

【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8月13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 DC海外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 DC海外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】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

平成30年8月14日から平成31年8月9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、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みに限り取り扱うものとします。

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。

(1 0) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【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)) 資産複合 ()					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 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、対円での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。

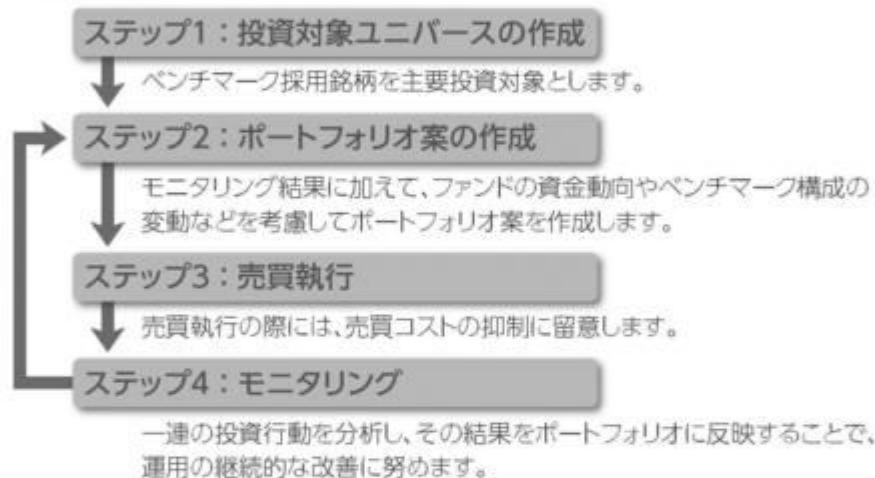
ファンドの特色

特色 1

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

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。
☞ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>) でご覧いただけます。

特色 2

「外国株式インデックスマザーファンド」を通じて、日本を除く世界の主要国の株式への投資を行います。

外国株式インデックスマザーファンドの株式の実質投資比率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。

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

- ・株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ・同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ・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(5月12日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- ・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。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。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

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。

(注)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ため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キングしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、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、広範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。

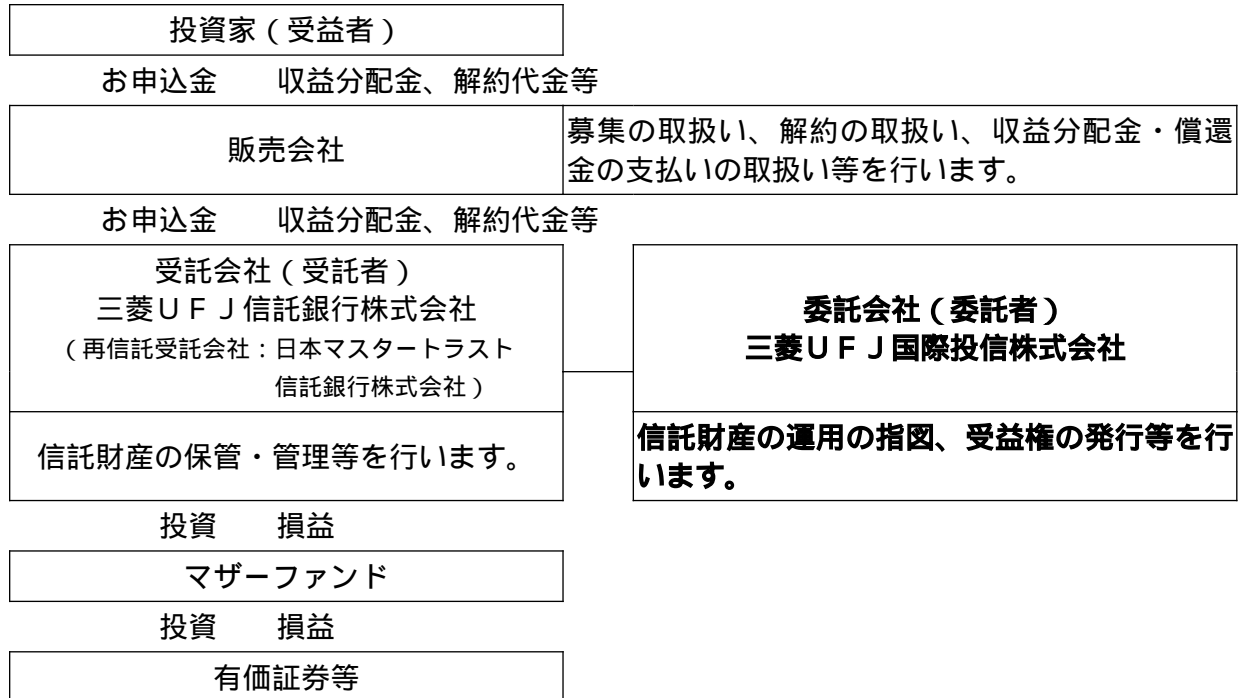
当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

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。

平成18年5月15日 設定日、信託契約締結、運用開始

(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



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5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

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、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%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、）

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券

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せん。）
 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せん。）
 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。

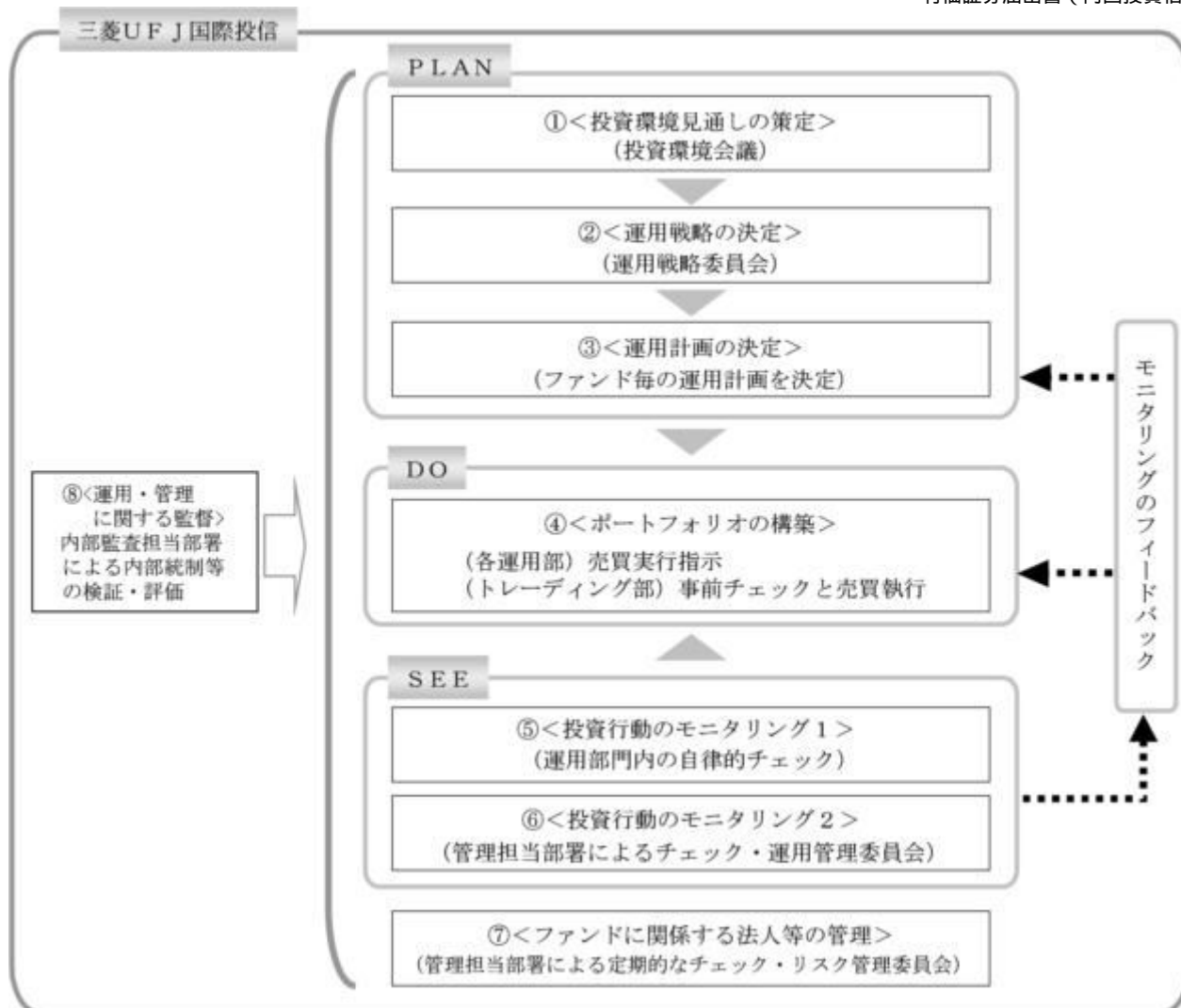
スワップ取引を行うことができます。

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（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償還金の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。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、定期的に関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及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。

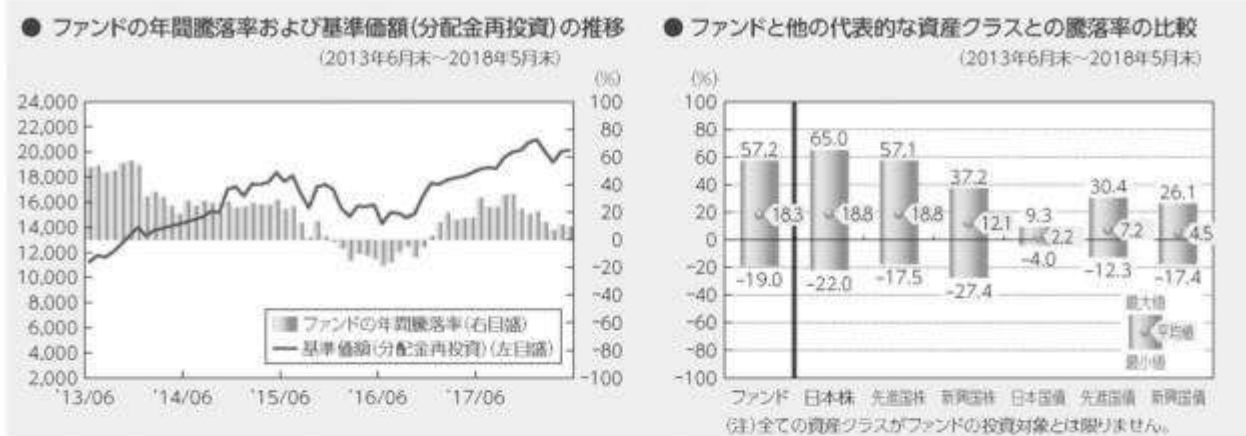
<流動性リスクに対する管理体制>

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】

ありません。

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。

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0.2268%（税抜0.21%）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	0.065%	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	0.09%	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	0.055%	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（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。

確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。上記以外の場合の課税の取扱いは、次の通りです。

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。

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5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 DC海外株式インデックスファンド】

(1) 【投資状況】

平成30年 5月31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	27,626,145,187	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,373,500	0.00
純資産総額		27,627,518,687	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 5月31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	10,486,693,436	2.6765	28,068,554,024	2.6344	27,626,145,187	100.00

(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 5月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(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5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3計算期間末日 (平成21年 5月12日)	236,242,005	236,242,005	6,466	6,466
第4計算期間末日 (平成22年 5月12日)	520,223,119	520,223,119	7,731	7,731
第5計算期間末日 (平成23年 5月12日)	1,090,870,564	1,090,870,564	8,273	8,273
第6計算期間末日 (平成24年 5月14日)	1,390,131,776	1,390,131,776	7,691	7,691
第7計算期間末日 (平成25年 5月13日)	2,536,679,131	2,536,679,131	12,014	12,014
第8計算期間末日 (平成26年 5月12日)	3,852,243,552	3,852,243,552	14,024	14,024
第9計算期間末日 (平成27年 5月12日)	8,885,698,370	8,885,698,370	17,753	17,753
第10計算期間末日 (平成28年 5月12日)	11,542,468,821	11,542,468,821	15,149	15,149
第11計算期間末日 (平成29年 5月12日)	18,664,580,996	18,664,580,996	18,621	18,621
第12計算期間末日 (平成30年 5月14日)	27,246,040,936	27,246,040,936	20,475	20,475
平成29年 5月末日	18,733,443,291		18,338	
6月末日	20,024,975,620		18,621	
7月末日	20,562,126,767		18,758	
8月末日	20,892,042,212		18,684	
9月末日	22,116,645,990		19,550	
10月末日	23,101,050,632		19,999	
11月末日	23,689,111,837		20,133	
12月末日	25,083,667,588		20,752	
平成30年 1月末日	26,237,268,996		20,983	
2月末日	25,473,143,579		20,035	
3月末日	24,993,397,139		19,182	
4月末日	26,330,149,356		20,040	
5月末日	27,627,518,687		20,136	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
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	0円
第11計算期間	0円

第12計算期間	0円
---------	----

【収益率の推移】

	収益率（％）
第3計算期間	40.25
第4計算期間	19.56
第5計算期間	7.01
第6計算期間	7.03
第7計算期間	56.20
第8計算期間	16.73
第9計算期間	26.59
第10計算期間	14.66
第11計算期間	22.91
第12計算期間	9.95

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）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3計算期間	206,313,433	26,596,567	365,341,777
第4計算期間	508,233,492	200,670,191	672,905,078
第5計算期間	989,578,155	343,881,975	1,318,601,258
第6計算期間	866,157,008	377,223,701	1,807,534,565
第7計算期間	897,291,597	593,393,895	2,111,432,267
第8計算期間	1,302,992,997	667,520,686	2,746,904,578
第9計算期間	3,434,566,005	1,176,278,340	5,005,192,243
第10計算期間	3,938,398,553	1,324,507,024	7,619,083,772
第11計算期間	4,098,128,352	1,693,541,631	10,023,670,493
第12計算期間	5,277,344,743	1,994,334,467	13,306,680,769

（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 5月31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	207,250,115,403	62.33
	イギリス	22,553,195,562	6.78
	フランス	12,460,949,916	3.75
	ドイツ	12,112,795,308	3.64
	カナダ	12,030,675,184	3.62
	スイス	9,568,784,741	2.88
	オーストラリア	7,984,524,662	2.40
	オランダ	5,354,934,602	1.61
	香港	4,164,223,391	1.25
	スペイン	3,753,538,520	1.13
	スウェーデン	3,274,022,272	0.98
	イタリア	2,368,146,132	0.71
	デンマーク	2,156,709,043	0.65
	シンガポール	1,570,069,834	0.47
	フィンランド	1,323,052,514	0.40
	ベルギー	1,314,880,382	0.40
	ノルウェー	868,333,594	0.26
	アイルランド	612,964,302	0.18
	ルクセンブルグ	400,871,298	0.12
	イスラエル	347,799,532	0.10
オーストリア	303,775,789	0.09	
ニュージーランド	223,809,595	0.07	
ポルトガル	194,324,834	0.06	
	小計	312,192,496,410	93.89
投資証券	アメリカ	5,708,038,447	1.72
	オーストラリア	677,225,305	0.20
	フランス	401,834,370	0.12
	イギリス	280,131,298	0.08
	香港	168,072,520	0.05
	シンガポール	131,595,968	0.04
	カナダ	62,442,027	0.02
	小計	7,429,339,935	2.23
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		12,892,386,359	3.88
純資産総額		332,514,222,704	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 5月31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	6,944,791,367	2.09
	買建	カナダ	399,903,350	0.12
	買建	ドイツ	1,595,905,820	0.48
	買建	オーストラリア	469,003,837	0.14
	買建	イギリス	730,312,783	0.22
	買建	スイス	292,949,798	0.09

