46.74	905,260.32
TECHNIPFMC PLC	40,249	29.09	1,170,843.41
VALERO ENERGY CORP	38,790	90.83	3,523,295.70
WILLIAMS COS INC	70,949	28.62	2,030,560.38
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,075	160.76	3,066,497.00
ALBEMARLE CORP	9,713	113.01	1,097,666.13
AVERY DENNISON CORP	7,989	116.92	934,073.88
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,420	31.29	607,651.80
BALL CORP	29,649	39.14	1,160,461.86
CELANESE CORP-SERIES A	11,555	102.43	1,183,578.65
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,358	42.63	910,491.54
CHEMOURS CO/THE	15,718	50.01	786,057.18
CROWN HOLDINGS INC	12,342	50.31	620,926.02
DOWDUPONT INC	205,202	70.96	14,561,133.92
EASTMAN CHEMICAL CO	12,204	101.09	1,233,702.36
ECOLAB INC	22,789	129.90	2,960,291.10

FMC CORP	11,903	82.12	977,474.36
FREEMPORT-MCMORAN INC	119,106	18.73	2,230,855.38
INTERNATIONAL PAPER CO	33,656	58.40	1,965,510.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,059	141.44	998,424.96
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,501	109.09	3,218,264.09
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,627	212.31	1,194,668.37
MONSANTO CO	38,552	120.19	4,633,564.88
MOSAIC CO/THE	30,291	27.46	831,790.86
NEWMONT MINING CORP	45,171	38.16	1,723,725.36
NUCOR CORP	27,229	66.85	1,820,258.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,464	119.22	1,009,078.08
PPG INDUSTRIES INC	22,239	115.62	2,571,273.18
PRAXAIR INC	25,101	152.74	3,833,926.74
SEALED AIR CORP	15,445	42.20	651,779.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,365	397.13	2,924,862.45
STEEL DYNAMICS INC	19,921	48.14	958,996.94
VULCAN MATERIALS CO	11,914	122.04	1,453,984.56
WESTROCK CO	22,702	65.13	1,478,581.26
WR GRACE & CO	6,231	67.33	419,533.23
3M CO	52,523	232.18	12,194,790.14
ACUITY BRANDS INC	3,902	147.58	575,857.16
AERCAP HOLDINGS NV	11,144	51.49	573,804.56
AGCO CORP	5,701	67.27	383,506.27
ALLEGION PLC	8,500	86.72	737,120.00
AMETEK INC	19,499	76.35	1,488,748.65
ARCONIC INC	35,919	24.66	885,762.54
BOEING CO/THE	49,393	352.37	17,404,611.41
CATERPILLAR INC	51,978	155.23	8,068,544.94
CUMMINS INC	13,767	166.28	2,289,176.76
DEERE & CO	24,032	162.09	3,895,346.88
DOVER CORP	14,057	99.98	1,405,418.86
EATON CORP PLC	38,996	81.56	3,180,513.76
EMERSON ELECTRIC CO	56,214	71.81	4,036,727.34
FASTENAL CO	24,432	54.38	1,328,612.16
FLOWSERVE CORP	11,755	43.78	514,633.90
FLUOR CORP	12,821	57.43	736,310.03
FORTIVE CORP	26,766	76.01	2,034,483.66
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	13,713	63.48	870,501.24
GENERAL DYNAMICS CORP	22,368	220.75	4,937,736.00
GENERAL ELECTRIC CO	760,796	14.49	11,023,934.04
HARRIS CORP	10,451	158.17	1,653,034.67
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18,421	36.39	670,340.19

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	63,587	154.05	9,795,577.35
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,129	270.88	1,118,463.52
IDEX CORP	6,904	137.11	946,607.44
ILLINOIS TOOL WORKS	27,260	161.26	4,395,947.60
INGERSOLL-RAND PLC	21,824	90.01	1,964,378.24
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,860	62.06	673,971.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	18,900	62.51	1,181,439.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	19,400	38.27	742,438.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	81,740	37.85	3,093,859.00
L3 TECHNOLOGIES INC	7,014	210.66	1,477,569.24
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,479	202.60	704,845.40
LOCKHEED MARTIN CORP	22,829	357.06	8,151,322.74
MASCO CORP	26,830	42.40	1,137,592.00
MIDDLEBY CORP	5,188	132.92	689,588.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,557	350.82	5,106,886.74
OWENS CORNING	9,593	83.03	796,506.79
PACCAR INC	30,176	69.22	2,088,782.72
PARKER HANNIFIN CORP	11,460	181.30	2,077,698.00
PENTAIR PLC	14,339	70.64	1,012,906.96
RAYTHEON COMPANY	25,522	215.80	5,507,647.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,107	183.95	2,043,132.65
ROCKWELL COLLINS INC	14,560	136.58	1,988,604.80
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,876	278.43	2,471,344.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	15,500	53.34	826,770.00
SMITH (A.O.) CORP	13,206	65.38	863,408.28
SNAP-ON INC	5,257	158.08	831,026.56
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	10,306	92.03	948,461.18
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,156	160.34	2,109,433.04
TEXTRON INC	22,450	59.52	1,336,224.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,387	292.72	1,284,162.64
UNITED RENTALS INC	7,700	171.90	1,323,630.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	66,743	129.26	8,627,200.18
WABCO HOLDINGS INC	4,624	142.31	658,041.44
WABTEC CORP	7,807	81.74	638,144.18
WW GRAINGER INC	4,690	261.79	1,227,795.10
XYLEM INC	15,094	75.18	1,134,766.92
CINTAS CORP	8,118	167.34	1,358,466.12
EQUIFAX INC	10,136	113.83	1,153,780.88
IHS MARKIT LTD	34,213	46.45	1,589,193.85
MANPOWERGROUP INC	6,038	121.35	732,711.30
NIELSEN HOLDINGS PLC	31,829	32.52	1,035,079.08
REPUBLIC SERVICES INC	21,195	64.94	1,376,403.30

ROBERT HALF INTL INC	11,431	57.57	658,082.67
ROLLINS INC	8,805	49.98	440,073.90
STERICYCLE INC	7,624	74.91	571,113.84
TRANSUNION	13,221	56.73	750,027.33
VERISK ANALYTICS INC	13,254	99.23	1,315,194.42
WASTE CONNECTIONS INC	23,617	70.32	1,660,747.44
WASTE MANAGEMENT INC	38,596	84.09	3,245,537.64
AMERCO	625	351.14	219,462.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,503	52.78	607,128.34
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,789	90.18	1,153,312.02
CSX CORP	80,299	54.96	4,413,233.04
DELTA AIR LINES INC	16,725	53.16	889,101.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,001	63.99	959,913.99
FEDEX CORP	22,414	243.30	5,453,326.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,950	119.00	946,050.00
KANSAS CITY SOUTHERN	9,515	107.99	1,027,524.85
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,001	48.30	579,648.30
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7,087	63.62	450,874.94
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,339	138.90	3,519,587.10
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,235	136.60	715,101.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,078	58.03	816,946.34
UNION PACIFIC CORP	70,429	132.50	9,331,842.50
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	7,192	67.00	481,864.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,675	104.70	6,352,672.50
APTIV PLC	23,823	92.55	2,204,818.65
AUTOLIV INC	7,266	144.54	1,050,227.64
BORGWARNER INC	19,111	52.09	995,491.99
FORD MOTOR CO	324,988	10.60	3,444,872.80
GENERAL MOTORS CO	115,102	40.56	4,668,537.12
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22,608	29.15	659,023.20
HARLEY-DAVIDSON INC	15,803	46.30	731,678.90
LEAR CORP	5,711	191.54	1,093,884.94
TESLA INC	11,725	333.30	3,907,942.50
DR HORTON INC	32,146	44.93	1,444,319.78
GARMIN LTD	10,947	61.86	677,236.15
HANESBRANDS INC	32,179	19.96	642,292.84
HASBRO INC	10,067	99.07	997,337.69
LEGGETT & PLATT INC	11,889	44.88	533,578.32
LENNAR CORP-A	25,821	58.66	1,514,659.86
LULULEMON ATHLETICA INC	9,233	81.16	749,350.28
MATTEL INC	30,802	17.02	524,250.04
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,995	63.61	890,221.95

MOHAWK INDUSTRIES INC	5,327	246.40	1,312,572.80
NEWELL BRANDS INC	44,511	26.83	1,194,230.13
NIKE INC -CL B	115,312	67.05	7,731,669.60
NVR INC	320	3,185.01	1,019,203.20
POLARIS INDUSTRIES INC	5,389	115.58	622,860.62
PULTEGROUP INC	22,513	29.34	660,531.42
PVH CORP	6,436	148.06	952,914.16
RALPH LAUREN CORP	4,951	106.67	528,123.17
TAPESTRY INC	25,447	49.58	1,261,662.26
TOLL BROTHERS INC	13,859	46.68	646,938.12
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	16,507	17.03	281,114.21
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,041	15.32	261,068.12
VF CORP	29,099	74.50	2,167,875.50
WHIRLPOOL CORP	6,067	166.29	1,008,881.43
ARAMARK	22,082	41.52	916,844.64
CARNIVAL CORP	29,800	69.58	2,073,484.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,306	320.96	740,133.76
DARDEN RESTAURANTS INC	11,166	95.30	1,064,119.80
DOMINO'S PIZZA INC	4,342	230.53	1,000,961.26
H&R BLOCK INC	18,609	26.41	491,463.69
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,746	84.29	1,411,520.34
LAS VEGAS SANDS CORP	34,422	75.06	2,583,715.32
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	27,838	141.96	3,951,882.48
MCDONALD'S CORP	71,309	158.64	11,312,459.76
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	22,000	28.50	627,000.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,478	34.40	1,426,843.20
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	16,387	58.72	962,244.64
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,719	130.55	1,921,565.45
STARBUCKS CORP	126,833	56.10	7,115,331.30
VAIL RESORTS INC	3,609	216.11	779,940.99
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,552	121.12	1,035,818.24
WYNN RESORTS LTD	7,388	166.36	1,229,067.68
YUM! BRANDS INC	28,493	77.81	2,217,040.33
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	30,985	55.38	1,715,949.30
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,006	360.97	6,138,655.82
COMCAST CORP-CLASS A	413,657	39.01	16,136,759.57
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	11,148	24.09	268,555.32
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,335	22.89	442,578.15
DISH NETWORK CORP-A	20,110	43.18	868,349.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,215	24.40	859,246.00
LIBERTY BROADBAND-C	9,586	91.20	874,243.20
LIBERTY GLOBAL PLC- C	48,273	31.01	1,496,945.73

LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,678	31.83	594,520.74
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,152	41.82	382,736.64
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	15,467	41.40	640,333.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	16,582	34.58	573,405.56
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,632	47.36	550,891.52
NEWS CORP - CLASS A	34,402	16.01	550,776.02
OMNICOM GROUP	19,788	77.03	1,524,269.64
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,663	88.12	675,263.56
SIRIUS XM HOLDINGS INC	146,504	6.13	898,069.52
TIME WARNER INC	68,344	94.80	6,479,011.20
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	37,959	36.56	1,387,781.04
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	91,790	37.06	3,401,737.40
VIACOM INC-CLASS B	31,796	33.03	1,050,221.88
WALT DISNEY CO/THE	135,713	105.05	14,256,650.65
ADVANCE AUTO PARTS INC	6,772	114.00	772,008.00
AMAZON.COM INC	35,891	1,482.92	53,223,481.72
AUTONATION INC	5,912	51.74	305,886.88
AUTOZONE INC	2,414	719.49	1,736,848.86
BEST BUY CO INC	23,497	70.79	1,663,352.63
CARMAX INC	16,618	60.98	1,013,365.64
DOLLAR GENERAL CORP	23,758	95.27	2,263,424.66
DOLLAR TREE INC	20,552	105.69	2,172,140.88
EXPEDIA INC	11,029	102.99	1,135,876.71
GAP INC/THE	21,353	32.22	687,993.66
GENUINE PARTS CO	12,359	93.34	1,153,589.06
HOME DEPOT INC	103,681	183.06	18,979,843.86
KOHL'S CORP	15,351	63.44	973,867.44
L BRANDS INC	22,051	47.92	1,056,683.92
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	38,791	28.16	1,092,354.56
LKQ CORP	27,946	41.58	1,161,994.68
LOWE'S COS INC	73,564	95.34	7,013,591.76
MACY'S INC	26,986	25.59	690,571.74
NETFLIX INC	37,946	281.04	10,664,343.84
NORDSTROM INC	11,209	50.06	561,122.54
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,819	247.69	1,936,688.11
PRICELINE GROUP INC/THE	4,310	1,880.68	8,105,730.80
ROSS STORES INC	33,970	77.88	2,645,583.60
TARGET CORP	45,556	72.96	3,323,765.76
TIFFANY & CO	11,290	101.50	1,145,935.00
TJX COMPANIES INC	55,828	75.84	4,233,995.52
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,482	66.30	761,256.60
TRIPADVISOR INC	10,389	42.37	440,181.93

ULTA BEAUTY INC	5,243	201.19	1,054,839.17
COSTCO WHOLESALE CORP	38,583	185.75	7,166,792.25
CVS HEALTH CORP	89,349	68.76	6,143,637.24
KROGER CO	79,675	27.41	2,183,891.75
SYSCO CORP	43,925	58.55	2,571,808.75
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	79,926	69.63	5,565,247.38
WALMART INC	131,464	91.52	12,031,585.28
ALTRIA GROUP INC	168,749	63.93	10,788,123.57
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,295	42.12	2,034,185.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,473	67.72	1,183,271.56
BUNGE LTD	12,629	75.10	948,437.90
CAMPBELL SOUP CO	16,347	42.90	701,286.30
COCA-COLA CO/THE	356,570	43.34	15,453,743.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	18,362	37.76	693,349.12
CONAGRA BRANDS INC	35,628	35.69	1,271,563.32
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,103	213.79	3,228,870.37
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,796	115.38	1,822,542.48
GENERAL MILLS INC	50,614	54.48	2,757,450.72
HERSHEY CO/THE	12,877	97.89	1,260,529.53
HORMEL FOODS CORP	26,342	32.68	860,856.56
INGREDION INC	6,495	127.02	824,994.90
JM SMUCKER CO/THE	9,689	120.82	1,170,624.98
KELLOGG CO	22,098	68.31	1,509,514.38
KRAFT HEINZ CO/THE	53,534	67.47	3,611,938.98
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,200	104.06	1,061,412.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	16,824	78.75	1,324,890.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	132,412	43.62	5,775,811.44
MONSTER BEVERAGE CORP	34,432	65.02	2,238,768.64
PEPSICO INC	125,464	108.00	13,550,112.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	136,664	103.72	14,174,790.08
TYSON FOODS INC-CL A	25,975	75.40	1,958,515.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	22,000	47.94	1,054,680.00
CLOROX COMPANY	11,521	126.29	1,454,987.09
COLGATE-PALMOLIVE CO	73,507	69.14	5,082,273.98
COTY INC-CL A	44,566	20.80	926,972.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,518	139.82	2,729,006.76
KIMBERLY-CLARK CORP	30,966	111.94	3,466,334.04
PROCTER & GAMBLE CO/THE	224,210	80.24	17,990,610.40
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,399	100.87	241,987.13
ABBOTT LABORATORIES	152,820	58.99	9,014,851.80
AETNA INC	29,164	175.77	5,126,156.28
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,472	252.14	1,631,850.08

AMERISOURCEBERGEN CORP	14,841	98.57	1,462,877.37
ANTHEM INC	23,081	232.03	5,355,484.43
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,047	67.05	2,886,301.35
BECTON DICKINSON AND CO	23,258	218.70	5,086,524.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	120,418	26.77	3,223,589.86
CARDINAL HEALTH INC	28,170	68.81	1,938,377.70
CENTENE CORP	15,505	100.20	1,553,601.00
CERNER CORP	26,581	63.37	1,684,437.97
CIGNA CORP	22,119	191.65	4,239,106.35
COOPER COS INC/THE	4,350	229.14	996,759.00
DANAHER CORP	54,980	97.35	5,352,303.00
DAVITA INC	13,983	72.55	1,014,466.65
DENTSPLY SIRONA INC	20,493	58.06	1,189,823.58
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,152	134.25	2,436,906.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	10,045	37.53	376,988.85
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	50,700	75.83	3,844,581.00
HCA HEALTHCARE INC	25,314	100.35	2,540,259.90
HENRY SCHEIN INC	14,050	68.68	964,954.00
HOLOGIC INC	25,355	38.85	985,041.75
HUMANA INC	12,690	266.38	3,380,362.20
IDEXX LABORATORIES INC	7,413	183.94	1,363,547.22
INTUITIVE SURGICAL INC	9,832	416.56	4,095,617.92
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,666	173.76	1,505,804.16
MCKESSON CORP	18,227	149.59	2,726,576.93
MEDTRONIC PLC	119,451	80.72	9,642,084.72
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,304	101.91	1,253,900.64
RESMED INC	12,868	93.20	1,199,297.60
STRYKER CORP	29,615	157.88	4,675,616.20
TELEFLEX INC	4,053	270.00	1,094,310.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	85,035	225.13	19,143,929.55
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,008	115.47	924,683.76
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,332	120.13	1,000,923.16
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,740	60.39	588,198.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,308	118.68	2,054,113.44
ABBVIE INC	140,102	117.91	16,519,426.82
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,614	71.25	1,967,497.50
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,930	117.10	2,333,803.00
ALKERMES PLC	13,785	63.19	871,074.15
ALLERGAN PLC	29,340	159.31	4,674,155.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,661	119.18	913,037.98
AMGEN INC	64,084	182.43	11,690,844.12
BIOGEN INC	18,556	286.10	5,308,871.60

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,614	84.21	1,314,854.94
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	144,105	66.53	9,587,305.65
CELGENE CORP	68,682	93.89	6,448,552.98
ELI LILLY & CO	87,049	77.55	6,750,649.95
GILEAD SCIENCES INC	114,695	80.69	9,254,739.55
ILLUMINA INC	12,781	227.91	2,912,917.71
INCYTE CORP	15,275	84.71	1,293,945.25
IQVIA HOLDINGS INC	12,612	99.76	1,258,173.12
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,379	145.39	782,052.81
JOHNSON & JOHNSON	235,984	129.91	30,656,681.44
MERCK & CO. INC.	239,712	54.55	13,076,289.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,164	628.61	1,360,312.04
MYLAN NV	38,990	41.21	1,606,777.90
PERRIGO CO PLC	11,620	87.10	1,012,102.00
PFIZER INC	522,951	35.76	18,700,727.76
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,997	317.51	2,221,617.47
SEATTLE GENETICS INC	9,002	54.11	487,098.22
TESARO INC	3,392	62.01	210,337.92
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	77,791	20.09	1,562,821.19
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	35,165	209.79	7,377,265.35
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,067	122.17	496,865.39
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,121	157.89	3,492,684.69
WATERS CORP	6,733	204.23	1,375,080.59
ZOETIS INC	42,818	80.50	3,446,849.00
BANK OF AMERICA CORP	881,195	31.87	28,083,684.65
BB&T CORP	70,960	55.09	3,909,186.40
CIT GROUP INC	11,076	53.91	597,107.16
CITIGROUP INC	239,592	77.00	18,448,584.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	43,179	46.30	1,999,187.70
COMERICA INC	15,075	98.41	1,483,530.75
EAST WEST BANCORP INC	13,000	67.39	876,070.00
FIFTH THIRD BANCORP	63,756	33.44	2,132,000.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,993	95.61	1,337,870.73
HUNTINGTON BANCSHARES INC	92,486	16.05	1,484,400.30
JPMORGAN CHASE & CO	309,474	115.19	35,648,310.06
KEYCORP	94,001	21.05	1,978,721.05
M & T BANK CORP	11,885	192.82	2,291,665.70
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	44,196	14.12	624,047.52
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	30,850	19.76	609,596.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	42,147	161.28	6,797,468.16
REGIONS FINANCIAL CORP	103,020	19.62	2,021,252.40
SIGNATURE BANK	4,963	152.74	758,048.62

SUNTRUST BANKS INC	42,037	71.45	3,003,543.65
SVB FINANCIAL GROUP	4,405	252.57	1,112,570.85
US BANCORP	147,121	55.10	8,106,367.10
WELLS FARGO & CO	414,734	59.73	24,772,061.82
ZIONS BANCORPORATION	18,191	55.86	1,016,149.26
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,056	189.03	955,735.68
ALLY FINANCIAL INC	38,104	28.41	1,082,534.64
AMERICAN EXPRESS CO	66,171	97.50	6,451,672.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,944	159.38	2,063,014.72
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,780	56.45	5,124,531.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	111,468	201.02	22,407,297.36
BLACKROCK INC	10,625	543.56	5,775,325.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,494	97.39	4,138,490.66
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,145	111.30	1,017,838.50
CME GROUP INC	29,884	161.78	4,834,633.52
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33,243	78.59	2,612,567.37
E*TRADE FINANCIAL CORP	24,892	51.76	1,288,409.92
EATON VANCE CORP	10,253	55.54	569,451.62
FRANKLIN RESOURCES INC	29,937	39.07	1,169,638.59
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,328	263.40	8,515,195.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	51,666	72.86	3,764,384.76
INVESCO LTD	36,601	33.22	1,215,885.22
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,367	24.98	733,587.66
MOODY'S CORP	14,955	166.99	2,497,335.45
MORGAN STANLEY	121,187	55.10	6,677,403.70
MSCI INC	7,536	142.79	1,076,065.44
NASDAQ INC	10,477	79.12	828,940.24
NORTHERN TRUST CORP	18,720	105.38	1,972,713.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,799	91.22	985,084.78
S&P GLOBAL INC	22,637	187.58	4,246,248.46
SCHWAB (CHARLES) CORP	105,907	52.30	5,538,936.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,209	73.95	902,855.55
STATE STREET CORP	32,836	103.96	3,413,630.56
SYNCHRONY FINANCIAL	71,094	36.57	2,599,907.58
T ROWE PRICE GROUP INC	20,773	109.95	2,283,991.35
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,001	55.36	1,217,975.36
VOYA FINANCIAL INC	14,745	50.52	744,917.40
AFLAC INC	34,269	88.88	3,045,828.72
ALLEGHANY CORP	1,390	591.74	822,518.60
ALLSTATE CORP	31,410	93.41	2,934,008.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,662	112.72	750,940.64
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	79,414	60.18	4,779,134.52

