

【表紙】
【提出書類】 有価証券届出書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 平成25年 8月12日
【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 後藤 俊夫
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【事務連絡者氏名】 井上 靖
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【電話番号】 03-6250-4740
【届出の対象とした募集内国投資信託 新興国株式インデックスオープン
受益証券に係るファンドの名称】
【届出の対象とした募集内国投資信託 継続募集額 上限1兆円
受益証券の金額】
【縦覧に供する場所】 該当ありません

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

新興国株式インデックスオープン（「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です。

当初元本は1口当たり1円です。

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ください。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

（略称：新株イオ）

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <http://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、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

毎営業日とは、土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。以下、同じ。

（５）【申込手数料】

申込価額（発行価格）×3.15%（税抜3%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

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

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

（６）【申込単位】

申込単位は販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については1口単位とします。

(7) 【申込期間】

平成25年8月13日から平成26年8月11日までです。

(注) 上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

(9) 【払込期日】

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

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

振替受益権に係る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経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、MSCI エマージング・マーケット・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、1,000億円です。

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
		債券		
	海外	不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		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	年1回	グローバル	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回 年4回 年6回	日本 北米 欧州	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	(隔月)	アジア オセアニア			その他 (MSCI エ マージング・ マーケット・ 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
一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	年12回 (毎月) 日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング				その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))						
資産複合 ()						

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。

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す。

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な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

新興国の株式等を実質的な主要投資対象とし、新興国の株式の指標であるMSCI エマージング・マーケット・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

1 「新興国株式インデックスマザーファンド」を通じて、新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)への投資を行います。

- 株式等の実質投資比率は原則として高位を維持します。
- 対象インデックスとの連動性を維持するため、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。
- DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

2 MSCI エマージング・マーケット・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。

- MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。

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

運用は主に新興国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、新興国の株式等へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



主な投資制限

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

分配方針

- 年1回の決算時(5月12日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

 MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、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。MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、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いれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。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、契約にもつぎ許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

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。

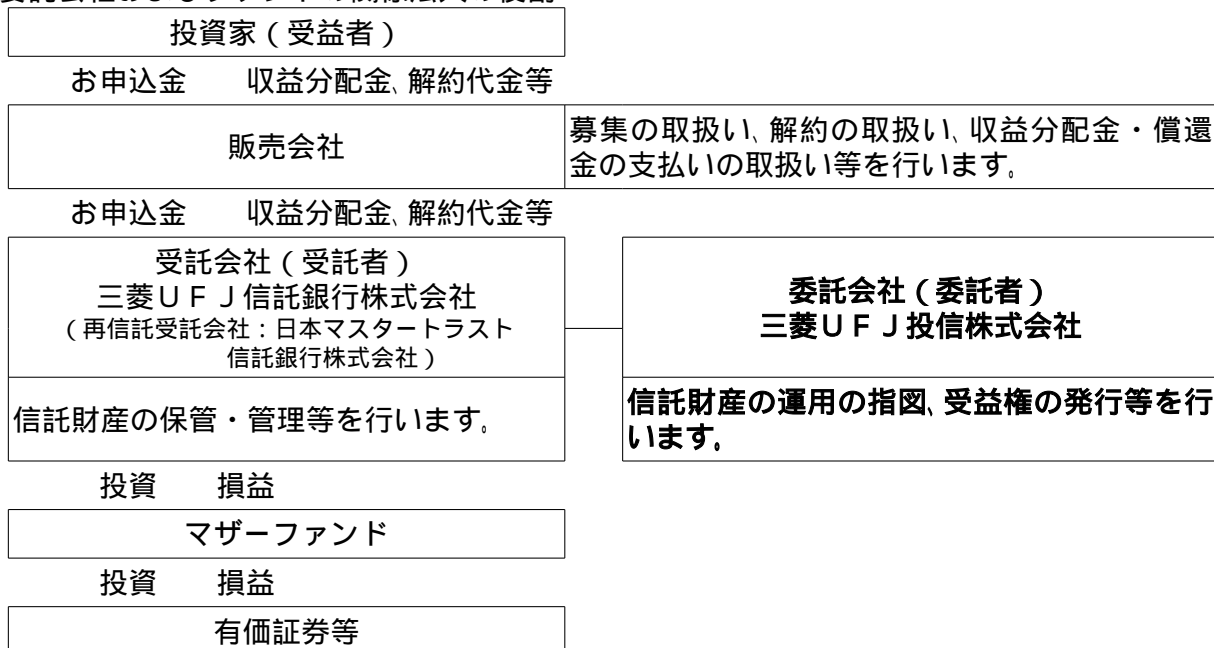
(2) 【ファンドの沿革】

平成22年6月21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 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	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

・資本金

2,000百万円（平成25年5月末現在）

・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

・大株主の状況（平成25年5月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

新興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、新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます。）に直接投資することがあります。

新興国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、新興国の株式等に実質的な投資を行い、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成

果をめざして運用を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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を行いません。

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。

（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

c. 金利先渡取引および為替先渡取引

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新興国株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. にお

いて同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23.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項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

<新興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 エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動した投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

新興国の株式等(DR(預託証書)を含みます。)を主要投資対象とします。

投資態度

新興国の株式等を主要投資対象とし、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

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等の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

(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、取得時において信託財産の純資産総額の20%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。

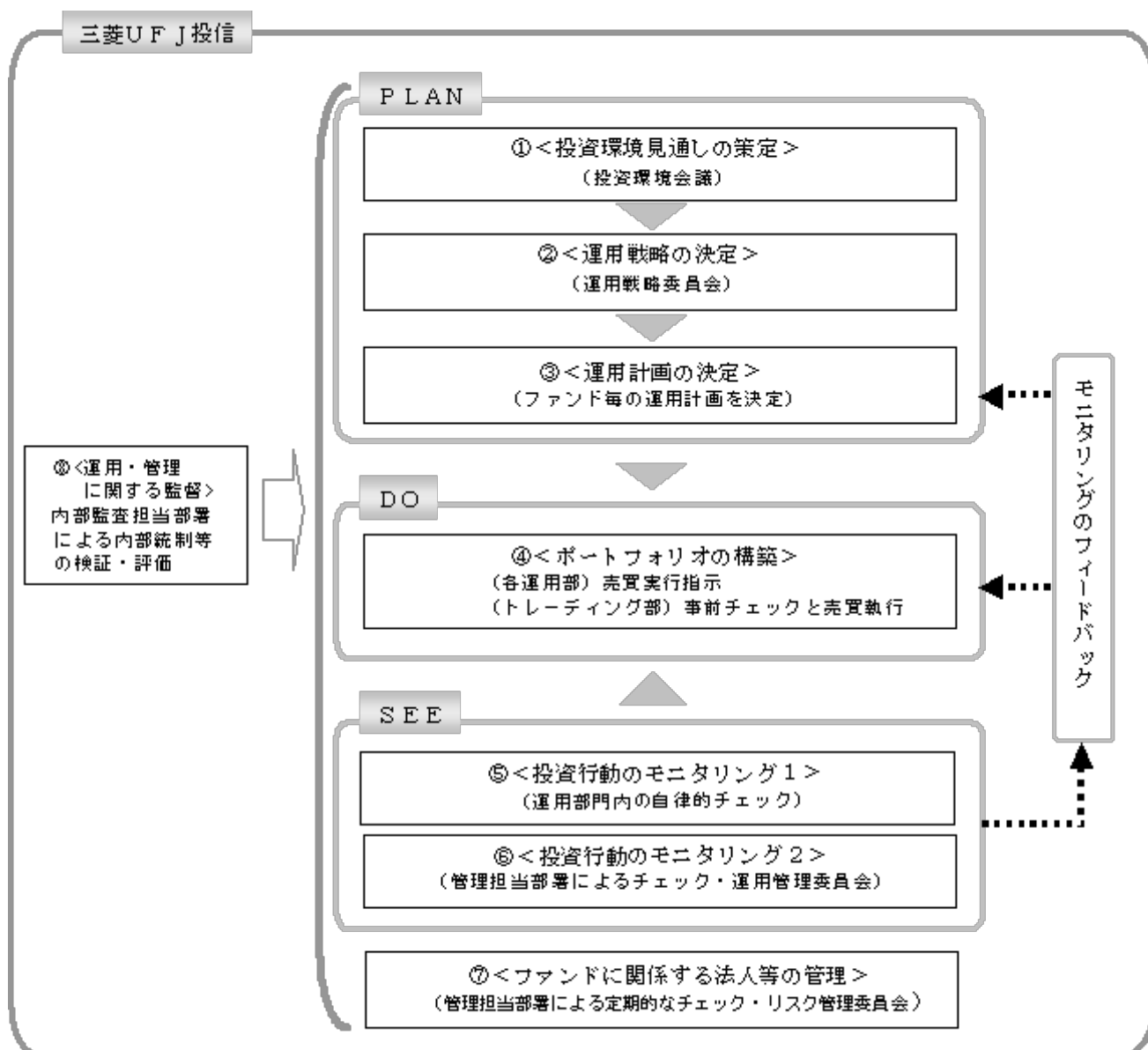
有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

（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、運用部門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

運用部門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(5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。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成25年8月13日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

(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、取得時において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(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。))を除きます。以下a. およびb. において同じ。)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ます。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ます。
- 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ます。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書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券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券の新株予約権(5. に定めるものを除きます。)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ます。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ます。

有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純

資産総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借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

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ます。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。

金利先渡取引および為替先渡取引

- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。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. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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ます。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡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。

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券またはの規定により借り入れた有価証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、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純

資産総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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

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。

<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。

- ・デリバティブ取引の投資制限

委託会社は、運用財産に関し、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あらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを内容とした運用を行うことをしないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当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金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、投資元金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。

当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。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

市場リスク

(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、投資元金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、投資元金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、投資元金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、投資元金を割り込むことがあります。

カントリーリスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、市場・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。この場合、基準価額

の下落により損失を被り、投資元金を割り込む可能性が高まることがあります。

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 エマージング・マーケット・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、新興国特有の制度や規制等によって運用に制約が生じること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

「投資リスク」を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内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

市場リスク

（価格変動リスク・為替変動リスク）

市場リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、市場リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、市場リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

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、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

申込価額（発行価格）×3.15%（税抜3%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）

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

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.3%）が差し引かれます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

（３）【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年1.05%（税抜年1%）

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.483% （税抜年0.46%）	年0.483% （税抜年0.46%）	年0.084% （税抜年0.08%）

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に信託財産から支払われます。

消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、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に信託財産から支払われます。

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、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および借入れに係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

（*）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（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。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。（平成26年1月1日以降）

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、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）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。

10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）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、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）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。

平成26年1月1日以降の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）となる予定です。

平成26年1月1日より、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）

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、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

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。

平成26年1月1日以降の税率は、15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となる予定です。

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25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】

(1)【投資状況】

平成25年5月31日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	279,139,888	99.99
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		19,935	0.01
純資産総額		279,159,823	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25年5月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					日本	新興国株式インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券	