（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 5月31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	410,862	20,499.73	8,422,561,299	20,381.24	8,373,881,137	2.52
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	586,426	10,619.98	6,227,838,255	10,755.86	6,307,518,888	1.90
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	32,776	174,236.31	5,710,769,526	176,625.54	5,789,078,797	1.74
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	190,846	20,325.81	3,879,100,108	20,399.72	3,893,206,681	1.17
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	277,590	12,376.58	3,435,615,398	11,777.64	3,269,356,476	0.98
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	339,050	8,835.13	2,995,552,860	8,859.04	3,003,660,902	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,174	119,380.86	3,005,293,820	116,069.86	2,921,942,656	0.88
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	214,947	13,830.98	2,972,929,378	13,149.43	2,826,432,465	0.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,868	119,937.40	2,862,666,006	117,120.98	2,795,443,765	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	792,708	3,361.00	2,664,294,759	3,205.56	2,541,075,435	0.76
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	374,488	5,942.62	2,225,443,249	6,052.41	2,266,557,163	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	374,238	5,918.71	2,215,008,065	5,894.80	2,206,058,537	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,583	21,663.91	2,200,684,970	21,098.67	2,143,266,195	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	151,990	14,113.60	2,145,127,280	13,604.89	2,067,807,535	0.62
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,522	25,901.03	2,007,900,113	26,624.97	2,064,021,545	0.62
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	248,987	8,539.87	2,126,319,101	8,282.36	2,062,200,716	0.62
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,076	14,328.83	2,078,769,921	14,200.56	2,060,161,603	0.62

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	93,441	20,686.69	1,932,985,654	20,336.68	1,900,279,996	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	476,812	3,858.85	1,839,945,987	3,918.63	1,868,452,192	0.56
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	395,369	4,992.59	1,973,915,711	4,657.79	1,841,547,751	0.55
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	45,274	37,225.40	1,685,342,850	38,935.25	1,762,754,644	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	330,067	5,284.99	1,744,402,115	5,282.82	1,743,684,549	0.52
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	491,130	3,509.92	1,723,828,483	3,540.35	1,738,776,516	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,600,739	1,063.67	1,702,662,022	1,049.21	1,679,521,739	0.51
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	202,835	7,975.31	1,617,673,829	8,140.54	1,651,187,039	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	75,142	21,017.14	1,579,270,309	20,844.31	1,566,283,292	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	211,467	7,919.88	1,674,793,687	7,248.11	1,532,737,346	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	323,777	4,580.61	1,483,098,754	4,688.23	1,517,941,368	0.46
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	177,953	8,535.47	1,518,913,916	8,200.92	1,459,379,384	0.44
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	127,715	11,324.36	1,446,291,404	11,197.18	1,430,048,738	0.43

(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 5月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.91
	素材	4.85
	資本財	7.14
	商業・専門サービス	1.01
	運輸	1.97
	自動車・自動車部品	1.43
	耐久消費財・アパレル	1.81
	消費者サービス	1.83
	メディア	1.99
	小売	4.52
	食品・生活必需品小売り	1.39
	食品・飲料・タバコ	4.56
	家庭用品・パーソナル用品	1.80
	ヘルスケア機器・サービス	4.41

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.49
	銀行	8.76
	各種金融	4.37
	保険	3.78
	不動産	0.61
	ソフトウェア・サービス	10.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.19
	電気通信サービス	2.17
	公益事業	2.89
	半導体・半導体製造装置	3.13
	小計	93.89
投資証券		2.23
合計		96.12

（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 5月31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 EMINI 1806	買建	469	アメリカドル	63,790,071.45	6,933,980,766	63,889,525	6,944,791,367	2.09
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE601806	買建	25	カナダドル	4,742,525	400,031,984	4,741,000	399,903,350	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 1806	買建	368	ユーロ	12,920,035.75	1,637,356,130	12,592,960	1,595,905,820	0.48
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1806	買建	38	オーストラリアドル	5,766,538	474,874,404	5,695,250	469,003,837	0.14
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1806	買建	66	イギリスポンド	5,086,943.9	735,368,610	5,051,970	730,312,783	0.22
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX1806	買建	31	スイスフラン	2,758,725.35	303,597,724	2,661,970	292,949,798	0.09

（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。

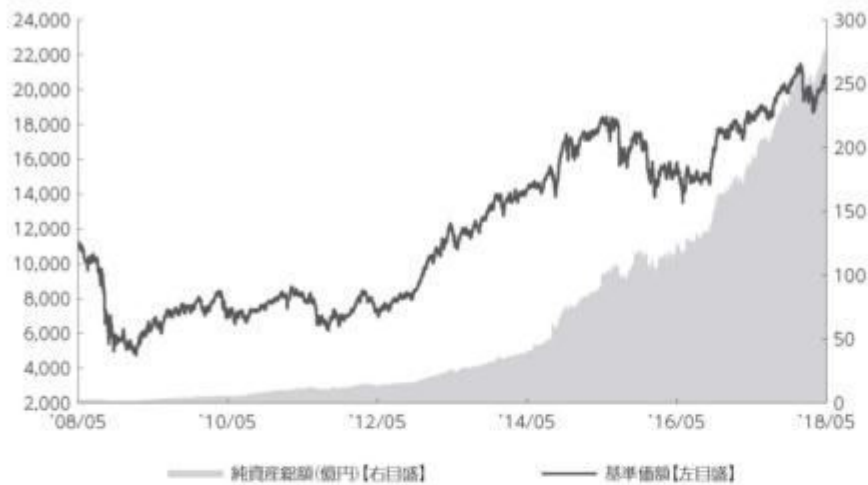
参考情報



運用実績

2018年5月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2008年5月30日～2018年5月31日



・基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	20,136円
純資産総額	276.2億円

■分配の推移

2018年5月	0円
2017年5月	0円
2016年5月	0円
2015年5月	0円
2014年5月	0円
2013年5月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

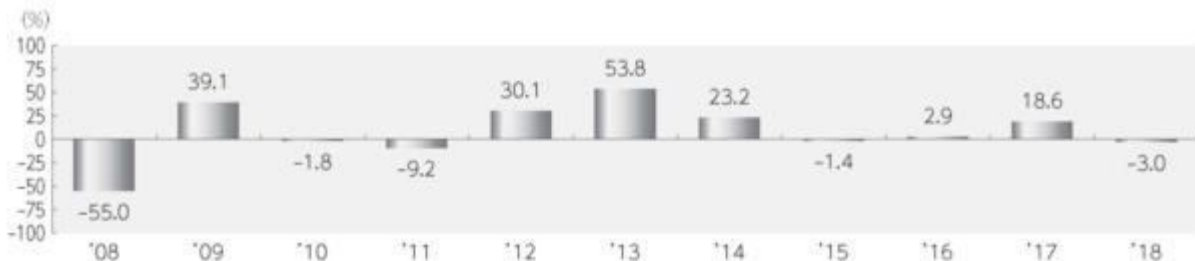
通貨別構成	比率	紹介上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	66.2%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.5%
ユーロ	12.6%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.9%
イギリスポンド	7.1%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.7%
カナダドル	3.8%	4 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.2%
スイスフラン	3.0%	5 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	1.0%
オーストラリアドル	2.7%	6 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.9%
香港ドル	1.3%	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	1.0%	8 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	0.8%
その他	2.3%	9 ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	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）	3.1%

・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



・収益率は基準価額で計算

・2018年は年初から5月31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。

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

1円以上1円単位

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。

申込価額の照会方法

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）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

申込手数料

ありません。

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、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

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

れます。

解約単位
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

信託財産留保額
ありません。

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/>

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6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18年5月15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5月13日から翌年5月12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30億口を下回るようになった場合
- ・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。

収益分配金は、「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5月13日から平成30年5月14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 DC海外株式インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 [平成29年 5月12日現在]	第12期 [平成30年 5月14日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	96,854,999	112,327,780
親投資信託受益証券	18,662,087,752	27,242,348,333
未収入金	29,784,400	-
流動資産合計	18,788,727,151	27,354,676,113
資産合計	18,788,727,151	27,354,676,113
負債の部		
流動負債		
未払解約金	105,400,077	80,065,619
未払受託者報酬	4,909,665	7,482,484
未払委託者報酬	13,836,275	21,086,929
未払利息	138	145
流動負債合計	124,146,155	108,635,177
負債合計	124,146,155	108,635,177
純資産の部		
元本等		
元本	10,023,670,493	13,306,680,769
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,640,910,503	13,939,360,167
（分配準備積立金）	3,073,564,652	4,565,814,751
元本等合計	18,664,580,996	27,246,040,936
純資産合計	18,664,580,996	27,246,040,936
負債純資産合計	18,788,727,151	27,354,676,113

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成28年 5月13日 至 平成29年 5月12日	自	平成29年 5月13日 至 平成30年 5月14日
営業収益				
受取利息		676		404
有価証券売買等損益		3,312,176,092		2,196,634,781
営業収益合計		3,312,176,768		2,196,635,185
営業費用				
支払利息		19,032		32,987
受託者報酬		8,684,929		13,700,055
委託者報酬		24,475,591		38,609,108
営業費用合計		33,179,552		52,342,150
営業利益又は営業損失（ ）		3,278,997,216		2,144,293,035
経常利益又は経常損失（ ）		3,278,997,216		2,144,293,035
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,278,997,216		2,144,293,035
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（ ）		240,190,595		166,006,683
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,923,385,049		8,640,910,503
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,568,260,782		5,064,598,057
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,568,260,782		5,064,598,057
剰余金減少額又は欠損金増加額		889,541,949		1,744,434,745
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		889,541,949		1,744,434,745
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,640,910,503		13,939,360,167

(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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月12日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成29年 5月13日から平成30年 5月14日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 [平成29年 5月12日現在]	第12期 [平成30年 5月14日現在]
1. 期首元本額	7,619,083,772円	10,023,670,493円
期中追加設定元本額	4,098,128,352円	5,277,344,743円
期中一部解約元本額	1,693,541,631円	1,994,334,467円
2. 受益権の総数	10,023,670,493口	13,306,680,769口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 平成28年 5月13日 至 平成29年 5月12日			第12期 自 平成29年 5月13日 至 平成30年 5月14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	326,568,601円	費用控除後の配当等収益額	A	480,468,447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	1,157,828,938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	1,497,817,905円
収益調整金額	C	9,627,776,673円	収益調整金額	C	14,282,578,547円
分配準備積立金額	D	1,589,167,113円	分配準備積立金額	D	2,587,528,399円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,701,341,325円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,848,393,298円
当ファンドの期末残存口数	F	10,023,670,493口	当ファンドの期末残存口数	F	13,306,680,769口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,671円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	14,164円
1万口当たり分配金額	H	円	1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	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11期 自 平成28年 5月13日 至 平成29年 5月12日	第12期 自 平成29年 5月13日 至 平成30年 5月14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	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。 また、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。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第11期 [平成29年 5月12日現在]	第12期 [平成30年 5月14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	(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。 (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。 (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。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

区分	第11期	第12期
	[平成29年 5月12日現在]	[平成30年 5月14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11期	第12期
	[平成29年 5月12日現在]	[平成30年 5月14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	3,279,599,395	2,190,828,452
合計	3,279,599,395	2,190,828,452

(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11期	第12期
	[平成29年 5月12日現在]	[平成30年 5月14日現在]
1口当たり純資産額	1.8621円	2.0475円
(1万口当たり純資産額)	(18,621円)	(20,475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	10,170,747,931	27,242,348,333	
合計		10,170,747,931	27,242,348,333	

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 5月14日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	8,929,463,254
コール・ローン	1,066,649,283
株式	318,482,921,497
投資証券	7,476,613,390
派生商品評価勘定	195,237,511
未収入金	17,741,871
未収配当金	607,801,278
差入委託証拠金	3,075,457,947
流動資産合計	339,851,886,031
資産合計	
339,851,886,031	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	224,995
未払金	1,925,037,159

[平成30年 5月14日現在]

未払解約金	700,040,647
未払利息	1,383
流動負債合計	2,625,304,184
負債合計	2,625,304,184
純資産の部	
元本等	
元本	125,901,148,704
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	211,325,433,143
元本等合計	337,226,581,847
純資産合計	337,226,581,847
負債純資産合計	339,851,886,031

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 5月14日現在]
1. 期首	平成29年 5月13日
期首元本額	137,017,202,778円
期中追加設定元本額	97,435,796,357円
期中一部解約元本額	108,551,850,431円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー（海外株式）	256,744,004円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,207,304,682円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,265,449,206円
eMAXIS バランス（波乗り型）	150,327,902円
コアバランス	353,091円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	7,829,583円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	10,971,321円

[平成30年 5月14日現在]

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	10,448,458円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	4,248,950,344円
海外株式セレクション(ラップ向け)	881,658,474円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	540,570,125円
つみたて先進国株式	222,973,451円
つみたて8資産均等バランス	56,482,439円
つみたて4資産均等バランス	11,806,232円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	892,051円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,123,371円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,482,934円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	542,499円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	798,907円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	880,017円
eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本)	174,076,749円
eMAXIS Slim 全世界株式(3地域均等型)	21,988,649円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	10,170,747,931円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,554,290,636円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,438,394,315円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,160,634,009円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	339,439,938円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	141,796,499円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	936,940,523円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	85,785,632円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	20,160,015円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	33,770,168円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	130,130,173円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	97,449,207円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	301,804,367円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	49,707,431円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,486,389,204円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	200,126,066円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	2,001,979,404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)	45,132,671,767円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	118,832,568円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	59,554,989円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,502,934,941円