AON PLC	23,065	139.37	3,214,569.05
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,535	88.82	1,024,538.70
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,223	68.91	1,117,926.93
ASSURANT INC	4,931	88.26	435,210.06
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	9,500	48.62	461,890.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,548	50.95	384,570.60
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	7,882	57.44	452,742.08
CHUBB LTD	40,992	143.72	5,891,370.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,969	75.54	1,055,218.26
EVEREST RE GROUP LTD	3,657	239.94	877,460.58
FNF GROUP	23,522	39.12	920,180.64
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,279	53.95	1,687,502.05
LINCOLN NATIONAL CORP	18,879	78.32	1,478,603.28
LOEWS CORP	25,793	49.75	1,283,201.75
MARKEL CORP	1,257	1,112.73	1,398,701.61
MARSH & MCLENNAN COS	45,161	82.76	3,737,524.36
METLIFE INC	79,333	46.95	3,724,684.35
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,918	63.30	1,640,609.40
PROGRESSIVE CORP	50,489	57.17	2,886,456.13
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,510	108.63	4,074,711.30
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,825	155.32	904,739.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,620	129.54	468,934.80
TORCHMARK CORP	10,035	86.17	864,715.95
TRAVELERS COS INC/THE	24,273	138.54	3,362,781.42
UNUM GROUP	20,487	51.98	1,064,914.26
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,917	157.57	1,720,191.69
WR BERKLEY CORP	8,757	69.14	605,458.98
XL GROUP LTD	23,189	43.30	1,004,083.70
CBRE GROUP INC - A	27,555	44.48	1,225,646.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	105,700	7.06	746,242.00
JONES LANG LASALLE INC	4,112	159.20	654,630.40
SBA COMMUNICATIONS CORP	10,331	169.50	1,751,104.50
ACCENTURE PLC-CL A	54,370	160.46	8,724,210.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	63,003	70.22	4,424,070.66
ADOBE SYSTEMS INC	43,378	202.09	8,766,260.02
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,682	66.32	1,040,030.24
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,175	239.59	1,000,288.25
ALPHABET INC-CL A	26,189	1,113.75	29,167,998.75
ALPHABET INC-CL C	27,520	1,111.34	30,584,076.80
ANSYS INC	7,163	163.54	1,171,437.02
AUTODESK INC	17,819	112.37	2,002,321.03
AUTOMATIC DATA PROCESSING	39,051	116.10	4,533,821.10

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	9,612	99.14	952,933.68
CA INC	28,681	34.69	994,943.89
CADENCE DESIGN SYS INC	25,141	39.26	987,035.66
CDK GLOBAL INC	10,749	69.59	748,022.91
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11,584	103.01	1,193,267.84
CITRIX SYSTEMS INC	13,700	91.38	1,251,906.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,823	81.80	4,239,121.40
COSTAR GROUP INC	3,024	352.11	1,064,780.64
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	18,101	69.92	1,265,621.92
DXC TECHNOLOGY CO	24,601	100.88	2,481,748.88
EBAY INC	89,177	43.12	3,845,312.24
ELECTRONIC ARTS INC	27,097	124.90	3,384,415.30
FACEBOOK INC-A	208,371	177.91	37,071,284.61
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	29,169	97.15	2,833,768.35
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,134	15.44	604,228.96
FISERV INC	18,435	139.79	2,577,028.65
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,852	203.64	1,598,981.28
FORTINET INC	13,493	49.11	662,641.23
GARTNER INC	8,187	114.10	934,136.70
GLOBAL PAYMENTS INC	13,771	112.24	1,545,657.04
IAC/INTERACTIVECORP	6,374	151.23	963,940.02
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,848	153.96	11,985,478.08
INTUIT INC	21,373	173.32	3,704,368.36
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,434	119.43	768,412.62
LEIDOS HOLDINGS INC	12,953	65.21	844,665.13
MASTERCARD INC - A	83,099	172.32	14,319,619.68
MERCADOLIBRE INC	3,586	373.34	1,338,797.24
MICROSOFT CORP	643,345	91.49	58,859,634.05
ORACLE CORP	272,927	49.43	13,490,781.61
PAYCHEX INC	27,655	65.08	1,799,787.40
PAYPAL HOLDINGS INC	100,442	76.51	7,684,817.42
RED HAT INC	15,340	143.42	2,200,062.80
SABRE CORP	18,948	23.53	445,846.44
SALESFORCE.COM INC	60,017	114.48	6,870,746.16
SERVICENOW INC	14,759	157.58	2,325,723.22
SPLUNK INC	11,624	92.85	1,079,288.40
SQUARE INC - A	21,679	44.10	956,043.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,633	50.11	783,369.63
SYMANTEC CORP	53,739	27.03	1,452,565.17
SYNOPSYS INC	13,517	88.46	1,195,713.82
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,226	108.54	1,001,390.04
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,028	86.56	1,214,263.68

TWITTER INC	54,744	33.38	1,827,354.72
VERISIGN INC	7,426	115.70	859,188.20
VISA INC-CLASS A SHARES	160,946	120.43	19,382,726.78
VMWARE INC-CLASS A	6,365	122.94	782,513.10
WESTERN UNION CO	42,386	20.09	851,534.74
WORKDAY INC-CLASS A	11,821	125.67	1,485,545.07
WORLDPAY INC-CLASS A	26,535	75.53	2,004,188.55
ZILLOW GROUP INC - C	9,384	47.57	446,396.88
AMPHENOL CORP-CL A	26,387	90.42	2,385,912.54
APPLE INC	454,060	171.07	77,676,044.20
ARISTA NETWORKS INC	4,239	238.03	1,009,009.17
ARROW ELECTRONICS INC	7,923	81.39	644,852.97
AVNET INC	11,219	42.01	471,310.19
CDW CORP/DE	14,140	71.13	1,005,778.20
CISCO SYSTEMS INC	439,487	43.31	19,034,181.97
COGNEX CORP	14,885	56.97	847,998.45
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17,665	38.50	680,102.50
CORNING INC	78,445	29.26	2,295,300.70
F5 NETWORKS INC	5,809	144.66	840,329.94
FLEX LTD	47,746	17.79	849,401.34
FLIR SYSTEMS INC	12,291	48.31	593,778.21
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	140,984	16.25	2,290,990.00
HP INC	147,366	21.17	3,119,738.22
IPG PHOTONICS CORP	3,191	247.95	791,208.45
JUNIPER NETWORKS INC	33,915	25.89	878,059.35
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,898	104.99	1,459,151.02
NETAPP INC	23,042	58.54	1,348,878.68
PALO ALTO NETWORKS INC	8,269	164.40	1,359,423.60
SEAGATE TECHNOLOGY	25,099	51.44	1,291,092.56
TE CONNECTIVITY LTD	30,872	102.17	3,154,192.24
TRIMBLE INC	22,911	38.28	877,033.08
WESTERN DIGITAL CORP	25,866	85.67	2,215,940.22
XEROX CORP	19,324	30.38	587,063.12
AT&T INC	539,862	36.31	19,602,389.22
CENTURYLINK INC	83,917	17.90	1,502,114.30
SPRINT CORP	71,605	5.35	383,086.75
T-MOBILE US INC	25,998	59.42	1,544,801.16
VERIZON COMMUNICATIONS INC	358,817	47.96	17,208,863.32
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,621	36.73	610,489.33
AES CORP	59,786	10.23	611,610.78
ALLIANT ENERGY CORP	20,541	38.62	793,293.42
AMEREN CORPORATION	21,754	54.40	1,183,417.60

AMERICAN ELECTRIC POWER	43,357	65.58	2,843,352.06
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,089	78.85	1,268,617.65
ATMOS ENERGY CORP	9,527	81.04	772,068.08
CENTERPOINT ENERGY INC	36,808	26.23	965,473.84
CMS ENERGY CORP	24,760	43.02	1,065,175.20
CONSOLIDATED EDISON INC	27,307	75.47	2,060,859.29
DOMINION ENERGY INC	56,690	73.54	4,168,982.60
DTE ENERGY COMPANY	16,139	101.90	1,644,564.10
DUKE ENERGY CORP	61,731	75.33	4,650,196.23
EDISON INTERNATIONAL	28,548	59.09	1,686,901.32
ENERGY CORP	16,280	74.44	1,211,883.20
EVERSOURCE ENERGY	28,552	57.36	1,637,742.72
EXELON CORP	84,060	37.06	3,115,263.60
FIRSTENERGY CORP	40,107	32.76	1,313,905.32
NEXTERA ENERGY INC	41,393	151.76	6,281,801.68
NISOURCE INC	29,683	22.80	676,772.40
OGE ENERGY CORP	18,186	30.82	560,492.52
P G & E CORP	44,013	39.79	1,751,277.27
PINNACLE WEST CAPITAL	10,011	76.10	761,837.10
PPL CORP	60,249	30.11	1,814,097.39
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,874	48.53	2,129,205.22
SCANA CORP	12,154	36.29	441,068.66
SEMPRA ENERGY	21,354	105.43	2,251,352.22
SOUTHERN CO/THE	88,138	42.92	3,782,882.96
UGI CORP	15,746	42.75	673,141.50
VISTRA ENERGY CORP	24,359	18.67	454,782.53
WEC ENERGY GROUP INC	28,399	60.12	1,707,347.88
WESTAR ENERGY INC	13,089	48.93	640,444.77
XCEL ENERGY INC	45,671	43.70	1,995,822.70
ADVANCED MICRO DEVICES	71,701	11.72	840,335.72
ANALOG DEVICES INC	32,186	88.41	2,845,564.26
APPLIED MATERIALS INC	93,618	56.13	5,254,778.34
BROADCOM LTD	35,722	248.62	8,881,203.64
INTEL CORP	413,048	45.94	18,975,425.12
KLA-TENCOR CORP	14,111	109.67	1,547,553.37
LAM RESEARCH CORP	14,110	189.23	2,670,035.30
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,922	23.19	833,031.18
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,002	61.75	1,482,123.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,282	84.15	1,706,730.30
MICRON TECHNOLOGY INC	92,901	44.54	4,137,810.54
NVIDIA CORP	52,738	241.51	12,736,754.38
NXP SEMICONDUCTORS NV	30,389	125.60	3,816,858.40

	QORVO INC	11,463	79.95	916,466.85	
	QUALCOMM INC	129,691	63.40	8,222,409.40	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,504	106.00	1,749,424.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	87,023	103.66	9,020,804.18	
	XILINX INC	22,218	68.46	1,521,044.28	
	アメリカドル 小計	26,904,229		2,086,146,338.92 (224,302,454,360)	
カナダドル	ALTAGAS LTD	15,500	26.46	410,130.00	
	ARC RESOURCES LTD	31,600	12.84	405,744.00	
	CAMECO CORP	35,700	11.44	408,408.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,100	39.45	3,791,145.00	
	CENOVUS ENERGY INC	92,300	9.32	860,236.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	49,000	9.09	445,410.00	
	ENBRIDGE INC	144,600	43.30	6,261,180.00	
	ENCANA CORP	87,600	13.44	1,177,344.00	
	HUSKY ENERGY INC	31,878	16.54	527,262.12	
	IMPERIAL OIL LTD	26,500	34.28	908,420.00	
	INTER PIPELINE LTD	29,700	22.48	667,656.00	
	KEYERA CORP	16,800	33.25	558,600.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,132	41.33	1,865,305.56	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	19,188	29.05	557,411.40	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,100	15.75	348,075.00	
	SUNCOR ENERGY INC	145,800	42.87	6,250,446.00	
	TOURMALINE OIL CORP	20,400	19.10	389,640.00	
	TRANSCANADA CORP	76,500	57.53	4,401,045.00	
	VERMILION ENERGY INC	10,100	42.02	424,402.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,600	51.29	1,056,574.00	
	BARRICK GOLD CORP	101,100	16.06	1,623,666.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,300	58.00	713,400.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63,300	20.70	1,310,310.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	16,000	90.77	1,452,320.00	
	GOLDCORP INC	77,600	16.44	1,275,744.00	
	KINROSS GOLD CORP	112,100	4.70	526,870.00	
	LUNDIN MINING CORP	62,100	8.34	517,914.00	
	METHANEX CORP	8,000	72.72	581,760.00	
	NUTRIEN LTD	56,359	59.77	3,368,577.43	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	51,500	36.90	1,900,350.00	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	90,900	3.50	318,150.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	89.00	542,900.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,000	24.69	962,910.00	
	BOMBARDIER INC-B	174,700	3.85	672,595.00	
	CAE INC	23,900	23.27	556,153.00	

FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	33.64	511,328.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	15,400	53.48	823,592.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,900	98.03	6,460,177.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,600	233.56	2,942,856.00
LINAMAR CORP	4,400	70.35	309,540.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,500	69.61	2,123,105.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,100	38.55	774,855.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,910	74.44	1,482,100.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	37,200	25.25	939,300.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	177.61	1,047,899.00
DOLLARAMA INC	9,000	154.72	1,392,480.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	35,900	62.26	2,235,134.00
EMPIRE CO LTD 'A'	15,600	23.01	358,956.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,300	24.29	177,317.00
LOBLAW COMPANIES LTD	19,500	65.31	1,273,545.00
METRO INC	20,200	39.77	803,354.00
WESTON (GEORGE) LTD	4,600	104.20	479,320.00
SAPUTO INC	18,700	40.50	757,350.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	29,800	23.60	703,280.00
BANK OF MONTREAL	56,900	99.23	5,646,187.00
BANK OF NOVA SCOTIA	105,200	78.01	8,206,652.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,200	116.47	4,449,154.00
NATIONAL BANK OF CANADA	30,500	62.58	1,908,690.00
ROYAL BANK OF CANADA	128,100	102.50	13,130,250.00
TORONTO-DOMINION BANK	162,000	73.29	11,872,980.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	73,900	51.10	3,776,290.00
CI FINANCIAL CORP	23,700	28.71	680,427.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	35,200	4.75	167,200.00
IGM FINANCIAL INC	7,700	39.30	302,610.00
ONEX CORPORATION	7,500	91.65	687,375.00
THOMSON REUTERS CORP	25,500	50.41	1,285,455.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,500	655.10	1,637,750.00
GREAT-WEST LIFECO INC	26,700	34.23	913,941.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,500	56.91	540,645.00
INTACT FINANCIAL CORP	11,700	97.44	1,140,048.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	173,400	24.78	4,296,852.00
POWER CORP OF CANADA	31,700	30.46	965,582.00
POWER FINANCIAL CORP	22,700	33.42	758,634.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,000	54.76	2,902,280.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	19.46	268,548.00
BLACKBERRY LTD	46,000	15.49	712,540.00
CGI GROUP INC - CLASS A	17,300	73.98	1,279,854.00

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,800	826.64	1,487,952.00
	OPEN TEXT CORP	23,900	44.05	1,052,795.00
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,200	168.64	1,214,208.00
	BCE INC	13,500	56.12	757,620.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	31,500	58.26	1,835,190.00
	TELUS CORP	11,600	46.41	538,356.00
	ATCO LTD -CLASS I	7,200	42.73	307,656.00
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	11,800	34.68	409,224.00
	EMERA INC	5,400	41.16	222,264.00
	FORTIS INC	36,500	41.71	1,522,415.00
	HYDRO ONE LTD	27,300	20.90	570,570.00
	カナダドル 小計	3,580,167		151,081,735.91 (12,786,047,310)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,027	33.90	814,515.30
	OIL SEARCH LTD	125,885	7.58	954,208.30
	ORIGIN ENERGY LTD	160,528	9.32	1,496,120.96
	SANTOS LTD	171,653	5.02	861,698.06
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	72,201	29.42	2,124,153.42
	WOODSIDE PETROLEUM LTD-RTS	8,022	1.74	13,958.28
	ALUMINA LTD	220,517	2.30	507,189.10
	AMCOR LIMITED	103,777	14.06	1,459,104.62
	BHP BILLITON LIMITED	282,052	29.81	8,407,970.12
	BLUESCOPE STEEL LTD	51,047	15.98	815,731.06
	BORAL LTD	107,576	7.87	846,623.12
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	140,882	5.11	719,907.02
	INCITEC PIVOT LTD	153,458	3.68	564,725.44
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	40,661	23.14	940,895.54
	NEWCREST MINING LTD	68,908	21.95	1,512,530.60
	ORICA LTD	34,168	18.90	645,775.20
	RIO TINTO LTD	36,904	80.26	2,961,915.04
	SOUTH32 LTD	472,406	3.13	1,478,630.78
	CIMIC GROUP LTD	8,873	45.70	405,496.10
	BRAMBLES LTD	144,560	9.57	1,383,439.20
	SEEK LTD	30,420	19.65	597,753.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	186,695	4.61	860,663.95
	SYDNEY AIRPORT	102,875	6.52	670,745.00
	TRANSURBAN GROUP	193,741	11.69	2,264,832.29
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,220	24.70	1,116,934.00
	CROWN RESORTS LTD	35,622	12.50	445,275.00
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	42.50	247,987.50
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,138	50.07	257,259.66
	TABCORP HOLDINGS LTD	173,558	4.71	817,458.18

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	4.44	231,728.04
	WESFARMERS LTD	99,741	41.99	4,188,124.59
	WOOLWORTHS GROUP LTD	112,775	27.56	3,108,079.00
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,552	8.83	464,034.16
	TREASURY WINE ESTATES LTD	61,102	18.00	1,099,836.00
	COCHLEAR LTD	5,273	178.47	941,072.31
	HEALTHSCOPE LTD	161,984	1.91	310,199.36
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,458	68.95	790,029.10
	SONIC HEALTHCARE LTD	36,814	24.04	885,008.56
	CSL LTD	39,724	156.85	6,230,709.40
	AUST AND NZ BANKING GROUP	258,454	28.12	7,267,726.48
	BANK OF QUEENSLAND LTD	36,107	12.37	446,643.59
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,263	11.22	485,410.86
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	152,509	74.33	11,335,993.97
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	236,393	29.38	6,945,226.34
	WESTPAC BANKING CORP	298,798	30.17	9,014,735.66
	AMP LTD	265,543	5.23	1,388,789.89
	ASX LTD	15,806	57.73	912,480.38
	CHALLENGER LTD	53,120	12.54	666,124.80
	MACQUARIE GROUP LTD	28,271	102.95	2,910,499.45
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	199,826	7.86	1,570,632.36
	MEDIBANK PRIVATE LTD	252,091	3.24	816,774.84
	QBE INSURANCE GROUP LTD	123,832	10.56	1,307,665.92
	SUNCORP GROUP LTD	117,787	13.15	1,548,899.05
	LENDLEASE GROUP	49,005	17.00	833,085.00
	COMPUTERSHARE LTD	42,496	18.01	765,352.96
	REA GROUP LTD	4,869	78.79	383,628.51
	TELSTRA CORP LTD	374,747	3.43	1,285,382.21
	TPG TELECOM LTD	34,153	6.17	210,724.01
	AGL ENERGY LTD	59,401	22.50	1,336,522.50
	AUSNET SERVICES	184,070	1.64	302,795.15
	オーストラリアドル 小計	6,671,364		106,177,410.29 (8,900,852,304)
イギリスポンド	BP PLC	1,737,294	4.72	8,203,502.26
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	396,758	22.58	8,958,795.64
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	329,282	22.83	7,519,154.47
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	52,151	6.15	320,728.65
	ANGLO AMERICAN PLC	116,293	17.96	2,089,320.03
	ANTOFAGASTA PLC	35,355	9.02	318,902.10
	BHP BILLITON PLC	184,956	14.94	2,763,242.64
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,925	45.23	539,367.75
	FRESNILLO PLC	19,964	13.32	265,920.48

GLENCORE PLC	1,073,564	4.04	4,343,103.16
JOHNSON MATTHEY PLC	17,313	32.10	555,747.30
MONDI PLC	32,631	19.26	628,636.21
RANDGOLD RESOURCES LTD	8,336	61.74	514,664.64
RIO TINTO PLC	108,195	40.16	4,345,111.20
ASHTED GROUP PLC	45,309	20.83	943,786.47
BAE SYSTEMS PLC	272,691	6.01	1,639,963.67
BUNZL PLC	29,856	19.95	595,627.20
COBHAM PLC	215,766	1.24	267,765.60
DCC PLC	8,040	66.70	536,268.00
FERGUSON PLC	21,524	52.74	1,135,175.76
IMI PLC	24,418	12.64	308,643.52
MEGGITT PLC	69,419	4.82	334,599.58
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	148,753	8.43	1,255,177.81
SMITHS GROUP PLC	32,048	16.02	513,569.20
TRAVIS PERKINS PLC	22,414	14.06	315,252.91
WEIR GROUP PLC/THE	19,948	20.20	402,949.60
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	6.42	146,189.82
CAPITA PLC	60,112	1.71	102,941.80
EXPERIAN PLC	80,550	15.76	1,269,870.75
G4S PLC	140,955	2.62	370,429.74
INTERTEK GROUP PLC	14,520	50.12	727,742.40
RELX PLC	91,388	15.22	1,391,382.30
EASYJET PLC	15,270	16.96	258,979.20
ROYAL MAIL PLC	80,182	5.63	451,424.66
GKN PLC	157,312	4.22	664,328.57
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	90,075	5.67	511,085.55
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	11,651	38.89	453,107.39
BURBERRY GROUP PLC	39,262	15.65	614,646.61
PERSIMMON PLC	27,570	24.84	684,838.80
TAYLOR WIMPEY PLC	294,631	1.91	563,776.41
CARNIVAL PLC	16,815	49.23	827,802.45
COMPASS GROUP PLC	138,476	15.53	2,150,532.28
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,951	46.86	700,603.86
MERLIN ENTERTAINMENT	63,785	3.49	222,673.43
TUI AG-DI	39,694	15.79	626,768.26
WHITBREAD PLC	16,437	39.35	646,795.95
ITV PLC	324,790	1.72	559,450.77
PEARSON PLC	74,172	7.01	520,242.40
SKY PLC	87,163	11.00	958,793.00
WPP PLC	113,601	13.79	1,567,125.79
KINGFISHER PLC	179,209	3.60	646,227.65

MARKS & SPENCER GROUP PLC	144,127	2.98	430,363.22
NEXT PLC	13,235	49.83	659,500.05
SAINSBURY (J) PLC	146,652	2.55	374,402.55
TESCO PLC	704,714	2.07	1,460,872.12
WM MORRISON SUPERMARKETS	198,878	2.21	441,310.28
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,547	26.57	838,203.79
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	201,585	44.50	8,970,532.50
COCA-COLA HBC AG-DI	16,463	24.75	407,459.25
DIAGEO PLC	221,433	24.96	5,528,074.84
IMPERIAL BRANDS PLC	83,979	26.66	2,238,880.14
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,560	58.69	3,436,886.40
UNILEVER PLC	110,788	37.30	4,132,946.34
CONVATEC GROUP PLC	123,135	2.11	259,814.85
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,328	6.05	201,634.40
SMITH & NEPHEW PLC	77,960	12.72	991,651.20
ASTRAZENECA PLC	111,191	47.99	5,336,612.04
GLAXOSMITHKLINE PLC	431,932	13.24	5,721,371.27
SHIRE PLC	79,514	29.92	2,379,058.88
BARCLAYS PLC	1,494,272	2.02	3,019,923.71
HSBC HOLDINGS PLC	1,767,636	7.47	13,209,543.82
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,322,807	0.69	4,408,261.04
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	324,172	2.77	899,253.12
STANDARD CHARTERED PLC	288,803	8.31	2,401,108.14
3I GROUP PLC	86,938	9.30	808,697.27
HARGREAVES LANSDOWN PLC	23,412	17.16	401,749.92
INVESTEC PLC	59,244	6.28	372,052.32
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,170	40.69	1,146,237.30
SCHRODERS PLC	11,176	34.80	388,924.80
ST JAMES'S PLACE PLC	47,745	11.42	545,486.62
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	224,954	3.81	857,074.74
ADMIRAL GROUP PLC	17,849	18.97	338,595.53
AVIVA PLC	351,543	5.02	1,766,855.11
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	123,007	3.89	479,604.29
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	509,163	2.60	1,326,878.77
OLD MUTUAL PLC	418,435	2.52	1,057,385.24
PRUDENTIAL PLC	227,188	18.53	4,209,793.64
RSA INSURANCE GROUP PLC	92,182	6.13	565,075.66
AUTO TRADER GROUP PLC	87,980	3.63	319,807.30
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	39,621	20.65	818,173.65
SAGE GROUP PLC/THE	97,285	7.06	686,832.10
BT GROUP PLC	737,470	2.32	1,714,617.75
VODAFONE GROUP PLC	2,341,295	2.02	4,738,781.08