(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25年5月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成25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)
第1計算期間末日 (平成23年5月12日)	111,730,975 (分配付) 111,529,606 (分配落)	11,097 (分配付) 11,077 (分配落)
第2計算期間末日 (平成24年5月14日)	110,444,701 (分配付) 109,250,219 (分配落)	9,246 (分配付) 9,146 (分配落)
第3計算期間末日 (平成25年5月13日)	276,096,587 (分配付) 274,363,816 (分配落)	12,747 (分配付) 12,667 (分配落)
平成24年5月末日	105,260,230	8,440
6月末日	113,300,431	8,533
7月末日	126,800,974	8,818
8月末日	131,965,053	8,839
9月末日	144,530,626	9,246
10月末日	165,096,733	9,437
11月末日	177,286,822	9,823
12月末日	164,378,863	10,830
平成25年1月末日	182,936,205	11,587
2月末日	197,203,866	11,543
3月末日	215,640,433	11,568
4月末日	256,718,785	12,006
5月末日	279,159,823	12,207

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	20円
第2計算期間	100円
第3計算期間	80円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	10.97
第2計算期間	16.52
第3計算期間	39.37

（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（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	151,579,470	50,894,796	100,684,674
第2計算期間	64,524,920	45,761,320	119,448,274
第3計算期間	219,067,139	121,918,989	216,596,424

<参考>

「新興国株式インデックスマザーファンド」

（１）投資状況

平成25年5月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率（％）
株式	香港	4,178,794,852	17.86
	韓国	3,372,892,807	14.41
	ブラジル	2,737,783,068	11.70
	台湾	2,563,190,317	10.95
	アメリカ	1,678,975,443	7.17
	インド	1,522,998,535	6.51
	南アフリカ	1,517,183,446	6.48
	メキシコ	1,152,720,590	4.93
	マレーシア	880,550,190	3.76
	インドネシア	699,791,040	2.99
	タイ	625,759,677	2.67
	トルコ	494,498,544	2.11
	チリ	404,551,708	1.73
	ポーランド	367,771,965	1.57
	コロンビア	247,740,117	1.06
	フィリピン	240,372,360	1.03
チェコ	54,957,690	0.23	
ハンガリー	54,279,264	0.23	
モロッコ	11,009,422	0.05	
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		594,927,832	2.56
純資産総額		23,400,748,867	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25年5月31日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	560,608,026	2.40

（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25年5月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	半導体・ 半導体製造装置	6,540	133,135.20 139,268.80	870,704,208 910,817,952		3.89
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,428,000	387.01 371.80	552,650,280 530,930,400		2.27
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信 サービス	362,500	1,123.18 1,077.58	407,154,925 390,623,112		1.67
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	4,337,550	86.51 82.74	375,281,355 358,891,055		1.53
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	3,876,350	73.48 70.49	284,869,860 273,252,827		1.17
アメリカ	GAZPROM OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	324,000	816.52 761.88	264,553,322 246,850,869		1.05
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	60,500	3,606.70 4,010.63	218,205,592 242,643,357		1.04
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	株式	エネルギー	239,000	956.40 951.60	228,580,317 227,434,551		0.97
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信 サービス	2,240,000	101.08 101.08	226,441,152 226,441,152		0.97
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	4,540,000	49.77 48.47	225,976,684 220,061,064		0.94
アメリカ	SBERBANK-SPONSORED ADR	株式	銀行	171,500	1,340.63 1,275.87	229,918,902 218,813,385		0.94
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	株式	銀行	141,680	1,510.58 1,536.47	214,075,878 217,688,061		0.93
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,074,000	192.32 179.29	206,554,687 192,560,467		0.82
アメリカ	LUKOIL OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	31,400	6,389.51 6,126.44	200,630,833 192,370,498		0.82
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	119,004	1,605.99 1,613.66	191,119,233 192,032,042		0.82
南アフリカ	MTN GROUP LTD	株式	電気通信 サービス	101,000	1,752.85 1,799.51	177,038,355 181,751,217		0.78
ブラジル	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	株式	食品・飲料・ タバコ	43,900	4,099.34 4,024.56	179,961,438 176,678,315		0.76
南アフリカ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	23,600	6,504.40 7,362.90	153,503,840 173,764,440		0.74
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	9,050	17,047.80 18,896.90	154,282,590 171,016,945		0.73
ブラジル	VALE SA-PREF	株式	素材	113,000	1,558.05 1,408.47	176,059,650 159,157,923		0.68
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	株式	エネルギー	171,000	920.44 897.91	157,396,608 153,543,670		0.66
香港	PETROCHINA CO LTD-H	株式	エネルギー	1,255,000	133.68 120.39	167,778,189 151,098,486		0.65
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	86,000	1,582.84 1,676.51	136,124,670 144,180,075		0.62
南アフリカ	SASOL LTD	株式	エネルギー	30,800	4,132.31 4,514.70	127,275,271 139,052,760		0.59
台湾	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	505,336	272.09 260.93	137,496,872 131,860,354		0.56
メキシコ	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	株式	食品・飲料・ タバコ	116,000	1,103.84 1,083.59	128,045,498 125,696,544		0.54
香港	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	株式	エネルギー	1,160,000	113.23 106.06	131,347,612 123,034,472		0.53
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	443,000	289.26 268.41	128,144,838 118,909,174		0.51
韓国	POSCO	株式	素材	3,900	28,818.90 29,269.90	112,393,710 114,152,610		0.49
ブラジル	VALE SA	株式	素材	75,300	1,641.46 1,488.53	123,602,359 112,086,836		0.48

(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25年5月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	11.32
	素材	9.61
	資本財	4.41
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.65

自動車・自動車部品	3.43
耐久消費財・アパレル	0.88
消費者サービス	0.55
メディア	1.37
小売	1.58
食品・生活必需品小売り	2.36
食品・飲料・タバコ	5.42
家庭用品・パーソナル用品	1.23
ヘルスケア機器・サービス	0.54
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.80
銀行	19.47
各種金融	2.69
保険	2.94
不動産	2.08
ソフトウェア・サービス	2.72
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.33
電気通信サービス	7.30
公益事業	3.42
半導体・半導体製造装置	8.31
合計	97.46

（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25年5月31日現在

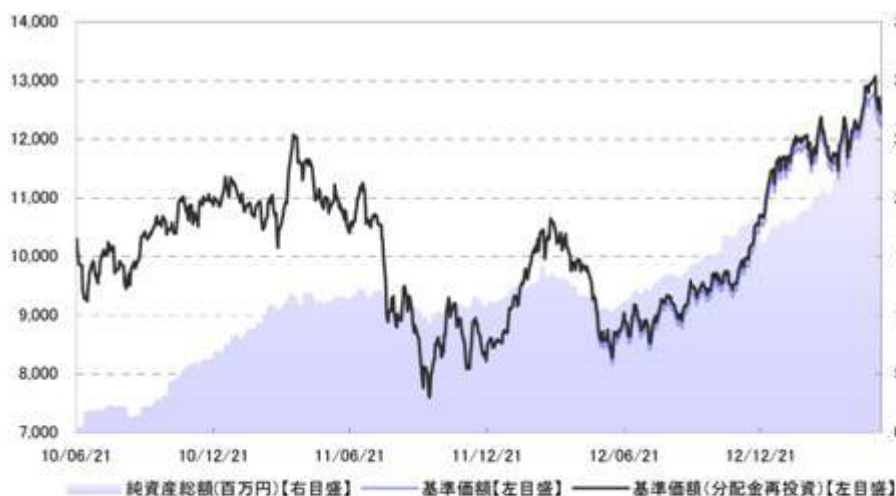
資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2013年6月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	110	アメリカドル	5,714,401.50	5,540,700.00	560,608,026	2.40

（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

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2013年5月31日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもとして計算

2 分配の推移

2013年 5月	80円
2012年 5月	100円
2011年 5月	20円
設定来累計	200円

・分配金は1万口当たり、税引前

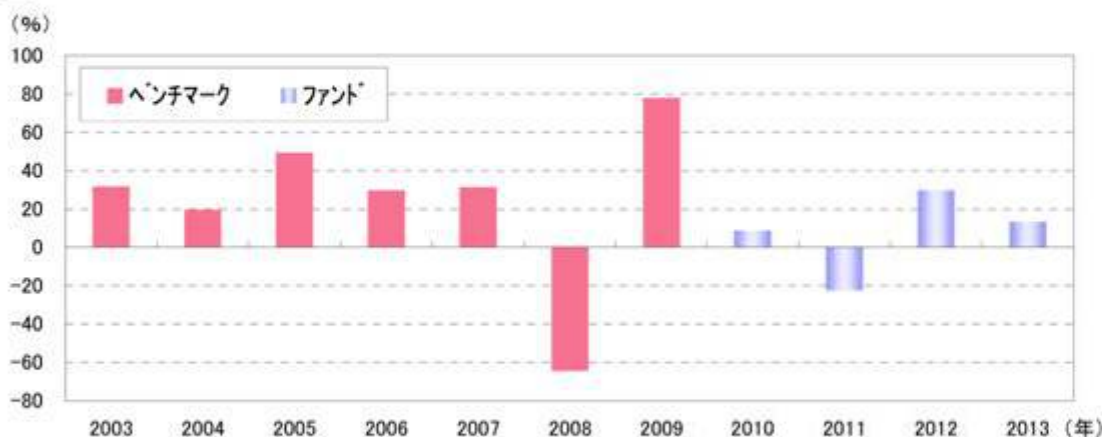
3 主要な資産の状況(2013年5月31日現在)

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
香港ドル	18.3%	1 SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	韓国	3.9%
韓国ウォン	14.5%	2 TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	台湾	2.3%
ブラジルレアル	12.0%	3 CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	香港	1.7%
ニュー台湾ドル	11.0%	4 CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	香港	1.5%
アメリカドル	7.6%	5 IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	香港	1.2%
南アフリカランド	6.6%	6 GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	アメリカ	1.1%
インドルピー	6.6%	7 TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	香港	1.0%
メキシコペソ	5.2%	8 PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	ブラジル	1.0%
その他	18.2%	9 AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	メキシコ	1.0%
合計	100.0%	10 BANK OF CHINA LTD-H	銀行	香港	0.9%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	2.4%

・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)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2010年は設定日から年末までの、2013年は5月31日までの収益率を表示
- ・2009年以前はベンチマークの年間収益率(委託会社の計算日基準)を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。 ただし、以下の日は申込みができません。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	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、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
申込手数料	申込価額×3.15%（税抜3%）を上限として販売会社が定める手数料率 分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。 消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります。この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 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。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることにしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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を取り消すことがあります。

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 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日
解約単位	販売会社が定める単位
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
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.3%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎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投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	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	原則、午後3時まで受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。 詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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。 委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。 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。

換金の詳細につい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	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「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。</p> <p>(主な評価方法)</p> <p>マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。</p> <p>株式：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、外国金融商品市場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。</p> <p>公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、第一種金融商品取引業者・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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。</p> <p>また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>

(2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3)【信託期間】

信託期間	<p>平成22年6月21日から無期限</p> <p>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。</p>
------	--

(4)【計算期間】

計算期間	<p>原則として、毎年5月13日から翌年5月12日まで</p> <p>上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この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なります。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。</p>
------	---

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	<p>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）</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 受益権の口数が10億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 <p>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。</p> <p>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。</p>
信託約款の変更等	<p>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または受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。</p> <p>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。</p>
ファンドの償還等に関する開示方法	<p>委託会社は、ファンドの任意償還、信託約款の変更のうち重大な内容の変更または併合について、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。</p> <p>併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。</p>
反対者の買取請求権	<p>委託会社がファンドの任意償還、信託約款について重大な内容の変更または併合を行う場合、書面決議において反対した受益者は、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。</p>
関係法人との契約の更改	<p>委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。</p>
運用報告書の作成	<p>委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、運用経過、信託財産の内容および有価証券の売買状況などを記載した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等があった場合は、その内容を運用報告書に記載します。</p>
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	<p>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。</p>
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	<p>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。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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。</p>
信託事務処理の再信託	<p>受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、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。</p>

