

【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4月26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受益 e M A X I S 全世界株式インデックス
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受益 継続募集額 上限1兆円
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】

e M A X I S 全世界株式インデックス(「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：e世界株)

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/>

e M A X I S 専用サイト <http://maxis.muam.jp/e/>

(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】

申込手数料はかかりません。

(6) 【申込単位】

申込単位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1口単位とします。

(7) 【申込期間】

平成25年4月27日から平成26年4月25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、下記にてご確認ください。

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經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

(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 オール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

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		
追加型	海外	不動産投信	MRF	特殊型 ()
	内外	その他資産 ()	ETF	
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年1回 年2回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般	年4回 年6回 (隔月)	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
公債 社債 その他債券 クレジット 属性 () 不動産投信	年12回 (毎月) 日々 その他 ()	アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング			その他 (MSCI オール・カン トリー・ワー ルド・イン デックス(除 く日本、円換 算ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
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（BBB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の

です。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本を除く先進国および新興国の株式市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

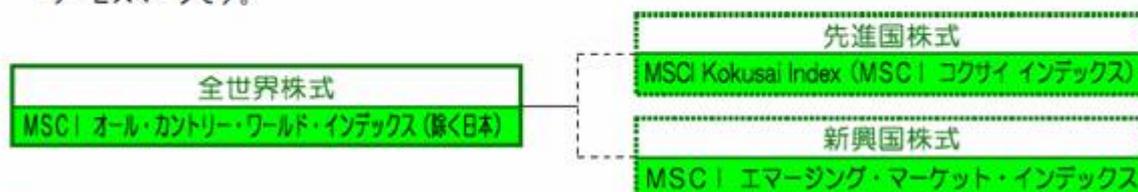
1 MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

- MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとします。

■ MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国・新興国の株式で構成されています。

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本)はMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。



■ 上記はMSCI インデックスの構造についてのイメージ図であり、各インデックスの比率は変動します。

2 日本を除く先進国ならびに新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)への投資を行います。

- 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、Depositary 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。

3 原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデクスマザーファンドならびに新興国株式インデクスマザーファンドへの投資を通じて、日本を除く先進国および新興国の株式に実質的に投資を行うファミリーファンド方式により行います。



- ・ 外国株式インデクスマザーファンドは、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。
- ・ 新興国株式インデクスマザーファンドは、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

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(1月26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。

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

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

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

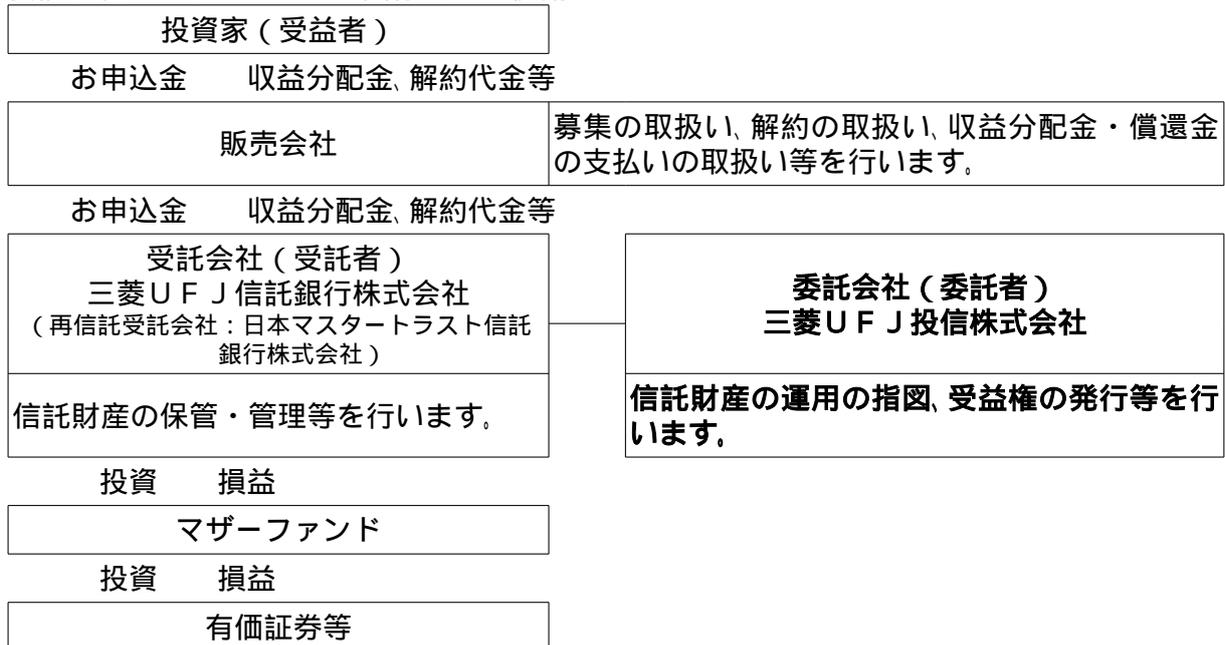
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成22年7月20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2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2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】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券および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、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。

外国株式インデックスマザーファンド受益証券および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、日本を除く先進国および新興国の株式等に実質的な投資を行い、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（除く日本、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は行いません。

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外国株式インデックスマザーファンドおよび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券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

11. コマーシャル・ペーパー

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

び新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券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

< マザーファンドの概要 >

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

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

（運用方法）

投資対象

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

投資態度

投資成果をMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算

ベース)の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため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行うことができます。

新興国株式インデックスマザーファンド

(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(預託証券)を含みます。以下同じ。)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。

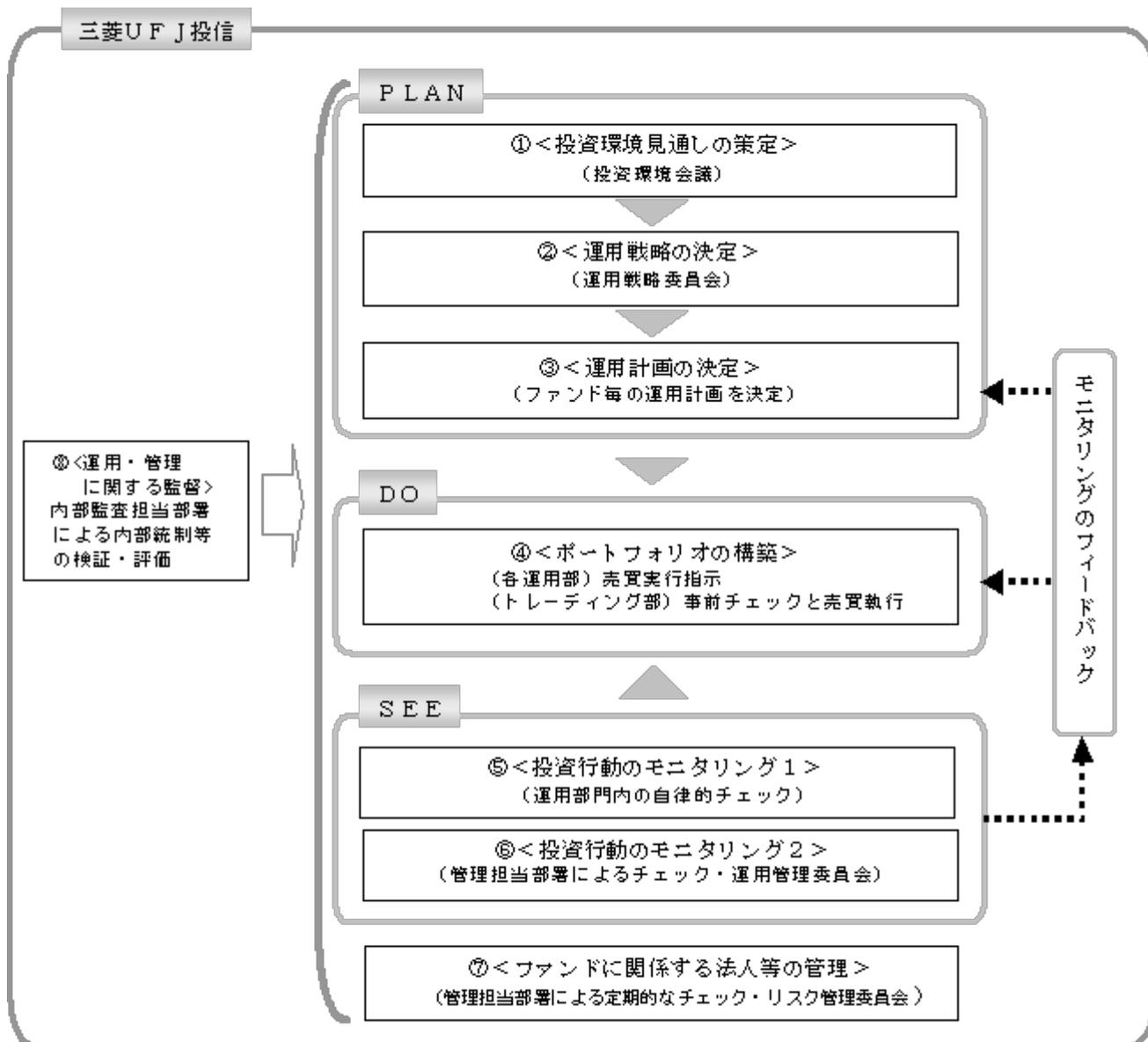
有価証券先物取引等を行うことができます。

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。

金利先渡取引および為替先渡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4月27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券により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債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場合があります。

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。

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 オール・カントリー・ワールド・インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

「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】

申込手数料はかかりません。

（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0.05%）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0.63%（税抜 年0.6%）