	CENTRICA PLC	480,117	1.32	634,714.67
	NATIONAL GRID PLC	300,538	7.46	2,243,816.70
	SEVERN TRENT PLC	19,069	17.14	326,938.00
	SSE PLC	85,126	12.19	1,038,111.57
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	62,248	6.62	412,206.25
	イギリスポンド 小計	26,688,011		162,198,809.92 (24,247,100,094)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	18,884	24.02	453,593.68
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	742	632.00	468,944.00
	GIVAUDAN-REG	796	2,168.00	1,725,728.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	39,141	55.76	2,182,502.16
	SIKA AG-BR	194	7,850.00	1,522,900.00
	ABB LTD-REG	161,900	23.59	3,819,221.00
	GEBERIT AG-REG	3,337	428.70	1,430,571.90
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,922	220.60	423,993.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,575	226.80	810,810.00
	ADECCO GROUP AG-REG	14,675	76.00	1,115,300.00
	SGS SA-REG	457	2,423.00	1,107,311.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,866	164.25	799,240.50
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	45,806	85.30	3,907,251.80
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,547	411.80	1,048,854.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,171	78.60	406,440.60
	DUFREY AG-REG	3,168	139.10	440,668.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	200	1,919.00	383,800.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	93	5,640.00	524,520.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	67,800.00	610,200.00
	NESTLE SA-REG	273,729	75.04	20,540,624.16
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,594	146.40	672,561.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	904	673.00	608,392.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,695	246.00	1,646,970.00
	NOVARTIS AG-REG	195,557	80.20	15,683,671.40
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	61,753	223.50	13,801,795.50
	VIFOR PHARMA AG	4,430	135.80	601,594.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	213,404	17.60	3,756,977.42
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,901	62.24	1,176,398.24
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,491	82.75	288,880.25
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,559	697.50	1,087,402.50
	UBS GROUP AG-REG	321,793	18.13	5,834,107.09
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,849	150.80	580,429.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,917	343.00	1,000,531.00
	SWISS RE AG	27,549	96.44	2,656,825.56
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,300	313.60	4,170,880.00

	SWISS PRIME SITE-REG	6,530	88.80	579,864.00
	SWISSCOM AG-REG	2,333	511.00	1,192,163.00
	スイスフラン 小計	1,470,771		99,061,918.16 (11,338,627,152)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	236,368	98.55	23,294,066.40
	NWS HOLDINGS LTD	141,500	14.70	2,080,050.00
	MTR CORP	134,500	41.60	5,595,200.00
	MINH GROUP LTD	72,000	44.55	3,207,600.00
	LI & FUNG LTD	534,000	4.05	2,162,700.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	126,000	49.70	6,262,200.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	67,500	33.65	2,271,375.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	202,000	67.95	13,725,900.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	86,800	23.75	2,061,500.00
	SANDS CHINA LTD	220,000	45.35	9,977,000.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	17.04	1,976,640.00
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	7.68	1,344,000.00
	WYNN MACAU LTD	141,600	27.65	3,915,240.00
	WH GROUP LTD	771,000	9.35	7,208,850.00
	BANK OF EAST ASIA LTD	110,420	33.55	3,704,591.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	332,000	39.20	13,014,400.00
	HANG SENG BANK LTD	68,700	192.50	13,224,750.00
	FIRST PACIFIC CO	200,000	5.30	1,060,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,600	283.20	29,056,320.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	400,000	5.25	2,100,000.00
	AIA GROUP LTD	1,061,400	64.35	68,301,090.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,368	68.00	15,257,024.00
	HANG LUNG GROUP LTD	80,000	27.20	2,176,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,000	18.86	3,432,520.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	106,589	50.45	5,377,415.05
	HYSAN DEVELOPMENT CO	56,000	44.40	2,486,400.00
	KERRY PROPERTIES LTD	59,500	35.30	2,100,350.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	545,000	11.66	6,354,700.00
	SINO LAND CO	283,400	13.72	3,888,248.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	124,000	127.40	15,797,600.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	45,000	75.45	3,395,250.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	105,600	26.30	2,777,280.00
	WHARF HOLDINGS LTD	93,000	29.00	2,697,000.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	104,000	51.25	5,330,000.00
	WHEELLOCK & CO LTD	74,000	56.85	4,206,900.00
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	345,000	9.99	3,446,550.00
	PCCW LTD	404,000	4.51	1,822,040.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	61,000	65.80	4,013,800.00

	CLP HOLDINGS LTD	142,000	76.75	10,898,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	717,168	15.16	10,872,266.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	125,500	65.55	8,226,525.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,900	111.20	2,657,680.00	
	香港ドル 小計	9,200,413		332,757,521.33 (4,572,088,343)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	134,200	8.15	1,093,730.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	92,600	3.39	313,914.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	143,900	3.38	486,382.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	208,500	1.50	312,750.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	197,100	2.02	398,142.00	
	SATS LTD	62,600	5.22	326,772.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,340	11.29	489,308.60	
	GENTING SINGAPORE PLC	549,100	1.30	713,830.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,550	2.67	391,288.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,000	37.74	339,660.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.36	230,241.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,100	3.08	449,988.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	157,600	29.45	4,641,320.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	274,200	13.00	3,564,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	116,400	27.60	3,212,640.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	59,600	7.59	452,364.00	
	CAPITALAND LTD	233,700	3.60	841,320.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,200	12.79	475,788.00	
	UOL GROUP LTD	43,800	8.42	368,796.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	731,160	3.37	2,464,009.20	
STARHUB LTD	58,200	2.55	148,410.00		
	シンガポールドル 小計	4,084,410		21,715,253.90 (1,761,758,548)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,019	6.39	396,301.41	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,732	6.42	556,819.44	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,472	12.88	585,679.36	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,654	10.59	377,575.86	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	161,174	3.32	535,097.68	
	MERCURY NZ LTD	64,309	3.25	209,325.79	
	MERIDIAN ENERGY LTD	126,539	2.87	363,166.93	
	ニュージーランドドル 小計	581,899		3,023,966.47 (237,774,483)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,956	190.10	3,223,335.60	
	BOLIDEN AB	24,478	290.20	7,103,515.60	
	ALFA LAVAL AB	26,406	200.10	5,283,840.60	
	ASSA ABLOY AB-B	87,543	182.35	15,963,466.05	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	58,493	354.80	20,753,316.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	34,950	315.10	11,012,745.00	
	SANDVIK AB	97,266	151.20	14,706,619.20	
	SKANSKA AB-B SHS	29,707	162.90	4,839,270.30	
	SKF AB-B SHARES	33,976	176.20	5,986,571.20	
	VOLVO AB-B SHS	135,859	158.55	21,540,444.45	
	SECURITAS AB-B SHS	28,100	142.20	3,995,820.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,449	270.20	5,795,519.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	37,258	87.78	3,270,507.24	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	80,774	141.50	11,429,521.00	
	ICA GRUPPEN AB	7,186	298.10	2,142,146.60	
	SWEDISH MATCH AB	16,479	349.10	5,752,818.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	54,370	225.00	12,233,250.00	
	GETINGE AB-B SHS	22,021	102.10	2,248,344.10	
	NORDEA BANK AB	266,571	93.98	25,052,342.58	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,223	98.64	12,647,916.72	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	136,357	116.70	15,912,861.90	
	SWEDBANK AB - A SHARES	80,820	208.10	16,818,642.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,468	201.50	2,915,302.00	
	INVESTOR AB-B SHS	39,774	367.70	14,624,899.80	
	KINNEVIK AB - B	20,941	296.30	6,204,818.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,319	622.00	2,064,418.00	
	ERICSSON LM-B SHS	263,923	54.82	14,468,258.86	
	HEXAGON AB-B SHS	21,882	491.40	10,752,814.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,988	564.50	3,380,226.00	
	TELE2 AB-B SHS	32,211	98.44	3,170,850.84	
	TELIA CO AB	232,186	37.84	8,785,918.24	
	スウェーデンクローネ 小計	2,059,934		294,080,322.08 (3,884,801,054)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	99,840	178.35	17,806,464.00	
	NORSK HYDRO ASA	119,359	55.88	6,669,780.92	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,051	358.60	5,755,888.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	200.00	1,613,800.00	
	MARINE HARVEST	37,053	150.35	5,570,918.55	
	ORKLA ASA	72,957	85.66	6,249,496.62	
	DNB ASA	83,194	155.80	12,961,625.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,992	143.40	2,580,052.80	
	TELENOR ASA	67,503	179.35	12,106,663.05	
	ノルウェークローネ 小計	522,018		71,314,689.74 (974,158,661)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,960	514.00	4,605,440.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	20,301	321.70	6,530,831.70	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,832	443.20	8,346,342.40	
	ISS A/S	15,182	223.00	3,385,586.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	356	9,620.00	3,424,720.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	568	10,100.00	5,736,800.00	
	DSV A/S	15,866	480.00	7,615,680.00	
	PANDORA A/S	9,618	616.20	5,926,611.60	
	CARLSBERG AS-B	8,856	735.40	6,512,702.40	
	COLOPLAST-B	10,605	522.80	5,544,294.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	10,386	197.00	2,046,042.00	
	GENMAB A/S	5,046	1,019.00	5,141,874.00	
	H LUNDBECK A/S	6,220	326.50	2,030,830.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	163,823	314.00	51,440,422.00	
	DANSKE BANK A/S	65,166	246.50	16,063,419.00	
	TRYG A/S	10,139	145.70	1,477,252.30	
	TDC A/S	72,933	49.32	3,597,055.56	
	ORSTED A/S	17,114	375.00	6,417,750.00	
	デンマーククローネ 小計	459,971		145,843,652.96 (2,582,891,093)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,477	310.60	1,079,956.20	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	46,853	15.26	714,976.78	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,101	504.70	1,060,374.70	
	BANK HAPOLIM BM	96,701	24.02	2,322,758.02	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	131,411	20.80	2,733,348.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	62.28	780,928.92	
	AZRIELI GROUP LTD	3,746	173.50	649,931.00	
	NICE LTD	5,540	334.00	1,850,360.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	5.33	994,103.63	
	イスラエルシェケル 小計	488,879		12,186,738.05 (375,107,797)	
ユーロ	ENAGAS SA	20,481	20.68	423,547.08	
	ENI SPA	223,539	13.71	3,065,166.76	
	GALP ENERGIA SGPS SA	45,148	14.84	669,996.32	
	NESTE OYJ	11,624	59.78	694,882.72	
	OMV AG	13,426	48.17	646,730.42	
	REPSOL SA	109,450	14.01	1,533,941.75	
	SNAM SPA	203,595	3.59	731,516.83	
	TENARIS SA	42,968	13.55	582,216.40	
	TOTAL SA	208,951	46.82	9,783,085.82	
	VOPAK	6,422	39.30	252,384.60	
	AIR LIQUIDE SA	37,458	102.00	3,820,716.00	
	AKZO NOBEL	22,540	79.62	1,794,634.80	
	ARCELORMITTAL	57,208	28.60	1,636,148.80	