	[平成30年 5月14日現在]
M S C Iコクサイインデックスファンド（ F O F s用）（適格機関投資家限定）	3,139,833,268円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,486,837,820円
アドバンスト・バランス（ F O F s用）（適格機関投資家限定）	38,467,093円
アドバンスト・バランス（ F O F s用）（適格機関投資家限定）	223,827,292円
M U K A M 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）	1,969,989,814円
M U K A M 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）	519,921,657円
M U K A M 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）	223,443,871円
世界8資産バランスファンドV L（適格機関投資家限定）	29,484,249円
M U K A M 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）	1,349,756,321円
M U K A M 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）	28,176,923円
外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	479,156,387円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,466,934,745円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）V A	2,199,430円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）V A	7,786,060円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）V A	9,797,630円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）V A	10,728,494円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドV A	70,579,527円
三菱UFJ バランスV A 3 0 D（適格機関投資家限定）	18,765,275円
三菱UFJ バランスV A 6 0 D（適格機関投資家限定）	116,697,293円
三菱UFJ バランスV A 3 0 G（適格機関投資家限定）	24,269,943円
三菱UFJ バランスV A 6 0 G（適格機関投資家限定）	176,155,083円
三菱UFJ < D C >外国株式インデックスファンド	4,405,605,447円
三菱UFJ < D C >インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	170,634,950円
三菱UFJ < D C >インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	671,803,453円
三菱UFJ < D C >インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	646,810,861円
三菱UFJ < D C >インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	576,291,546円
合計	125,901,148,704円
2. 受益権の総数	125,901,148,704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 5月13日 至 平成30年 5月14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。
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 5月14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 5月14日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
株式	23,657,283,088	
投資証券	72,628,851	
合計	23,584,654,237	

（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 5月14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	11,378,488,938		11,572,151,199	193,662,261
	合計	11,378,488,938		11,572,151,199	193,662,261

（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 5月14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	437,291,850		437,165,500	126,350
	カナダドル	68,505,040		68,432,000	73,040
	オーストラリアドル	24,770,000		24,793,000	23,000
	スイスフラン	27,331,125		27,360,000	28,875
	香港ドル	9,752,120		9,744,000	8,120
	ノルウェークローネ	9,568,860		9,555,000	13,860

	デンマーククローネ	173,926,000		175,400,000	1,474,000
	ユーロ	58,773,750		58,819,500	45,750
	合計	809,918,745		811,269,000	1,350,255

（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 5月14日現在]
1口当たり純資産額	2.6785円
(1万口当たり純資産額)	(26,785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	43,750	68.31	2,988,562.50	
	ANDEAVOR	11,865	140.16	1,662,998.40	
	ANTERO RESOURCES CORP	15,404	18.47	284,511.88	
	APACHE CORP	30,385	41.41	1,258,242.85	
	APERGY CORP	5,733	38.05	218,140.65	
	BAKER HUGHES A GE CO	32,540	35.76	1,163,630.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	37,944	22.67	860,190.48	
	CHENIERE ENERGY INC	16,407	62.39	1,023,632.73	

CHEVRON CORP	151,990	129.84	19,734,381.60
CIMAREX ENERGY CO	7,893	98.54	777,776.22
CONCHO RESOURCES INC	11,882	152.70	1,814,381.40
CONOCOPHILLIPS	95,607	69.44	6,638,950.08
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,968	67.63	471,245.84
DEVON ENERGY CORP	39,813	40.95	1,630,342.35
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,199	123.82	891,380.18
EOG RESOURCES INC	46,208	117.41	5,425,281.28
EQT CORP	20,449	50.80	1,038,809.20
EXXON MOBIL CORP	339,050	81.28	27,557,984.00
HALLIBURTON CO	69,864	52.28	3,652,489.92
HELMERICH & PAYNE	8,565	68.85	589,700.25
HESS CORP	22,850	62.72	1,433,152.00
HOLLYFRONTIER CORP	13,507	67.62	913,343.34
KINDER MORGAN INC	160,943	16.51	2,657,168.93
MARATHON OIL CORP	67,901	21.00	1,425,921.00
MARATHON PETROLEUM CORP	39,119	77.33	3,025,072.27
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,403	40.65	1,235,881.95
NEWFIELD EXPLORATION CO	14,404	27.95	402,591.80
NOBLE ENERGY INC	36,904	34.86	1,286,473.44
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,263	84.97	5,205,517.11
ONEOK INC	30,753	65.82	2,024,162.46
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	17,025	31.61	538,160.25
PHILLIPS 66	34,816	117.76	4,099,932.16
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,592	202.17	2,747,894.64
RANGE RESOURCES CORP	22,809	14.29	325,940.61
SCHLUMBERGER LTD	110,805	71.08	7,876,019.40
TARGA RESOURCES CORP	17,637	48.12	848,692.44
TECHNIPFMC PLC	35,476	32.01	1,135,586.76
VALERO ENERGY CORP	35,036	114.63	4,016,176.68
WILLIAMS COS INC	66,249	27.14	1,797,997.86
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,509	166.29	2,911,571.61
ALBEMARLE CORP	8,841	98.54	871,192.14
AVERY DENNISON CORP	7,252	107.67	780,822.84
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16,520	31.56	521,371.20
BALL CORP	26,844	38.55	1,034,836.20
CELANESE CORP-SERIES A	10,864	108.05	1,173,855.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,222	39.50	759,269.00
CHEMOURS CO/THE	14,041	50.76	712,721.16
CROWN HOLDINGS INC	10,510	44.68	469,586.80
DOWDUPONT INC	187,219	66.93	12,530,567.67
EASTMAN CHEMICAL CO	11,520	106.73	1,229,529.60

ECOLAB INC	20,838	147.15	3,066,311.70
FMC CORP	10,760	88.90	956,564.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	110,051	16.27	1,790,529.77
INTERNATIONAL PAPER CO	31,381	53.65	1,683,590.65
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,526	127.62	832,848.12
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,825	112.57	3,019,690.25
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,053	215.45	1,088,668.85
MONSANTO CO	35,256	124.97	4,405,942.32
MOSAIC CO/THE	26,752	26.56	710,533.12
NEWMONT MINING CORP	43,107	40.39	1,741,091.73
NUCOR CORP	25,557	63.12	1,613,157.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,699	116.62	897,857.38
PPG INDUSTRIES INC	20,376	100.43	2,046,361.68
PRAXAIR INC	22,926	157.63	3,613,825.38
SEALED AIR CORP	13,577	44.37	602,411.49
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,742	381.09	2,569,308.78
STEEL DYNAMICS INC	19,198	48.23	925,919.54
VULCAN MATERIALS CO	10,586	127.37	1,348,338.82
WESTROCK CO	20,366	61.03	1,242,936.98
WR GRACE & CO	6,087	71.87	437,472.69
3M CO	47,640	205.16	9,773,822.40
ACUITY BRANDS INC	3,234	114.34	369,775.56
AERCAP HOLDINGS NV	11,344	55.31	627,436.64
AGCO CORP	4,492	64.35	289,060.20
ALLEGION PLC	7,433	77.28	574,422.24
AMETEK INC	18,473	74.81	1,381,965.13
ARCONIC INC	36,975	18.22	673,684.50
BOEING CO/THE	45,274	342.46	15,504,534.04
CATERPILLAR INC	47,591	154.86	7,369,942.26
CUMMINS INC	12,583	146.25	1,840,263.75
DEERE & CO	21,844	147.32	3,218,058.08
DOVER CORP	11,466	77.13	884,372.58
EATON CORP PLC	35,183	76.47	2,690,444.01
EMERSON ELECTRIC CO	51,308	72.00	3,694,176.00
FASTENAL CO	22,967	51.78	1,189,231.26
FLOWSERVE CORP	9,747	43.53	424,286.91
FLUOR CORP	11,229	46.55	522,709.95
FORTIVE CORP	25,016	75.62	1,891,709.92
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	12,220	56.12	685,786.40
GENERAL DYNAMICS CORP	20,290	203.92	4,137,536.80
GENERAL ELECTRIC CO	693,692	14.60	10,127,903.20
HARRIS CORP	9,536	156.65	1,493,814.40

HD SUPPLY HOLDINGS INC	13,366	39.88	533,036.08
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	57,873	147.36	8,528,165.28
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,743	220.17	824,096.31
IDEX CORP	6,262	138.79	869,102.98
ILLINOIS TOOL WORKS	24,655	145.79	3,594,452.45
INGERSOLL-RAND PLC	19,953	88.82	1,772,225.46
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,853	63.55	689,708.15
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	60.90	1,077,930.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	17,400	36.92	642,408.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	73,934	36.30	2,683,804.20
L3 TECHNOLOGIES INC	6,248	196.10	1,225,232.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,049	204.57	623,733.93
LOCKHEED MARTIN CORP	20,644	324.04	6,689,481.76
MASCO CORP	25,156	38.07	957,688.92
MIDDLEBY CORP	4,487	107.32	481,544.84
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,234	325.30	4,305,020.20
OWENS CORNING	8,513	66.92	569,689.96
PACCAR INC	28,068	63.79	1,790,457.72
PARKER HANNIFIN CORP	10,640	175.12	1,863,276.80
PENTAIR PLC	14,688	44.67	656,112.96
RAYTHEON COMPANY	23,124	213.83	4,944,604.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,266	177.91	1,826,424.06
ROCKWELL COLLINS INC	13,031	134.30	1,750,063.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,185	279.43	2,287,134.55
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,096	52.07	733,978.72
SMITH (A.O.) CORP	11,994	63.99	767,496.06
SNAP-ON INC	4,716	148.98	702,589.68
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9,301	84.27	783,795.27
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,243	143.70	1,759,319.10
TEXTRON INC	21,056	65.79	1,385,274.24
TRANSDIGM GROUP INC	4,162	333.84	1,389,442.08
UNITED RENTALS INC	6,762	166.89	1,128,510.18
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,662	124.48	7,551,205.76
WABCO HOLDINGS INC	3,947	130.44	514,846.68
WABTEC CORP	6,665	93.06	620,244.90
WW GRAINGER INC	4,330	296.05	1,281,896.50
XYLEM INC	14,371	73.53	1,056,699.63
CINTAS CORP	7,233	183.91	1,330,221.03
COSTAR GROUP INC	2,906	392.13	1,139,529.78
EQUIFAX INC	9,623	114.72	1,103,950.56
IHS MARKIT LTD	31,872	52.24	1,664,993.28
MANPOWERGROUP INC	5,265	96.00	505,440.00

NIELSEN HOLDINGS PLC	29,113	30.17	878,339.21
REPUBLIC SERVICES INC	18,716	67.91	1,271,003.56
ROBERT HALF INTL INC	9,844	63.15	621,648.60
ROLLINS INC	7,105	50.55	359,157.75
STERICYCLE INC	6,137	64.25	394,302.25
TRANSUNION	14,675	69.50	1,019,912.50
VERISK ANALYTICS INC	12,537	105.88	1,327,417.56
WASTE CONNECTIONS INC	21,122	75.70	1,598,935.40
WASTE MANAGEMENT INC	34,745	82.97	2,882,792.65
AMERCO	625	342.77	214,231.25
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,768	42.60	416,116.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,834	86.44	936,490.96
CSX CORP	67,956	63.09	4,287,344.04
DELTA AIR LINES INC	15,037	52.90	795,457.30
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,468	72.35	1,046,759.80
FEDEX CORP	20,387	250.90	5,115,098.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,213	124.66	899,172.58
KANSAS CITY SOUTHERN	8,465	110.00	931,150.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,101	40.17	405,757.17
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7,121	37.80	269,173.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,907	152.40	3,491,026.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,169	147.09	760,308.21
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,709	52.46	666,714.14
UNION PACIFIC CORP	63,002	142.36	8,968,964.72
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	5,879	66.92	393,422.68
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,997	115.45	6,349,403.65
APTIV PLC	21,278	96.22	2,047,369.16
AUTOLIV INC	7,065	142.33	1,005,561.45
BORGWARNER INC	17,350	50.61	878,083.50
FORD MOTOR CO	296,430	11.19	3,317,051.70
GENERAL MOTORS CO	102,206	36.89	3,770,379.34
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	19,283	25.54	492,487.82
HARLEY-DAVIDSON INC	13,887	40.77	566,172.99
LEAR CORP	5,246	194.98	1,022,865.08
TESLA INC	10,759	301.06	3,239,104.54
DR HORTON INC	28,533	43.87	1,251,742.71
GARMIN LTD	9,413	59.29	558,096.77
HANESBRANDS INC	27,455	16.73	459,322.15
HASBRO INC	9,113	87.25	795,109.25
LEGGETT & PLATT INC	9,928	41.87	415,685.36
LENNAR CORP-A	22,853	54.29	1,240,689.37
LULULEMON ATHLETICA INC	8,200	98.54	808,028.00

MATTEL INC	24,833	14.88	369,515.04
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,551	63.08	791,717.08
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	213.58	1,081,141.96
NEWELL BRANDS INC	39,208	27.06	1,060,968.48
NIKE INC -CL B	105,040	68.43	7,187,887.20
NVR INC	289	3,053.61	882,493.29
POLARIS INDUSTRIES INC	4,604	107.22	493,640.88
PULTEGROUP INC	19,835	31.32	621,232.20
PVH CORP	6,270	153.19	960,501.30
RALPH LAUREN CORP	4,173	109.01	454,898.73
TAPESTRY INC	22,831	46.04	1,051,139.24
TOLL BROTHERS INC	11,839	42.66	505,051.74
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,946	18.76	205,346.96
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,041	16.90	287,992.90
VF CORP	26,926	77.94	2,098,612.44
WHIRLPOOL CORP	5,846	155.97	911,800.62
ARAMARK	20,269	38.00	770,222.00
CARNIVAL CORP	27,739	64.02	1,775,850.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,030	424.90	862,547.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,021	90.33	905,196.93
DOMINO'S PIZZA INC	3,541	249.91	884,931.31
H&R BLOCK INC	15,185	27.85	422,902.25
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	22,808	83.51	1,904,696.08
LAS VEGAS SANDS CORP	31,578	78.14	2,467,504.92
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	24,769	139.82	3,463,201.58
MCDONALD'S CORP	63,765	165.39	10,546,093.35
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	19,000	31.42	596,980.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,182	31.80	1,150,587.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,441	51.46	897,513.86
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,657	107.06	1,462,118.42
STARBUCKS CORP	113,724	57.27	6,512,973.48
VAIL RESORTS INC	3,253	238.03	774,311.59
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,792	111.71	870,444.32
WYNN RESORTS LTD	7,782	195.65	1,522,548.30
YUM! BRANDS INC	25,594	84.62	2,165,764.28
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	27,463	52.52	1,442,356.76
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14,904	272.81	4,065,960.24
COMCAST CORP-CLASS A	372,913	31.90	11,895,924.70
DISCOVERY INC - A	11,297	24.03	271,466.91
DISCOVERY INC-C	26,257	22.84	599,709.88
DISH NETWORK CORP-A	17,814	31.38	559,003.32
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	31,690	24.26	768,799.40