公告	<p>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。</p> <p>http://www.am.mufg.jp/</p> <p>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。</p>
----	---

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	<p>受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。</p> <p>「分配金受取りコース（一般コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 <p>「分配金再投資コース（累積投資コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、課税後、原則として毎計算期間の終了日（決算日）の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	<p>受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・償還金は、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営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金（解約）請求権	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 <p>（「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）</p>

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、第3期計算期間（平成24年5月15日から平成25年5月13日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

新興国株式インデックスオープン

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 [平成24年5月14日現在]	第3期 [平成25年5月13日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	647,159	1,536,091
親投資信託受益証券	109,232,112	274,286,087
未収入金	1,352,915	3,232,027
未収利息	1	2
流動資産合計	111,232,187	279,054,207
資産合計	111,232,187	279,054,207
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,194,482	1,732,771
未払解約金	150,391	1,925,601
未払受託者報酬	50,817	82,316
未払委託者報酬	584,366	946,573
その他未払費用	1,912	3,130
流動負債合計	1,981,968	4,690,391
負債合計	1,981,968	4,690,391
純資産の部		
元本等		
元本	119,448,274	216,596,424
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,198,055	57,767,392
(分配準備積立金)	2,333,540	40,618,258
元本等合計	109,250,219	274,363,816
純資産合計	109,250,219	274,363,816
負債純資産合計	111,232,187	279,054,207

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第 2 期 自 平成23年 5月13日 至 平成24年 5月14日	第 3 期 自 平成24年 5月15日 至 平成25年 5月13日
営業収益		
受取利息	143	604
有価証券売買等損益	18,570,072	66,555,452
営業収益合計	18,569,929	66,556,056
営業費用		
受託者報酬	97,539	137,750
委託者報酬	1,121,640	1,583,940
その他費用	3,658	5,208
営業費用合計	1,222,837	1,726,898
営業利益	19,792,766	64,829,158
経常利益	19,792,766	64,829,158
当期純利益	19,792,766	64,829,158
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	4,542,396	15,655,192
期首剰余金又は期首欠損金 ()	10,844,932	10,198,055
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	20,524,252
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,532,371
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	13,991,881
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,598,135	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,912,422	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,685,713	-
分配金	1,194,482	1,732,771
期末剰余金又は期末欠損金 ()	10,198,055	57,767,392

(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	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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、前計算期間および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24年5月15日から平成25年5月13日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第 2 期 [平成24年5月14日現在]	第 3 期 [平成25年5月13日現在]
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	100,684,674円 64,524,920円 45,761,320円	119,448,274円 219,067,139円 121,918,989円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	10,198,055円	
3 受益権の総数	119,448,274口	216,596,424口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9146円 (9,146円)	1.2667円 (12,667円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 (自 平成23年5月13日 至 平成24年5月14日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	1,386,077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	
収益調整金額	C	1,805,343円
分配準備積立金額	D	2,141,945円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,333,365円
当ファンドの期末残存口数	F	119,448,274口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	446円
1万口当たり分配金額	H	100円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,194,482円

第 3 期 (自 平成24年5月15日 至 平成25年5月13日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	3,763,100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	37,443,614円
収益調整金額	C	17,149,134円
分配準備積立金額	D	1,144,315円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	59,500,163円
当ファンドの期末残存口数	F	216,596,424口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,747円
1万口当たり分配金額	H	80円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,732,771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 2 期 (自 平成23年 5月13日 至 平成24年 5月14日)	第 3 期 (自 平成24年 5月15日 至 平成25年 5月13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を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 (1) 親投資信託受益証券は、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。 (2) 親投資信託受益証券は、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。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	また、親投資信託受益証券に係る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。 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、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 2 期 [平成24年5月14日現在]	第 3 期 [平成25年5月13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 （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 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。	同 左
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

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種 類	第 2 期 [平成24年5月14日現在]	第 3 期 [平成25年5月13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	13,953,702	55,184,606
合計	13,953,702	55,184,606

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

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。

（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	新興国株式インデックスマザーファンド	138,724,503	274,286,087	
	親投資信託受益証券 小計	138,724,503	274,286,087	
	合計	138,724,503	274,286,087	

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 >

当ファンドは「新興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ており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。
 なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

「新興国株式インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年5月14日現在]	[平成25年5月13日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	530,062,937	331,015,642
コール・ローン	117,734,579	101,502,212
株式	13,791,301,817	23,651,055,301
投資証券	67,720,957	
派生商品評価勘定	367,441	12,016,368
未収入金	234,128,253	4,545,939
未収配当金	27,205,276	52,893,847
未収利息	271	169
差入委託証拠金	64,609,478	42,744,390
流動資産合計	14,833,131,009	24,195,773,868
資産合計	14,833,131,009	24,195,773,868
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	22,244,107	25,481
未払金	469,511,832	27,227,847
未払解約金	5,064,984	88,864,920
流動負債合計	496,820,923	116,118,248
負債合計	496,820,923	116,118,248
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,205,856,490
剰余金		
剰余金又は欠損金()		4,130,453,596
元本等合計		14,336,310,086
純資産合計		14,336,310,086
負債純資産合計		14,833,131,009
		24,195,773,868

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(2) 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	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、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。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年5月14日現在]	[平成25年5月13日現在]
1 期首	平成23年5月13日	平成24年5月15日
期首元本額	5,211,421,010円	10,205,856,490円
期首からの追加設定元本額	5,433,618,585円	3,156,931,132円
期首からの一部解約元本額	439,183,105円	1,184,140,409円
元本の内訳*		
F P バランスファンド(安定型)	5,399,769円	5,279,878円
F P バランスファンド(安定成長型)	34,983,152円	30,050,267円
e M A X I S 新興国株式インデックス	8,577,570,311円	9,702,679,286円
e M A X I S バランス(8資産均等型)	19,776,971円	118,192,031円
e M A X I S バランス(波乗り型)	3,583,577円	27,581,724円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	27,753円	471,885円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	692,733,737円	1,284,533,551円
新興国株式インデックスオープン	77,761,880円	138,724,503円
e M A X I S 全世界株式インデックス	105,603,535円	144,956,546円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	8,952,116円	11,121,173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)	679,463,689円	715,056,369円
(合計)	10,205,856,490円	12,178,647,213円
2 受益権の総数	10,205,856,490口	12,178,647,213口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4047円 (14,047円)	1.9772円 (19,772円)

* 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23年5月13日 至平成24年5月14日)	(自平成24年5月15日 至平成25年5月13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、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年5月14日現在]	[平成25年5月13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 (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 (デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。 (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。	同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	[平成24年5月14日現在]	[平成25年5月13日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	790,461,576	1,781,364,627
投資証券	19,015,905	
合計	809,477,481	1,781,364,627

（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。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	[平成24年5月14日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	431,833,391	409,655,009	22,178,382
	合計	431,833,391	409,655,009	22,178,382

区分	種類	[平成25年5月13日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	403,622,565	415,613,452	11,990,887
	合計	403,622,565	415,613,452	11,990,887

（注）時価の算定方法

- 1 株価指数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最終相場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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

区分	種類	[平成24年5月14日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	31,024,757	31,020,884	3,873
	買建 香港ドル	15,450,000	15,480,000	30,000
	タイバーツ	8,480,725	8,415,000	65,725
	フィリピンペソ	6,777,913	6,804,000	26,087
	インドネシアルピア	15,766,119	16,016,000	249,881
	ニュー台湾ドル	16,322,400	16,380,000	57,600
	合計	93,821,914	94,115,884	301,716

[平成25年5月13日現在]
 該当事項はありません。

（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。

（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。

[次へ](#)

(3) 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					
	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	5,000	21.110000	105,550.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	7,918	16.590000	131,359.62	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	10,800	19.830000	214,164.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	43,132	4.650000	200,563.80	
	COMPANHIA DE BEBIDAS-PRF ADR	3,000	42.430000	127,290.00	
	CREDICORP LTD	4,100	150.580000	617,378.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	2,000	45.010000	90,020.00	
	EFG-HERMES HOLDINGS-GDR	20,000	2.900000	58,000.00	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	75,000	1.663000	124,725.00	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	324,000	8.070000	2,614,680.00	
	HDFC BANK LTD-ADR	4,500	42.520000	191,340.00	
	HON HAI PRECISION-GDR REG S	43,366	5.370000	232,875.42	
	INFOSYS LTD-SP ADR	4,000	42.870000	171,480.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,000	5.454000	196,344.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	7,090	17.120000	121,380.80	
	LSR GROUP OJSC-GDR REGS	18,000	4.664000	83,952.00	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	31,400	63.150000	1,982,910.00	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	16,500	54.200000	894,300.00	
	MECHEL-SPONSORED ADR	18,400	4.300000	79,120.00	
	MEGAFON-GDR	7,000	31.650000	221,550.00	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	34,000	15.650000	532,100.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	30,000	19.970000	599,100.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,600	106.600000	596,960.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7,000	16.540000	115,780.00	
	ORASCOM TELECOM-GDR REG S	40,000	3.290000	131,600.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	11,000	18.870000	207,570.00	
	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	6,000	29.390000	176,340.00	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	81,000	7.060000	571,860.00	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	14,000	22.250000	311,500.00	
	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	340	664.000000	225,760.00	
	SASOL LTD-SPONSORED ADR	2,000	45.040000	90,080.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	171,500	13.250000	2,272,375.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,000	8.950000	89,500.00	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	9,000	20.460000	184,140.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	10,107	33.310000	336,664.17	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	76,000	8.295000	630,420.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	7,614	20.170000	153,574.38	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	14,766	38.740000	572,034.84	
	TMK-GDR REG S	6,000	12.410000	74,460.00	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	15,400	36.340000	559,636.00	
	VALE SA-SP ADR	10,000	16.960000	169,600.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	89,000	3.080000	274,120.00	
	アメリカドル 小計	1,331,533		17,334,157.03 (1,766,697,284)	
香港ドル					
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	76,000	10.240000	778,240.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,310,000	3.870000	5,069,700.00	
	AIR CHINA LTD-H	116,000	6.880000	798,080.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.240000	680,400.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	5.110000	122,640.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	74,000	28.350000	2,097,900.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	65,000	7.020000	456,300.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	120,000	4.140000	496,800.00	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,540,000	3.820000	17,342,800.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	521,900	6.260000	3,267,094.00	
	BBMG CORPORATION-H	80,000	6.370000	509,600.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	130,000	5.390000	700,700.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	30,000	61.050000	1,831,500.00	
	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	13.200000	3,696,000.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	220,000	2.090000	459,800.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	150,000	9.840000	1,476,000.00	