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。

取扱純資産総額（注）	委託会社	販売会社	受託会社
50億円未満の部分	年0.2835% （税抜 年0.27%）	年0.2835% （税抜 年0.27%）	年0.063% （税抜 年0.06%）
50億円以上100億円未満の部分	年0.273% （税抜 年0.26%）	年0.294% （税抜 年0.28%）	年0.063% （税抜 年0.06%）
100億円以上の部分	年0.2625% （税抜 年0.25%）	年0.3045% （税抜 年0.29%）	年0.063% （税抜 年0.06%）

（注）各販売会社における取扱純資産総額に応じて配分されます。

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

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。

（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。

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。

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

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成25年2月28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	1,781,277,187	99.97
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		616,209	0.03
純資産総額		1,781,893,396	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2月28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	外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		1,165,378,862	1.3046 1.3209	1,520,372,525 1,539,348,938		86.39
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		135,420,235	1.7896 1.7865	242,359,886 241,928,249		13.58

(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2月28日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

(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2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成23年1月26日)	263,742,117 (分配付) 263,742,117 (分配落)	11,153 (分配付) 11,153 (分配落)
第2計算期間末日 (平成24年1月26日)	1,011,861,717 (分配付) 1,011,861,717 (分配落)	10,227 (分配付) 10,227 (分配落)
第3計算期間末日 (平成25年1月28日)	1,706,615,349 (分配付) 1,706,615,349 (分配落)	13,735 (分配付) 13,735 (分配落)
平成24年2月末日	1,110,949,076	11,127
3月末日	1,122,579,461	11,321
4月末日	1,125,723,804	11,103
5月末日	1,016,463,317	9,861
6月末日	1,077,720,768	10,060
7月末日	1,158,479,356	10,428
8月末日	1,183,567,762	10,629
9月末日	1,213,747,810	10,970
10月末日	1,260,969,289	11,133
11月末日	1,342,497,795	11,590
12月末日	1,424,720,852	12,453
平成25年1月末日	1,718,043,883	13,782

2月末日	1,781,893,396	13,880
------	---------------	--------

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.53
第2計算期間	8.30
第3計算期間	34.30

(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	275,183,096	38,699,375	236,483,721
第2計算期間	1,094,884,113	341,989,163	989,378,671
第3計算期間	768,791,890	515,630,684	1,242,539,877

<参考>

「外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2月28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	アメリカ	92,780,825,864	55.79
	イギリス	16,302,882,416	9.80
	カナダ	8,289,953,972	4.98
	スイス	6,853,787,090	4.12
	フランス	6,512,094,511	3.92
	オーストラリア	6,481,053,643	3.90
	ドイツ	6,415,899,307	3.86
	スウェーデン	2,502,579,985	1.50
	香港	2,299,804,437	1.38
	スペイン	2,181,830,779	1.31
	オランダ	2,053,576,932	1.23
	イタリア	1,506,981,436	0.91
	シンガポール	1,300,819,624	0.78
	デンマーク	914,237,497	0.55
	ベルギー	891,213,304	0.54
	ノルウェー	696,261,969	0.42
	フィンランド	610,166,905	0.37
	イスラエル	403,355,499	0.24
	ルクセンブルグ	232,937,901	0.14
	オーストリア	221,418,464	0.13
	アイルランド	199,367,895	0.12
	ポルトガル	125,180,802	0.08
ニュージーランド	102,146,431	0.06	
ギリシャ	37,981,684	0.02	
投資証券	アメリカ	2,599,416,196	1.56
	オーストラリア	502,818,803	0.30
	フランス	212,832,056	0.13
	イギリス	186,983,249	0.11
	香港	79,379,834	0.05
	シンガポール	74,617,351	0.04

	カナダ	36,223,958	0.02
	オランダ	18,770,189	0.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,682,774,439	1.63
純資産総額		166,310,174,422	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2月28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)	2,530,569,296	1.52

(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2月28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)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	67,600	52,449.46 41,127.17	3,545,584,144 2,780,196,739		1.67
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	333,000	7,680.18 8,282.42	2,557,500,006 2,758,045,959		1.66
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	762,000	1,758.61 2,161.95	1,340,064,706 1,647,412,529		0.99
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	141,800	9,490.60 10,791.29	1,345,767,207 1,530,205,134		0.92
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	232,463	5,491.60 6,416.17	1,276,595,112 1,491,522,591		0.90
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	78,300	18,588.03 18,717.54	1,455,443,085 1,465,584,031		0.88
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	198,800	5,887.33 7,100.14	1,170,402,476 1,411,508,329		0.85
アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	198,700	5,939.14 7,060.36	1,180,107,515 1,402,894,167		0.84
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	544,500	2,875.21 2,572.70	1,565,552,280 1,400,836,837		0.84
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	18,900	55,947.27 73,987.64	1,057,403,454 1,398,366,543		0.84
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	415,900	3,108.33 3,316.48	1,292,756,942 1,379,325,487		0.83
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	538,400	2,093.50 2,535.69	1,127,141,099 1,365,220,395		0.82
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,321,441	774.84 1,017.68	1,023,908,515 1,344,807,380		0.81
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	274,200	3,405.29 4,558.89	933,731,368 1,250,048,405		0.75
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	362,100	3,074.10 3,249.87	1,113,134,253 1,176,780,208		0.71
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,657	15,629.95 21,111.59	791,766,600 1,069,450,169		0.64
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	292,600	3,577.36 3,557.00	1,046,736,033 1,040,780,979		0.63
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	165,790	4,951.61 6,221.89	820,927,587 1,031,527,723		0.62
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	121,500	7,960.48 8,458.18	967,198,988 1,027,669,999		0.62
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	282,000	2,497.77 3,208.24	704,371,140 904,725,597		0.54
アメリカ	WAL-MART STORES INC	株式	食品・生活必需品 小売り	134,100	5,515.44 6,629.26	739,621,335 888,984,651		0.53
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	205,300	3,808.63 4,287.83	781,913,114 880,293,244		0.53
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	219,400	3,517.23 3,975.15	771,680,305 872,148,941		0.52
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,374,603	581.13 627.38	798,825,515 862,403,535		0.52

アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	211,000	2,704.99 3,900.22	570,753,396 822,946,757		0.49
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	3,544,973	240.03 231.75	850,909,440 821,550,576		0.49
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	各種金融	778,100	696.60 1,045.36	542,024,693 813,396,950		0.49
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	268,276	2,897.23 3,027.07	777,259,099 812,092,659		0.49
オーストラ リア	BHP BILLITON LTD	株式	素材	232,798	3,246.10 3,480.41	755,687,729 810,233,278		0.49
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・ タバコ	112,000	6,183.36 6,982.65	692,537,260 782,057,337		0.47

(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2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	10.85
	素材	6.49
	資本財	7.38
	商業・専門サービス	0.95
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	1.40
	耐久消費財・アパレル	1.41
	消費者サービス	1.65
	メディア	2.73
	小売	2.95
	食品・生活必需品小売り	2.31
	食品・飲料・タバコ	6.85
	家庭用品・パーソナル用品	1.94
	ヘルスケア機器・サービス	2.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.10
	銀行	7.87
	各種金融	5.05
	保険	4.32
	不動産	0.73
	ソフトウェア・サービス	6.11
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.98
	電気通信サービス	3.60
	公益事業	3.37
半導体・半導体製造装置	1.42	
小計	96.16	
投資証券		2.23
合計		98.39

(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2月28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								
S&P 500 (2013年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	43	アメリカドル	16,103,354.00	16,294,850.00	1,507,436,573	0.91
FTSE100 (2013年3月限)	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	29	イギリスポンド	1,824,857.50	1,832,075.00	257,168,367	0.15
SP/TSE60 (2013年3月限)	モントリオール取引所	買建	8	カナダドル	1,164,630.00	1,171,200.00	105,935,040	0.06
SPI 200 (2013年3月限)	シドニー先物取引所	買建	12	オーストラリアドル	1,377,048.00	1,506,000.00	142,859,160	0.09
EURO ST (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	130	ユーロ	3,454,907.50	3,395,600.00	413,074,740	0.25
SWISS IX (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	14	スイスフラン	1,040,122.50	1,044,820.00	104,095,416	0.06

(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>

「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2月28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	3,823,401,794	17.79
	韓国	3,184,885,884	14.82
	ブラジル	2,579,301,020	12.00
	台湾	2,224,733,571	10.35
	アメリカ	1,640,482,337	7.63
	南アフリカ	1,514,618,972	7.05
	インド	1,358,851,206	6.32
	メキシコ	1,093,974,659	5.09
	マレーシア	703,548,860	3.27
	インドネシア	611,638,200	2.85
	タイ	558,777,901	2.60
	チリ	414,937,620	1.93
	トルコ	410,006,726	1.91
	ポーランド	322,005,060	1.50
	コロンビア	252,802,920	1.18
	フィリピン	213,618,554	0.99
	チェコ	54,012,250	0.25
ハンガリー	45,943,010	0.21	
モロッコ	10,641,942	0.05	
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		473,191,024	2.21
純資産総額		21,491,373,510	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2月28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）	418,677,132	1.95