ARKEMA	6,116	103.30	631,782.80
BASF SE	80,648	87.49	7,055,893.52
COVESTRO AG	14,278	94.02	1,342,417.56
CRH PLC	73,396	28.28	2,075,638.88
EVONIK INDUSTRIES AG	14,769	30.61	452,079.09
FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,184	45.58	281,866.72
HEIDELBERGCEMENT AG	13,345	83.80	1,118,311.00
IMERYS SA	3,211	83.80	269,081.80
K+S AG-REG	17,191	22.37	384,562.67
KONINKLIJKE DSM NV	15,447	85.04	1,313,612.88
LANXESS AG	8,305	68.02	564,906.10
LINDE AG - TENDER	16,272	188.50	3,067,272.00
SOLVAY SA	6,600	114.00	752,400.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	50,057	14.50	726,076.78
SYMRISE AG	11,186	65.96	737,828.56
THYSSENKRUPP AG	38,160	22.88	873,100.80
UMICORE	17,197	47.09	809,806.73
UPM-KYMMENE OYJ	45,451	28.66	1,302,625.66
VOESTALPINE AG	10,577	47.27	499,974.79
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,183	28.60	634,433.80
AIRBUS SE	51,070	97.66	4,987,496.20
ALSTOM	13,693	34.25	468,985.25
ANDRITZ AG	6,583	48.94	322,172.02
BOSKALIS WESTMINSTER	8,202	31.34	257,050.68
BOUYGUES SA	17,699	43.13	763,357.87
BRENTAG AG	12,881	52.12	671,357.72
CNH INDUSTRIAL NV	86,136	11.59	998,316.24
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	43,997	44.37	1,952,146.89
DASSAULT AVIATION SA	222	1,395.00	309,690.00
EIFFAGE	6,737	93.26	628,292.62
FERROVIAL SA	43,028	17.57	756,001.96
GEA GROUP AG	16,513	38.77	640,209.01
HOCHTIEF AG	1,738	134.40	233,587.20
KION GROUP AG	6,359	71.86	456,957.74
KONE OYJ-B	30,271	45.27	1,370,368.17
LEGRAND SA	23,001	63.90	1,469,763.90
LEONARDO SPA	33,278	9.10	303,096.02
MAN SE	3,133	95.00	297,635.00
METSO OYJ	10,175	26.63	270,960.25
MTU AERO ENGINES AG	4,522	137.30	620,870.60
OSRAM LICHT AG	8,021	66.94	536,925.74
PRYSMIAN SPA	18,585	26.44	491,387.40

REXEL SA	27,249	14.87	405,192.63
SAFRAN SA	29,259	90.30	2,642,087.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,731	72.34	3,597,540.54
SIEMENS AG-REG	67,230	111.12	7,470,597.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,231	12.61	267,829.06
THALES SA	9,448	92.22	871,294.56
VINCI SA	44,352	82.90	3,676,780.80
WARTSILA OYJ ABP	13,421	59.46	798,012.66
BUREAU VERITAS SA	24,364	21.94	534,546.16
EDENRED	20,231	28.30	572,537.30
RANDSTAD HOLDING NV	10,800	59.34	640,872.00
RELX NV	86,745	17.25	1,496,351.25
SOCIETE BIC SA	2,546	82.95	211,190.70
TELEPERFORMANCE	4,933	120.00	591,960.00
WOLTERS KLUWER	25,671	42.16	1,082,289.36
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	59,100	19.52	1,153,632.00
ADP	2,719	163.50	444,556.50
AENA SME SA	5,669	165.50	938,219.50
ATLANTIA SPA	40,694	25.30	1,029,558.20
BOLLORE	79,699	4.55	363,108.64
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,780	27.65	602,217.00
DEUTSCHE POST AG-REG	85,336	37.48	3,198,393.28
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,775	84.90	320,497.50
GETLINK SE	43,040	10.55	454,072.00
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	58,425	6.99	408,624.45
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,927	86.77	2,509,995.79
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,933	74.30	366,521.90
CONTINENTAL AG	9,588	230.80	2,212,910.40
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	84,517	70.34	5,944,925.78
FAURECIA	6,154	71.50	440,011.00
FERRARI NV	11,124	105.30	1,171,357.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	92,866	18.12	1,683,289.11
MICHELIN (CGDE)	14,829	127.65	1,892,921.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,377	38.05	394,844.85
PEUGEOT SA	52,058	17.78	925,851.53
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12,822	68.88	883,179.36
RENAULT SA	17,014	86.14	1,465,585.96
SCHAEFFLER AG	15,276	13.61	207,906.36
VALEO SA	21,516	61.60	1,325,385.60
VOLKSWAGEN AG	3,139	166.40	522,329.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,086	163.56	2,631,026.16
ADIDAS AG	16,521	180.75	2,986,170.75

HERMES INTERNATIONAL	2,671	444.50	1,187,259.50
HUGO BOSS AG -ORD	5,624	72.26	406,390.24
KERING	6,632	395.40	2,622,292.80
LUXOTTICA GROUP SPA	13,883	50.22	697,204.26
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	24,518	246.70	6,048,590.60
SEB SA	2,038	162.50	331,175.00
ACCOR SA	15,468	47.41	733,337.88
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,509	96.05	721,239.45
SODEXO SA	7,483	100.30	750,544.90
ALTICE NV - A	47,736	7.66	365,657.76
AXEL SPRINGER SE	4,257	73.05	310,973.85
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,700	18.42	289,272.50
JCDECAUX SA	6,778	32.80	222,318.40
LAGARDERE SCA	10,504	24.68	259,238.72
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	21,028	31.14	654,811.92
PUBLICIS GROUPE	18,058	60.88	1,099,371.04
RTL GROUP	3,426	70.25	240,676.50
SES	31,022	11.79	365,749.38
TELENET GROUP HOLDING NV	4,843	56.15	271,934.45
VIVENDI	89,184	20.94	1,867,512.96
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	95,773	27.03	2,588,744.19
ZALANDO SE	10,117	47.88	484,401.96
CARREFOUR SA	51,405	19.12	983,120.62
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,022	45.52	228,601.44
COLRUYT SA	5,266	44.25	233,020.50
JERONIMO MARTINS	22,605	17.57	397,282.87
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	111,687	17.63	1,969,041.81
METRO AG	16,244	15.63	253,893.72
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,039	85.67	5,743,231.13
DANONE	53,041	64.71	3,432,283.11
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	54,194	6.26	339,525.41
HEINEKEN HOLDING NV	10,164	80.80	821,251.20
HEINEKEN NV	22,646	85.00	1,924,910.00
KERRY GROUP PLC-A	13,750	81.30	1,117,875.00
PERNOD RICARD SA	18,429	134.30	2,475,014.70
REMY COINTREAU	2,005	108.40	217,342.00
BEIERSDORF AG	8,997	90.96	818,367.12
HENKEL AG & CO KGAA	8,605	96.50	830,382.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,036	106.35	1,705,428.60
L'OREAL	22,123	174.40	3,858,251.20
UNILEVER NV-CVA	143,250	43.33	6,207,738.75
BIOMERIEUX	4,050	70.90	287,145.00

ESSILOR INTERNATIONAL	18,024	109.90	1,980,837.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	18,440	87.26	1,609,074.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,229	63.36	2,295,469.44
KONINKLIJKE PHILIPS NV	82,632	31.36	2,591,752.68
BAYER AG-REG	72,631	98.43	7,149,069.33
EUROFINS SCIENTIFIC	982	485.80	477,055.60
GRIFOLS SA	26,932	23.51	633,171.32
IPSEN	3,371	122.20	411,936.20
MERCK KGAA	11,477	82.34	945,016.18
ORION OYJ-CLASS B	9,317	27.27	254,074.59
QIAGEN N.V.	19,233	27.69	532,561.77
RECORDATI SPA	9,371	29.50	276,444.50
SANOFI	99,758	64.70	6,454,342.60
UCB SA	11,488	65.90	757,059.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	37,428	25.23	944,308.44
AIB GROUP PLC	65,783	5.34	351,610.13
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	585,697	6.97	4,082,308.09
BANCO DE SABADELL SA	479,407	1.81	869,644.29
BANCO SANTANDER SA	1,420,520	5.65	8,035,881.64
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,620	7.80	660,036.00
BANKIA SA	90,363	4.03	364,795.43
BANKINTER SA	60,287	8.96	540,533.24
BNP PARIBAS	98,730	64.95	6,412,513.50
CAIXABANK S.A	321,103	4.04	1,298,540.53
COMMERZBANK AG	96,419	13.14	1,267,138.49
CREDIT AGRICOLE SA	102,360	13.99	1,432,528.20
ERSTE GROUP BANK AG	25,369	39.83	1,010,447.27
ING GROEP NV	342,338	14.71	5,035,791.98
INTESA SANPAOLO	1,183,642	3.09	3,666,922.91
INTESA SANPAOLO-RSP	82,627	3.25	268,537.75
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROEP NV	21,592	73.40	1,584,852.80
MEDIOBANCA SPA	51,879	9.89	513,187.06
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	13,370	31.51	421,288.70
SOCIETE GENERALE SA	67,288	46.40	3,122,499.64
UNICREDIT SPA	175,930	17.52	3,083,701.04
AMUNDI SA	4,620	69.18	319,611.60
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	181,108	13.58	2,459,808.85
DEUTSCHE BOERSE AG	16,568	108.15	1,791,829.20
EURAZEO SA	3,949	79.25	312,958.25
EXOR NV	9,853	61.20	603,003.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,466	93.08	601,855.28

NATIXIS	84,670	7.07	598,955.58
WENDEL	2,624	142.40	373,657.60
AEGON NV	160,224	5.68	910,713.21
AGEAS	17,068	41.63	710,540.84
ALLIANZ SE-REG	39,544	192.34	7,605,892.96
ASSICURAZIONI GENERALI	107,116	15.47	1,657,084.52
AXA SA	170,359	25.44	4,334,784.75
CNP ASSURANCES	15,727	19.86	312,338.22
HANNOVER RUECK SE	5,455	111.60	608,778.00
MAPFRE SA	94,896	2.77	263,336.40
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,602	183.85	2,500,727.70
NN GROUP NV	25,791	36.80	949,108.80
POSTE ITALIANE SPA	46,876	6.76	316,881.76
SAMPO OYJ-A SHS	38,571	46.54	1,795,094.34
SCOR SE	15,449	35.81	553,228.69
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	88,023	2.00	176,750.18
DEUTSCHE WOHNEN SE	31,616	34.00	1,074,944.00
VONOVIA SE	42,508	37.26	1,583,848.08
AMADEUS IT GROUP SA	38,370	59.80	2,294,526.00
ATOS SE	8,443	115.20	972,633.60
CAPGEMINI SE	13,686	102.55	1,403,499.30
DASSAULT SYSTEMES SA	11,722	103.25	1,210,296.50
SAP SE	86,405	84.50	7,301,222.50
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,026	68.10	410,370.60
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,200	55.70	623,840.00
WIRECARD AG	10,400	100.85	1,048,840.00
INGENICO GROUP	5,304	91.98	487,861.92
NOKIA OYJ	509,871	4.68	2,390,275.24
1&1 DRILLISCH AG	3,913	64.40	251,997.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	292,632	13.28	3,887,616.12
ELISA OYJ	13,010	35.12	456,911.20
ILIAD SA	2,360	197.75	466,690.00
KONINKLIJKE KPN NV	305,442	2.58	790,178.45
ORANGE	174,905	13.69	2,395,323.97
PROXIMUS	13,567	26.10	354,098.70
TELECOM ITALIA SPA	1,010,661	0.71	727,271.65
TELECOM ITALIA-RSP	535,180	0.61	328,814.59
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,777	4.09	273,184.70
TELEFONICA SA	397,184	7.64	3,034,485.76
E.ON SE	197,879	8.20	1,623,201.43
EDF	50,724	10.46	530,826.66
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	211,788	2.68	567,803.62