BYD CO LTD-H	30,500	31.550000	962,275.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	134,000	4.010000	537,340.00
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	100,000	5.050000	505,000.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	450,000	4.570000	2,056,500.00
CHINA COAL ENERGY CO-H	230,000	5.900000	1,357,000.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	265,000	7.890000	2,090,850.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	170,000	5.550000	943,500.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,337,550	6.640000	28,801,332.00
CHINA COSCO HOLDINGS-H	170,000	3.550000	603,500.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	54,000	13.580000	733,320.00
CHINA FOODS LTD	56,000	4.230000	236,880.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	180,000	8.170000	1,470,600.00
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	39,300	12.800000	503,040.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	443,000	22.200000	9,834,600.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	166,000	7.590000	1,259,940.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	76,000	24.100000	1,831,600.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	231,550	16.900000	3,913,195.00
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	68,000	25.000000	1,700,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	312,000	10.640000	3,319,680.00
CHINA MOBILE LTD	362,500	86.200000	31,247,500.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	150,000	9.410000	1,411,500.00
CHINA OILFIELD SERVICES-H	92,000	16.700000	1,536,400.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	246,000	24.200000	5,953,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	157,000	28.950000	4,545,150.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,160,000	8.690000	10,080,400.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	120,000	8.300000	996,000.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	283,000	4.280000	1,211,240.00
CHINA RESOURCES CEMENT	140,000	4.430000	620,200.00
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	74,000	26.550000	1,964,700.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	60,000	21.000000	1,260,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	136,000	23.900000	3,250,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	110,000	22.850000	2,513,500.00
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	100,000	4.530000	453,000.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	203,000	28.050000	5,694,150.00
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	161,000	2.040000	328,440.00
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	40,000	3.620000	144,800.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	140,000	4.350000	609,000.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	100,000	11.360000	1,136,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	54,000	12.980000	700,920.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	830,000	4.120000	3,419,600.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	284,000	11.460000	3,254,640.00
CHINA VANKE CO LTD -B	84,951	16.700000	1,418,681.70
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	120,000	4.380000	525,600.00
CITIC PACIFIC LTD	80,000	10.040000	803,200.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,000	17.940000	1,148,160.00
CNOOC LTD	1,074,000	14.760000	15,852,240.00
COSCO PACIFIC LTD	80,000	10.420000	833,600.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	287,232	4.630000	1,329,884.16
CSR CORP LTD - H	80,000	5.790000	463,200.00
DAH CHONG HONG	70,000	7.210000	504,700.00
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	8.460000	507,600.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	200,000	3.790000	758,000.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	5,600	13.280000	74,368.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	168,000	12.900000	2,167,200.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	40,000	43.950000	1,758,000.00
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	420,000	3.390000	1,423,800.00
FAR EAST HORIZON LTD	70,000	5.300000	371,000.00
FOSUN INTERNATIONAL	93,000	5.570000	518,010.00
FRANSHION PROPERTIES	200,000	2.780000	556,000.00
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	400,000	1.610000	644,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	290,000	4.150000	1,203,500.00
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	40,000	12.720000	508,800.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	310,000	0.820000	254,200.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	35.750000	2,145,000.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	33,000	15.400000	508,200.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	156,000	7.550000	1,177,800.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	130,675	7.390000	965,688.25
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	39,200	14.660000	574,672.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	65,000	13.320000	865,800.00

HAITONG SECURITIES CO LTD-H	70,000	11.260000	788,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,000	85.000000	3,740,000.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	120,000	3.960000	475,200.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	196,000	9.590000	1,879,640.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,876,350	5.640000	21,862,614.00	
INTIME DEPARTMENT STORE	80,000	8.590000	687,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	70,000	9.230000	646,100.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	82,000	16.420000	1,346,440.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	45,000	18.940000	852,300.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS-NEW	9,000	18.940000	170,460.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	180,000	15.460000	2,782,800.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	100,000	5.580000	558,000.00	
LENOVO GROUP LTD	368,000	6.850000	2,520,800.00	
LONGFOR PROPERTIES	100,000	14.060000	1,406,000.00	
MMG LTD	140,000	2.520000	352,800.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	35,000	28.950000	1,013,250.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	128,000	6.530000	835,840.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	64,000	4.140000	264,960.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	240,000	4.190000	1,005,600.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,255,000	10.260000	12,876,300.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	160,000	10.300000	1,648,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	109,000	63.600000	6,932,400.00	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	90,000	5.560000	500,400.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	104,000	7.620000	792,480.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	150,000	3.050000	457,500.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	32,000	26.000000	832,000.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,000	15.700000	785,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	80,500	17.520000	1,410,360.00	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	168,000	2.960000	497,280.00	
SHUI ON LAND LTD	227,600	2.950000	671,420.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	160,000	4.540000	726,400.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	130,000	5.420000	704,600.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	154,000	2.840000	437,360.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	50,000	24.050000	1,202,500.00	
SOHO CHINA LTD	150,000	6.850000	1,027,500.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	140,000	10.440000	1,461,600.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	60,500	276.800000	16,746,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	108,000	19.940000	2,153,520.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	52.750000	844,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	86,000	8.500000	731,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	335,000	11.580000	3,879,300.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	29,200	30.300000	884,760.00	
WUMART STORES INC-H	35,000	13.960000	488,600.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	126,000	8.220000	1,035,720.00	
YINGDE GASES GROUP CO LTD	80,000	7.620000	609,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	280,000	2.430000	680,400.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	50,000	8.500000	425,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	100,000	6.700000	670,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	52,000	10.820000	562,640.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	31,000	24.850000	770,350.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	380,000	2.330000	885,400.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	52,000	8.460000	439,920.00	
ZTE CORP-H	38,276	14.040000	537,395.04	
香港ドル 小計	36,199,384		333,130,659.15 (4,374,005,554)	
マレーシアリングット				
AIRASIA BHD	70,000	3.030000	212,100.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,000	4.840000	338,800.00	
AMMB HOLDINGS BHD	114,000	7.150000	815,100.00	
AXIATA GROUP BERHAD	150,000	6.930000	1,039,500.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	43,881	4.380000	192,198.78	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,000	64.000000	384,000.00	
BUMI ARMADA BERHAD	70,000	3.950000	276,500.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	292,800	8.290000	2,427,312.00	
DIGI.COM BHD	175,000	4.690000	820,750.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	70,000	4.630000	324,100.00	
GAMUDA BHD	105,000	4.750000	498,750.00	
GENTING BHD	114,900	10.940000	1,257,006.00	
GENTING MALAYSIA BHD	177,900	3.870000	688,473.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	15,000	8.950000	134,250.00	

HONG LEONG BANK BERHAD	29,000	14.420000	418,180.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,000	15.840000	142,560.00	
IHH HEALTHCARE BHD	140,000	3.870000	541,800.00	
IJM CORP BHD	59,100	5.770000	341,007.00	
IOI CORPORATION BHD	176,400	5.330000	940,212.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	25,700	21.700000	557,690.00	
LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	25,000	10.980000	274,500.00	
MALAYAN BANKING BHD	253,000	10.080000	2,550,240.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	40,000	6.150000	246,000.00	
MALAYSIA MARINE AND HEAVY EN	30,000	3.800000	114,000.00	
MAXIS BHD	138,000	6.990000	964,620.00	
MISC BHD	60,000	4.570000	274,200.00	
MMC CORP BHD	14,000	2.810000	39,340.00	
PARKSON HOLDINGS BHD	45,000	4.210000	189,450.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	170,000	6.600000	1,122,000.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	12,000	24.200000	290,400.00	
PETRONAS GAS BHD	33,700	20.400000	687,480.00	
PPB GROUP BERHAD	30,300	13.420000	406,626.00	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	60,000	16.600000	996,000.00	
RHB CAPITAL BHD	45,000	8.760000	394,200.00	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	210,000	3.540000	743,400.00	
SIME DARBY BERHAD	160,000	9.500000	1,520,000.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	60,000	5.510000	330,600.00	
TENAGA NASIONAL BHD	168,000	8.260000	1,387,680.00	
UEM LAND HOLDINGS BHD	120,000	3.160000	379,200.00	
UMW HOLDINGS BHD	35,000	13.940000	487,900.00	
YTL CORPORATION BERHAD	302,464	1.790000	541,410.56	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	200,000	1.540000	308,000.00	
マレーシアリングット 小計	4,125,145		26,597,535.34 (903,784,250)	
タイバーツ				
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	72,700	287.000000	20,864,900.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	32,000	148.000000	4,736,000.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	85,000	227.000000	19,295,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	24,000	172.000000	4,128,000.00	
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	123,300	33.000000	4,068,900.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	6,000	326.000000	1,956,000.00	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	55,000	72.500000	3,987,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	72,000	56.250000	4,050,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	150,000	30.750000	4,612,500.00	
CP ALL PCL-NVDR	265,200	41.000000	10,873,200.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	40,000	75.750000	3,030,000.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	60,000	23.100000	1,386,000.00	
IRPC PCL - NVDR	650,000	4.000000	2,600,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	114,000	219.000000	24,966,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	200,000	24.800000	4,960,000.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	81,000	164.000000	13,284,000.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	81,561	76.750000	6,259,806.75	
PTT PCL-NVDR	51,000	340.000000	17,340,000.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	26,500	486.000000	12,879,000.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	106,000	187.500000	19,875,000.00	
SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	7,000	752.000000	5,264,000.00	
THAI OIL PCL-NVDR	70,000	65.500000	4,585,000.00	
タイバーツ 小計	2,372,261		195,000,806.75 (666,902,759)	
フィリピンペン				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	110,000	57.000000	6,270,000.00	
ABOITIZ POWER CORP	110,000	36.150000	3,976,500.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	130,000	26.450000	3,438,500.00	
AYALA CORPORATION	11,920	672.000000	8,010,240.00	
AYALA LAND INC	300,000	33.500000	10,050,000.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,000	103.000000	5,356,000.00	
BDO UNIBANK INC	70,000	93.100000	6,517,000.00	
DMCI HOLDINGS INC	60,000	59.600000	3,576,000.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	500,000	6.330000	3,165,000.00	
GLOBE TELECOM INC	2,000	1,620.000000	3,240,000.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	50,000	100.500000	5,025,000.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	27,200	134.000000	3,644,800.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	15,000	131.500000	1,972,500.00	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,500	3,128.000000	7,820,000.00	