LIBERTY BROADBAND-C	8,777	71.63	628,696.51
LIBERTY GLOBAL PLC- C	45,691	28.92	1,321,383.72
LIBERTY GLOBAL PLC-A	14,956	29.61	442,847.16
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	6,982	43.94	306,789.08
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	15,093	43.96	663,488.28
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	16,859	30.68	517,234.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,571	42.52	491,998.92
NEWS CORP - CLASS A	28,895	15.18	438,626.10
OMNICOM GROUP	18,327	75.08	1,375,991.16
SIRIUS XM HOLDINGS INC	131,974	6.79	896,103.46
TIME WARNER INC	62,163	93.81	5,831,511.03
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	35,058	37.48	1,313,973.84
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	84,270	37.94	3,197,203.80
VIACOM INC-CLASS B	28,860	30.22	872,149.20
WALT DISNEY CO/THE	120,709	102.07	12,320,767.63
ADVANCE AUTO PARTS INC	6,056	119.94	726,356.64
AMAZON.COM INC	32,776	1,602.91	52,536,978.16
AUTONATION INC	4,074	46.02	187,485.48
AUTOZONE INC	2,199	660.86	1,453,231.14
BEST BUY CO INC	21,539	77.78	1,675,303.42
BOOKING HOLDINGS INC	3,902	2,071.99	8,084,904.98
CARMAX INC	14,817	63.80	945,324.60
DOLLAR GENERAL CORP	21,857	93.62	2,046,252.34
DOLLAR TREE INC	18,962	93.89	1,780,342.18
EXPEDIA GROUP INC	10,062	113.91	1,146,162.42
GAP INC/THE	18,563	29.19	541,853.97
GENUINE PARTS CO	11,720	91.38	1,070,973.60
HOME DEPOT INC	93,441	190.31	17,782,756.71
KOHL'S CORP	13,815	60.23	832,077.45
L BRANDS INC	20,170	32.33	652,096.10
LKQ CORP	25,697	30.28	778,105.16
LOWE'S COS INC	66,482	87.45	5,813,850.90
MACY'S INC	23,845	29.64	706,765.80
NETFLIX INC	34,626	326.46	11,304,003.96
NORDSTROM INC	9,412	48.80	459,305.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,803	269.62	1,834,224.86
QURATE RETAIL INC QVC GROUP	35,456	22.02	780,741.12
ROSS STORES INC	30,843	81.94	2,527,275.42
TARGET CORP	41,307	70.25	2,901,816.75
TIFFANY & CO	10,028	103.75	1,040,405.00
TJX COMPANIES INC	50,578	84.07	4,252,092.46
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,033	69.62	698,497.46

TRIPADVISOR INC	8,261	48.99	404,706.39
ULTA BEAUTY INC	4,632	250.00	1,158,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,958	195.76	6,843,378.08
KROGER CO	70,459	24.57	1,731,177.63
SYSCO CORP	39,612	62.82	2,488,425.84
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,289	64.09	4,312,552.01
WALMART INC	119,489	83.38	9,962,992.82
ALTRIA GROUP INC	152,610	55.19	8,422,545.90
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,693	43.98	1,965,598.14
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	20,451	56.86	1,162,843.86
BUNGE LTD	11,634	71.17	827,991.78
CAMPBELL SOUP CO	14,324	40.68	582,700.32
COCA-COLA CO/THE	323,777	42.14	13,643,962.78
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16,562	38.71	641,115.02
CONAGRA BRANDS INC	32,637	37.85	1,235,310.45
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,780	220.23	3,034,769.40
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,452	119.36	1,724,990.72
GENERAL MILLS INC	45,400	42.66	1,936,764.00
HERSHEY CO/THE	11,459	92.46	1,059,499.14
HORMEL FOODS CORP	23,767	36.26	861,791.42
INGREDION INC	5,986	111.76	668,995.36
JM SMUCKER CO/THE	9,124	113.02	1,031,194.48
KELLOGG CO	20,716	61.39	1,271,755.24
KRAFT HEINZ CO/THE	48,639	59.24	2,881,374.36
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,587	107.02	1,026,000.74
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,384	60.72	934,116.48
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	119,477	39.23	4,687,082.71
MONSTER BEVERAGE CORP	31,556	49.27	1,554,764.12
PEPSICO INC	113,762	97.43	11,083,831.66
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,263	81.20	10,090,155.60
TYSON FOODS INC-CL A	23,768	68.25	1,622,166.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	20,149	47.46	956,271.54
CLOROX COMPANY	10,289	120.54	1,240,236.06
COLGATE-PALMOLIVE CO	66,684	62.71	4,181,753.64
COTY INC-CL A	40,711	14.30	582,167.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,964	140.19	2,518,373.16
KIMBERLY-CLARK CORP	28,105	104.90	2,948,214.50
PROCTER & GAMBLE CO/THE	202,835	73.37	14,882,003.95
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,613	74.49	120,152.37
ABBOTT LABORATORIES	139,195	61.26	8,527,085.70
AETNA INC	26,071	174.67	4,553,821.57
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,090	286.49	1,744,724.10

AMERISOURCEBERGEN CORP	13,068	86.88	1,135,347.84
ANTHEM INC	20,530	232.05	4,763,986.50
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,170	70.52	2,762,268.40
BECTON DICKINSON AND CO	21,177	225.24	4,769,907.48
BOSTON SCIENTIFIC CORP	109,740	29.97	3,288,907.80
CARDINAL HEALTH INC	25,111	55.30	1,388,638.30
CENTENE CORP	16,208	114.44	1,854,843.52
CERNER CORP	23,881	60.83	1,452,681.23
CIGNA CORP	19,706	173.73	3,423,523.38
COOPER COS INC/THE	3,983	234.32	933,296.56
CVS HEALTH CORP	81,003	64.41	5,217,403.23
DANAHER CORP	50,036	101.81	5,094,165.16
DAVITA INC	11,339	66.01	748,487.39
DENTSPLY SIRONA INC	18,811	46.93	882,800.23
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,919	138.11	2,336,683.09
ENVISION HEALTHCARE CORP	10,108	42.32	427,770.56
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	45,251	72.80	3,294,272.80
HCA HEALTHCARE INC	22,656	101.78	2,305,927.68
HENRY SCHEIN INC	12,690	72.94	925,608.60
HOLOGIC INC	22,660	38.26	866,971.60
HUMANA INC	11,422	284.72	3,252,071.84
IDEXX LABORATORIES INC	6,979	211.38	1,475,221.02
INTUITIVE SURGICAL INC	8,961	468.35	4,196,884.35
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,125	175.94	1,429,512.50
MCKESSON CORP	16,659	149.21	2,485,689.39
MEDTRONIC PLC	108,232	85.56	9,260,329.92
QUEST DIAGNOSTICS INC	10,912	102.50	1,118,480.00
RESMED INC	11,351	101.99	1,157,688.49
STRYKER CORP	26,927	169.48	4,563,587.96
TELEFLEX INC	3,655	265.68	971,060.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,522	238.28	18,471,942.16
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,182	118.36	850,061.52
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,522	118.50	891,357.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,724	77.71	677,942.04
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,173	116.44	1,883,184.12
ABBVIE INC	127,715	104.18	13,305,348.70
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,753	69.45	1,788,545.85
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,855	119.66	2,136,529.30
ALKERMES PLC	12,397	46.71	579,063.87
ALLERGAN PLC	26,594	153.67	4,086,699.98
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,078	100.91	714,240.98
AMGEN INC	53,878	173.89	9,368,845.42

BIOGEN INC	16,905	282.39	4,773,802.95
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,023	88.41	1,239,773.43
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,940	51.86	6,790,548.40
CELGENE CORP	62,944	84.54	5,321,285.76
ELI LILLY & CO	79,270	82.45	6,535,811.50
GILEAD SCIENCES INC	104,440	66.16	6,909,750.40
ILLUMINA INC	11,684	266.99	3,119,511.16
INCYTE CORP	14,631	66.45	972,229.95
IQVIA HOLDINGS INC	10,860	103.02	1,118,797.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,881	164.42	802,534.02
JOHNSON & JOHNSON	214,947	127.24	27,349,856.28
MERCK & CO. INC.	217,956	59.69	13,009,793.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,048	563.72	1,154,498.56
MYLAN NV	36,457	38.41	1,400,313.37
PERRIGO CO PLC	10,497	77.52	813,727.44
PFIZER INC	476,812	35.50	16,926,826.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,318	306.94	1,939,246.92
SEATTLE GENETICS INC	9,185	56.92	522,810.20
TESARO INC	3,392	49.94	169,396.48
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,067	19.31	1,410,923.77
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,084	216.55	6,947,790.20
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,243	102.90	333,704.70
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,218	155.97	3,153,401.46
WATERS CORP	6,367	196.52	1,251,242.84
ZOETIS INC	39,019	84.45	3,295,154.55
BANK OF AMERICA CORP	792,708	30.92	24,510,531.36
BB&T CORP	63,062	55.06	3,472,193.72
CIT GROUP INC	11,317	53.66	607,270.22
CITIGROUP INC	211,467	72.86	15,407,485.62
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,272	42.40	1,665,132.80
COMERICA INC	13,887	97.90	1,359,537.30
EAST WEST BANCORP INC	11,619	69.61	808,798.59
FIFTH THIRD BANCORP	56,390	33.98	1,916,132.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,617	97.42	1,229,148.14
HUNTINGTON BANCSHARES INC	86,304	15.13	1,305,779.52
JPMORGAN CHASE & CO	277,590	113.86	31,606,397.40
KEYCORP	85,937	20.26	1,741,083.62
M & T BANK CORP	10,821	185.64	2,008,810.44
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	37,394	11.68	436,761.92
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26,187	18.64	488,125.68
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,042	150.97	5,743,200.74
REGIONS FINANCIAL CORP	92,651	19.32	1,790,017.32

SIGNATURE BANK	4,354	130.62	568,719.48
SUNTRUST BANKS INC	38,019	69.24	2,632,435.56
SVB FINANCIAL GROUP	4,218	321.02	1,354,062.36
US BANCORP	132,656	51.50	6,831,784.00
WELLS FARGO & CO	374,238	54.45	20,377,259.10
ZIONS BANCORPORATION	16,233	57.81	938,429.73
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,627	164.76	762,344.52
ALLY FINANCIAL INC	35,595	26.64	948,250.80
AMERICAN EXPRESS CO	59,012	101.42	5,984,997.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,805	137.07	1,618,111.35
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	81,841	57.18	4,679,668.38
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,583	199.30	20,245,491.90
BLACKROCK INC	9,609	540.43	5,192,991.87
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,732	92.63	3,587,745.16
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,390	106.82	896,219.80
CME GROUP INC	27,204	159.29	4,333,325.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,041	75.37	2,188,820.17
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,407	64.39	1,378,396.73
EATON VANCE CORP	8,653	57.10	494,086.30
FRANKLIN RESOURCES INC	27,157	33.26	903,241.82
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,660	242.92	6,962,087.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	46,741	71.42	3,338,242.22
INVESCO LTD	33,132	28.20	934,322.40
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,317	24.56	621,785.52
MOODY'S CORP	13,764	174.05	2,395,624.20
MORGAN STANLEY	108,439	55.20	5,985,832.80
MSCI INC	7,225	160.97	1,163,008.25
NASDAQ INC	9,460	90.54	856,508.40
NORTHERN TRUST CORP	17,248	108.92	1,878,652.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,580	93.76	991,980.80
S&P GLOBAL INC	20,404	199.99	4,080,595.96
SCHWAB (CHARLES) CORP	96,483	59.46	5,736,879.18
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,251	64.38	724,339.38
STATE STREET CORP	29,624	102.01	3,021,944.24
SYNCHRONY FINANCIAL	62,538	34.11	2,133,171.18
T ROWE PRICE GROUP INC	19,350	118.22	2,287,557.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,636	61.57	1,393,698.52
VOYA FINANCIAL INC	14,866	52.76	784,330.16
AFLAC INC	62,899	45.23	2,844,921.77
ALLEGHANY CORP	1,254	585.79	734,580.66
ALLSTATE CORP	28,707	96.38	2,766,780.66
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,873	111.95	657,482.35

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,841	52.85	3,796,796.85
AON PLC	20,019	144.09	2,884,537.71
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,520	79.65	837,918.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,643	68.74	1,006,559.82
ASSURANT INC	3,979	87.57	348,441.03
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	11,930	46.51	554,864.30
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,048	57.50	347,760.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,139	48.11	295,347.29
CHUBB LTD	37,135	136.17	5,056,672.95
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,800	71.88	920,064.00
EVEREST RE GROUP LTD	3,407	228.29	777,784.03
FNF GROUP	21,428	38.27	820,049.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,526	52.56	1,499,326.56
LINCOLN NATIONAL CORP	17,467	68.01	1,187,930.67
LOEWS CORP	22,943	51.69	1,185,923.67
MARKEL CORP	1,118	1,158.00	1,294,644.00
MARSH & MCLENNAN COS	40,880	81.57	3,334,581.60
METLIFE INC	71,464	46.77	3,342,371.28
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,051	59.03	1,360,700.53
PROGRESSIVE CORP	46,589	62.43	2,908,551.27
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,866	99.88	3,382,536.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,302	151.65	804,048.30
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,020	128.00	386,560.00
TORCHMARK CORP	9,098	85.52	778,060.96
TRAVELERS COS INC/THE	21,889	131.25	2,872,931.25
UNUM GROUP	18,805	37.95	713,649.75
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,042	155.37	1,560,225.54
WR BERKLEY CORP	7,557	76.91	581,208.87
XL GROUP LTD	20,495	54.93	1,125,790.35
CBRE GROUP INC - A	24,401	47.04	1,147,823.04
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	92,900	7.21	669,809.00
JONES LANG LASALLE INC	3,602	170.77	615,113.54
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,410	160.10	1,506,541.00
ACCENTURE PLC-CL A	49,160	157.08	7,722,052.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,456	71.70	4,119,595.20
ADOBE SYSTEMS INC	39,436	241.88	9,538,779.68
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,095	76.30	999,148.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,118	208.05	856,749.90
ALPHABET INC-CL A	23,868	1,103.38	26,335,473.84
ALPHABET INC-CL C	25,174	1,098.26	27,647,597.24
ANSYS INC	6,790	172.13	1,168,762.70
AUTODESK INC	15,787	136.21	2,150,347.27

AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,469	127.34	4,516,622.46
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	9,437	117.52	1,109,036.24
CA INC	25,586	35.32	903,697.52
CADENCE DESIGN SYS INC	22,744	42.25	960,934.00
CDK GLOBAL INC	9,408	64.47	606,533.76
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,497	100.23	1,052,114.31
CITRIX SYSTEMS INC	11,710	107.47	1,258,473.70
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	47,142	76.58	3,610,134.36
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	16,207	74.32	1,204,504.24
DXC TECHNOLOGY CO	22,803	104.60	2,385,193.80
EBAY INC	79,501	38.26	3,041,708.26
ELECTRONIC ARTS INC	24,630	132.81	3,271,110.30
FACEBOOK INC-A	190,846	186.99	35,686,293.54
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,692	104.89	2,799,723.88
FIRST DATA CORP- CLASS A	38,248	19.41	742,393.68
FISERV INC	33,351	72.79	2,427,619.29
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,162	202.58	1,450,877.96
FORTINET INC	12,004	60.38	724,801.52
GARTNER INC	7,391	135.04	998,080.64
GLOBAL PAYMENTS INC	12,728	116.13	1,478,102.64
IAC/INTERACTIVECORP	5,830	148.26	864,355.80
INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,347	144.14	10,139,816.58
INTUIT INC	19,424	194.20	3,772,140.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,436	123.99	797,999.64
LEIDOS HOLDINGS INC	11,892	63.27	752,406.84
MASTERCARD INC - A	75,142	193.35	14,528,705.70
MERCADOLIBRE INC	3,363	309.01	1,039,200.63
MICROSOFT CORP	586,426	97.70	57,293,820.20
ORACLE CORP	250,363	46.82	11,721,995.66
PAYCHEX INC	25,826	63.34	1,635,818.84
PAYPAL HOLDINGS INC	91,338	79.20	7,233,969.60
RED HAT INC	14,159	172.47	2,442,002.73
SABRE CORP	18,992	23.24	441,374.08
SALESFORCE.COM INC	54,887	130.63	7,169,888.81
SERVICENOW INC	13,817	178.87	2,471,446.79
SPLUNK INC	11,196	116.05	1,299,295.80
SQUARE INC - A	21,521	54.73	1,177,844.33
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	16,174	49.19	795,599.06
SYMANTEC CORP	49,586	19.52	967,918.72
SYNOPSYS INC	12,082	91.02	1,099,703.64
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,176	116.09	1,065,241.84
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,241	88.31	1,169,312.71