ENDESA SA	28,382	17.01	482,919.73	
ENEL SPA	716,240	4.70	3,366,328.00	
ENGIE	160,185	12.70	2,034,349.50	
FORTUM OYJ	40,592	17.96	729,235.28	
GAS NATURAL SDG SA	31,426	18.28	574,467.28	
IBERDROLA SA	511,225	5.89	3,015,205.05	
INNOGY SE	12,762	30.29	386,560.98	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	35,301	15.75	556,167.25	
RWE AG	45,950	16.10	739,795.00	
SUEZ	33,681	10.88	366,449.28	
TERNA SPA	128,643	4.51	581,080.43	
UNIPER SE	19,009	24.74	470,282.66	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,454	19.55	849,525.70	
ASML HOLDING NV	34,146	159.35	5,441,165.10	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	98,889	22.38	2,213,135.82	
STMICROELECTRONICS NV	57,575	18.78	1,081,546.37	
ユーロ 小計	17,346,709		347,504,496.54 (45,839,318,138)	
合計	100,058,775		341,802,979,337 (341,802,979,337)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	30,621	569,244.39	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,115	961,059.45	
		AMERICAN TOWER CORP	37,730	5,185,611.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	103,104	1,047,536.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,336	1,924,662.72	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,761	1,594,211.85	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	27,436	419,496.44	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,381	666,121.88	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	46,657	375,122.28	
		CROWN CASTLE INTL CORP	35,703	3,812,723.37	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,258	1,788,371.10	
		DUKE REALTY CORP	32,395	804,043.90	
		EQUINIX INC	6,839	2,632,467.88	
		EQUITY RESIDENTIAL	31,251	1,745,993.37	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,746	1,264,981.90	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,307	921,520.50
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,792	643,549.12
		GGP INC	55,504	1,171,134.40
		HCP INC	41,053	894,955.40
		HOST HOTELS & RESORTS INC	66,421	1,276,611.62
		INVITATION HOMES INC	25,212	525,670.20
		IRON MOUNTAIN INC	22,416	705,431.52
		KIMCO REALTY CORP	39,433	578,876.44
		LIBERTY PROPERTY TRUST	13,238	513,369.64
		MACERICH CO/THE	11,029	639,240.84
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,933	849,370.83
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,428	497,641.68
		PROLOGIS INC	46,571	2,790,068.61
		PUBLIC STORAGE	13,709	2,614,991.75
		REALTY INCOME CORP	24,093	1,165,860.27
		REGENCY CENTERS CORP	13,645	774,217.30
		SIMON PROPERTY GROUP INC	27,326	4,134,423.80
		SL GREEN REALTY CORP	8,163	771,403.50
		UDR INC	23,511	781,035.42
		VENTAS INC	31,652	1,561,709.68
		VEREIT INC	84,153	567,191.22
		VORNADO REALTY TRUST	15,182	989,714.58
		WELLTOWER INC	32,236	1,740,421.64
		WEYERHAEUSER CO	64,937	2,257,210.12
アメリカドル合計			1,118,277	54,157,268.45 (5,822,989,503)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200	244,732.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700	324,005.00
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700	168,093.00
カナダドル合計			31,600	736,830.00 (62,357,922)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	92,928	870,735.36
		GOODMAN GROUP	161,239	1,331,834.14
		GPT GROUP	161,024	771,304.96
		MIRVAC GROUP	336,014	712,349.68
		SCENTRE GROUP	456,616	1,776,236.24
		STOCKLAND	195,404	803,110.44
		VICINITY CENTRES	305,971	771,046.92
		WESTFIELD CORP	166,345	1,433,893.90
オーストラリアドル合計			1,875,541	8,470,511.64 (710,082,990)
	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	87,749	560,716.11

イギリス ポンド		HAMMERSON PLC	70,806	331,159.66
		LAND SECURITIES GROUP PLC	65,717	613,205.32
		SEGRO PLC	89,418	520,949.26
イギリスポンド合計			313,690	2,026,030.35 (302,871,277)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	189,000	12,388,950.00
香港ドル合計			189,000	12,388,950.00 (170,224,173)
シンガ ポール ドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	225,600	584,304.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	203,100	355,425.00
		CAPITALAND MALL TRUST	225,900	449,541.00
		SUNTEC REIT	231,600	449,304.00
シンガポールドル合計			886,200	1,838,574.00 (149,163,508)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	3,052	267,202.60
		GECINA SA	4,233	651,882.00
		ICADE	3,002	246,013.90
		KLEPIERRE	19,757	663,440.06
		UNIBAIL-RODAMCO SE	8,673	1,642,666.20
ユーロ合計			38,717	3,471,204.76 (457,886,619)
合計				7,675,575,992 (7,675,575,992)

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	601銘柄	97.47%	64.18%
	投資証券	39銘柄		2.53%
カナダドル	株式	88銘柄	99.51%	3.66%
	投資証券	3銘柄		0.49%
オーストラリアドル	株式	60銘柄	92.61%	2.55%
	投資証券	8銘柄		7.39%
イギリスポンド	株式	98銘柄	98.77%	6.94%
	投資証券	4銘柄		1.23%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.00%	3.24%
香港ドル	株式	42銘柄	96.41%	1.31%
	投資証券	1銘柄		3.59%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.19%	0.50%

	投資証券	4銘柄		7.81%	0.04%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%		0.07%
スウェーデンクローネ	株式	31銘柄	100.00%		1.11%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.00%		0.28%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%		0.74%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.00%		0.11%
ユーロ	株式	239銘柄	99.01%		13.12%
	投資証券	5銘柄		0.99%	0.13%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

2【ファンドの現況】

【三菱UFJ 外国株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	6,256,721,533
負債総額	1,867,862
純資産総額（ - ）	6,254,853,671
発行済口数	2,553,669,028口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.4494
（10,000口当たり）	（24,494）

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	371,585,349,729
負債総額	1,205,353,849
純資産総額（ - ）	370,379,995,880
発行済口数	141,387,981,204口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.6196
（10,000口当たり）	（26,196）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、

ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとし、

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額等

平成30年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

平成30年2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	844	11,748,864
追加型公社債投資信託	16	1,329,544
単位型株式投資信託	54	320,129
単位型公社債投資信託	1	6,116
合計	915	13,404,653

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	80,707,781	2	69,212,680
有価証券		2,728,127		36,210
前払費用		402,267		337,699
未収入金		14,286		35,896

未収委託者報酬		11,275,577		10,076,022
未収収益	2	564,923	2	659,405
繰延税金資産		491,700		446,374
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		438,012		113,754
流動資産合計		96,652,678		80,948,042
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	846,844	1	806,798
器具備品	1	768,584	1	759,446
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,971,428		2,922,245
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,813,951		1,844,549
ソフトウェア仮勘定		341,815		608,066
その他		71		10
無形固定資産合計		2,171,661		2,468,448
投資その他の資産				
投資有価証券		24,223,272		24,327,081
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		686,446		654,402
前払年金費用		499,178		463,105
繰延税金資産		786,810		711,230
その他		51,090		50,235
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,543,335		26,502,592
固定資産合計		31,686,425		31,893,286
資産合計		128,339,103		112,841,328

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	199,091	166,493
未払金		
未払収益分配金	101,046	108,024
未払償還金	821,178	547,707
未払手数料	2 4,866,423	2 4,225,009
その他未払金	2 2,521,849	2 2,355,815
未払費用	2 3,419,978	2 3,061,479
未払消費税等	370,110	351,670
未払法人税等	947,540	756,668

賞与引当金	882,523	843,729
役員賞与引当金		100,680
その他	670,983	711,633
流動負債合計	14,800,725	13,228,909
固定負債		
退職給付引当金	508,142	590,154
役員退職慰労引当金	166,789	166,458
時効後支払損引当金	257,105	253,070
固定負債合計	932,038	1,009,684
負債合計	15,732,763	14,238,594
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	57,079,782	43,034,713
利益剰余金合計	64,420,372	50,375,303
株主資本合計	111,153,216	97,108,147

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,446,576	1,494,586
繰延ヘッジ損益	6,546	
評価・換算差額等合計	1,453,123	1,494,586
純資産合計	112,606,339	98,602,734
負債純資産合計	128,339,103	112,841,328

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,096,942	81,709,776

投資顧問料		2,226,322		2,396,020
その他営業収益		35,063		25,763
営業収益合計		84,358,328		84,131,560
営業費用				
支払手数料	2	34,821,751	2	33,975,255
広告宣伝費		742,632		731,771
公告費				482
調査費				
調査費		1,642,352		1,713,892
委託調査費		14,530,744		13,961,993
事務委託費		751,410		984,749
営業雑経費				
通信費		122,574		158,915
印刷費		704,639		699,940
協会費		51,201		51,995
諸会費		7,730		9,887
事務機器関連費		1,674,745		1,611,608
その他営業雑経費		30,382		11,925
営業費用合計		55,080,164		53,912,419
一般管理費				
給料				
役員報酬		280,681		331,997
給料・手当		5,948,603		6,496,165
賞与引当金繰入		882,523		843,729
役員賞与引当金繰入				100,680
福利厚生費		1,091,897		1,196,210
交際費		17,062		14,843
旅費交通費		212,578		233,159
租税公課		264,376		422,030
不動産賃借料		795,415		706,571
退職給付費用		341,073		441,736
役員退職慰労引当金繰入		34,369		48,393
固定資産減価償却費		1,068,796		1,030,040
諸経費		426,547		474,521
一般管理費合計		11,363,925		12,340,079
営業利益		17,914,238		17,879,061

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	235,697	243,048
有価証券利息	523	0
受取利息	2 15,142	2 4,601
投資有価証券償還益	9,315	260,190
収益分配金等時効完成分	71,619	278,148

その他		17,393		4,383
営業外収益合計		349,691		790,372
営業外費用				
投資有価証券償還損		152,298		11,552
時効後支払損引当金繰入		98,891		
事務過誤費		421		218
その他		5,862		4,357
営業外費用合計		257,473		16,128
経常利益		18,006,455		18,653,304
特別利益				
投資有価証券売却益		424,605		259,137
ゴルフ会員権売却益		1,300		
特別利益合計		425,905		259,137
特別損失				
投資有価証券売却損		52,623		42,248
デリバティブ解約損				126,228
有価証券評価損		67,284		
投資有価証券評価損		18,539		157,482
固定資産除却損	1	1,305	1	13,540
減損損失	3	42,073	3	48,575
合併関連費用		829,181		
特別損失合計		1,011,007		388,075
税引前当期純利益		17,421,353		18,524,367
法人税、住民税及び事業税	2	5,796,941	2	5,658,953
法人税等調整額		1,035,591		103,169
法人税等合計		4,761,350		5,762,122
当期純利益		12,660,003		12,762,244

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096		222,096	342,589	6,998,000	48,527,422	55,868,012	58,090,240
当期変動額									
剰余金の配当							4,107,643	4,107,643	4,107,643
当期純利益							12,660,003	12,660,003	12,660,003
合併による増加		3,350,000	41,160,616	44,510,616					44,510,616
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計		3,350,000	41,160,616	44,510,616			8,552,359	8,552,359	53,062,976