SAN MIGUEL CORP	30,000	123.000000	3,690,000.00	
SM INVESTMENTS CORP	12,400	1,160.000000	14,384,000.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	392,500	20.050000	7,869,625.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	55,000	124.000000	6,820,000.00	
フィリピンペソ 小計	1,930,520		104,825,165.00 (259,966,409)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	1,000,000	1,190.000000	1,190,000,000.00	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	36,000	17,150.000000	617,400,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,220,000	7,200.000000	8,784,000,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	720,000	11,050.000000	7,956,000,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	206,000	6,400.000000	1,318,400,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	550,000	10,300.000000	5,665,000,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	460,000	5,400.000000	2,484,000,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	670,000	9,300.000000	6,231,000,000.00	
BUMI RESOURCES TBK PT	1,000,000	660.000000	660,000,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	420,000	5,000.000000	2,100,000,000.00	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	450,000	2,500.000000	1,125,000,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	25,000	53,800.000000	1,345,000,000.00	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	22,000	35,050.000000	771,100,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	85,000	25,300.000000	2,150,500,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	247,000	7,200.000000	1,778,400,000.00	
INDOSAT TBK PT	120,000	5,900.000000	708,000,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	150,000	6,600.000000	990,000,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	1,250,000	1,450.000000	1,812,500,000.00	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	260,000	3,400.000000	884,000,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	662,500	6,250.000000	4,140,625,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	180,000	19,000.000000	3,420,000,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	56,500	14,500.000000	819,250,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	590,000	11,850.000000	6,991,500,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	90,000	27,500.000000	2,475,000,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	95,000	17,200.000000	1,634,000,000.00	
XL AXIATA TBK PT	130,000	4,975.000000	646,750,000.00	
インドネシアルピア 小計	10,695,000		68,697,425,000.00 (721,322,962)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B. -A	170,000	28.530000	4,850,100.00	
ALPEK SA DE CV	35,000	28.370000	992,950.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,240,000	12.780000	28,627,200.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	19,866	101.690000	2,020,173.54	
CEMEX SAB-CPO	697,872	14.510000	10,126,122.72	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	24,200	193.240000	4,676,408.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	56,000	18.920000	1,059,520.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	11,000	152.760000	1,680,360.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	116,000	139.550000	16,187,800.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,000	142.040000	1,988,560.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	17,000	68.240000	1,160,080.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	108,000	38.160000	4,121,280.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	33,700	69.490000	2,341,813.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	95,000	42.360000	4,024,200.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	112,000	89.990000	10,078,880.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	118,000	32.510000	3,836,180.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	226,770	42.320000	9,596,906.40	
GRUPO MODELO S.A.B. -SER C	38,700	110.230000	4,265,901.00	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	152,000	64.450000	9,796,400.00	
INDUSTRIAS CH S.A.B. -SER B	11,000	96.550000	1,062,050.00	
INDUSTRIAS PENOLAS SAB DE CV	8,000	469.070000	3,752,560.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	94,600	40.780000	3,857,788.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	65,000	61.130000	3,973,450.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	38,700	51.120000	1,978,344.00	
WALMART DE MEXICO-SER V	321,000	36.370000	11,674,770.00	
メキシコペソ 小計	4,823,408		147,729,796.66 (1,245,362,185)	
ブラジルリアル				
AES TIETE SA-PREF	6,700	21.460000	143,782.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	33,000	10.790000	356,070.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	27,000	12.100000	326,700.00	
ARTERIS SA	8,000	22.720000	181,760.00	
BANCO BRADESCO S.A.	35,860	34.040000	1,220,674.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	119,004	33.500000	3,986,634.00	

BANCO DO BRASIL S.A.	34,400	25.420000	874,448.00
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	10,000	17.750000	177,500.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	46,000	14.400000	662,400.00
BM&FBOVESPA SA	100,000	14.430000	1,443,000.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	25,000	23.600000	590,000.00
BR PROPERTIES SA	14,000	21.150000	296,100.00
BRADSPAR SA -PREF	13,500	25.080000	338,580.00
BRASKEM SA-PREF A	10,000	16.560000	165,600.00
BRF SA	39,000	49.720000	1,939,080.00
CCR SA	51,000	20.340000	1,037,340.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	18,500	4.840000	89,540.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	12,000	8.210000	98,520.00
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	14,000	25.400000	355,600.00
CIA BRAS DISTR PAO AC-RTS	8	9.000000	72.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	7,400	109.750000	812,150.00
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	43,900	85.510000	3,753,889.00
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	6,900	84.240000	581,256.00
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	8,700	21.710000	188,877.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	31,410	21.580000	677,827.80
CIA HERING	7,000	41.750000	292,250.00
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,000	35.450000	283,600.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,000	27.690000	581,490.00
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	4,500	44.760000	201,420.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,200	7.290000	307,638.00
CIELO SA	21,052	55.090000	1,159,754.68
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	7,500	46.840000	351,300.00
CPFL ENERGIA SA	14,500	21.850000	316,825.00
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	20,000	17.380000	347,600.00
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	10,000	11.690000	116,900.00
DURATEX SA	16,236	14.870000	241,429.32
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	12,000	17.670000	212,040.00
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,000	12.010000	216,180.00
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	6,000	7.670000	46,020.00
EMBRAER SA	33,000	18.040000	595,320.00
FIBRIA CELULOSE SA	15,200	21.550000	327,560.00
GERDAU SA-PREF	49,200	14.100000	693,720.00
HYPERMARCAS SA	21,000	16.850000	353,850.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	128,800	34.670000	4,465,496.00
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	164,969	9.190000	1,516,065.11
ITAUSA-INVESTIMENTOS-RTS	4,283	2.730000	11,692.59
JBS SA	30,000	6.210000	186,300.00
KLABIN SA-PREF	25,000	13.680000	342,000.00
KROTON EDUCACIONAL SA	11,400	28.900000	329,460.00
LIGHT SA	5,000	19.440000	97,200.00
LOCALIZA RENT A CAR	6,300	33.460000	210,798.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	29,215	17.350000	506,880.25
LOJAS RENNER S.A.	7,500	76.590000	574,425.00
MARCOPOLO SA-PREF	15,000	13.150000	197,250.00
METALURGICA GERDAU SA-PREF	16,500	17.920000	295,680.00
MPX ENERGIA SA	13,500	8.530000	115,155.00
MRV ENGENHARIA	22,000	8.030000	176,660.00
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,000	58.470000	292,350.00
MULTIPLUS SA	3,500	31.510000	110,285.00
NATURA COSMETICOS SA	10,000	50.260000	502,600.00
ODONTOPREV S.A.	21,000	9.800000	205,800.00
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	68,000	1.630000	110,840.00
OI SA	5,589	5.260000	29,398.14
OI SA-PREFERENCE	63,815	4.600000	293,549.00
PDG REALTY SA	79,000	2.290000	180,910.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	171,000	19.200000	3,283,200.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	239,000	19.950000	4,768,050.00
PORTO SEGURO SA	8,900	25.720000	228,908.00
QUALICORP SA	12,000	19.100000	229,200.00
RAIA DROGASIL SA	9,000	22.300000	200,700.00
SOUZA CRUZ SA	21,000	29.620000	622,020.00
SUL AMERICA SA - UNITS	11,906	14.500000	172,637.00
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	16,975	52.930000	898,486.75
TIM PARTICIPACOES SA	54,377	8.340000	453,504.18
TOTVS SA	6,000	36.380000	218,280.00

TRACTEBEL ENERGIA SA	10,000	36.060000	360,600.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	19,600	55.000000	1,078,000.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,000	8.710000	148,070.00	
VALE SA	75,300	34.240000	2,578,272.00	
VALE SA-PREF	113,000	32.500000	3,672,500.00	
WEG SA	15,000	27.850000	417,750.00	
ブラジルリアル 小計	2,577,099		57,023,269.22 (2,876,253,699)	
チリペソ				
AES GENER SA	140,000	331.710000	46,439,400.00	
AGUAS ANDINAS SA-A	180,000	374.870000	67,476,600.00	
BANCO DE CHILE	1,100,000	72.160000	79,376,000.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,522	33,613.000000	51,158,986.00	
BANCO SANTANDER CHILE	3,800,000	31.630000	120,194,000.00	
CAP SA	4,500	14,623.000000	65,803,500.00	
CENCOSUD SA	68,000	2,619.300000	178,112,400.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,900	7,776.200000	53,655,780.00	
COLBUN SA	490,000	145.170000	71,133,300.00	
CORPBANCA	8,700,000	6.224000	54,148,800.00	
E.CL SA	30,000	1,016.000000	30,480,000.00	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	14,000	3,176.800000	44,475,200.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	200,000	817.810000	163,562,000.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	7,400	9,552.600000	70,689,240.00	
EMPRESAS CMPC SA	64,000	1,720.100000	110,086,400.00	
EMPRESAS CMPC SA-RTS	4,487	240.000000	1,076,880.00	
EMPRESAS COPEC SA	27,700	6,847.500000	189,675,750.00	
ENERSIS SA	1,140,000	176.360000	201,050,400.00	
LATAM AIRLINES GROUP SA	16,500	9,686.400000	159,825,600.00	
S.A.C.I. FALABELLA	27,000	5,390.100000	145,532,700.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,300	23,321.000000	123,601,300.00	
VINA CONCHA Y TORO SA	35,000	937.230000	32,803,050.00	
チリペソ 小計	16,062,309		2,060,357,286.00 (442,976,816)	
韓国ウォン				
AMOREPACIFIC CORP	195	902,000.000000	175,890,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	220	379,500.000000	83,490,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	9,500	14,300.000000	135,850,000.00	
CELLTRION INC	3,018	28,500.000000	86,013,000.00	
CHEIL INDUSTRIES INC	2,800	93,500.000000	261,800,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	6,500	25,950.000000	168,675,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	500	289,000.000000	144,500,000.00	
CJ CORP	800	139,500.000000	111,600,000.00	
COWAY CO LTD	3,000	52,800.000000	158,400,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2,000	85,300.000000	170,600,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,000	7,870.000000	70,830,000.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,618	39,000.000000	102,102,000.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	10,738	11,250.000000	120,802,500.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,500	27,950.000000	125,775,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	7,000	15,750.000000	110,250,000.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,050	43,500.000000	89,175,000.00	
DOOSAN CORP	450	130,500.000000	58,725,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,100	43,500.000000	134,850,000.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	5,000	13,500.000000	67,500,000.00	
E-MART CO LTD	1,200	210,000.000000	252,000,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,300	31,800.000000	41,340,000.00	
GS HOLDINGS	3,150	56,400.000000	177,660,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	17,330	35,150.000000	609,149,500.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	4,476	48,250.000000	215,967,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	4,000	17,300.000000	69,200,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,500	31,950.000000	79,875,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,000	6,670.000000	86,710,000.00	

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
韓国ウォン					
	HYOSUNG CORPORATION	1,200	58,600.000000	70,320,000.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	900	162,500.000000	146,250,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,500	26,250.000000	91,875,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,000	61,200.000000	244,800,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	750	171,000.000000	128,250,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,500	200,000.000000	500,000,000.00	
	HYUNDAI HYSKO	2,500	31,500.000000	78,750,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,500	30,000.000000	105,000,000.00	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,000	10,400.000000	41,600,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	550	127,000.000000	69,850,000.00	
	HYUNDAI MOBIS CO LTD	3,950	255,000.000000	1,007,250,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	9,050	189,000.000000	1,710,450,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2,100	82,600.000000	173,460,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,000	79,800.000000	159,600,000.00	
	HYUNDAI SECURITIES CO	8,500	7,700.000000	65,450,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	3,500	75,300.000000	263,550,000.00	
	HYUNDAI WIA CORP	800	142,000.000000	113,600,000.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	10,500	12,450.000000	130,725,000.00	
	KANGWON LAND INC	5,500	31,650.000000	174,075,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	22,900	36,150.000000	827,835,000.00	
	KCC CORP	260	319,000.000000	82,940,000.00	
	KIA MOTORS CORPORATION	15,200	52,100.000000	791,920,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,500	28,050.000000	98,175,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,000	29,550.000000	472,800,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,400	65,700.000000	91,980,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,000	44,700.000000	134,100,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	520	340,500.000000	177,060,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	2,800	35,950.000000	100,660,000.00	
	KT CORP	2,500	38,800.000000	97,000,000.00	
	KT&G CORP	6,600	76,500.000000	504,900,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	650	99,800.000000	64,870,000.00	
	LG CHEM LTD	2,700	266,500.000000	719,550,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	750	99,300.000000	74,475,000.00	
	LG CORP	6,100	65,800.000000	401,380,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	14,100	29,100.000000	410,310,000.00	
	LG ELECTRONICS INC	6,171	83,300.000000	514,044,300.00	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	550	616,000.000000	338,800,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	850	89,600.000000	76,160,000.00	
	LG UPLUS CORP	11,000	12,100.000000	133,100,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	930	177,000.000000	164,610,000.00	
	LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	55	1,768,000.000000	97,240,000.00	
	LOTTE SHOPPING CO	600	375,000.000000	225,000,000.00	
	LS CORP	1,330	77,500.000000	103,075,000.00	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS	950	61,600.000000	58,520,000.00	
	MANDO CORP	500	92,700.000000	46,350,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,600	48,450.000000	77,520,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	900	166,000.000000	149,400,000.00	
	NHN CORP	2,500	290,500.000000	726,250,000.00	
	OCI CO LTD	900	140,000.000000	126,000,000.00	
	ORION CORP	200	1,105,000.000000	221,000,000.00	
	POSCO	3,900	319,500.000000	1,246,050,000.00	
	S-1 CORPORATION	1,300	60,500.000000	78,650,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	6,900	60,000.000000	414,000,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	3,000	41,500.000000	124,500,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,650	95,800.000000	349,670,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,540	1,476,000.000000	9,653,040,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,110	880,000.000000	976,800,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,800	98,300.000000	176,940,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,100	220,000.000000	462,000,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	9,800	33,900.000000	332,220,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,700	105,000.000000	388,500,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,950	126,500.000000	246,675,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,863	51,800.000000	200,103,400.00	
	SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,380	66,300.000000	157,794,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	25,800	37,850.000000	976,530,000.00	