(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2月28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	6,390	111,023.99 131,016.60	709,443,644 837,196,074		3.90
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,410,000	265.51 326.04	374,413,871 459,716,400		2.14
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信サービス	355,000	1,031.34 1,013.45	366,169,536 359,775,992		1.67
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	4,251,550	66.09 73.72	281,094,365 313,455,727		1.46
アメリカ	GAZPROM OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	315,000	943.60 827.03	297,328,855 260,517,411		1.21
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	3,816,350	57.86 64.42	221,090,202 245,856,899		1.14
アメリカ	SBERBANK-SPONSORED ADR	株式	銀行	171,500	1,104.56 1,258.13	189,509,565 215,770,324		1.00
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信サービス	2,180,000	124.07 97.21	270,576,984 211,920,852		0.99
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	株式	銀行	125,400	1,380.13 1,622.08	173,099,714 203,409,835		0.95
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	4,440,000	35.79 42.35	158,976,255 188,040,660		0.87
ブラジル	VALE SA-PREF	株式	素材	113,000	1,751.25 1,659.06	197,920,476 187,473,780		0.87
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	59,000	2,688.66 3,151.90	158,637,557 185,962,454		0.87
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,040,000	178.23 178.71	185,470,652 185,859,856		0.86
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	株式	エネルギー	232,000	919.62 786.70	213,438,107 182,516,256		0.85
南アフリカ	MTN GROUP LTD	株式	電気通信サービス	99,000	1,447.18 1,840.18	143,271,736 182,178,136		0.85
アメリカ	LUKOIL OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	30,400	5,143.55 5,966.89	156,386,865 181,393,608		0.84
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	108,186	1,435.35 1,638.00	155,302,092 177,208,668		0.82
ブラジル	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	株式	食品・飲料・ タバコ	42,500	3,648.06 4,042.58	155,047,703 171,809,820		0.80
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	8,750	21,209.93 18,447.00	185,587,082 161,411,250		0.75
香港	PETROCHINA CO LTD-H	株式	エネルギー	1,219,000	123.71 125.98	150,950,775 153,570,595		0.71
南アフリカ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	22,600	4,712.75 6,073.16	106,509,804 137,253,416		0.64
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	246.01 254.90	124,327,861 128,812,167		0.60
ブラジル	VALE SA	株式	素材	71,500	1,815.37 1,731.60	129,802,862 123,809,400		0.58
南アフリカ	SASOL LTD	株式	エネルギー	30,800	3,829.18 3,981.87	117,941,357 122,641,780		0.57
香港	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	株式	エネルギー	1,160,000	92.69 104.14	107,601,898 120,812,724		0.56
韓国	POSCO	株式	素材	3,900	32,422.36 30,244.50	126,447,502 117,953,550		0.55
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	株式	エネルギー	171,000	959.86 689.36	164,193,806 117,881,244		0.55
メキシコ	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	株式	食品・飲料・ タバコ	111,000	814.06 1,046.52	90,368,052 116,164,719		0.54
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	86,000	1,192.09 1,348.27	102,520,122 115,951,693		0.54
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	422,000	238.60 271.40	100,689,200 114,533,965		0.53

(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2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	11.78
	素材	10.81
	資本財	4.52
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.70

自動車・自動車部品	3.35
耐久消費財・アパレル	0.92
消費者サービス	0.49
メディア	1.27
小売	1.63
食品・生活必需品小売り	2.31
食品・飲料・タバコ	5.27
家庭用品・パーソナル用品	1.11
ヘルスケア機器・サービス	0.57
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.71
銀行	19.13
各種金融	2.68
保険	2.87
不動産	2.12
ソフトウェア・サービス	2.66
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.20
電気通信サービス	7.25
公益事業	3.43
半導体・半導体製造装置	7.96
合計	97.80

（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2月28日現在

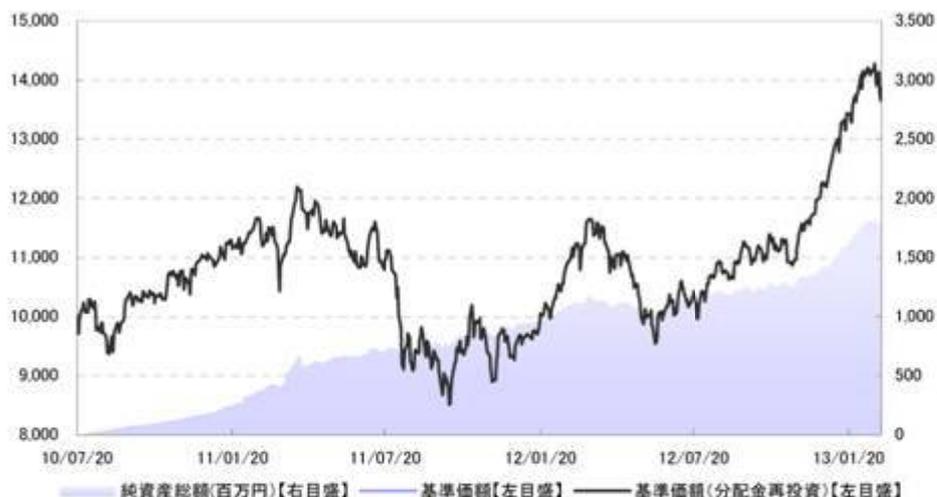
資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2013年3月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	86	アメリカドル	4,591,292.00	4,525,750.00	418,677,132	1.95

（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2月28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)を再投資したもものとして計算

2 分配の推移

2013年1月	0円
2012年1月	0円
2011年1月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

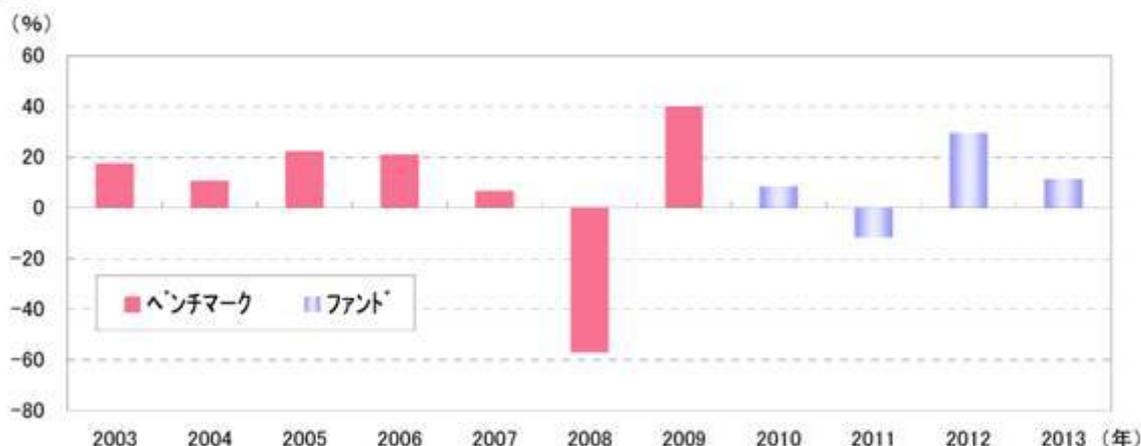
3 主要な資産の状況(2013年2月28日現在)

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	51.5%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.4%
ユーロ	11.2%	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.4%
イギリスポンド	8.7%	3 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	0.9%
カナダドル	4.4%	4 CHEVRON CORP	エネルギー	アメリカ	0.8%
香港ドル	3.7%	5 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.8%
オーストラリアドル	3.7%	6 INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
スイスフラン	3.6%	7 PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	アメリカ	0.7%
韓国ウォン	2.0%	8 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.7%
その他	11.2%	9 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%
合計	100.0%	10 GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	1.6%

・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2月28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/ eMAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/e/
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 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）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	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 × 0.05%
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/ eMAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/e/</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	平成22年7月20日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

(4)【計算期間】

計算期間	原則として、毎年1月27日から翌年1月26日まで 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します。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。
------	---

(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、日本経済新聞に掲載します。 ただし、平成25年6月21日以降は、以下の通り変更される予定です。</p> <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1月27日から平成25年1月28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】

eMAXIS 全世界株式インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 [平成24年1月26日現在]	第3期 [平成25年1月28日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,197,877	16,853,680
親投資信託受益証券	1,011,697,038	1,706,031,067
未収入金	18,204	-
未収利息	11	44
流動資産合計	1,016,913,130	1,722,884,791
資産合計	1,016,913,130	1,722,884,791
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,383,121	12,065,270
未払受託者報酬	265,475	418,270
未払委託者報酬	2,389,163	3,764,357
その他未払費用	13,654	21,545
流動負債合計	5,051,413	16,269,442
負債合計	5,051,413	16,269,442
純資産の部		
元本等		
元本	989,378,671	1,242,539,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	22,483,046	464,075,472
(分配準備積立金)	20,484,190	347,415,553
元本等合計	1,011,861,717	1,706,615,349
純資産合計	1,011,861,717	1,706,615,349
負債純資産合計	1,016,913,130	1,722,884,791

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自平成23年1月27日 至平成24年1月26日	第3期 自平成24年1月27日 至平成25年1月28日
営業収益		
受取利息	3,576	5,781
有価証券売買等損益	39,079,628	414,289,719
営業収益合計	39,076,052	414,295,500
営業費用		
受託者報酬	440,898	758,333
委託者報酬	3,967,900	6,824,870
その他費用	22,657	39,049
営業費用合計	4,431,455	7,622,252
営業利益	43,507,507	406,673,248
経常利益	43,507,507	406,673,248
当期純利益	43,507,507	406,673,248
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	14,279,113	45,926,192
期首剰余金又は期首欠損金()	27,258,396	22,483,046
剰余金増加額又は欠損金減少額	60,567,323	100,958,828
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	60,567,323	100,958,828
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,114,279	20,113,458
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,114,279	20,113,458
分配金	1	1
期末剰余金又は期末欠損金()	22,483,046	464,075,472