TWITTER INC	50,565	32.75	1,656,003.75
VERISIGN INC	6,796	125.65	853,917.40
VISA INC-CLASS A SHARES	145,076	131.82	19,123,918.32
VMWARE INC-CLASS A	5,717	144.04	823,476.68
WESTERN UNION CO	38,052	19.88	756,473.76
WORKDAY INC-CLASS A	10,959	135.74	1,487,574.66
WORLDPAY INC-CLASS A	23,783	80.59	1,916,671.97
ZILLOW GROUP INC - C	7,912	54.91	434,447.92
AMPHENOL CORP-CL A	24,518	87.98	2,157,093.64
APPLE INC	410,862	188.59	77,484,464.58
ARISTA NETWORKS INC	3,857	259.91	1,002,472.87
ARROW ELECTRONICS INC	6,738	76.75	517,141.50
AVNET INC	9,064	40.75	369,358.00
CDW CORP/DE	12,445	78.64	978,674.80
CISCO SYSTEMS INC	395,369	45.93	18,159,298.17
COGNEX CORP	13,209	48.37	638,919.33
COMMSCOPE HOLDING CO INC	16,514	29.90	493,768.60
CORNING INC	69,595	28.00	1,948,660.00
F5 NETWORKS INC	5,138	171.76	882,502.88
FLEX LTD	44,009	14.80	651,333.20
FLIR SYSTEMS INC	10,551	55.26	583,048.26
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	127,675	17.67	2,256,017.25
HP INC	133,744	22.71	3,037,326.24
IPG PHOTONICS CORP	3,125	251.47	785,843.75
JUNIPER NETWORKS INC	30,605	26.52	811,644.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,927	108.37	1,400,898.99
NETAPP INC	21,376	72.27	1,544,843.52
PALO ALTO NETWORKS INC	7,343	202.31	1,485,562.33
SEAGATE TECHNOLOGY	23,181	56.71	1,314,594.51
TE CONNECTIVITY LTD	28,181	94.58	2,665,358.98
TRIMBLE INC	20,682	34.53	714,149.46
WESTERN DIGITAL CORP	23,664	78.80	1,864,723.20
XEROX CORP	16,301	30.17	491,801.17
AT&T INC	491,130	32.29	15,858,587.70
CENTURYLINK INC	76,978	19.60	1,508,768.80
SPRINT CORP	72,295	5.16	373,042.20
T-MOBILE US INC	23,317	56.39	1,314,845.63
VERIZON COMMUNICATIONS INC	330,067	48.62	16,047,857.54
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	14,121	34.07	481,102.47
AES CORP	51,531	12.29	633,315.99
ALLIANT ENERGY CORP	18,407	41.66	766,835.62
AMEREN CORPORATION	19,696	56.87	1,120,111.52

AMERICAN ELECTRIC POWER	39,583	67.16	2,658,394.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,456	83.48	1,206,786.88
ATMOS ENERGY CORP	8,550	88.25	754,537.50
CENTERPOINT ENERGY INC	33,802	26.68	901,837.36
CMS ENERGY CORP	22,967	45.38	1,042,242.46
CONSOLIDATED EDISON INC	25,016	76.83	1,921,979.28
DOMINION ENERGY INC	51,708	64.70	3,345,507.60
DTE ENERGY COMPANY	14,516	102.45	1,487,164.20
DUKE ENERGY CORP	56,197	77.91	4,378,308.27
EDISON INTERNATIONAL	26,198	62.29	1,631,873.42
ENERGY CORP	14,638	78.85	1,154,206.30
EVERSOURCE ENERGY	25,627	58.04	1,487,391.08
EXELON CORP	77,160	40.64	3,135,782.40
FIRSTENERGY CORP	35,969	34.06	1,225,104.14
NEXTERA ENERGY INC	37,744	160.74	6,066,970.56
NISOURCE INC	28,570	24.93	712,250.10
OGE ENERGY CORP	15,486	34.23	530,085.78
P G & E CORP	41,236	43.32	1,786,343.52
PINNACLE WEST CAPITAL	9,432	78.12	736,827.84
PPL CORP	55,421	27.82	1,541,812.22
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	40,745	51.15	2,084,106.75
SCANA CORP	9,837	35.29	347,147.73
SEMPRA ENERGY	19,224	107.08	2,058,505.92
SOUTHERN CO/THE	80,685	44.93	3,625,177.05
UGI CORP	13,681	49.93	683,092.33
VISTRA ENERGY CORP	27,136	22.94	622,499.84
WEC ENERGY GROUP INC	25,504	61.89	1,578,442.56
WESTAR ENERGY INC	11,319	53.79	608,849.01
XCEL ENERGY INC	40,992	45.26	1,855,297.92
ADVANCED MICRO DEVICES	63,043	11.95	753,363.85
ANALOG DEVICES INC	29,502	92.60	2,731,885.20
APPLIED MATERIALS INC	85,322	54.84	4,679,058.48
BROADCOM INC	32,643	243.38	7,944,653.34
INTEL CORP	374,488	54.67	20,473,258.96
KLA-TENCOR CORP	12,544	111.07	1,393,262.08
LAM RESEARCH CORP	12,954	201.55	2,610,878.70
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	32,137	21.02	675,519.74
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,550	57.60	1,298,880.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,717	92.95	1,739,745.15
MICRON TECHNOLOGY INC	92,248	51.82	4,780,291.36
NVIDIA CORP	48,494	254.53	12,343,177.82
NXP SEMICONDUCTORS NV	27,087	99.01	2,681,883.87

	QORVO INC	10,212	81.64	833,707.68	
	QUALCOMM INC	117,952	55.23	6,514,488.96	
	SKYWORCS SOLUTIONS INC	14,696	97.01	1,425,658.96	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	78,866	109.25	8,616,110.50	
	XILINX INC	20,096	69.20	1,390,643.20	
	アメリカドル 小計	24,475,619		1,909,323,982.26 (208,708,204,500)	
カナダドル	ALTAGAS LTD	15,500	25.48	394,940.00	
	ARC RESOURCES LTD	24,400	13.33	325,252.00	
	CAMECO CORP	35,000	14.73	515,550.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	97,300	46.04	4,479,692.00	
	CENOVUS ENERGY INC	81,400	13.99	1,138,786.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	48,300	10.47	505,701.00	
	ENBRIDGE INC	132,400	43.14	5,711,736.00	
	ENCANA CORP	78,800	16.90	1,331,720.00	
	HUSKY ENERGY INC	25,778	18.27	470,964.06	
	IMPERIAL OIL LTD	23,100	41.42	956,802.00	
	INTER PIPELINE LTD	30,000	23.66	709,800.00	
	KEYERA CORP	17,300	35.97	622,281.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	40,432	44.31	1,791,541.92	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	15,188	26.87	408,101.56	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,800	16.25	370,500.00	
	SUNCOR ENERGY INC	132,500	50.92	6,746,900.00	
	TOURMALINE OIL CORP	20,500	23.41	479,905.00	
	TRANSCANADA CORP	69,900	55.96	3,911,604.00	
	VERMILION ENERGY INC	10,100	44.10	445,410.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	18,900	57.14	1,079,946.00	
	BARRICK GOLD CORP	94,400	17.23	1,626,512.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,600	62.83	665,998.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,600	20.83	1,178,978.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,100	93.84	1,416,984.00	
	GOLDCORP INC	70,400	17.65	1,242,560.00	
	KINROSS GOLD CORP	90,100	4.77	429,777.00	
	LUNDIN MINING CORP	48,400	8.55	413,820.00	
	METHANEX CORP	6,500	88.82	577,330.00	
	NUTRIEN LTD	51,559	62.51	3,222,953.09	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	45,700	35.56	1,625,092.00	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	67,000	3.75	251,250.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,900	90.22	442,078.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	35,100	27.97	981,747.00	
	BOMBARDIER INC-B	175,600	4.14	726,984.00	
	CAE INC	19,200	24.38	468,096.00	

FINNING INTERNATIONAL INC	15,000	33.28	499,200.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,400	56.09	751,606.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	59,800	101.58	6,074,484.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,600	238.46	2,766,136.00
LINAMAR CORP	4,400	74.33	327,052.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,500	80.79	2,221,725.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,000	36.75	624,750.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	18,310	72.78	1,332,601.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	32,900	26.18	861,322.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,200	162.47	844,844.00
DOLLARAMA INC	8,600	146.99	1,264,114.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,500	53.60	1,849,200.00
EMPIRE CO LTD 'A'	11,600	24.62	285,592.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,300	24.48	178,704.00
LOBLAW COMPANIES LTD	17,400	65.81	1,145,094.00
METRO INC	17,400	40.92	712,008.00
WESTON (GEORGE) LTD	3,600	104.24	375,264.00
SAPUTO INC	16,000	42.77	684,320.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	24,300	26.64	647,352.00
BANK OF MONTREAL	51,800	100.77	5,219,886.00
BANK OF NOVA SCOTIA	95,900	80.02	7,673,918.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,800	115.10	4,005,480.00
NATIONAL BANK OF CANADA	27,300	63.35	1,729,455.00
ROYAL BANK OF CANADA	116,600	100.38	11,704,308.00
TORONTO-DOMINION BANK	147,800	74.67	11,036,226.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	67,300	51.86	3,490,178.00
CI FINANCIAL CORP	23,900	25.48	608,972.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	35,200	4.64	163,328.00
IGM FINANCIAL INC	7,800	39.00	304,200.00
ONEX CORPORATION	6,300	91.15	574,245.00
THOMSON REUTERS CORP	23,200	48.14	1,116,848.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,200	712.21	1,566,862.00
GREAT-WEST LIFECO INC	23,800	33.39	794,682.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	7,600	52.07	395,732.00
INTACT FINANCIAL CORP	10,600	95.45	1,011,770.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,300	24.82	3,929,006.00
POWER CORP OF CANADA	27,800	29.81	828,718.00
POWER FINANCIAL CORP	19,200	32.17	617,664.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,000	54.44	2,667,560.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	20.71	285,798.00
BLACKBERRY LTD	38,900	14.83	576,887.00
CGI GROUP INC - CLASS A	20,400	77.12	1,573,248.00

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,600	970.83	1,553,328.00	
	OPEN TEXT CORP	21,500	44.52	957,180.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,100	184.53	1,310,163.00	
	BCE INC	11,500	53.78	618,470.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	29,100	61.50	1,789,650.00	
	TELUS CORP	11,600	45.70	530,120.00	
	ATCO LTD -CLASS I	7,600	38.52	292,752.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,300	31.76	390,648.00	
	EMERA INC	5,400	40.23	217,242.00	
	FORTIS INC	34,200	42.21	1,443,582.00	
	HYDRO ONE LTD	22,500	19.73	443,925.00	
	カナダドル 小計	3,250,467		142,534,691.43 (12,193,842,851)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,414	30.45	621,606.30	
	OIL SEARCH LTD	109,837	8.50	933,614.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	141,815	9.85	1,396,877.75	
	SANTOS LTD	146,946	6.20	911,065.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,976	33.52	2,513,195.52	
	ALUMINA LTD	218,403	2.75	600,608.25	
	AMCOR LIMITED	94,730	13.89	1,315,799.70	
	BHP BILLITON LIMITED	257,657	33.16	8,543,906.12	
	BLUESCOPE STEEL LTD	43,294	17.71	766,736.74	
	BORAL LTD	92,091	6.79	625,297.89	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	114,684	4.93	565,392.12	
	INCITEC PIVOT LTD	124,461	3.51	436,858.11	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,366	23.53	855,691.98	
	NEWCREST MINING LTD	62,435	22.22	1,387,305.70	
	ORICA LTD	27,781	18.40	511,170.40	
	RIO TINTO LTD	33,229	83.88	2,787,248.52	
	SOUTH32 LTD	416,876	3.94	1,642,491.44	
	CIMIC GROUP LTD	9,171	44.07	404,165.97	
	BRAMBLES LTD	129,655	9.85	1,277,101.75	
	SEEK LTD	30,062	20.76	624,087.12	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,542	4.40	701,984.80	
	SYDNEY AIRPORT	85,110	7.14	607,685.40	
	TRANSURBAN GROUP	179,383	11.86	2,127,482.38	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,252	28.26	1,250,561.52	
	CROWN RESORTS LTD	26,683	13.39	357,285.37	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	42.72	249,271.20	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,195	60.56	314,609.20	
	TABCORP HOLDINGS LTD	147,277	4.55	670,110.35	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	3.47	181,102.77	

	WESFARMERS LTD	90,875	44.03	4,001,226.25
	WOOLWORTHS GROUP LTD	104,777	28.60	2,996,622.20
	COCA-COLA AMATIL LTD	39,381	9.04	356,004.24
	TREASURY WINE ESTATES LTD	59,641	18.72	1,116,479.52
	COCHLEAR LTD	4,694	195.98	919,930.12
	HEALTHSCOPE LTD	160,669	2.47	396,852.43
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,572	64.37	744,889.64
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,877	23.67	754,528.59
	CSL LTD	36,206	175.76	6,363,566.56
	AUST AND NZ BANKING GROUP	235,553	28.15	6,630,816.95
	BANK OF QUEENSLAND LTD	38,258	10.07	385,258.06
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,844	10.74	470,884.56
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	140,461	70.53	9,906,714.33
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	215,447	28.40	6,118,694.80
	WESTPAC BANKING CORP	272,085	29.59	8,050,995.15
	AMP LTD	244,675	3.73	912,637.75
	ASX LTD	16,061	61.93	994,657.73
	CHALLENGER LTD	43,290	12.53	542,423.70
	MACQUARIE GROUP LTD	26,003	113.40	2,948,740.20
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	191,707	8.22	1,575,831.54
	MEDIBANK PRIVATE LTD	213,510	3.03	646,935.30
	QBE INSURANCE GROUP LTD	112,351	10.21	1,147,103.71
	SUNCORP GROUP LTD	105,352	13.89	1,463,339.28
	LENDLEASE GROUP	42,452	18.14	770,079.28
	COMPUTERSHARE LTD	35,943	17.63	633,675.09
	REA GROUP LTD	4,993	88.71	442,929.03
	TELSTRA CORP LTD	343,336	3.20	1,098,675.20
	TPG TELECOM LTD	34,153	5.78	197,404.34
	AGL ENERGY LTD	53,914	21.96	1,183,951.44
	AUSNET SERVICES	186,905	1.73	324,280.17
	オーストラリアドル 小計	6,030,336		99,276,441.23 (8,206,190,632)
イギリスポンド	BP PLC	1,584,923	5.64	8,946,890.33
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	363,842	26.56	9,663,643.52
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	299,909	27.10	8,129,033.44
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	52,585	6.48	340,961.14
	ANGLO AMERICAN PLC	107,024	18.59	1,990,004.25
	ANTOFAGASTA PLC	28,655	10.45	299,588.02
	BHP BILLITON PLC	169,577	17.11	2,901,801.62
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,768	46.29	498,450.72
	FRESNILLO PLC	15,587	12.97	202,163.39
	GLENCORE PLC	980,519	3.86	3,785,783.85