SHINSEGAE CO LTD	454	224,500.000000	101,923,000.00	
SK C&C CO LTD	1,200	96,100.000000	115,320,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,550	161,000.000000	249,550,000.00	
SK HYNIX INC	31,000	29,100.000000	902,100,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	3,460	151,000.000000	522,460,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	9,000	7,230.000000	65,070,000.00	
SK TELECOM	450	215,000.000000	96,750,000.00	
S-OIL CORPORATION	2,700	87,700.000000	236,790,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	21,500	11,550.000000	248,325,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,539	12,050.000000	102,894,950.00	
YUHAN CORPORATION	582	195,000.000000	113,490,000.00	
韓国ウォン 小計	475,489		35,828,753,650.00 (3,281,913,834)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	113,168	24.100000	2,727,348.80	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	352,589	25.900000	9,132,055.10	
ADVANTECH CO LTD	25,000	140.000000	3,500,000.00	
ASIA CEMENT CORP	124,915	37.500000	4,684,312.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	40,774	346.000000	14,107,804.00	
AU OPTRONICS CORP	440,000	13.250000	5,830,000.00	
CAPITAL SECURITIES CORP	200,000	10.750000	2,150,000.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	34,000	160.000000	5,440,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	408,887	40.100000	16,396,368.70	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	50,000	95.800000	4,790,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	306,608	17.200000	5,273,657.60	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	103,968	99.800000	10,376,006.40	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	32,000	60.600000	1,939,200.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	41,400	82.400000	3,411,360.00	
CHINA AIRLINES LTD	180,000	11.600000	2,088,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	755,255	8.410000	6,351,694.55	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	112,784	30.650000	3,456,829.60	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	129,250	16.150000	2,087,387.50	
CHINA STEEL CORP	687,214	25.950000	17,833,203.30	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	739,605	18.200000	13,460,811.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	228,000	96.000000	21,888,000.00	
CLEVO COMPANY	8,403	54.600000	458,803.80	
COMPAL ELECTRONICS	231,775	18.800000	4,357,370.00	
CTCI CORP	50,000	61.300000	3,065,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	102,220	145.000000	14,821,900.00	
E INK HOLDINGS INC	48,000	21.150000	1,015,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	247,170	17.700000	4,374,909.00	
EPISTAR CORP	40,000	54.500000	2,180,000.00	
ETERNAL CHEMICAL CO LTD	50,000	26.000000	1,300,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	132,000	17.200000	2,270,400.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	153,999	17.100000	2,633,382.90	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	71,656	28.000000	2,006,368.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	139,410	32.700000	4,558,707.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	88,000	73.700000	6,485,600.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	8,000	56.900000	455,200.00	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	7,000	53.400000	373,800.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	420,477	18.300000	7,694,729.10	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	181,000	73.700000	13,339,700.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,150	82.900000	5,069,335.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	240,000	74.000000	17,760,000.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	80,000	27.950000	2,236,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	50,300	80.800000	4,064,240.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	346,087	41.400000	14,328,001.80	
GIANT MANUFACTURING	12,000	186.500000	2,238,000.00	
HERMES MICROVISION INC	2,000	859.000000	1,718,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	36,000	67.000000	2,412,000.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10,815	212.000000	2,292,780.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	505,336	80.500000	40,679,548.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	287.000000	3,731,000.00	
HTC CORP	43,744	279.000000	12,204,576.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	325,077	17.350000	5,640,085.95	
INNOLUX CORP	410,112	18.600000	7,628,083.20	
INVENTEC CORP	200,429	12.050000	2,415,169.45	
KINSUS INTERCONNECT TECH	25,000	107.500000	2,687,500.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,020	845.000000	5,086,900.00	
LCY CHEMICAL CORP	42,000	36.400000	1,528,800.00	

LITE-ON TECHNOLOGY CORP	123,182	51.300000	6,319,236.60	
MACRONIX INTERNATIONAL	186,836	8.070000	1,507,766.52	
MEDIA TEK INC	69,042	369.000000	25,476,498.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	486,754	23.400000	11,390,043.60	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	13,000	192.000000	2,496,000.00	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	15,320	257.000000	3,937,240.00	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	53,104	35.800000	1,901,123.20	
NAN YA PLASTICS CORP	263,750	62.100000	16,378,875.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	36,000	141.500000	5,094,000.00	
ORIENTAL UNION CHEMICAL	40,000	32.900000	1,316,000.00	
PEGATRON CORP	86,976	50.700000	4,409,683.20	
PHISON ELECTRONICS CORP	7,000	227.000000	1,589,000.00	
POU CHEN	150,500	31.850000	4,793,425.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	36,300	53.900000	1,956,570.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	30,000	194.000000	5,820,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	132,150	63.100000	8,338,665.00	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	25,750	117.000000	3,012,750.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,350	87.300000	3,086,055.00	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	4,200	160.000000	672,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,000	57.300000	3,151,500.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	35,000	69.500000	2,432,500.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	19,000	71.000000	1,349,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	400,000	9.920000	3,968,000.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	175,000	35.000000	6,125,000.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	18,150	135.000000	2,450,250.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	308,800	15.100000	4,662,880.00	
STANDARD FOODS CORP	25,000	101.000000	2,525,000.00	
SYNEX TECHNOLOGY INTL CORP	68,137	50.500000	3,440,918.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	332,707	13.450000	4,474,909.15	
TAIWAN BUSINESS BANK	240,000	9.150000	2,196,000.00	
TAIWAN CEMENT	191,706	39.200000	7,514,875.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	320,340	17.050000	5,461,797.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	42,000	74.100000	3,112,200.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	68,970	30.000000	2,069,100.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,400	110.000000	10,604,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,428,000	114.500000	163,506,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	140,000	28.000000	3,920,000.00	
TPK HOLDING CO LTD	13,442	586.000000	7,877,012.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	14,000	100.500000	1,407,000.00	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	27,750	69.700000	1,934,175.00	
TSRC CORP	33,000	59.000000	1,947,000.00	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	60,000	28.800000	1,728,000.00	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	7,000	47.100000	329,700.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	95,000	31.350000	2,978,250.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	248,574	60.100000	14,939,297.40	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	720,000	12.600000	9,072,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	190,000	9.090000	1,727,100.00	
WAN HAI LINES LTD	80,000	17.200000	1,376,000.00	
WINTEK CORP	76,994	14.850000	1,143,360.90	
WISTRON CORP	129,943	29.200000	3,794,335.60	
WPG HOLDINGS LTD	65,400	35.150000	2,298,810.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	436,909	15.700000	6,859,471.30	
YULON MOTOR COMPANY	58,000	52.000000	3,016,000.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,000	73.600000	1,472,000.00	
ニュー台湾ドル 小計	17,529,033		768,393,501.42 (2,627,905,774)	
インドルピー				
ACC LTD	2,200	1,239.050000	2,725,910.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,000	226.300000	2,941,900.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	24,000	151.100000	3,626,400.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	35,000	189.250000	6,623,750.00	
ASIAN PAINTS LTD	2,000	4,716.250000	9,432,500.00	
AXIS BANK LTD	17,100	1,472.450000	25,178,895.00	
BAJAJ AUTO LTD	5,000	1,862.000000	9,310,000.00	
BANK OF BARODA	5,200	703.450000	3,657,940.00	
BANK OF INDIA	10,000	339.350000	3,393,500.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	22,500	196.150000	4,413,375.00	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,000	418.350000	5,020,200.00	
BHARTI AIRTEL LTD	30,000	325.450000	9,763,500.00	
CAIRN INDIA LTD	28,000	304.100000	8,514,800.00	

CANARA BANK	6,000	424.450000	2,546,700.00	
CIPLA LTD	25,000	401.800000	10,045,000.00	
COAL INDIA LTD	32,000	303.650000	9,716,800.00	
DABUR INDIA LTD	35,000	162.550000	5,689,250.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,500	1,083.350000	2,708,375.00	
DLF LTD	30,000	237.050000	7,111,500.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,000	2,091.700000	12,550,200.00	
GAIL INDIA LTD	15,000	341.100000	5,116,500.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,000	846.950000	6,775,600.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,500	772.650000	10,430,775.00	
HDFC BANK LIMITED	77,000	702.800000	54,115,600.00	
HERO MOTOCORP LTD	3,500	1,709.100000	5,981,850.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	55,000	106.300000	5,846,500.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	52,000	586.100000	30,477,200.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	86,000	874.500000	75,207,000.00	
ICICI BANK LTD	25,000	1,167.950000	29,198,750.00	
IDEA CELLULAR LTD	50,000	127.450000	6,372,500.00	
IDFC LTD	50,000	153.950000	7,697,500.00	
INFOSYS LTD	21,600	2,361.950000	51,018,120.00	
ITC LTD	130,000	354.150000	46,039,500.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	80,000	76.000000	6,080,000.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	21,000	310.250000	6,515,250.00	
JSW STEEL LTD	5,600	695.250000	3,893,400.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,000	734.800000	9,552,400.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,000	1,563.550000	18,762,600.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	20,000	249.650000	4,993,000.00	
LUPIN LTD	10,000	766.200000	7,662,000.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	18,000	967.600000	17,416,800.00	
NTPC LTD	64,000	154.150000	9,865,600.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	48,000	328.650000	15,775,200.00	
POWER FINANCE CORPORATION	20,000	197.650000	3,953,000.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	70,000	112.200000	7,854,000.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	8,000	448.950000	3,591,600.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	66,000	814.100000	53,730,600.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,000	407.150000	2,850,050.00	
RELIANCE POWER LTD	40,000	80.000000	3,200,000.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	23,000	233.250000	5,364,750.00	
SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	35,000	113.850000	3,984,750.00	
SESA GOA LTD	17,000	164.300000	2,793,100.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	10,000	761.600000	7,616,000.00	
SIEMENS LTD	6,000	573.050000	3,438,300.00	
STATE BANK OF INDIA	7,800	2,305.700000	17,984,460.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	90,000	97.800000	8,802,000.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,000	952.750000	17,149,500.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,000	1,489.650000	41,710,200.00	
TATA MOTORS LTD	45,000	307.550000	13,839,750.00	
TATA POWER CO LTD	75,000	94.250000	7,068,750.00	
TATA STEEL LTD	20,000	318.700000	6,374,000.00	
TITAN INDUSTRIES LTD	17,000	288.600000	4,906,200.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	2,300	1,980.300000	4,554,690.00	
UNITECH LTD	110,000	28.850000	3,173,500.00	
UNITED BREWERIES LTD	4,200	755.950000	3,174,990.00	
UNITED SPIRITS LTD	5,700	2,339.250000	13,333,725.00	
WIPRO LTD	29,500	355.000000	10,472,500.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	32,000	243.050000	7,777,600.00	
インドルピー 小計	2,007,200		838,462,155.00 (1,567,924,229)	
チェコルナ				
CEZ AS	10,000	562.200000	5,622,000.00	
KOMERCNI BANKA AS	1,000	3,630.000000	3,630,000.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	4,600	284.800000	1,310,080.00	
チェコルナ 小計	15,600		10,562,080.00 (54,077,849)	
コロンビアペソ				
ALMACENES EXITO SA	13,000	28,200.000000	366,600,000.00	
BANCO DAVIVIENDA SA	6,500	24,480.000000	159,120,000.00	
BANCOLOMBIA SA	14,000	28,320.000000	396,480,000.00	
BANCOLOMBIA SA-PREF	20,000	29,060.000000	581,200,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	26,000	7,880.000000	204,880,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	5,000	35,300.000000	176,500,000.00	