当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
-------	-----------	-----------	------------	------------	---------	-----------	------------	------------	-------------

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,300,727		2,300,727	60,390,967
当期変動額				
剰余金の配当				4,107,643
当期純利益				12,660,003
合併による増加	903,495	148,745	754,749	45,265,365
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,757,645	155,292	1,602,353	1,602,353
当期変動額合計	854,150	6,546	847,604	52,215,371
当期末残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

[注記事項]

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

（追加情報）

当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一

時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行しております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準委員会 平成14年1月31日 企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（企業会計基準委員会 平成19年2月7日 実務対応報告第2号）を適用しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

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

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

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

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

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	467,206千円	539,649千円
器具備品	897,207千円	1,029,950千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
預金	43,128,360千円	47,798,472千円
未収収益	52,753千円	46,963千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	2,612,168千円	1,993,055千円
その他未払金	2,296,632千円	2,071,256千円
未払費用	442,340千円	456,748千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	254千円	2,392千円
器具備品	1,051千円	7,791千円
ソフトウェア	-	3,356千円
計	1,305千円	13,540千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
支払手数料	15,120,269千円	13,862,465千円
受取利息	12,609千円	4,375千円
法人税、住民税及び事業税	3,980,844千円	4,204,969千円

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
静岡県裾野市	遊休資産（不動産）	土地	35,031千円
東京都千代田区（本社）	遊休資産（美術品）	器具備品	7,041千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア （遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループ

ングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式（注）	124,098	87,483	-	211,581
合計	124,098	87,483	-	211,581

（注）普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,107,643千円
1株当たり配当額	33,100円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,651,815千円	1,973,699千円
合計	3,329,932千円	2,651,815千円

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1)現金及び預金	80,707,781	80,707,781	-
(2)有価証券	2,728,127	2,728,127	-
(3)未収委託者報酬	11,275,577	11,275,577	-
(4)投資有価証券	24,054,542	24,054,542	-
資産計	118,766,029	118,766,029	-
(1)未払手数料	4,866,423	4,866,423	-
負債計	4,866,423	4,866,423	-

デリバティブ取引()	(3,459)	(3,459)	-
-------------	---------	---------	---

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

第32期(平成29年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

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

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	168,730	137,160
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	80,707,781	-	-	-
未収委託者報酬	11,275,577	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				

その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,728,127	9,234,321	9,756,778	5,050
合計	94,711,487	9,234,321	9,756,778	5,050

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	113,875	30,541	83,333
	債券	-	-	-
	その他	19,085,937	16,697,402	2,388,535
	小計	19,199,812	16,727,944	2,471,868
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,582,857	7,969,134	386,277
	小計	7,582,857	7,969,134	386,277
合計		26,782,669	24,697,079	2,085,590

第32期(平成29年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

3. 売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,649,814	424,605	52,623
合計	5,649,814	424,605	52,623

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	945,410	-	3,459
合計			945,410	-	3,459

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けておりません。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	263,476 千円	2,997,931 千円
勤務費用	135,457	199,166
利息費用	19,818	22,711
数理計算上の差異の発生額	113,714	40,934
退職給付の支払額	159,115	183,403
過去勤務費用の発生額	-	653,618
合併による増加	2,624,579	-
退職給付債務の期末残高	2,997,931	3,649,089

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	196,439 千円	2,678,827 千円
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の発生額	111,449	7,066
事業主からの拠出額	210,960	107,823
退職給付の支払額	139,379	142,532
合併による増加	2,486,329	-
年金資産の期末残高	2,678,827	2,698,738

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,422,447 千円	3,471,120 千円
年金資産	2,678,827	2,698,738
	256,380	772,381
非積立型制度の退職給付債務	575,484	177,969
未積立退職給付債務	319,103	950,350
未認識数理計算上の差異	310,139	207,810
未認識過去勤務費用	-	615,490
貸借対照表に計上された負債と資産 の純額	8,964	127,049
退職給付引当金	508,142	590,154
前払年金費用	499,178	463,105
貸借対照表に計上された負債と資産 の純額	8,964	127,049

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	135,457 千円	199,166 千円

利息費用	19,818	22,711
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の費用処理額	13,847	54,327
過去勤務費用の費用処理額	-	38,127
その他	65,395	28,533
確定給付制度に係る退職給付費用	198,592	295,314

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
債券	58.1 %	62.9 %
株式	35.5	33.3
その他	6.3	3.7
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.077～0.71%	0.061～0.90%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円であります。

(税効果会計関係)

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	475,116 千円	455,165 千円
投資有価証券評価損	238,391	242,551
ゴルフ会員権評価損	295	295
未払事業税	185,473	124,367
賞与引当金	272,346	260,374
役員賞与引当金	-	11,509
役員退職慰労引当金	51,071	50,969
退職給付引当金	155,593	180,726
減価償却超過額	29,059	19,277
委託者報酬	204,395	217,902
長期差入保証金	6,344	14,803
時効後支払損引当金	78,725	77,490

連結納税適用による時価評価	309,675	236,450
その他	69,525	68,614
繰延税金資産 小計	2,076,013	1,960,499
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,076,013	1,960,499
繰延税金負債		
未収配当金	1,228	-
前払年金費用	152,848	141,802
連結納税適用による時価評価	1,516	1,447
その他有価証券評価差額金	639,013	659,638
繰延ヘッジ損益	2,889	-
その他	6	3
繰延税金負債 合計	797,502	802,893
繰延税金資産の純額	1,278,511	1,157,605

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
法定実効税率 (調整)	33.06 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
評価性引当額の減少	6.34	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.59	
その他	0.02	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.33	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	3,980,844 千円	その他未払金	2,296,632 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借	投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料	5,895,622 千円 223,695 千円	未払手数料	805,721 千円
主要株	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入	9,224,647 千円 35,000,000 千円	未払手数料 現金及び預金	1,806,446 千円 35,000,000 千円

主						コーラブル預金 に係る受取利息	9,263 千円	未収収益	2,372 千円
---	--	--	--	--	--	--------------------	-------------	------	-------------

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に 伴う支払	4,204,969 千円	その他未払 金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,398,782 千円	未払手数料	898,096 千円

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
1株当たり純資産額	532,213.85円	466,028.30円
1株当たり当期純利益金額	66,691.34円	60,318.47円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株式の期中平均株式数 (株)	189,829	211,581

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)	
(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	46,287,102
有価証券	78,897
前払費用	496,625
未収入金	87,286
未収委託者報酬	9,160,402
未収収益	681,527
繰延税金資産	471,973
金銭の信託	30,000
その他	95,228
流動資産合計	57,389,043
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 780,721
器具備品	1 764,182
土地	1,356,000
有形固定資産合計	2,900,904
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,938,735
ソフトウェア仮勘定	1,212,251
無形固定資産合計	3,166,809
投資その他の資産	
投資有価証券	28,266,735
関係会社株式	320,136
長期差入保証金	640,950
前払年金費用	448,902
繰延税金資産	451,891
その他	45,230
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	30,150,247
固定資産合計	36,217,960
資産合計	93,607,004

(単位：千円)

第33期中間会計期間
(平成29年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金		196,841
未払金		
未払収益分配金		174,797
未払償還金		514,622
未払手数料		3,754,874
その他未払金		2,503,473
未払費用		4,229,858
未払消費税等	2	305,160
未払法人税等		792,896
賞与引当金		863,522
役員賞与引当金		66,649
その他		776,417
流動負債合計		14,179,114

固定負債

退職給付引当金		651,492
役員退職慰労引当金		163,557
時効後支払損引当金		252,546
固定負債合計		1,067,596

負債合計

15,246,710

(純資産の部)

株主資本

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

利益剰余金

利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		22,251,535
利益剰余金合計		29,592,124

株主資本合計

76,324,968

(単位：千円)

第33期中間会計期間
(平成29年9月30日現在)

評価・換算差額等

その他有価証券		2,035,325
評価差額金		

評価・換算差額等合計		2,035,325
------------	--	-----------

純資産合計

78,360,294

負債純資産合計

93,607,004

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	38,184,632
投資顧問料	1,346,730
その他営業収益	26,405
営業収益合計	39,557,767
営業費用	
支払手数料	15,720,488
広告宣伝費	318,084
公告費	500
調査費	
調査費	861,247
委託調査費	6,711,776
事務委託費	436,601
営業雑経費	
通信費	85,593
印刷費	251,837
協会費	24,207
諸会費	7,746
事務機器関連費	821,139
その他営業雑経費	13,599
営業費用合計	25,252,824
一般管理費	
給料	
役員報酬	178,839
給料・手当	2,821,754
賞与引当金繰入	863,522
役員賞与引当金繰入	66,649
福利厚生費	619,913
交際費	6,009
旅費交通費	93,328
租税公課	222,435
不動産賃借料	341,770
退職給付費用	210,625
役員退職慰労引当金繰入	23,884
固定資産減価償却費	1 512,328
諸経費	199,624
一般管理費合計	6,160,685
営業利益	8,144,257

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	134,154
受取利息	277
投資有価証券償還益	29,656

収益分配金等時効完成分	34,222
その他	9,043
営業外収益合計	207,354
営業外費用	
投資有価証券償還損	20,261
時効後支払損引当金繰入	26,116
その他	5,612
営業外費用合計	51,990
経常利益	8,299,622
特別利益	
投資有価証券売却益	196,888
ゴルフ会員権売却益	2,495
特別利益合計	199,383
特別損失	
投資有価証券売却損	60,319
固定資産除却損	0
特別損失合計	60,319
税引前中間純利益	8,438,686
法人税、住民税及び事業税	2,631,045
法人税等調整額	4,911
法人税等合計	2,626,133
中間純利益	5,812,552

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
中間純利益							5,812,552	5,812,552	5,812,552
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							20,783,178	20,783,178	20,783,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	22,251,535	29,592,124	76,324,968

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当中間期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
中間純利益			5,812,552

株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	540,738	540,738	540,738
当中間期変動額合計	540,738	540,738	20,242,440
当中間期末残高	2,035,325	2,035,325	78,360,294

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
建物	571,713千円
器具備品	1,115,446千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
有形固定資産	114,767千円
無形固定資産	397,560千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日至平成29年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	678,116千円
1年超	1,634,641千円
合 計	2,312,757千円

(金融商品関係)

第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,287,102	46,287,102	-
(2) 有価証券	78,897	78,897	-
(3) 未収委託者報酬	9,160,402	9,160,402	-
(4) 投資有価証券	28,129,575	28,129,575	-
資産計	83,655,978	83,655,978	-
(1) 未払手数料	3,754,874	3,754,874	-
負債計	3,754,874	3,754,874	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(有価証券関係)

第33期中間会計期間（平成29年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	21,493,708	18,316,441	3,177,266
	小計	21,493,708	18,316,441	3,177,266
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,714,765	6,958,415	243,650
	小計	6,714,765	6,958,415	243,650
合計		28,208,473	25,274,857	2,933,616

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 （平成29年9月30日現在）
1株当たり純資産額	370,356.00円
（算定上の基礎）	

純資産の部の合計額（千円）	78,360,294
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	78,360,294
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	27,471.99円
中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社
 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
 資本金の額：324,279百万円（平成29年9月末現在）
 事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名称	資本金の額 （平成29年9月末現在）	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

- （１）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- （２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成30年4月2日現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【その他】

- （１）目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- （２）投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- （３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- （４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されること

があります。

- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年3月28日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三菱UFJ外国株式インデックスファンドの平成29年2月23日から平成30年2月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ外国株式インデックスファンドの平成30年2月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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