(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 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1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年1月27日から平成25年1月28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1月26日現在]	第3期 [平成25年1月28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	236,483,721円 1,094,884,113円 341,989,163円	989,378,671円 768,791,890円 515,630,684円
2 受益権の総数	989,378,671口	1,242,539,877口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0227円 (10,227円)	1.3735円 (13,735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1月27日至平成24年1月26日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	12,850,099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	52,016,326円
分配準備積立金額	D	7,634,091円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	72,500,516円
当ファンドの期末残存口数	F	989,378,671口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	732円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第3期(自平成24年1月27日至平成25年1月28日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	29,779,678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	304,907,472円
収益調整金額	C	116,659,919円
分配準備積立金額	D	12,728,403円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	464,075,472円
当ファンドの期末残存口数	F	1,242,539,877口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,734円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

（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1月27日 至平成24年1月26日)	第3期 (自平成24年1月27日 至平成25年1月28日)
	1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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1月26日現在]	第3期 [平成25年1月28日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	(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1月26日現在]	第3期 [平成25年1月28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	39,930,847	400,663,076
合計	39,930,847	400,663,076

（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	130,663,297	233,704,373	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,129,171,481	1,472,326,694	
	親投資信託受益証券 小計	1,259,834,778	1,706,031,067	
	合計	1,259,834,778	1,706,031,067	

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「外国株式インデックスマザーファンド」および「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、これら親投資信託の受益証券です。

なお、これら親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

「外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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,103,723,955	317,465,780
コール・ローン	240,705,766	312,264,272
株式	140,598,452,842	163,526,479,317
投資証券	2,838,231,659	3,782,024,296
派生商品評価勘定	116,572,712	28,792,271
未収入金	15,142,201	1,273,613,144
未収配当金	157,821,977	162,976,167
未収利息	555	819
差入委託証拠金	1,196,501,235	788,338,604
流動資産合計	146,267,152,902	170,191,954,670
資産合計	146,267,152,902	170,191,954,670
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		300,240
未払解約金	154,589,777	281,352,688
流動負債合計	154,589,777	281,652,928
負債合計	154,589,777	281,652,928
純資産の部		
元本等		
元本	1	152,966,217,901
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2	6,853,654,776
元本等合計		169,910,301,742
純資産合計		169,910,301,742
負債純資産合計		170,191,954,670

(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>(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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年1月27日	平成24年1月27日
期首元本額	142,093,596,791円	152,966,217,901円
期首からの追加設定元本額	50,967,093,172円	13,892,253,884円
期首からの一部解約元本額	40,094,472,062円	36,544,458,244円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	395,154,854円	38,411,836円
eMAXIS 先進国株式インデックス	6,843,380,397円	7,349,584,806円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	14,597,580円	84,916,884円
eMAXIS バランス(波乗り型)	7,788,874円	19,270,810円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,331,229,001円	1,499,942,798円
eMAXIS 全世界株式インデックス	909,297,717円	1,129,171,481円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	54,122,058,304円	46,305,295,275円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	39,452,589,454円	30,523,985,791円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	1,134,750,555円	863,771,127円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	7,419,043,560円	5,931,153,773円
MUAM 外国株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	7,564,059,426円	6,752,005,577円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	925,851,386円	764,785,597円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	630,286,271円	487,917,822円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,345,334,335円	4,112,438,026円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	2,083,256,017円	1,743,323,566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)	25,344,882円	23,775,854円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	5,792,069,515円	5,805,181,219円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,590,536,930円	2,485,272,027円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	72,088,548円	44,784,745円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	185,270,735円	133,585,723円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	263,581,280円	200,683,389円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	336,615,868円	239,515,902円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	2,912,661,401円	2,434,162,777円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	356,695,992円	260,775,431円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	2,608,846,212円	2,087,096,357円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	677,534,675円	513,289,360円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	2,969,919,359円	2,470,816,153円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	2,742,334,817円	3,146,261,813円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)	361,940,449円	292,250,258円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)	1,272,085,497円	1,097,814,399円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	954,526,538円	858,261,533円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)	665,487,472円	614,511,432円
(合計)	152,966,217,901円	130,314,013,541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。	6,853,654,776円	
3 受益権の総数	152,966,217,901口	130,314,013,541口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9552円 (9,552円)	1.3039円 (13,039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1月27日 至平成24年1月26日）	（自平成24年1月27日 至平成25年1月28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、新株予約権証券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、新株予約権証券および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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。	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、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	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1月26日現在]	[平成25年1月28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 同左 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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,366,907,894	19,306,743,255
投資証券	48,244,821	334,085,241
合計	4,318,663,073	19,640,828,496

（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1月26日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	うち1年超		
			2,328,955,426	116,548,762
合計		2,212,406,664	2,328,955,426	116,548,762

区分	種類	[平成25年1月28日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	うち1年超		
			2,047,285,693	28,762,861
合計		2,018,522,832	2,047,285,693	28,762,861

（注）時価の算定方法

- 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。
- 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。
- 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1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	101,112,700		101,101,000	11,700
	イギリスポンド	18,263,100		18,262,500	600
	スイスフラン	16,862,400		16,862,000	400
	香港ドル	25,050,000		25,050,000	
	スウェーデンクローネ	17,306,250		17,295,000	11,250
	合計	178,594,450		178,570,500	23,950

区分	種類	[平成25年1月28日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	282,097,370		282,162,000	64,630
	カナダドル	22,581,250		22,580,000	1,250
	オーストラリアドル	18,964,400		18,964,000	400
	イギリスポンド	57,374,250		57,440,000	65,750
	スイスフラン	19,632,000		19,632,000	
	香港ドル	11,739,900		11,740,000	100
	ユーロ	91,725,500		91,867,500	142,000
		合計	504,114,670		504,385,500

(注) 時価の算定方法

- 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。
- 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					
	3M CO	48,800	100.590000	4,908,792.00	
	ABBOTT LABORATORIES	117,300	32.790000	3,846,267.00	
	ABBVIE INC	117,100	37.600000	4,402,960.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	47,400	72.210000	3,422,754.00	
	ACE LTD	25,400	85.340000	2,167,636.00	
	ACTAVIS INC	9,500	84.270000	800,565.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	33,300	11.390000	379,287.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	36,793	38.320000	1,409,907.76	
	ADT CORP/THE	16,900	47.180000	797,342.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	5,300	75.250000	398,825.00	
	AES CORP	49,100	11.090000	544,519.00	
	AETNA INC	25,000	49.760000	1,244,000.00	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,900	144.930000	565,227.00	
	AFLAC INC	34,700	53.480000	1,855,756.00	
	AGCO CORP	7,200	53.540000	385,488.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,666	45.290000	1,162,413.14	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,900	88.360000	1,404,924.00	
	AIRGAS INC	4,800	93.220000	447,456.00	
	AKAMA TECHNOLOGIES INC	13,382	41.150000	550,669.30	
	ALBEMARLE CORP	6,500	62.430000	405,795.00	
	ALCOA INC	78,400	9.030000	707,952.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14,511	94.680000	1,373,901.48	
	ALLEGHANY CORP	1,000	356.970000	356,970.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,800	30.290000	236,262.00	
	ALLERGAN INC	23,009	107.210000	2,466,794.89	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,700	158.050000	584,785.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	8,300	45.800000	380,140.00	
	ALLSTATE CORP	36,100	43.910000	1,585,151.00	
	ALTERA CORP	23,400	33.515000	784,251.00	
	ALTRIA GROUP INC	151,700	33.450000	5,074,365.00	
	AMAZON.COM INC	27,000	283.990000	7,667,730.00	
	AMEREN CORPORATION	18,100	32.170000	582,277.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,600	44.460000	1,627,236.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	76,300	59.500000	4,539,850.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	104,300	36.700000	3,827,810.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,700	37.400000	512,380.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,500	67.380000	1,044,390.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	18,700	45.030000	842,061.00	
	AMETEK INC	17,800	41.070000	731,046.00	
	AMGEN INC	57,400	83.420000	4,788,308.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	11,900	67.700000	805,630.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	37,300	81.000000	3,021,300.00	
	ANALOG DEVICES INC	22,600	43.800000	989,880.00	
	ANSYS INC	6,800	73.520000	499,936.00	
	AON PLC	22,862	57.620000	1,317,308.44	
	APACHE CORP	29,320	84.150000	2,467,278.00	
	APPLE INC	69,900	439.880000	30,747,612.00	
	APPLIED MATERIALS INC	91,942	12.830000	1,179,615.86	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,100	45.320000	457,732.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,700	28.970000	1,410,839.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	7,900	39.470000	311,813.00	
	ASSURANT INC	5,600	38.620000	216,272.00	
	AT&T INC	429,800	34.020000	14,621,796.00	
	AUTODESK INC	16,700	38.990000	651,133.00	
	AUTOLIV INC	6,900	66.590000	459,471.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,700	59.890000	2,138,073.00	
	AUTOZONE INC	2,500	365.360000	913,400.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,300	34.160000	625,128.00	
	AVERY DENNISON CORP	8,000	36.000000	288,000.00	
	AVNET INC	10,700	35.460000	379,422.00	