CORP FINANCIERA COLOMBIANA-NEW	134	34,300.000000	4,596,200.00	
ECOPETROL SA	250,000	4,135.000000	1,033,750,000.00	
GRUPO ARGOS SA	18,000	20,480.000000	368,640,000.00	
GRUPO ARGOS SA-PRF	5,000	20,200.000000	101,000,000.00	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	50,000	1,270.000000	63,500,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	15,000	37,620.000000	564,300,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	3,500	38,600.000000	135,100,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	25,000	8,200.000000	205,000,000.00	
ISAGEN SA ESP	60,000	2,580.000000	154,800,000.00	
コロンビアペソ 小計	511,134		4,515,466,200.00 (251,059,920)	
ハンガリーフォリント				
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	35,000	348.000000	12,180,000.00	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,600	16,550.000000	43,030,000.00	
OTP BANK PLC	13,000	4,864.000000	63,232,000.00	
ハンガリーフォリント 小計	50,600		118,442,000.00 (53,441,030)	
ポーランドズロチ				
ASSECO POLAND SA	5,700	43.400000	247,380.00	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,900	100.000000	290,000.00	
BANK MILLENNIUM SA	45,000	4.980000	224,100.00	
BANK PEKAO SA	7,800	150.700000	1,175,460.00	
BANK ZACHODNI WBK SA	1,700	267.200000	454,240.00	
BRE BANK SA	1,000	354.500000	354,500.00	
CYFROWY POLSAT SA	9,500	17.750000	168,625.00	
ENEA SA	8,000	14.000000	112,000.00	
EUROCASH SA	3,500	53.000000	185,500.00	
GRUPA AZOTY SA	2,500	66.000000	165,000.00	
GRUPA LOTOS SA	4,000	38.800000	155,200.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	3,000	78.800000	236,400.00	
KERNEL HOLDING SA	3,500	57.050000	199,675.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	8,400	146.050000	1,226,820.00	
PGE SA	39,500	16.810000	663,995.00	
PKO BANK POLSKI SA	52,000	33.180000	1,725,360.00	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,500	48.320000	942,240.00	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	110,200	5.680000	625,936.00	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,100	448.000000	1,388,800.00	
SYNTHOS SA	40,000	4.800000	192,000.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	60,000	4.210000	252,600.00	
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	44,000	7.550000	332,200.00	
ポーランドズロチ 小計	474,800		11,318,031.00 (360,705,647)	
南アフリカランド				
ABSA GROUP LTD	19,000	150.000000	2,850,000.00	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	46,000	22.600000	1,039,600.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	177.500000	1,242,500.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,400	330.000000	1,452,000.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,300	168.210000	3,582,873.00	
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	18,260	26.990000	492,837.40	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	16,000	215.000000	3,440,000.00	
ASSORE LTD	1,800	325.000000	585,000.00	
AVENG LTD	25,000	30.550000	763,750.00	
BARLOWORLD LTD	15,000	98.800000	1,482,000.00	
BIDVEST GROUP LTD	16,500	261.550000	4,315,575.00	
DISCOVERY LTD	20,000	83.500000	1,670,000.00	
EXXARO RESOURCES LTD	9,500	140.350000	1,333,325.00	
FIRSTSTRAND LTD	183,000	31.600000	5,782,800.00	
GOLD FIELDS LTD	46,000	60.100000	2,764,600.00	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	100,000	29.590000	2,959,000.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	22,000	40.250000	885,500.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	33,000	110.000000	3,630,000.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,000	222.690000	2,226,900.00	
INVESTEC LTD	13,000	68.850000	895,050.00	
KUMBA IRON ORE LTD	4,500	503.000000	2,263,500.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,000	125.500000	753,000.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	54,000	35.800000	1,933,200.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	6,930	196.700000	1,363,131.00	
MMI HOLDINGS LTD	50,000	24.600000	1,230,000.00	
MR PRICE GROUP LTD	15,000	130.500000	1,957,500.00	
MTN GROUP LTD	101,000	173.550000	17,528,550.00	

NASPERS LTD-N SHS	23,600	644.000000	15,198,400.00	
NEDBANK GROUP LTD	11,500	184.000000	2,116,000.00	
NETCARE LTD	55,900	20.480000	1,144,832.00	
NORTHAM PLATINUM LTD	20,000	31.900000	638,000.00	
PICK N PAY STORES LTD	19,000	40.550000	770,450.00	
PPC LTD	24,200	35.000000	847,000.00	
REDEFINE PROPERTIES LTD	170,000	11.390000	1,936,300.00	
REMGRO LTD	24,000	194.250000	4,662,000.00	
REUNERT LTD	11,000	71.300000	784,300.00	
RMB HOLDINGS LTD	43,000	40.930000	1,759,990.00	
RMI HOLDINGS	56,500	24.440000	1,380,860.00	
SANLAM LTD	100,000	46.500000	4,650,000.00	
SAPPI LIMITED	42,700	24.600000	1,050,420.00	
SASOL LTD	30,800	409.140000	12,601,512.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	24,500	176.500000	4,324,250.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	11,000	120.150000	1,321,650.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	71,334	115.500000	8,239,077.00	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	68,147	22.990000	1,566,699.53	
THE FOSCHINI GROUP LTD	11,000	108.650000	1,195,150.00	
TIGER BRANDS LTD	10,300	300.000000	3,090,000.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	27,700	90.000000	2,493,000.00	
VODACOM GROUP LTD	22,400	110.600000	2,477,440.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	46,000	74.180000	3,412,280.00	
南アフリカランド 小計	1,788,771		148,081,801.93 (1,651,112,091)	
トルコリラ				
AKBANK T.A.S.	109,666	9.980000	1,094,466.68	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	13,000	28.500000	370,500.00	
ARCELIC AS	13,000	13.500000	175,500.00	
ASYA KATILIM BANKASI AS	55,000	2.240000	123,200.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	6,000	93.250000	559,500.00	
COCA-COLA ICECEK AS	4,500	55.000000	247,500.00	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	15,554	5.520000	85,858.08	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	53,952	2.070000	111,680.64	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,500	26.500000	172,250.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	50,000	12.200000	610,000.00	
KOC HOLDING AS	38,350	11.300000	433,355.00	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	2,500	32.000000	80,000.00	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	8,500	10.900000	92,650.00	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	8,000	12.900000	103,200.00	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,500	52.250000	444,125.00	
TURK HAVA YOLLARI AO	29,856	8.040000	240,042.24	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	30,000	3.200000	96,000.00	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	32,000	8.660000	277,120.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	46,000	11.050000	508,300.00	
TURKIYE GARANTI BANKASI	138,000	10.450000	1,442,100.00	
TURKIYE HALK BANKASI	39,000	20.850000	813,150.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	92,726	7.420000	688,026.92	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,000	6.900000	351,900.00	
YAPI VE KREDI BANKASI	54,000	6.000000	324,000.00	
トルコリラ 小計	905,604		9,444,424.56 (533,798,876)	
ユーロ				
MAROC TELECOM	9,000	9.960000	89,640.00	
ユーロ 小計	9,000		89,640.00 (11,844,133)	
合計	103,883,890		23,651,055,301 (23,651,055,301)	

(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
該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 42銘柄	100.00%	7.47%
香港ドル	株式 138銘柄	100.00%	18.49%
マレーシアリングット	株式 42銘柄	100.00%	3.82%
タイバーツ	株式 22銘柄	100.00%	2.82%
フィリピンペソ	株式 18銘柄	100.00%	1.10%
インドネシアルピア	株式 26銘柄	100.00%	3.05%
メキシコペソ	株式 25銘柄	100.00%	5.27%
ブラジルレアル	株式 81銘柄	100.00%	12.16%
チリペソ	株式 22銘柄	100.00%	1.87%
韓国ウォン	株式 103銘柄	100.00%	13.88%
ニュー台湾ドル	株式 110銘柄	100.00%	11.11%
インドルピー	株式 68銘柄	100.00%	6.63%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	0.23%
コロンビアペソ	株式 15銘柄	100.00%	1.06%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%	0.23%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.00%	1.53%
南アフリカランド	株式 50銘柄	100.00%	6.98%
トルコリラ	株式 24銘柄	100.00%	2.26%
ユーロ	株式 1銘柄	100.00%	0.05%

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
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年5月31日現在

(単位:円)

資産総額	279,718,913
負債総額	559,090
純資産総額(-)	279,159,823
発行済口数	228,695,695 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2207 (1万口当たり 12,207)

<参考>

「新興国株式インデックスマザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成25年5月31日現在

(単位:円)

資産総額	23,419,758,316
負債総額	19,009,449
純資産総額(-)	23,400,748,867
発行済口数	12,276,077,171 口
1口当たり純資産価額(/)	1.9062 (1万口当たり 19,062)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り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り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。

したがって、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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、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

譲渡制限はありません。

（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ます。

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ます。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ます。

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たと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）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）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25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、124,098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、運用部門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

運用部門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（5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。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成25年5月末現在のものであり、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」に定める投資助言業務を行っています。

平成25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	406	6,743,741
追加型公社債投資信託	18	686,919
単位型株式投資信託	6	114,768
単位型公社債投資信託	3	83,626
合計	433	7,629,055