JOHNSON MATTHEY PLC	15,583	34.65	539,950.95
MONDI PLC	29,973	19.99	599,310.13
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,236	58.90	426,200.40
RIO TINTO PLC	97,179	42.24	4,104,840.96
ASHTED GROUP PLC	40,058	22.31	893,693.98
BAE SYSTEMS PLC	255,396	6.34	1,620,232.22
BUNZL PLC	26,298	22.35	587,760.30
COBHAM PLC	170,593	1.17	200,446.77
DCC PLC	7,122	72.90	519,193.80
FERGUSON PLC	20,062	56.56	1,134,706.72
IMI PLC	19,277	10.79	207,998.83
MEGGITT PLC	56,562	4.87	275,456.94
MELROSE INDUSTRIES PLC	376,910	2.33	878,954.12
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	132,792	8.36	1,110,141.12
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	8,618,406	0.00	8,618.40
SMITHS GROUP PLC	32,841	16.68	547,952.08
TRAVIS PERKINS PLC	17,915	13.06	233,969.90
WEIR GROUP PLC/THE	19,831	22.82	452,543.42
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	7.63	173,924.89
EXPERIAN PLC	74,329	17.36	1,290,351.44
G4S PLC	115,955	2.70	313,542.32
INTERTEK GROUP PLC	13,214	51.06	674,706.84
RELX PLC	85,681	15.92	1,364,041.52
EASYJET PLC	11,810	17.18	202,895.80
ROYAL MAIL PLC	68,682	6.31	433,383.42
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	78,163	5.61	438,650.75
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	9,986	42.00	419,412.00
BURBERRY GROUP PLC	34,696	18.05	626,436.28
PERSIMMON PLC	25,010	27.95	699,029.50
TAYLOR WIMPEY PLC	265,537	1.95	518,593.76
CARNIVAL PLC	14,984	48.28	723,427.52
COMPASS GROUP PLC	126,903	15.08	1,913,697.24
GVC HOLDINGS PLC	41,340	8.75	361,931.70
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,659	47.68	698,941.12
MERLIN ENTERTAINMENT	65,182	3.73	243,650.31
TUI AG-DI	35,880	17.65	633,461.40
WHITBREAD PLC	14,854	42.28	628,027.12
ITV PLC	281,780	1.72	484,661.60
PEARSON PLC	66,244	9.21	610,372.21
SKY PLC	82,524	13.58	1,120,675.92
WPP PLC	100,854	13.11	1,322,195.94
KINGFISHER PLC	181,908	2.97	540,812.48

MARKS & SPENCER GROUP PLC	121,127	2.93	355,265.49
NEXT PLC	12,044	55.42	667,478.48
SAINSBURY (J) PLC	142,153	3.06	435,698.94
TESCO PLC	779,274	2.46	1,921,689.68
WM MORRISON SUPERMARKETS	169,778	2.53	430,557.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,611	27.50	786,802.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	183,556	38.60	7,085,261.60
COCA-COLA HBC AG-DI	13,946	25.20	351,439.20
DIAGEO PLC	199,833	26.80	5,356,523.56
IMPERIAL BRANDS PLC	76,383	27.65	2,112,371.86
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,495	57.56	3,079,172.20
UNILEVER PLC	98,631	41.39	4,082,830.24
CONVATEC GROUP PLC	123,640	2.28	282,641.04
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,942	6.91	234,607.10
SMITH & NEPHEW PLC	70,206	12.98	911,273.88
ASTRAZENECA PLC	101,376	52.79	5,351,639.04
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,900	14.66	5,776,149.60
SHIRE PLC	72,682	40.62	2,952,706.25
BARCLAYS PLC	1,364,784	2.14	2,926,779.28
HSBC HOLDINGS PLC	1,600,739	7.35	11,778,237.56
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,764,879	0.67	3,867,080.83
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	288,007	2.94	847,028.58
STANDARD CHARTERED PLC	263,984	7.68	2,029,772.97
3I GROUP PLC	78,219	9.81	767,641.26
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,612	18.89	370,568.74
INVESTEC PLC	49,143	5.86	288,371.12
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,064	44.31	1,110,585.84
SCHRODERS PLC	9,276	34.46	319,650.96
ST JAMES'S PLACE PLC	42,286	11.86	501,723.39
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,587	3.70	795,688.59
ADMIRAL GROUP PLC	14,838	19.40	287,931.39
AVIVA PLC	322,078	5.42	1,747,595.22
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	106,707	3.70	395,456.14
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	478,982	2.79	1,338,754.69
OLD MUTUAL PLC	396,127	2.59	1,028,741.81
PRUDENTIAL PLC	207,260	19.29	3,998,045.40
RSA INSURANCE GROUP PLC	84,058	6.53	549,403.08
AUTO TRADER GROUP PLC	69,598	3.80	264,541.99
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	33,080	13.00	430,040.00
SAGE GROUP PLC/THE	89,391	6.79	606,964.89
BT GROUP PLC	675,366	2.17	1,465,544.22
VODAFONE GROUP PLC	2,136,856	2.10	4,489,534.45

	CENTRICA PLC	451,590	1.47	664,514.68
	NATIONAL GRID PLC	272,786	8.46	2,308,315.13
	SEVERN TRENT PLC	19,125	19.76	377,910.00
	SSE PLC	82,498	14.06	1,160,334.37
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	52,841	7.66	404,973.42
	イギリス債券 小計	33,278,707		156,832,952.06 (23,253,621,801)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	19,121	24.29	464,449.09
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	734	629.50	462,053.00
	GIVAUDAN-REG	743	2,286.00	1,698,498.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	36,431	52.84	1,925,014.04
	SIKA AG-BR	173	8,130.00	1,406,490.00
	ABB LTD-REG	147,325	24.08	3,547,586.00
	GEBERIT AG-REG	2,970	447.60	1,329,372.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,452	208.20	302,306.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,466	215.00	745,190.00
	ADECCO GROUP AG-REG	13,354	64.40	859,997.60
	SGS SA-REG	413	2,515.00	1,038,695.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,374	153.80	672,721.20
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	41,825	96.58	4,039,458.50
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,561	483.30	1,237,731.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,925	89.85	352,661.25
	DUFREY AG-REG	2,518	149.35	376,063.30
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,821.00	291,360.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	88	6,365.00	560,120.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	75,000.00	600,000.00
	NESTLE SA-REG	248,987	77.60	19,321,391.20
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,044	166.75	674,337.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	881	688.00	606,128.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,964	265.90	1,585,827.60
	NOVARTIS AG-REG	177,953	77.56	13,802,034.68
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	56,207	222.15	12,486,385.05
	VIFOR PHARMA AG	3,847	158.90	611,288.30
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	194,121	17.14	3,328,204.54
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,946	62.82	1,127,367.72
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,611	91.60	239,167.60
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,409	746.50	1,051,818.50
	UBS GROUP AG-REG	292,668	16.43	4,808,535.24
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,919	155.80	610,580.20
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,659	360.30	958,037.70
	SWISS RE AG	25,174	95.14	2,395,054.36
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,110	317.30	3,842,503.00

	SWISS PRIME SITE-REG	5,600	94.30	528,080.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,115	460.40	973,746.00	
	スイスフラン 小計	1,339,856		90,860,253.37 (9,943,746,128)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	216,368	92.35	19,981,584.80	
	NWS HOLDINGS LTD	146,500	14.82	2,171,130.00	
	MTR CORP	118,000	45.45	5,363,100.00	
	MINH GROUP LTD	54,000	38.40	2,073,600.00	
	LI & FUNG LTD	542,000	4.31	2,336,020.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	110,500	47.90	5,292,950.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	48,000	22.50	1,080,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	189,000	69.50	13,135,500.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	88,400	22.90	2,024,360.00	
	SANDS CHINA LTD	194,800	47.35	9,223,780.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	122,000	14.84	1,810,480.00	
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	9.01	1,576,750.00	
	WYNN MACAU LTD	117,600	29.90	3,516,240.00	
	WH GROUP LTD	694,500	7.97	5,535,165.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	90,820	34.25	3,110,585.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	296,500	40.65	12,052,725.00	
	HANG SENG BANK LTD	61,300	201.60	12,358,080.00	
	FIRST PACIFIC CO	200,000	4.03	806,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,300	262.00	24,706,600.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	416,000	3.98	1,655,680.00	
	AIA GROUP LTD	966,600	72.80	70,368,480.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	206,868	68.20	14,108,397.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	85,000	24.55	2,086,750.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	149,000	18.64	2,777,360.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	93,589	50.75	4,749,641.75	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	57,000	44.45	2,533,650.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	60,500	38.70	2,341,350.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	494,000	11.62	5,740,280.00	
	SINO LAND CO	229,400	13.24	3,037,256.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	116,000	127.00	14,732,000.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	36,500	79.15	2,888,975.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	83,400	30.10	2,510,340.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	92,000	25.75	2,369,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	61.90	6,313,800.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	62,000	56.90	3,527,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000	10.48	2,892,480.00	
	PCCW LTD	406,000	4.89	1,985,340.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,500	62.95	3,178,975.00	

	CLP HOLDINGS LTD	133,500	82.35	10,993,725.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	683,168	16.84	11,504,549.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	115,500	59.35	6,854,925.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	24,400	101.70	2,481,480.00	
	香港ドル 小計	8,498,513		309,786,884.27 (4,315,331,297)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	121,800	8.26	1,006,068.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	92,600	3.10	287,060.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	144,500	3.39	489,855.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	208,500	1.19	248,115.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	201,000	2.33	468,330.00	
	SATS LTD	65,000	5.57	362,050.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,940	11.15	489,931.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	443,500	1.28	567,680.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	106,150	2.77	294,035.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,300	33.84	213,192.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.36	233,439.40	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,900	3.16	464,204.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	142,800	29.47	4,208,316.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	249,800	13.14	3,282,372.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	106,100	29.66	3,146,926.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	61,500	7.71	474,165.00	
	CAPITALAND LTD	201,200	3.67	738,404.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,800	12.53	473,634.00	
	UOL GROUP LTD	44,300	8.72	386,296.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	646,860	3.55	2,296,353.00	
STARHUB LTD	58,200	2.18	126,876.00		
	シンガポールドル 小計	3,768,310		20,257,301.90 (1,661,098,755)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,944	6.39	402,212.16	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,349	6.66	575,084.34	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,896	12.99	596,189.04	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,094	11.35	409,666.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	128,848	3.54	456,121.92	
	MERCURY NZ LTD	64,309	3.18	204,502.62	
	MERIDIAN ENERGY LTD	85,115	2.96	251,940.40	
	ニュージーランドドル 小計	509,555		2,895,717.38 (220,798,450)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,452	269.90	4,440,394.80	
	BOLIDEN AB	22,237	322.40	7,169,208.80	
	ALFA LAVAL AB	22,627	227.30	5,143,117.10	
	ASSA ABLOY AB-B	80,230	191.40	15,356,022.00	

	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	49,415	8.00	395,320.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,571	351.00	18,803,421.00	
	ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	28,974	8.00	231,792.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	31,407	319.40	10,031,395.80	
	SANDVIK AB	90,349	157.65	14,243,519.85	
	SKANSKA AB-B SHS	25,051	165.05	4,134,667.55	
	SKF AB-B SHARES	29,760	183.80	5,469,888.00	
	VOLVO AB-B SHS	124,997	156.95	19,618,279.15	
	SECURITAS AB-B SHS	23,000	138.50	3,185,500.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,714	227.40	4,255,563.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,164	85.90	3,278,287.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	75,885	138.84	10,535,873.40	
	ICA GRUPPEN AB	7,273	276.50	2,010,984.50	
	SWEDISH MATCH AB	14,539	410.90	5,974,075.10	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,445	229.00	11,093,905.00	
	GETINGE AB-B SHS	14,321	85.20	1,220,149.20	
	NORDEA BANK AB	243,205	91.28	22,199,752.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	121,764	85.14	10,366,986.96	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	122,507	100.05	12,256,825.35	
	SWEDBANK AB - A SHARES	72,698	195.00	14,176,110.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,069	194.20	2,926,399.80	
	INVESTOR AB-B SHS	36,349	381.20	13,856,238.80	
	KINNEVIK AB - B	18,534	320.90	5,947,560.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,319	606.00	2,011,314.00	
	ERICSSON LM-B SHS	245,725	68.28	16,778,103.00	
	HEXAGON AB-B SHS	20,841	474.60	9,891,138.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,688	565.00	2,648,720.00	
	TELE2 AB-B SHS	25,686	115.10	2,956,458.60	
	TELIA CO AB	227,083	43.54	9,887,193.82	
	スウェーデンクローネ 小計	1,972,879		272,494,166.38 (3,466,125,796)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	93,152	216.70	20,186,038.40	
	NORSK HYDRO ASA	104,705	48.39	5,066,674.95	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,916	334.00	4,647,944.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	217.00	1,750,973.00	
	MARINE HARVEST	33,438	169.30	5,661,053.40	
	ORKLA ASA	66,555	74.04	4,927,732.20	
	DNB ASA	78,514	156.40	12,279,589.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,716	126.50	1,735,074.00	
	TELENOR ASA	60,281	173.35	10,449,711.35	
	ノルウェークローネ 小計	472,346		66,704,790.90 (911,187,443)	

デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,970	578.20	4,608,254.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	18,524	316.90	5,870,255.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,211	440.10	7,574,561.10	
	ISS A/S	12,749	220.90	2,816,254.10	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	288	9,930.00	2,859,840.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	535	10,535.00	5,636,225.00	
	DSV A/S	15,228	514.40	7,833,283.20	
	PANDORA A/S	8,665	692.80	6,003,112.00	
	CARLSBERG AS-B	8,702	713.20	6,206,266.40	
	COLOPLAST-B	9,613	594.60	5,715,889.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	8,279	237.60	1,967,090.40	
	GENMAB A/S	4,727	1,244.00	5,880,388.00	
	H LUNDBECK A/S	6,299	411.30	2,590,778.70	
	NOVO NORDISK A/S-B	149,133	300.20	44,769,726.60	
	DANSKE BANK A/S	59,824	215.20	12,874,124.80	
	TRYG A/S	8,747	146.50	1,281,435.50	
ORSTED A/S	15,366	400.80	6,158,692.80		
デンマーククローネ 小計		351,860		130,646,178.00	(2,291,533,962)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,628	341.00	896,148.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	48,301	16.54	798,898.54	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,224	402.60	895,382.40	
	BANK HAPOALIM BM	84,651	25.92	2,194,153.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	119,218	22.00	2,622,796.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	67.90	851,398.10	
	AZRIELI GROUP LTD	3,746	167.50	627,455.00	
	NICE LTD	4,623	357.70	1,653,647.10	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	4.19	782,040.62	
イスラエルシェケル 小計		464,441		11,321,919.68	(345,997,865)
ユーロ	ENAGAS SA	17,298	24.61	425,703.78	
	ENI SPA	203,833	16.44	3,351,014.52	
	GALP ENERGIA SGPS SA	41,211	17.11	705,326.26	
	NESTE OYJ	10,473	67.36	705,461.28	
	OMV AG	12,060	55.02	663,541.20	
	REPSOL SA	100,163	16.64	1,666,712.32	
	SNAM SPA	186,489	3.87	721,712.43	
	TENARIS SA	38,020	16.32	620,676.50	
	TOTAL SA	192,296	53.33	10,255,145.68	
	VOPAK	4,832	41.35	199,803.20	
	AIR LIQUIDE SA	34,317	108.10	3,709,667.70	
	AKZO NOBEL	20,171	75.08	1,514,438.68	

ARCELORMITTAL	53,345	30.22	1,612,352.62
ARKEMA	5,560	109.30	607,708.00
BASF SE	73,516	86.87	6,386,334.92
COVESTRO AG	15,400	77.98	1,200,892.00
CRH PLC	67,673	30.71	2,078,237.83
EVONIK INDUSTRIES AG	12,299	31.29	384,835.71
FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,365	45.26	288,079.90
HEIDELBERGCEMENT AG	11,930	79.98	954,161.40
IMERYS SA	3,250	73.50	238,875.00
K+S AG-REG	14,173	24.21	343,128.33
KONINKLIJKE DSM NV	14,519	85.48	1,241,084.12
LANXESS AG	7,138	68.90	491,808.20
LINDE AG - TENDER	14,880	193.95	2,885,976.00
SOLVAY SA	5,786	116.10	671,754.60
STORA ENSO OYJ-R SHS	45,052	17.27	778,048.04
SYMRISE AG	10,180	70.90	721,762.00
THYSSENKRUPP AG	35,229	23.21	817,665.09
UMICORE	17,081	47.99	819,717.19
UPM-KYMMENE OYJ	42,624	31.02	1,322,196.48
VOESTALPINE AG	8,922	46.80	417,549.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,564	36.59	715,846.76
AIRBUS SE	46,481	99.45	4,622,535.45
ALSTOM	11,760	38.55	453,348.00
ANDRITZ AG	5,187	43.62	226,256.94
BOSKALIS WESTMINSTER	8,202	23.88	195,863.76
BOUYGUES SA	17,663	43.02	759,862.26
BRENTAG AG	13,002	50.06	650,880.12
CNH INDUSTRIAL NV	82,488	10.50	866,536.44
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	39,904	45.24	1,805,456.48
DASSAULT AVIATION SA	181	1,700.00	307,700.00
EIFFAGE	6,064	100.40	608,825.60
FERROVIAL SA	39,220	17.97	704,783.40
GEA GROUP AG	14,558	32.96	479,831.68
HOCHTIEF AG	1,797	150.00	269,550.00
KION GROUP AG	5,364	72.18	387,173.52
KONE OYJ-B	26,919	41.84	1,126,290.96
LEGRAND SA	21,313	66.46	1,416,461.98
LEONARDO SPA	33,278	9.61	319,801.58
MAN SE	2,503	97.30	243,541.90
METSO OYJ	10,202	30.54	311,569.08
MTU AERO ENGINES AG	3,953	153.50	606,785.50
OSRAM LICHT AG	8,336	50.94	424,635.84

PRYSMIAN SPA	15,800	26.78	423,124.00
REXEL SA	22,104	13.11	289,783.44
SAFRAN SA	26,685	99.42	2,653,022.70
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,325	75.64	3,428,383.00
SIEMENS AG-REG	61,184	115.50	7,066,752.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,635	13.84	299,428.40
THALES SA	8,481	110.65	938,422.65
VINCI SA	40,574	85.54	3,470,699.96
WARTSILA OYJ ABP	36,809	18.00	662,562.00
BUREAU VERITAS SA	20,920	21.75	455,010.00
EDENRED	17,773	28.45	505,641.85
RANDSTAD NV	9,747	53.64	522,829.08
RELX NV	77,270	17.92	1,385,064.75
SOCIETE BIC SA	2,656	84.55	224,564.80
TELEPERFORMANCE	4,425	135.20	598,260.00
WOLTERS KLUWER	23,206	46.45	1,077,918.70
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	55,876	18.25	1,019,737.00
ADP	2,325	184.70	429,427.50
AENA SME SA	5,420	177.50	962,050.00
ATLANTIA SPA	36,487	28.17	1,027,838.79
BOLLORE	63,360	4.41	279,671.04
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,485	25.11	489,268.35
DEUTSCHE POST AG-REG	77,828	34.43	2,679,618.04
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	2,984	82.82	247,134.88
GETLINK SE	36,809	11.83	435,634.51
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	48,325	7.92	382,927.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,696	92.18	2,460,837.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,090	81.15	331,903.50
CONTINENTAL AG	8,806	222.70	1,961,096.20
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	77,030	67.05	5,164,861.50
FAURECIA	6,208	70.92	440,271.36
FERRARI NV	9,857	113.80	1,121,726.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,034	19.01	1,635,850.47
MICHELIN (CGDE)	13,703	119.10	1,632,027.30
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,460	32.14	271,904.40
PEUGEOT SA	47,169	20.08	947,153.52
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12,200	70.16	855,952.00
RENAULT SA	15,354	89.00	1,366,506.00
SCHAEFFLER AG	16,169	13.49	218,119.81
VALEO SA	19,186	57.18	1,097,055.48
VOLKSWAGEN AG	2,744	169.40	464,833.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	14,746	172.30	2,540,735.80

ADIDAS AG	15,083	189.55	2,858,982.65
HERMES INTERNATIONAL	2,551	584.00	1,489,784.00
HUGO BOSS AG -ORD	4,624	74.84	346,060.16
KERING	6,072	493.70	2,997,746.40
LUXOTTICA GROUP SPA	13,938	52.50	731,745.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	22,329	293.60	6,555,794.40
SEB SA	1,630	160.60	261,778.00
ACCOR SA	15,414	46.45	715,980.30
PADDY POWER BETFAIR PLC	6,890	80.40	553,956.00
SODEXO SA	7,574	83.72	634,095.28
ALTICE NV - A	47,955	7.71	370,116.69
AXEL SPRINGER SE	3,325	67.55	224,603.75
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,822	17.94	283,925.79
JCDECAUX SA	6,778	29.32	198,730.96
LAGARDERE SCA	11,024	23.27	256,528.48
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18,565	29.06	539,498.90
PUBLICIS GROUPE	16,592	62.04	1,029,367.68
RTL GROUP	2,552	71.00	181,192.00
SES	31,749	13.29	421,944.21
TELENET GROUP HOLDING NV	3,539	49.86	176,454.54
VIVENDI	82,638	23.24	1,920,507.12
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	87,132	26.75	2,330,781.00
ZALANDO SE	8,519	43.58	371,258.02
CARREFOUR SA	47,464	16.45	780,782.80
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,233	41.04	214,762.32
COLRUYT SA	5,320	47.30	251,636.00
JERONIMO MARTINS	18,324	13.64	249,939.36
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	102,315	19.62	2,008,034.19
METRO AG	11,840	11.70	138,528.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,958	79.80	4,864,448.40
DANONE	48,296	64.73	3,126,200.08
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,690	6.23	266,172.15
HEINEKEN HOLDING NV	9,454	84.40	797,917.60
HEINEKEN NV	20,691	87.44	1,809,221.04
KERRY GROUP PLC-A	12,870	89.00	1,145,430.00
PERNOD RICARD SA	17,006	138.35	2,352,780.10
REMY COINTREAU	2,083	116.60	242,877.80
BEIERSDORF AG	8,254	97.10	801,463.40
HENKEL AG & CO KGAA	8,605	97.40	838,127.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,022	104.30	1,462,494.60
L'OREAL	20,134	200.30	4,032,840.20
UNILEVER NV-CVA	130,202	47.54	6,189,803.08

BIOMERIEUX	2,930	68.70	201,291.00
ESSILOR INTERNATIONAL	16,607	114.75	1,905,653.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	17,226	84.96	1,463,520.96
FRESENIUS SE & CO KGAA	33,263	66.60	2,215,315.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	75,127	35.14	2,640,338.41
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,781	33.60	429,441.60
BAYER AG-REG	66,163	102.10	6,755,242.30
EUROFINS SCIENTIFIC	1,003	445.60	446,936.80
GRIFOLS SA	24,100	25.05	603,705.00
IPSEN	2,810	129.90	365,019.00
MERCK KGAA	10,470	83.32	872,360.40
ORION OYJ-CLASS B	6,918	25.25	174,679.50
QIAGEN N.V.	16,538	29.40	486,217.20
RECORDATI SPA	7,257	30.50	221,338.50
SANOFI	90,923	63.74	5,795,432.02
UCB SA	10,500	63.00	661,500.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	34,089	26.35	898,245.15
AIB GROUP PLC	66,715	5.01	334,242.15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	532,221	6.85	3,647,842.73
BANCO DE SABADELL SA	439,147	1.73	760,822.17
BANCO SANTANDER SA	1,289,689	5.51	7,116,503.90
BANK OF IRELAND GROUP PLC	76,133	7.50	570,997.50
BANKIA SA	91,183	3.74	341,480.33
BANKINTER SA	51,594	9.10	469,711.77
BNP PARIBAS	89,845	62.77	5,639,570.65
CAIXABANK S.A	285,877	4.30	1,229,556.97
COMMERZBANK AG	85,578	10.79	923,728.93
CREDIT AGRICOLE SA	91,074	13.47	1,226,766.78
ERSTE GROUP BANK AG	24,401	38.81	947,002.81
ING GROEP NV	310,476	13.38	4,156,652.68
INTESA SANPAOLO	1,069,207	3.14	3,363,725.22
INTESA SANPAOLO-RSP	84,372	3.29	278,090.11
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROUP NV	20,080	72.02	1,446,161.60
MEDIOBANCA SPA	52,486	9.94	522,130.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11,130	28.50	317,205.00
SOCIETE GENERALE SA	61,317	42.73	2,620,075.41
UNICREDIT SPA	160,277	17.93	2,875,048.82
AMUNDI SA	4,654	71.10	330,899.40
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	165,308	11.64	1,924,846.35
DEUTSCHE BOERSE AG	15,451	116.70	1,803,131.70
EURAZEO SA	3,256	69.75	227,106.00

EXOR NV	8,647	65.16	563,438.52
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,713	93.06	624,711.78
NATIXIS	73,936	6.94	513,115.84
WENDEL	2,038	128.30	261,475.40
AEGON NV	143,554	5.82	835,484.28
AGEAS	15,519	44.60	692,147.40
ALLIANZ SE-REG	35,698	191.54	6,837,594.92
ASSICURAZIONI GENERALI	100,036	16.50	1,650,594.00
AXA SA	155,193	22.49	3,491,066.53
CNP ASSURANCES	12,635	20.88	263,818.80
HANNOVER RUECK SE	4,864	113.60	552,550.40
MAPFRE SA	96,950	2.92	283,287.90
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,410	192.50	2,388,925.00
NN GROUP NV	24,458	39.03	954,595.74
POSTE ITALIANE SPA	37,341	8.15	304,329.15
SAMPO OYJ-A SHS	35,711	44.00	1,571,284.00
SCOR SE	13,243	33.22	439,932.46
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	88,023	2.18	192,066.18
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,486	39.68	1,130,324.48
VONOVIA SE	38,934	39.48	1,537,114.32
AMADEUS IT GROUP SA	35,076	64.24	2,253,282.24
ATOS SE	7,658	110.75	848,123.50
CAPGEMINI SE	12,860	115.85	1,489,831.00
DASSAULT SYSTEMES SA	10,405	111.10	1,155,995.50
SAP SE	78,629	97.42	7,660,037.18
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,972	86.16	514,547.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,983	56.56	564,638.48
WIRECARD AG	9,404	121.95	1,146,817.80
INGENICO GROUP	4,342	74.28	322,523.76
NOKIA OYJ	466,285	5.34	2,492,759.61
1&1 DRILLISCH AG	3,933	62.95	247,582.35
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	266,980	14.27	3,809,804.60
ELISA OYJ	11,017	37.25	410,383.25
ILIAD SA	1,939	168.30	326,333.70
KONINKLIJKE KPN NV	277,545	2.53	703,854.12
ORANGE	159,927	15.19	2,429,291.13
PROXIMUS	10,763	24.23	260,787.49
TELECOM ITALIA SPA	944,380	0.80	759,659.27
TELECOM ITALIA-RSP	441,476	0.70	310,799.10
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	67,973	4.13	281,068.35
TELEFONICA SA	373,277	8.34	3,116,116.39
E.ON SE	176,795	9.33	1,651,088.50

EDF	44,708	12.30	549,908.40	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	187,412	3.11	582,851.32	
ENDESA SA	24,382	19.46	474,473.72	
ENEL SPA	653,099	5.07	3,311,211.93	
ENGIE	146,784	14.64	2,148,917.76	
FORTUM OYJ	36,767	20.07	737,913.69	
GAS NATURAL SDG SA	27,717	21.82	604,784.94	
IBERDROLA SA	465,780	6.51	3,033,159.36	
INNOGY SE	10,899	36.30	395,633.70	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	36,322	17.27	627,280.94	
RWE AG	41,875	20.08	840,850.00	
SUEZ	27,670	11.82	327,197.75	
TERNA SPA	115,585	4.87	563,592.46	
UNIPER SE	16,234	27.18	441,240.12	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,207	20.71	811,976.97	
ASML HOLDING NV	31,069	167.25	5,196,290.25	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	91,026	23.96	2,180,982.96	
STMICROELECTRONICS NV	51,031	20.20	1,030,826.20	
ユーロ 小計	15,830,024		328,706,617.84 (42,965,242,017)	
合計	100,242,913		318,482,921,497 (318,482,921,497)	

(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	31,594	600,286.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,655	980,146.20	
		AMERICAN TOWER CORP	34,312	4,764,564.32	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	93,335	971,617.35	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,028	1,834,838.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,344	1,535,346.72	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	22,238	324,007.66	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,315	639,331.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	47,575	294,013.50	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,502	3,367,532.22	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,438	1,788,290.02	
		DUKE REALTY CORP	29,082	835,235.04	
		EQUINIX INC	6,257	2,514,625.73	