AVON PRODUCTS INC	32,900	16.680000	548,772.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,700	38.160000	331,992.00
BAKER HUGHES INC	33,000	45.610000	1,505,130.00
BALL CORP	11,100	46.610000	517,371.00
BANK OF AMERICA CORP	803,400	11.620000	9,335,508.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	88,200	27.080000	2,388,456.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,600	68.000000	2,760,800.00
BB&T CORP	52,100	30.870000	1,608,327.00
BEAM INC	10,800	61.980000	669,384.00
BECTON DICKINSON AND CO	15,100	84.590000	1,277,309.00
BED BATH & BEYOND INC	17,200	59.780000	1,028,216.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	68,800	97.390000	6,700,432.00
BEST BUY CO INC	20,600	15.780000	325,068.00
BIOGEN IDEC INC	16,765	146.200000	2,451,043.00
BLACKROCK INC	10,000	236.420000	2,364,200.00
BMC SOFTWARE INC	11,700	44.500000	520,650.00
BOEING CO/THE	53,300	75.030000	3,999,099.00
BORGWARNER INC	8,600	77.290000	664,694.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	104,700	6.860000	718,242.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	125,200	36.690000	4,593,588.00
BROADCOM CORP-CL A	38,100	34.250000	1,304,925.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,000	65.090000	585,810.00
BUNGE LTD	10,800	78.380000	846,504.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,900	67.190000	799,561.00
CA INC	24,300	25.050000	608,715.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	14,800	15.200000	224,960.00
CABOT OIL & GAS CORP	15,700	52.850000	829,745.00
CALPINE CORP	22,400	19.140000	428,736.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	18,500	60.720000	1,123,320.00
CAMPBELL SOUP CO	13,900	36.530000	507,767.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,300	56.320000	2,438,656.00
CARDINAL HEALTH INC	25,500	44.900000	1,144,950.00
CAREFUSION CORP	16,300	31.440000	512,472.00
CARMAX INC	17,407	39.690000	690,883.83
CARNIVAL CORP	33,100	39.120000	1,294,872.00
CATERPILLAR INC	48,800	95.580000	4,664,304.00
CBRE GROUP INC - A	22,700	21.840000	495,768.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	44,300	42.190000	1,869,017.00
CELANESE CORP-SERIES A	11,600	46.970000	544,852.00
CELGENE CORP	32,000	99.760000	3,192,320.00
CENTERPOINT ENERGY INC	30,100	20.330000	611,933.00
CENTURYLINK INC	46,800	40.130000	1,878,084.00
CERNER CORP	10,800	83.380000	900,504.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,700	230.280000	1,082,316.00
CHARTER COMMUNICATION-A	3,000	80.680000	242,040.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	49,600	19.360000	960,256.00
CHEVRON CORP	146,400	116.200000	17,011,680.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,400	303.480000	728,352.00
CHUBB CORP	19,700	81.010000	1,595,897.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,200	57.150000	582,930.00
CIGNA CORP	21,500	58.480000	1,257,320.00
CIMAREX ENERGY CO	6,200	64.000000	396,800.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,400	42.780000	487,692.00
CINTAS CORP	8,300	42.510000	352,833.00
CISCO SYSTEMS INC	399,600	21.150000	8,451,540.00
CIT GROUP INC	14,100	40.710000	574,011.00
CITIGROUP INC	218,700	42.910000	9,384,417.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,100	71.550000	1,008,855.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,900	35.710000	389,239.00
CLOROX COMPANY	9,000	77.540000	697,860.00
CME GROUP INC	23,200	57.700000	1,338,640.00
CMS ENERGY CORP	20,000	25.230000	504,600.00
COACH INC	21,100	51.210000	1,080,531.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,000	24.470000	415,990.00
COCA-COLA CO/THE	302,500	37.050000	11,207,625.00
COCA-COLA ENTERPRISES	21,800	34.480000	751,664.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,100	77.630000	1,715,623.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	35,463	110.150000	3,906,249.45
COMCAST CORP-CLASS A	157,900	39.760000	6,278,104.00

COMCAST CORP-SPECIAL CL A	42,900	38.310000	1,643,499.00
COMERICA INC	15,000	33.710000	505,650.00
COMPUTER SCIENCES CORP	11,700	42.440000	496,548.00
CONAGRA FOODS INC	30,300	32.330000	979,599.00
CONCHO RESOURCES INC	7,300	91.900000	670,870.00
CONOCOPHILLIPS	86,000	61.060000	5,251,160.00
CONSOL ENERGY INC	17,100	32.080000	548,568.00
CONSOLIDATED EDISON INC	21,858	56.510000	1,235,195.58
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	38.500000	427,350.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,500	82.570000	288,995.00
CORE LABORATORIES N.V.	3,500	118.740000	415,590.00
CORNING INC	110,200	12.240000	1,348,848.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,200	102.360000	3,295,992.00
COVENTRY HEALTH CARE INC	9,700	46.390000	449,983.00
COVIDIEN PLC	36,000	62.280000	2,242,080.00
CR BARD INC	5,900	103.440000	610,296.00
CREE INC	7,900	41.970000	331,563.00
CROWN CASTLE INTL CORP	21,700	73.450000	1,593,865.00
CROWN HOLDINGS INC	10,900	38.190000	416,271.00
CSX CORP	77,300	22.240000	1,719,152.00
CUMMINS INC	13,400	116.980000	1,567,532.00
CVS CAREMARK CORP	94,600	51.860000	4,905,956.00
DANAHER CORP	43,900	60.540000	2,657,706.00
DARDEN RESTAURANTS INC	9,900	45.870000	454,113.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	7,500	114.530000	858,975.00
DEERE & CO	27,880	93.470000	2,605,943.60
DELL INC	110,400	13.160000	1,452,864.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,000	39.270000	903,210.00
DELTA AIR LINES INC	17,300	14.170000	245,141.00
DENBURY RESOURCES INC	29,539	18.500000	546,471.50
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	11,000	42.330000	465,630.00
DEVON ENERGY CORPORATION	28,900	54.980000	1,588,922.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,400	74.660000	403,164.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,500	48.820000	366,150.00
DIRECTV	47,077	53.650000	2,525,681.05
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,400	39.090000	1,501,056.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,800	69.000000	745,200.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,800	62.800000	427,040.00
DISH NETWORK CORP-A	15,700	37.730000	592,361.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,500	31.320000	109,620.00
DOLLAR GENERAL CORP	19,600	46.840000	918,064.00
DOLLAR TREE INC	17,488	41.050000	717,882.40
DOMINION RESOURCES INC/VA	42,700	53.880000	2,300,676.00
DOVER CORP	13,800	66.780000	921,564.00
DOW CHEMICAL CO/THE	89,200	34.580000	3,084,536.00
DR HORTON INC	21,800	21.760000	474,368.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,800	44.560000	704,048.00
DTE ENERGY COMPANY	12,900	62.750000	809,475.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	69,500	48.330000	3,358,935.00
DUKE ENERGY CORP	52,500	67.920000	3,565,800.00
DUN & BRADSTREET CORP	3,600	79.900000	287,640.00
EASTMAN CHEMICAL CO	11,200	71.900000	805,280.00
EATON CORP PLC	34,600	57.520000	1,990,192.00
EATON VANCE CORP	8,900	35.780000	318,442.00
EBAY INC	86,600	56.530000	4,895,498.00
ECOLAB INC	21,800	73.440000	1,600,992.00
EDISON INTERNATIONAL	23,500	47.030000	1,105,205.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,500	92.090000	782,765.00
ELECTRONIC ARTS INC	23,600	14.770000	348,572.00
ELI LILLY & CO	77,900	53.210000	4,145,059.00
EMC CORP/MA	156,200	25.260000	3,945,612.00
EMERSON ELECTRIC CO	54,000	57.470000	3,103,380.00
ENERGEN CORP	5,700	48.220000	274,854.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,600	87.520000	402,592.00
ENSCO PLC-CL A	17,100	62.110000	1,062,081.00
ENTERGY CORP	13,100	64.590000	846,129.00
EOG RESOURCES INC	20,194	125.270000	2,529,702.38
EQT CORP	11,100	61.950000	687,645.00
EQUIFAX INC	9,200	58.870000	541,604.00

EQUINIX INC	3,600	225.250000	810,900.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,500	63.250000	1,106,875.00
EVEREST RE GROUP LTD	3,700	114.950000	425,315.00
EXELON CORP	64,289	31.010000	1,993,601.89
EXPEDIA INC	7,500	66.490000	498,675.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	16,500	43.540000	718,410.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	60,200	54.160000	3,260,432.00
EXXON MOBIL CORP	344,100	91.730000	31,564,293.00
F5 NETWORKS INC	5,800	105.430000	611,494.00
FACEBOOK INC-A	74,000	31.540000	2,333,960.00
FAMILY DOLLAR STORES	7,600	58.550000	444,980.00
FASTENAL CO	20,900	48.960000	1,023,264.00
FEDEX CORP	22,400	102.570000	2,297,568.00
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,100	25.160000	379,916.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	17,300	37.200000	643,560.00
FIFTH THIRD BANCORP	68,300	16.370000	1,118,071.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	35.340000	250,914.00
FIRSTENERGY CORP	31,234	40.270000	1,257,793.18
FISERV INC	10,100	80.850000	816,585.00
FLEXTRONICS INTL LTD	47,600	6.440000	306,544.00
FLIR SYSTEMS INC	11,131	24.190000	269,258.89
FLOWSERVE CORP	3,900	154.470000	602,433.00
FLUOR CORP	12,500	66.060000	825,750.00
FMC CORP	10,200	61.870000	631,074.00
FMC TECHNOLOGIES INC	18,142	46.800000	849,045.60
FORD MOTOR CO	265,800	13.680000	3,636,144.00
FOREST LABORATORIES INC	19,700	36.790000	724,763.00
FOSSIL INC	3,700	107.460000	397,602.00
FRANKLIN RESOURCES INC	11,217	134.480000	1,508,462.16
FREEMONT-MCMORAN COPPER	70,500	34.870000	2,458,335.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,600	4.460000	332,716.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	8,600	23.710000	203,906.00
GAP INC/THE	23,300	33.540000	781,482.00
GARMIN LTD	8,400	38.770000	325,668.00
GENERAL DYNAMICS CORP	22,100	70.960000	1,568,216.00
GENERAL ELECTRIC CO	787,000	22.290000	17,542,230.00
GENERAL MILLS INC	48,400	41.750000	2,020,700.00
GENERAL MOTORS CO	58,000	29.070000	1,686,060.00
GENUINE PARTS CO	11,700	66.980000	783,666.00
GILEAD SCIENCES INC	56,700	79.360000	4,499,712.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,900	144.460000	4,897,194.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,500	13.870000	242,725.00
GOOGLE INC-CL A	19,500	753.670000	14,696,565.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	10,066	46.310000	466,156.46
H&R BLOCK INC	20,900	22.330000	466,697.00
HALLIBURTON CO	68,900	39.720000	2,736,708.00
HARLEY-DAVIDSON INC	17,000	53.940000	916,980.00
HARRIS CORP	8,100	49.490000	400,869.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,500	24.820000	781,830.00
HASBRO INC	8,700	37.310000	324,597.00
HCA HOLDINGS INC	16,600	37.740000	626,484.00
HELMERICH & PAYNE	7,700	62.200000	478,940.00
HENRY SCHEIN INC	6,600	87.790000	579,414.00
HERBALIFE LTD	8,500	43.590000	370,515.00
HERSHEY CO/THE	11,700	77.850000	910,845.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,400	18.120000	424,008.00
HESS CORP	23,080	58.900000	1,359,412.00
HEWLETT-PACKARD CO	147,400	16.990000	2,504,326.00
HJ HEINZ CO	24,081	60.720000	1,462,198.32
HOLLYFRONTIER CORP	14,880	47.270000	703,377.60
HOLOGIC INC	20,300	23.740000	481,922.00
HOME DEPOT INC	112,300	67.820000	7,616,186.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,200	68.330000	3,771,816.00
HORMEL FOODS CORP	10,400	35.340000	367,536.00
HOSPIRA INC	12,000	35.100000	421,200.00
HUDSON CITY BANCORP INC	34,700	8.640000	299,808.00
HUMANA INC	12,263	74.930000	918,866.59
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,300	67.560000	493,188.00
IHS INC-CLASS A	4,000	103.950000	415,800.00