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。

なお、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28期事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25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27期 (平成24年3月31日現在)		第28期 (平成25年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	14,298,590	2	22,261,065
有価証券	2	8,000,000	2	8,000,000
前払費用		154,925		159,117
未収入金		13,813		5,504
未収委託者報酬		3,977,324		4,489,181
未収収益	2	42,563	2	47,936
繰延税金資産		339,052		402,791
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		27,621		39,167
流動資産合計		26,883,891		35,434,764
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	281,399	1	270,058
器具備品	1	177,757	1	171,754
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,664,188		1,646,844
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		881,368		857,424
ソフトウェア仮勘定		402,721		430,432
その他		24		
無形固定資産合計		1,299,937		1,303,679
投資その他の資産				
投資有価証券		14,456,313		15,689,317
関係会社株式		320,136		320,136
長期性預金	2	8,500,000	2	3,500,000
長期差入保証金	2	837,456	2	825,804
繰延税金資産		139,650		
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		24,268,591		20,350,294
固定資産合計		27,232,718		23,300,818
資産合計		54,116,609		58,735,583

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	79,079	75,221
未払金		
未払収益分配金	185,817	33,936
未払償還金	1,159,445	1,004,879
未払手数料	2 1,557,726	2 1,761,746
その他未払金	50,899	84,763
未払費用	2 1,174,572	2 1,333,574
未払消費税等	63,602	128,077
未払法人税等	1,532,874	1,686,070
賞与引当金	520,000	594,000
その他	278,521	348,389
流動負債合計	6,602,539	7,050,661
固定負債		
退職給付引当金	119,902	119,776
役員退職慰労引当金	49,735	65,103
時効後支払損引当金	195,228	201,877
繰延税金負債		251,776
固定負債合計	364,866	638,533
負債合計	6,967,405	7,689,194
(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	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
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	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計	44,203,921	47,026,806
株主資本合計	46,426,148	49,249,033
評価・換算差額等		
その他有価証券	723,054	1,797,355
評価差額金		
評価・換算差額等合計	723,054	1,797,355
純資産合計	47,149,203	51,046,388
負債純資産合計	54,116,609	58,735,583

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		47,476,170		48,411,166
投資顧問料		15,335		13,601
その他営業収益		153,305		138,788
営業収益合計		47,644,812		48,563,556
営業費用				
支払手数料	2	19,292,904	2	19,724,426
広告宣伝費		516,886		543,508
公告費		7,961		1,748
調査費				
調査費		909,999		942,478
委託調査費		9,975,300		10,699,987
事務委託費		306,137		242,537
営業雑経費				
通信費		90,066		89,308
印刷費		400,552		443,177
協会費		40,636		39,963
諸会費		7,593		7,621
事務機器関連費		958,507		971,457
その他営業雑経費		16,396		8,989
営業費用合計		32,522,943		33,715,204
一般管理費				
給料				
役員報酬		202,812		198,915
給料・手当		3,623,556		3,740,875
賞与引当金繰入		520,000		594,000
福利厚生費		520,897		593,073
交際費		26,743		23,259
旅費交通費		153,892		139,968
租税公課		102,255		115,450
不動産賃借料		698,539		699,860
退職給付費用		142,883		162,650
役員退職慰労引当金繰入		22,805		19,007
固定資産減価償却費		481,601		442,844
諸経費		247,162		270,874
一般管理費合計		6,743,148		7,000,782
営業利益		8,378,719		7,847,569

(単位：千円)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		153,215		213,088
有価証券利息	2	8,160	2	6,698
受取利息	2	25,661	2	25,684
投資有価証券償還益		1,876		6,072
収益分配金等時効完成分		318,285		412,323
その他		7,856		1,935
営業外収益合計		515,056		665,802
営業外費用				
投資有価証券償還損				8,689
時効後支払損引当金繰入		15,288		16,881
事務過誤費		7,845		186
その他		82		45
営業外費用合計		23,216		25,802
経常利益		8,870,559		8,487,569
特別利益				
投資有価証券売却益		150,103		334,775
特別利益合計		150,103		334,775
特別損失				
投資有価証券売却損		153,276		32,155
関係会社株式売却損		13,563		
投資有価証券評価損		1,925		
固定資産除却損	1	17,034	1	253
その他		412		
特別損失合計		186,212		32,409
税引前当期純利益		8,834,449		8,789,934
法人税、住民税及び事業税		3,510,046		3,441,310
法人税等調整額		175,067		55,499
法人税等合計		3,685,113		3,385,811
当期純利益		5,149,336		5,404,123

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	34,903,313	36,863,331
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計		
当期首残高	42,243,903	44,203,921
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	44,203,921	47,026,806
株主資本合計		
当期首残高	44,466,131	46,426,148
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	46,426,148	49,249,033
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	391,537	723,054
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
評価・換算差額等合計		
当期首残高	391,537	723,054
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300

当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
純資産合計		
当期首残高	44,857,668	47,149,203
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	2,291,534	3,897,185
当期末残高	47,149,203	51,046,388

[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。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(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) 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。

(2) 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。

数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。

(3) 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。

(4) 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

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

(会計方針の変更)

法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

(未適用の会計基準等)

- ・「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日)
- ・「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日)

(1)概要

本会計基準等は、財務報告を改善する観点及び国際的な動向を踏まえ、退職給付債務の計算方法並びに開示の拡充を中心に改正されたものです。

(2)適用予定日

平成26年3月期の期末より適用予定です。ただし、退職給付債務の計算方法の改正については、平成27年3月期の期首より適用予定です。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中です。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
建物	208,976千円	233,990千円
器具備品	294,294千円	351,481千円

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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
預金	11,773,728千円	19,410,015千円
有価証券	8,000,000千円	8,000,000千円
未収収益	42,563千円	40,120千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	8,500,000千円	3,500,000千円
長期差入保証金	828,908千円	816,823千円
未払手数料	851,491千円	927,107千円
未払費用	135,926千円	148,712千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
器具備品	1,144千円	253千円
ソフトウェア	15,890千円	-
計	17,034千円	253千円

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27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
支払手数料	10,760,427千円	10,230,968千円
有価証券利息	6,532千円	5,170千円
受取利息	25,661千円	25,684千円

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日至平成24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	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成23年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	3,189,318千円
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30日

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

平成24年6月26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	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

第28期（自平成24年4月1日至平成25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	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成24年6月26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	2,581,238千円
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27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25年6月24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	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

（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27期（平成24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	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

第28期（平成25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	22,261,065	22,261,065	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,489,181	4,489,181	-
(4) 長期性預金	3,500,000	3,505,795	5,795
(5) 投資有価証券	15,650,417	15,650,417	-
資産計	53,900,663	53,906,459	5,795
(1) 未払手数料	1,761,746	1,761,746	-
(2) 未払法人税等	1,686,070	1,686,070	-
負債計	3,447,816	3,447,816	-

（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、(2)有価証券、(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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4)長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5)投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
非上場株式	38,900	38,900
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、「(5) 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27期（平成24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	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
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				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

第28期（平成25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	22,261,065	-	-	-
未収委託者報酬	4,489,181	-	-	-
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				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	4,150,204	2,167,462	2,151,428
長期性預金	-	3,500,000	-	-
合計	34,750,246	7,650,204	2,167,462	2,151,428

(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27期（平成24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	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
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	3,325,285	3,446,474	121,188
	小計	3,325,285	3,446,474	121,188
合計		14,417,413	13,440,240	977,173

第28期（平成25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	12,625,086	10,181,990	2,443,096
	小計	12,625,086	10,181,990	2,443,096
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	3,025,331	3,033,767	8,436
	小計	3,025,331	3,033,767	8,436
合計		15,650,417	13,215,757	2,434,660

3. 売却したその他有価証券

第27期（自平成23年4月1日至平成24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	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合計	3,195,269	150,103	153,276

第28期（自平成24年4月1日至平成25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	7,033,368	334,775	32,155
合計	7,033,368	334,775	32,155

（デリバティブ取引関係）
重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付年金制度へ移行しました。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
(1)退職給付債務	475,564	382,988
(2)年金資産	198,994	143,462
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	276,569	239,525
(4)未認識数理計算上の差異	156,666	119,749
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	119,902	119,776
(6)退職給付引当金	119,902	119,776

3. 退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
(1)勤務費用	27,806	26,748
(2)利息費用	8,420	7,087
(3)期待運用収益	4,635	2,984
(4)数理計算上の差異の費用処理額	13,599	27,653
(5)退職給付費用	45,191	58,504
(6)その他	97,692	104,146
(7)合計	142,883	162,650

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

（2）割引率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

（3）期待運用収益率

第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1.5%	1.5%

（4）数理計算上の差異の処理年数

8年（各事業年度の発生時における従業員の平均支払期間以内の一定の年数による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。）

（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27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	557,868千円	542,460千円
投資有価証券評価損	362,665	226,404
ゴルフ会員権評価損	8,505	8,505
未払事業税	109,608	140,336
賞与引当金	197,652	225,779
役員退職慰労引当金	17,725	23,202

		有価証券届出書(内国投資信託受益証券)
退職給付引当金	42,783	45,495
減価償却超過額	19,890	10,083
委託者報酬	99,265	124,166
長期差入保証金	21,895	26,203
時効後支払損引当金	69,579	71,948
その他	39,304	48,666
繰延税金資産 小計	1,546,744	1,493,253
評価性引当額	813,923	704,932
繰延税金資産 合計	732,821	788,320
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	254,118	637,305
繰延税金負債 合計	254,118	637,305
繰延税金資産の純額	478,702	151,015

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第27期(自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日 至 平成25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27期(自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日 至 平成25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]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(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27期（自平成23年4月1日至平成24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	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 50.0%	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	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	667,780 千円	長期差入保証金	812,027 千円
							投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却		98,112 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 25.0%	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	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	6,532 千円	未収収益	544 千円
								マルチコーラブル預金の預入	7,000,000 千円	現金及び預金	5,500,000 千円
										長期性預金	8,500,000 千円
			マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,415 千円	未収収益	2,886 千円					

第28期（自平成24年4月1日至平成25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	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 50.0%	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,556,241 千円	未払手数料	324,725 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	671,086 千円	長期差入保証金	812,027 千円
							投資の助言	投資助言料	167,142 千円	未払費用	85,301 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 25.0%	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,674,726 千円	未払手数料	602,382 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	30,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	5,170 千円	未収収益	717 千円
								マルチコーラブル預金の預入	5,500,000 千円	現金及び預金	10,500,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,246 千円	未収収益	2,301 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。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は3ヶ月～3年であります。

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第27期(自平成23年4月1日至平成24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	3,914,481千円	未払手数料	285,874千円

第28期(自平成24年4月1日至平成25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	3,513,173千円	未払手数料	321,822千円

(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、大阪証券取引所、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27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	379,935.23円	411,339.33円
1株当たり当期純利益金額	41,494.11円	43,547.22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27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益金額(千円)	5,149,336	5,404,123
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)	5,149,336	5,404,123
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常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

平成25年6月21日付で、定款について次の変更を行いました。

- ・公告方法の変更(日本経済新聞に掲載する方法から電子公告(ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告による公告ができない場合は日本経済新聞に掲載する方法による)に変更)

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25年3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25年3月末現在)	事業の内容
株式会社北海道銀行	93,524 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社千葉銀行	145,069 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社八十二銀行	52,243 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	50,710 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。

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25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50.0%（62,050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、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (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のほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）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25年6月26日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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」に掲げられている新興国株式インデックスオープンの平成24年5月15日から平成25年5月13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、新興国株式インデックスオープンの平成25年5月13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、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月24日

三菱UFJ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	長島 拓也	印
--------------------	-------	-------	---

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28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投信株式会社の平成25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。