		EQUITY RESIDENTIAL	29,383	1,837,906.65	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,282	1,280,515.26	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,192	970,788.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,953	705,906.74	
		GGP INC	46,537	960,523.68	
		HCP INC	37,512	903,288.96	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,094	1,225,018.62	
		INVITATION HOMES INC	25,988	615,395.84	
		IRON MOUNTAIN INC	22,236	745,573.08	
		KIMCO REALTY CORP	33,117	477,878.31	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,038	479,711.48	
		MACERICH CO/THE	9,484	540,018.96	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,988	826,716.24	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,159	450,042.47	
		PROLOGIS INC	42,530	2,778,484.90	
		PUBLIC STORAGE	12,519	2,649,020.40	
		REALTY INCOME CORP	22,514	1,193,016.86	
		REGENCY CENTERS CORP	12,092	707,986.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	24,876	3,977,423.64	
		SL GREEN REALTY CORP	8,088	809,447.04	
		UDR INC	20,971	761,037.59	
		VENTAS INC	28,452	1,522,466.52	
		VEREIT INC	83,556	589,905.36	
		VORNADO REALTY TRUST	13,856	969,642.88	
		WELLTOWER INC	29,583	1,664,043.75	
		WEYERHAEUSER CO	60,341	2,209,687.42	
アメリカドル合計			1,027,016	52,301,281.65	(5,717,053,097)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200	254,980.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700	327,704.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700	163,362.00	
カナダドル合計			31,600	746,046.00	(63,824,235)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	80,527	777,890.82	
		GOODMAN GROUP	145,763	1,323,528.04	
		GPT GROUP	137,092	669,008.96	
		MIRVAC GROUP	283,253	642,984.31	
		SCENTRE GROUP	427,988	1,759,030.68	
		STOCKLAND	199,371	841,345.62	
		VICINITY CENTRES	258,227	663,643.39	
		WESTFIELD CORP	158,823	1,442,112.84	
			1,691,044	8,119,544.66	

オーストラリアドル合計				(671,161,561)
イギリス ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	79,407	551,084.58
		HAMMERSON PLC	59,206	332,264.07
		LAND SECURITIES GROUP PLC	60,008	586,698.21
		SEGRO PLC	79,187	518,674.85
イギリスポンド合計			277,808	1,988,721.71 (294,867,767)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	176,000	11,906,400.00
香港ドル合計			176,000	11,906,400.00 (165,856,152)
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	182,200	486,474.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	204,700	362,319.00
		CAPITALAND MALL TRUST	176,500	370,650.00
		SUNTEC REIT	239,200	456,872.00
シンガポールドル合計			802,600	1,676,315.00 (137,457,830)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	3,109	298,464.00
		GECINA SA	3,732	545,245.20
		ICADE	3,138	250,883.10
		KLEPIERRE	17,864	608,626.48
		UNIBAIL-RODAMCO SE	7,976	1,558,909.20
ユーロ合計			35,819	3,262,127.98 (426,392,748)
合計				7,476,613,390 (7,476,613,390)

(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	97.33%	64.03%
	投資証券	39銘柄		1.75%
カナダドル	株式	88銘柄	99.48%	3.74%
	投資証券	3銘柄		0.02%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	92.44%	2.52%
	投資証券	8銘柄		0.21%
イギリスポンド	株式	99銘柄	98.75%	7.13%
	投資証券	4銘柄		0.09%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.00%	3.05%
香港ドル	株式	42銘柄	96.30%	1.32%

	投資証券	1銘柄		3.70%	0.05%
シンガポールドル	株式	21銘柄	92.36%		0.51%
	投資証券	4銘柄		7.64%	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	33銘柄	100.00%		1.06%
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	17銘柄	100.00%		0.70%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.00%		0.11%
ユーロ	株式	240銘柄	99.02%		13.18%
	投資証券	5銘柄		0.98%	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 DC海外株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

平成30年 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	27,675,337,751
負債総額	47,819,064
純資産総額（ - ）	27,627,518,687
発行済口数	13,720,301,004口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.0136
（10,000口当たり）	（20,136）

（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 5月31日現在

（単位：円）

資産総額	332,720,605,322
負債総額	206,382,618
純資産総額（ - ）	332,514,222,704
発行済口数	126,219,261,789口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.6344
（10,000口当たり）	（26,344）

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5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5月31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	860	11,892,092
追加型公社債投資信託	16	1,277,974
単位型株式投資信託	56	299,979
単位型公社債投資信託	1	5,957
合計	933	13,476,002

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。

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33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)		第33期 (平成30年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	69,212,680	2	54,140,307
有価証券		36,210		19,967
前払費用		337,699		362,886
未収入金		35,896		2,109
未収委託者報酬		10,076,022		9,770,529
未収収益	2	659,405	2	674,156
繰延税金資産		446,374		490,903
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		113,754		224,645
流動資産合計		80,948,042		65,715,506

固定資産				
有形固定資産				
建物	1	806,798	1	760,010
器具備品	1	759,446	1	724,852
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,922,245		2,840,863
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,844,549		2,654,296
ソフトウェア仮勘定		608,066		1,097,970
その他		10		
無形固定資産合計		2,468,448		3,768,090
投資その他の資産				
投資有価証券		24,327,081		26,361,327
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		654,402		627,141
前払年金費用		463,105		434,700
繰延税金資産		711,230		747,085
その他		50,235		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,502,592		28,512,021
固定資産合計		31,893,286		35,120,975
資産合計		112,841,328		100,836,481

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	166,493	359,176
未払金		
未払収益分配金	108,024	174,333
未払償還金	547,707	456,159
未払手数料	2 4,225,009	2 3,905,670
その他未払金	2 2,355,815	2 4,330,584
未払費用	2 3,061,479	2 4,388,803
未払消費税等	351,670	99,010
未払法人税等	756,668	736,829
賞与引当金	843,729	906,167
役員賞与引当金	100,680	125,343
その他	711,633	842,194
流動負債合計	13,228,909	16,324,272
固定負債		
退職給付引当金	590,154	720,536

役員退職慰労引当金	166,458	187,562
時効後支払損引当金	253,070	254,851
固定負債合計	1,009,684	1,162,951
負債合計	14,238,594	17,487,223
(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	43,034,713	27,790,911
利益剰余金合計	50,375,303	35,131,500
株主資本合計	97,108,147	81,864,344

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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	1,494,586	1,484,913
評価・換算差額等合計	1,494,586	1,484,913
純資産合計	98,602,734	83,349,257
負債純資産合計	112,841,328	100,836,481

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	81,709,776	75,423,596
投資顧問料	2,396,020	2,723,458
その他営業収益	25,763	48,215
営業収益合計	84,131,560	78,195,269
営業費用		
支払手数料	2 33,975,255	2 30,906,879
広告宣伝費	731,771	730,784

公告費	482	1,000
調査費		
調査費	1,713,892	1,723,057
委託調査費	13,961,993	13,467,029
事務委託費	984,749	864,916
営業雑経費		
通信費	158,915	178,652
印刷費	699,940	467,973
協会費	51,995	50,251
諸会費	9,887	15,328
事務機器関連費	1,611,608	1,635,079
その他営業雑経費	11,925	23,250
営業費用合計	53,912,419	50,064,204
一般管理費		
給料		
役員報酬	331,997	349,359
給料・手当	6,496,165	6,421,837
賞与引当金繰入	843,729	906,167
役員賞与引当金繰入	100,680	125,343
福利厚生費	1,196,210	1,231,033
交際費	14,843	13,012
旅費交通費	233,159	192,192
租税公課	422,030	410,229
不動産賃借料	706,571	678,182
退職給付費用	441,736	423,171
役員退職慰労引当金繰入	48,393	47,889
固定資産減価償却費	1,030,040	1,115,719
諸経費	474,521	450,299
一般管理費合計	12,340,079	12,364,437
営業利益	17,879,061	15,766,627

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	243,048	349,402
有価証券利息	0	
受取利息	2 4,601	2 483
投資有価証券償還益	260,190	81,580
収益分配金等時効完成分	278,148	91,672
その他	4,383	9,989
営業外収益合計	790,372	533,128
営業外費用		
投資有価証券償還損	11,552	30,114
時効後支払損引当金繰入		43,182

事務過誤費		218		10,402
その他		4,357		3,829
営業外費用合計		16,128		87,529
経常利益		18,653,304		16,212,226
特別利益				
投資有価証券売却益		259,137		516,394
ゴルフ会員権売却益				7,495
特別利益合計		259,137		523,889
特別損失				
投資有価証券売却損		42,248		105,903
デリバティブ解約損		126,228		
投資有価証券評価損		157,482		102,096
固定資産除却損	1	13,540	1	54
減損損失	3	48,575		
特別損失合計		388,075		208,054
税引前当期純利益		18,524,367		16,528,061
法人税、住民税及び事業税	2	5,658,953	2	5,252,224
法人税等調整額		103,169		76,092
法人税等合計		5,762,122		5,176,132
当期純利益		12,762,244		11,351,928

(3) 【株主資本等変動計算書】

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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	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	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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	利益 準備金	その他利益剰余金			
						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
当期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
当期純利益							11,351,928	11,351,928	11,351,928
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							15,243,802	15,243,802	15,243,802
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344

	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
当期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
当期純利益			11,351,928
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	9,673	9,673	9,673
当期変動額合計	9,673	9,673	15,253,476
当期末残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257

[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. 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. 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。

4. 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。

(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。

5. 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。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会)

(1)概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606)を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

平成34年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	539,649千円	604,123千円
器具備品	1,029,950千円	1,215,234千円

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
預金	47,798,472千円	41,809,118千円
未収収益	46,963千円	40,621千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	1,993,055千円	1,577,059千円
その他未払金	2,071,256千円	3,850,734千円
未払費用	456,748千円	430,491千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	2,392千円	
器具備品	7,791千円	54千円
ソフトウェア	3,356千円	
計	13,540千円	54千円

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32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
支払手数料	13,862,465千円	11,380,244千円
受取利息	4,375千円	380千円
法人税、住民税及び事業税	4,204,969千円	3,851,536千円

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つのグループニ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プニ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。

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

（株主資本等変動計算書関係）

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30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
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

(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30年6月27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	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,030,029千円	1,351,912千円
合計	2,708,145千円	2,030,029千円

(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。

(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。

(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。

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	-

第33期(平成30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	54,140,307	54,140,307	-
(2) 有価証券	19,967	19,967	-
(3) 未収委託者報酬	9,770,529	9,770,529	-
(4) 投資有価証券	26,224,167	26,224,167	-
資産計	90,154,972	90,154,972	-
(1) 未払手数料	3,905,670	3,905,670	-
負債計	3,905,670	3,905,670	-

(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

これらはすべて投資信託であり、時価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

(単位：千円)

区分	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	137,160	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

第33期(平成30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	54,140,307	-	-	-
未収委託者報酬	9,770,529	-	-	-
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	19,967	13,110,758	8,593,680	68,714
合計	63,930,804	13,110,758	8,593,680	68,714

(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

第33期(平成30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	18,599,111	16,040,884	2,558,227
	小計	18,599,111	16,040,884	2,558,227
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	7,645,023	8,062,990	417,966
	小計	7,645,023	8,062,990	417,966

合計	26,244,135	24,103,874	2,140,260
----	------------	------------	-----------

3.売却したその他有価証券

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30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	8,169,769	516,394	105,903
合計	8,169,769	516,394	105,903

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。

当事業年度において、有価証券について102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）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。

（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す。

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32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）		第33期 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	
		千円		千円
退職給付債務の期首残高	2,997,931		3,649,089	
勤務費用	199,166		184,120	
利息費用	22,711		27,829	
数理計算上の差異の発生額	40,934		56,895	
退職給付の支払額	183,403		188,683	
過去勤務費用の発生額	653,618		-	
退職給付債務の期末残高	3,649,089		3,729,252	

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）		第33期 （自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）	
		千円		千円
年金資産の期首残高	2,678,827		2,698,738	
期待運用収益	47,553		48,080	

数理計算上の差異の発生額	7,066	47,759
事業主からの拠出額	107,823	102,564
退職給付の支払額	142,532	173,748
年金資産の期末残高	2,698,738	2,723,393

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,471,120 千円	3,374,562 千円
年金資産	2,698,738	2,723,393
	772,381	651,168
非積立型制度の退職給付債務	177,969	354,690
未積立退職給付債務	950,350	1,005,858
未認識数理計算上の差異	207,810	169,893
未認識過去勤務費用	615,490	550,128
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	127,049	285,836
退職給付引当金	590,154	720,536
前払年金費用	463,105	434,700
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	127,049	285,836

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	199,166 千円	184,120 千円
利息費用	22,711	27,829
期待運用収益	47,553	48,080
数理計算上の差異の費用処理額	54,327	47,053
過去勤務費用の費用処理額	38,127	65,361
その他	28,533	4,780
確定給付制度に係る退職給付費用	295,314	281,066

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
債券	62.9 %	62.2 %
株式	33.3	34.7
その他	3.7	3.1
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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.061～0.90%	0.069～0.67%
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146,421千円、当事業年度142,105千円であります。

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	455,165千円	445,379千円
投資有価証券評価損	242,551	223,512
ゴルフ会員権評価損	295	-
未払事業税	124,367	135,805
賞与引当金	260,374	277,468
役員賞与引当金	11,509	12,235
役員退職慰労引当金	50,969	57,431
退職給付引当金	180,726	220,628
減価償却超過額	19,277	13,690
委託者報酬	217,902	257,879
長期差入保証金	14,803	23,262
時効後支払損引当金	77,490	78,035
連結納税適用による時価評価	236,450	200,331
その他	68,614	82,168
繰延税金資産 小計	1,960,499	2,027,829
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	1,960,499	2,027,829
繰延税金負債		
前払年金費用	141,802	133,105
連結納税適用による時価評価	1,447	1,382
その他有価証券評価差額金	659,638	655,348
その他	3	4
繰延税金負債 合計	802,893	789,840
繰延税金資産の純額	1,157,605	1,237,989

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32期（平成29年3月31日現在）及び第33期（平成30年3月31日現在）

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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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	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

会社						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

第33期(自平成29年4月1日至平成30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	連結納税に伴う支払	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 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	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	664,152 千円	未払費用	348,142 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	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 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。

投資助言料については、市場実勢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)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30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	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 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32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第33期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
1株当たり純資産額	466,028.30円	393,935.45円
1株当たり当期純利益金額	60,318.47円	53,652.87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32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	第33期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益金額（千円）	12,762,244	11,351,928
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）	12,762,244	11,351,928
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

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。
株式会社南都銀行	37,924 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。
株式会社京葉銀行	49,759 百万円	銀行業務を営んでいます。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000 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5月末現在）

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30年6月27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30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6月20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 DC海外株式インデックスファンドの平成29年5月13日から平成30年5月14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 DC海外株式インデックスファンドの平成30年5月14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。