ILLINOIS TOOL WORKS	31,319	64.990000	2,035,421.81
ILLUMINA INC	9,000	52.060000	468,540.00
INGERSOLL-RAND PLC	23,100	51.470000	1,188,957.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,800	54.610000	316,738.00
INTEL CORP	372,900	20.960000	7,815,984.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,400	134.820000	728,028.00
INTERNATIONAL PAPER CO	31,400	42.510000	1,334,814.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,300	12.170000	405,261.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	80,900	204.970000	16,582,073.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,100	71.130000	433,893.00
INTL GAME TECHNOLOGY	20,095	15.120000	303,836.40
INTUIT INC	20,600	63.710000	1,312,426.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,000	577.820000	1,733,460.00
INVESCO LTD	33,900	28.200000	955,980.00
IRON MOUNTAIN INC	10,352	34.290000	354,970.08
J.C. PENNEY CO INC	12,900	19.350000	249,615.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,400	48.460000	455,524.00
JM SMUCKER CO/THE	8,400	89.260000	749,784.00
JOHNSON & JOHNSON	205,400	73.920000	15,183,168.00
JOHNSON CONTROLS INC	51,200	30.940000	1,584,128.00
JOY GLOBAL INC	7,900	63.260000	499,754.00
JPMORGAN CHASE & CO	282,900	47.160000	13,341,564.00
JUNIPER NETWORKS INC	39,400	22.570000	889,258.00
KANSAS CITY SOUTHERN	8,300	94.020000	780,366.00
KBR INC	11,100	31.770000	352,647.00
KELLOGG CO	18,900	58.840000	1,112,076.00
KEYCORP	71,400	9.290000	663,306.00
KIMBERLY-CLARK CORP	29,300	86.260000	2,527,418.00
KINDER MORGAN INC	48,200	37.250000	1,795,450.00
KLA-TENCOR CORPORATION	12,700	56.340000	715,518.00
KOHL'S CORP	16,500	45.250000	746,625.00
KRAFT FOODS GROUP INC	41,700	47.140000	1,965,738.00
KROGER CO	38,900	27.840000	1,082,976.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,100	78.710000	558,841.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,100	88.660000	629,486.00
LAM RESEARCH CORP	13,600	41.840000	569,024.00
LAS VEGAS SANDS CORP	30,500	52.710000	1,607,655.00
LEGG MASON INC	9,700	27.620000	267,914.00
LEGETT & PLATT INC	11,100	29.570000	328,227.00
LENNAR CORP-A	11,700	43.070000	503,919.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,500	25.100000	414,150.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	11,300	24.390000	275,607.00
LIBERTY GLOBAL INC-A	10,500	68.430000	718,515.00
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,300	64.020000	531,366.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	38,400	21.010000	806,784.00
LIBERTY MEDIA CORP	8,100	110.750000	897,075.00
LIFE TECHNOLOGIES CORP	13,286	63.490000	843,528.14
LIMITED BRANDS INC	18,400	48.280000	888,352.00
LINCOLN NATIONAL CORP	21,102	29.110000	614,279.22
LINEAR TECHNOLOGY CORP	17,900	36.700000	656,930.00
LINKEDIN CORP - A	5,800	123.780000	717,924.00
LKQ CORP	21,200	23.380000	495,656.00
LOCKHEED MARTIN CORP	20,500	92.390000	1,893,995.00
LOEWS CORP	23,600	43.470000	1,025,892.00
LORILLARD INC	30,003	39.660000	1,189,918.98
LOWE'S COS INC	87,866	38.580000	3,389,870.28
LSI CORP	40,000	7.320000	292,800.00
LULULEMON ATHLETICA INC	7,400	69.830000	516,742.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,700	62.750000	1,487,175.00
M & T BANK CORP	8,700	103.990000	904,713.00
MACY'S INC	30,200	38.740000	1,169,948.00
MANPOWER INC	5,700	48.120000	274,284.00
MARATHON OIL CORP	52,600	33.780000	1,776,828.00
MARATHON PETROLEUM CORP	25,300	68.670000	1,737,351.00
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,600	39.560000	775,376.00
MARSH & MCLENNAN COS	40,500	35.000000	1,417,500.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,300	99.350000	327,855.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	37,600	9.160000	344,416.00
MASCO CORP	26,300	18.360000	482,868.00

MASTERCARD INC-CLASS A	8,000	519.420000	4,155,360.00	
MATTEL INC	25,300	37.150000	939,895.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,100	31.630000	699,023.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	61.870000	569,204.00	
MCDONALD'S CORP	75,200	93.720000	7,047,744.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	19,000	56.980000	1,082,620.00	
MCKESSON CORP	17,600	106.620000	1,876,512.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	13,700	22.700000	310,990.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,300	70.030000	1,071,459.00	
MEADWESTVACO CORP	12,600	33.050000	416,430.00	
MEDTRONIC INC	76,500	46.420000	3,551,130.00	
MERCK & CO. INC.	226,800	43.460000	9,856,728.00	
METLIFE INC	63,200	37.650000	2,379,480.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	24,000	9.710000	233,040.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,200	13.000000	366,600.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,200	33.300000	472,860.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,400	7.870000	601,268.00	
MICROSOFT CORP	562,500	27.880000	15,682,500.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,300	102.470000	440,621.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,100	45.120000	500,832.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	125,700	27.780000	3,491,946.00	
MONSANTO CO	39,600	103.450000	4,096,620.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,000	46.710000	513,810.00	
MOODY'S CORP	15,100	54.340000	820,534.00	
MORGAN STANLEY	109,800	22.700000	2,492,460.00	
MOSAIC CO/THE	23,000	63.220000	1,454,060.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,300	58.600000	1,130,980.00	
MURPHY OIL CORP	13,900	61.790000	858,881.00	
MYLAN INC	31,000	28.460000	882,260.00	
NABORS INDUSTRIES LTD	21,543	16.630000	358,260.09	
NASDAQ OMX GROUP/THE	9,267	27.700000	256,695.90	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	31,800	74.000000	2,353,200.00	
NETAPP INC	27,300	36.150000	986,895.00	
NETFLIX INC	3,800	169.560000	644,328.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,400	13.070000	436,538.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	22,700	23.230000	527,321.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,600	28.890000	277,344.00	
NEWMONT MINING CORP	37,400	43.360000	1,621,664.00	
NEWS CORP-B	33,000	27.830000	918,390.00	
NEWS CORP-CL A	116,200	27.210000	3,161,802.00	
NEXTERA ENERGY INC	30,100	72.500000	2,182,250.00	
NIELSEN HOLDINGS NV	9,300	32.140000	298,902.00	
NIKE INC -CL B	54,400	55.550000	3,021,920.00	
NISOURCE INC	22,400	26.660000	597,184.00	
NOBLE CORP	18,400	38.230000	703,432.00	
NOBLE ENERGY INC	13,341	108.300000	1,444,830.30	
NORDSTROM INC	11,800	56.050000	661,390.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,900	69.690000	1,665,591.00	
NORTHEAST UTILITIES	24,000	40.320000	967,680.00	
NORTHERN TRUST CORP	16,300	51.320000	836,516.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,600	67.740000	1,192,224.00	
NRG ENERGY INC	24,200	23.590000	570,878.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	18,900	23.580000	445,662.00	
NUCOR CORP	24,000	47.680000	1,144,320.00	
NVIDIA CORP	45,900	12.410000	569,619.00	
NYSE EURONEXT	18,100	33.610000	608,341.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	60,600	84.060000	5,094,036.00	
OCEANEERING INTL INC	7,900	61.820000	488,378.00	
OGE ENERGY CORP	7,400	57.980000	429,052.00	
OMNICARE INC	7,900	39.090000	308,811.00	
OMNICOM GROUP	19,800	54.190000	1,072,962.00	
ONEOK INC	14,962	47.420000	709,498.04	
ORACLE CORP	291,300	35.380000	10,306,194.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,700	92.170000	801,879.00	
OWENS-ILLINOIS INC	11,300	22.960000	259,448.00	

(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					
	P G & E CORP	32,200	41.890000	1,348,858.00	
	PACCAR INC	24,991	48.230000	1,205,315.93	
	PALL CORP	8,700	67.990000	591,513.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	11,100	94.370000	1,047,507.00	
	PARTNERRE LTD	4,600	85.490000	393,254.00	
	PATTERSON COS INC	6,500	36.640000	238,160.00	
	PAYCHEX INC	24,100	31.840000	767,344.00	
	PEABODY ENERGY CORP	20,781	25.820000	536,565.42	
	PENTAIR LTD-REGISTERED	15,529	53.250000	826,919.25	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,300	12.470000	340,431.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	17,300	19.260000	333,198.00	
	PEPSICO INC	115,900	72.490000	8,401,591.00	
	PERRIGO CO	6,600	103.120000	680,592.00	
	PETSMART INC	8,288	69.990000	580,077.12	
	PFIZER INC	556,300	27.000000	15,020,100.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,600	89.420000	11,231,152.00	
	PHILLIPS 66	44,728	56.810000	2,540,997.68	
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,800	53.320000	469,216.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,700	115.610000	1,005,807.00	
	PITNEY BOWES INC	15,700	12.150000	190,755.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,900	47.380000	469,062.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,400	61.970000	2,441,618.00	
	POLARIS INDUSTRIES INC	4,700	93.230000	438,181.00	
	PPG INDUSTRIES INC	11,300	144.210000	1,629,573.00	
	PPL CORPORATION	43,800	29.600000	1,296,480.00	
	PRAXAIR INC	22,100	111.730000	2,469,233.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	10,805	191.490000	2,069,049.45	
	PRICELINE.COM INC	3,700	718.820000	2,659,634.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,700	30.780000	667,926.00	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	205,400	73.250000	15,045,550.00	
	PROGRESSIVE CORP	43,200	22.630000	977,616.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,400	59.090000	2,032,696.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,600	30.530000	1,147,928.00	
	PULTEGROUP INC	26,000	21.670000	563,420.00	
	PVH CORP	5,200	120.860000	628,472.00	
	QEP RESOURCES INC	12,900	29.810000	384,549.00	
	QUALCOMM INC	127,100	63.660000	8,091,186.00	
	QUANTA SERVICES INC	15,900	29.720000	472,548.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	11,900	57.940000	689,486.00	
	RACKSPACE HOSTING INC	8,200	78.930000	647,226.00	
	RALCORP HOLDINGS INC	4,197	89.960000	377,562.12	
	RALPH LAUREN CORP	4,500	170.080000	765,360.00	
	RANGE RESOURCES CORP	12,000	68.700000	824,400.00	
	RAYTHEON COMPANY	24,500	55.880000	1,369,060.00	
	RED HAT INC	14,300	56.050000	801,515.00	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,700	174.480000	994,536.00	
	REGIONS FINANCIAL CORP	104,500	7.690000	803,605.00	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	82.700000	330,800.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	23,000	31.110000	715,530.00	
	RESMED INC	10,200	48.310000	492,762.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	25,500	43.850000	1,118,175.00	
	ROBERT HALF INTL INC	9,500	33.670000	319,865.00	
	ROCK TENN COMPANY -CL A	5,500	79.800000	438,900.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	10,600	89.650000	950,290.00	
	ROCKWELL COLLINS INC	10,000	59.420000	594,200.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	7,400	118.830000	879,342.00	
	ROSS STORES INC	17,000	61.090000	1,038,530.00	
	ROWAN COMPANIES PLC-A	9,600	34.940000	335,424.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	38.420000	411,094.00	
	SAFEWAY INC	17,700	19.430000	343,911.00	
	SAIC INC	20,200	12.130000	245,026.00	
	SALESFORCE.COM INC	9,800	173.860000	1,703,828.00	
	SANDISK CORP	18,100	49.660000	898,846.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,000	71.350000	642,150.00	
	SCANA CORP	9,600	46.720000	448,512.00	

SCHLUMBERGER LTD	98,700	79.510000	7,847,637.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	80,000	16.050000	1,284,000.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,800	59.930000	407,524.00
SEAGATE TECHNOLOGY	26,500	37.250000	987,125.00
SEALED AIR CORP	13,300	18.620000	247,646.00
SEARS HOLDINGS CORP	3,100	45.120000	139,872.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,000	25.530000	255,300.00
SEMPRA ENERGY	17,400	74.360000	1,293,864.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,434	34.720000	223,388.48
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,500	165.510000	1,075,815.00
SIGMA-ALDRICH	8,909	77.400000	689,556.60
SIRIUS XM RADIO INC	284,000	3.150000	894,600.00
SLM CORP	34,700	16.900000	586,430.00
SOUTHERN CO/THE	65,100	44.450000	2,893,695.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,400	11.440000	176,176.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	26,731	34.630000	925,694.53
SPECTRA ENERGY CORP	49,000	27.090000	1,327,410.00
SPRINT NEXTEL CORP	226,900	5.640000	1,279,716.00
SPX CORP	4,000	73.790000	295,160.00
ST JUDE MEDICAL INC	23,100	40.880000	944,328.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,900	76.870000	914,753.00
STAPLES INC	50,100	12.970000	649,797.00
STARBUCKS CORP	56,500	56.810000	3,209,765.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,600	60.890000	888,994.00
STATE STREET CORP	35,900	56.450000	2,026,555.00
STERICYCLE INC	6,400	94.500000	604,800.00
STRYKER CORP	22,500	63.550000	1,429,875.00
SUNTRUST BANKS INC	40,300	29.350000	1,182,805.00
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,200	24.960000	279,552.00
SYMANTEC CORP	51,600	22.130000	1,141,908.00
SYNOPSIS INC	11,500	33.610000	386,515.00
SYSCO CORP	44,000	31.830000	1,400,520.00
T ROWE PRICE GROUP INC	18,700	72.090000	1,348,083.00
TARGET CORP	46,300	61.540000	2,849,302.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,100	19.230000	328,833.00
TE CONNECTIVITY LTD	31,700	39.470000	1,251,199.00
TERADATA CORP	12,800	69.340000	887,552.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	84,600	32.800000	2,774,880.00
TEXTRON INC	21,212	28.750000	609,845.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,400	71.210000	1,951,154.00
TIFFANY & CO	9,300	64.170000	596,781.00
TIME WARNER CABLE	22,900	100.600000	2,303,740.00
TIME WARNER INC	70,500	50.400000	3,553,200.00
TJX COMPANIES INC	54,864	45.120000	2,475,463.68
TOLL BROTHERS INC	11,700	37.980000	444,366.00
TORCHMARK CORP	7,000	55.980000	391,860.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,400	23.750000	294,500.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,400	95.860000	517,644.00
TRANSDIGM GROUP INC	3,700	138.410000	512,117.00
TRAVELERS COS INC/THE	28,700	78.350000	2,248,645.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	9,300	63.560000	591,108.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,900	58.370000	461,123.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	34,100	31.230000	1,064,943.00
TYSON FOODS INC-CL A	22,100	22.440000	495,924.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,538	100.400000	455,615.20
ULTRA PETROLEUM CORP	11,300	18.600000	210,180.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,700	48.260000	275,082.00
UNION PACIFIC CORP	35,400	134.770000	4,770,858.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,016	25.500000	153,408.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,000	82.450000	4,452,300.00
UNITED STATES STEEL CORP	11,800	24.530000	289,454.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,500	89.790000	5,791,455.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,000	56.040000	4,315,080.00
UNUM GROUP	20,500	23.290000	477,445.00
URBAN OUTFITTERS INC	9,000	43.620000	392,580.00
US BANCORP	141,600	33.170000	4,696,872.00
VALERO ENERGY CORP	41,000	38.100000	1,562,100.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,100	73.410000	594,621.00
VERIFONE SYSTEMS INC	8,400	35.940000	301,896.00

VERISIGN INC	11,927	42.960000	512,383.92	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,500	54.990000	577,395.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	212,300	42.670000	9,058,841.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,000	46.850000	749,600.00	
VF CORP	6,500	148.970000	968,305.00	
VIACOM INC-CLASS B	34,600	59.020000	2,042,092.00	
VIRGIN MEDIA INC	19,000	39.780000	755,820.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	39,300	159.840000	6,281,712.00	
VMWARE INC-CLASS A	6,000	99.000000	594,000.00	
VULCAN MATERIALS CO	9,800	57.200000	560,560.00	
WALGREEN CO	66,900	39.670000	2,653,923.00	
WAL-MART STORES INC	138,600	69.000000	9,563,400.00	
WALT DISNEY CO/THE	127,400	54.380000	6,928,012.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	14,900	13.720000	204,428.00	
WASTE MANAGEMENT INC	33,000	35.690000	1,177,770.00	
WATERS CORP	6,500	92.610000	601,965.00	
WEATHERFORD INTL LTD	55,700	12.820000	714,074.00	
WELLPOINT INC	24,000	66.170000	1,588,080.00	
WELLS FARGO & CO	374,100	35.140000	13,145,874.00	
WESTERN DIGITAL CORP	16,400	48.080000	788,512.00	
WESTERN UNION CO	43,900	13.530000	593,967.00	
WHIRLPOOL CORP	5,700	109.680000	625,176.00	
WHITING PETROLEUM CORP	9,000	47.750000	429,750.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	12,900	95.650000	1,233,885.00	
WILLIAMS COS INC	50,600	34.830000	1,762,398.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,400	34.880000	467,392.00	
WINDSTREAM CORP	43,500	9.650000	419,775.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	17,300	38.770000	670,721.00	
WR BERKLEY CORP	8,500	41.550000	353,175.00	
WW GRAINGER INC	4,400	217.090000	955,196.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,000	57.130000	628,430.00	
WYNN RESORTS LTD	6,000	123.930000	743,580.00	
XCEL ENERGY INC	36,700	27.550000	1,011,085.00	
XEROX CORP	95,600	7.930000	758,108.00	
XILINX INC	19,400	36.850000	714,890.00	
XL GROUP PLC	23,000	27.790000	639,170.00	
XYLEM INC	13,500	27.700000	373,950.00	
YAHOO! INC	83,400	20.370000	1,698,858.00	
YUM! BRANDS INC	33,800	64.630000	2,184,494.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	12,900	75.120000	969,048.00	
アメリカドル 小計	22,730,425		1,027,707,963.97 (93,552,255,960)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES LTD	12,700	46.200000	586,740.00	
AGRIUM INC	11,100	115.360000	1,280,496.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,600	48.190000	462,624.00	
ARC RESOURCES LTD	21,000	23.840000	500,640.00	
ATHABASCA OIL CORP	23,600	10.570000	249,452.00	
BANK OF MONTREAL	48,100	64.150000	3,085,615.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	85,300	58.480000	4,988,344.00	
BARRICK GOLD CORP	74,100	33.020000	2,446,782.00	
BAYTEX ENERGY CORP	9,300	45.850000	426,405.00	
BCE INC	18,800	44.360000	833,968.00	
BELL ALIANT INC	5,500	26.100000	143,550.00	
BOMBARDIER INC-B	109,400	3.990000	436,506.00	
BONAVISTA ENERGY CORP	13,200	13.900000	183,480.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	41,900	37.740000	1,581,306.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	20,800	17.150000	356,720.00	
CAE INC	18,000	10.860000	195,480.00	
CAMECO CORP	31,100	21.540000	669,894.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,100	83.560000	2,515,156.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,400	95.550000	3,095,820.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	81,500	30.920000	2,519,980.00	
CANADIAN OIL SANDS LTD	35,500	21.520000	763,960.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,700	112.640000	1,430,528.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	70.440000	415,596.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,200	74.810000	314,202.00	
CATAMARAN CORP	15,200	53.680000	815,936.00	
CENOVUS ENERGY INC	56,900	33.450000	1,903,305.00	
CENTERRA GOLD INC	11,300	8.900000	100,570.00	

CGI GROUP INC - CLASS A	15,800	24.930000	393,894.00	
CI FINANCIAL CORP	11,500	26.340000	302,910.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,100	39.570000	1,032,777.00	
DOLLARAMA INC	5,100	59.040000	301,104.00	
ELDORADO GOLD CORP	50,900	11.550000	587,895.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,000	60.630000	121,260.00	
ENBRIDGE INC	57,000	44.180000	2,518,260.00	
ENCANA CORP	55,400	19.710000	1,091,934.00	
ENERPLUS CORP	14,000	13.440000	188,160.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	12,600	25.950000	326,970.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	35,500	20.610000	731,655.00	
FORTIS INC	14,500	34.380000	498,510.00	
FRANCO-NEVADA CORP	10,800	52.140000	563,112.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,500	38.050000	323,425.00	
GOLDCORP INC	60,500	35.810000	2,166,505.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	20,800	26.380000	548,704.00	
HUSKY ENERGY INC	26,200	31.970000	837,614.00	
IAMGOLD CORP	26,700	8.450000	225,615.00	
IGM FINANCIAL INC	7,900	43.300000	342,070.00	
IMPERIAL OIL LTD	22,300	45.080000	1,005,284.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,700	34.770000	232,959.00	
INMET MINING CORPORATION	4,000	70.800000	283,200.00	
INTACT FINANCIAL CORP	9,600	65.390000	627,744.00	
KINROSS GOLD CORP	84,100	8.580000	721,578.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,400	40.580000	340,872.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,600	53.490000	887,934.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	135,700	14.800000	2,008,360.00	
MEG ENERGY CORP	9,900	34.800000	344,520.00	
METRO INC	7,100	65.110000	462,281.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,200	79.400000	968,680.00	
NEW GOLD INC	34,900	9.470000	330,503.00	
NEXEN INC	39,800	27.140000	1,080,172.00	
ONEX CORPORATION	7,400	43.790000	324,046.00	
OPEN TEXT CORP	4,300	59.680000	256,624.00	
OSISKO MINING CORP	29,700	6.970000	207,009.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	22,800	23.260000	530,328.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,800	17.740000	191,592.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,200	29.300000	650,460.00	
PENGROWTH ENERGY CORP	37,300	4.670000	174,191.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	33,900	10.460000	354,594.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	63,600	43.930000	2,793,948.00	
POWER CORP OF CANADA	25,900	26.850000	695,415.00	
POWER FINANCIAL CORP	18,000	29.100000	523,800.00	
RESEARCH IN MOTION	34,400	17.610000	605,784.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,800	21.920000	127,136.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,700	46.260000	1,327,662.00	
ROYAL BANK OF CANADA	107,500	62.100000	6,675,750.00	
SAPUTO INC	9,400	49.820000	468,308.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	29,300	23.570000	690,601.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,000	41.320000	619,800.00	
SILVER WHEATON CORP	26,200	34.550000	905,210.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,300	44.880000	507,144.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,200	29.360000	1,297,712.00	
SUNCOR ENERGY INC	115,800	34.370000	3,980,046.00	
TALISMAN ENERGY INC	77,300	12.040000	930,692.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	42,900	37.730000	1,618,617.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	11,200	65.050000	728,560.00	
THOMSON REUTERS CORP	28,100	30.960000	869,976.00	
TIM HORTONS INC	11,400	50.560000	576,384.00	
TORONTO-DOMINION BANK	68,000	83.580000	5,683,440.00	
TOURMALINE OIL CORP	9,700	33.580000	325,726.00	
TRANSALTA CORP	20,300	16.210000	329,063.00	
TRANSCANADA CORP	53,000	48.770000	2,584,810.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	30,800	8.400000	258,720.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	21,300	66.070000	1,407,291.00	
VERMILION ENERGY INC	7,300	51.200000	373,760.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,800	72.840000	276,792.00	
YAMANA GOLD INC	57,500	16.410000	943,575.00	
カナダドル 小計	2,838,400		95,514,082.00 (8,627,787,027)	

オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	40,931	15.370000	629,109.47	
ALS LTD	24,520	11.870000	291,052.40	
ALUMINA LTD	173,982	1.080000	187,900.56	
AMCOR LIMITED	89,350	8.320000	743,392.00	
AMP LTD	217,960	5.320000	1,159,547.20	
ASCIANO LTD	79,833	4.840000	386,391.72	
ASX LTD	13,045	33.790000	440,790.55	
AURIZON HOLDINGS LTD	141,692	4.010000	568,184.92	
AUST AND NZ BANKING GROUP	202,839	26.070000	5,288,012.73	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,612	9.100000	287,669.20	
BHP BILLITON LTD	240,529	37.100000	8,923,625.90	
BORAL LTD	58,154	4.860000	282,628.44	
BRAMBLES LTD	119,229	8.010000	955,024.29	
CALTEX AUSTRALIA LTD	11,100	19.530000	216,783.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	42,133	13.710000	577,643.43	
COCHLEAR LTD	4,243	81.070000	343,980.01	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	118,744	63.590000	7,550,930.96	
COMPUTERSHARE LTD	34,247	10.040000	343,839.88	
CROWN LTD	29,303	11.710000	343,138.13	
CSL LTD	37,745	53.050000	2,002,372.25	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	52,860	3.550000	187,653.00	
FLIGHT CENTRE LTD	3,594	29.600000	106,382.40	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	106,352	4.560000	484,965.12	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	44,167	1.985000	87,671.49	
ILUKA RESOURCES LTD	30,113	9.240000	278,244.12	
INCITEC PIVOT LTD	122,641	3.100000	380,187.10	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	154,180	4.920000	758,565.60	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	35,024	9.720000	340,433.28	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,861	20.000000	237,220.00	
LEND LEASE GROUP	42,089	10.190000	428,886.91	
MACQUARIE GROUP LTD	24,491	37.990000	930,413.09	
METCASH LTD	71,035	3.720000	264,250.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	170,043	27.240000	4,631,971.32	
NEWCREST MINING LTD	57,600	23.620000	1,360,512.00	
ORICA LTD	27,127	25.300000	686,313.10	
ORIGIN ENERGY LTD	83,000	12.270000	1,018,410.00	
OZ MINERALS LTD	26,401	6.850000	180,846.85	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.525000	129,103.45	
QBE INSURANCE GROUP LTD	88,997	11.590000	1,031,475.23	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,223	29.320000	299,738.36	
RIO TINTO LTD	32,664	66.060000	2,157,783.84	
SANTOS LTD	71,370	11.850000	845,734.50	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	11,143	9.000000	100,287.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	29,332	13.250000	388,649.00	
SP AUSNET	120,000	1.150000	138,000.00	
SUNCORP GROUP LTD	97,114	10.910000	1,059,513.74	
TABCORP HOLDINGS LTD	58,291	3.090000	180,119.19	
TATTS GROUP LTD	101,040	3.190000	322,317.60	
TELSTRA CORP LTD	322,602	4.580000	1,477,517.16	
TOLL HOLDINGS LTD	50,032	5.080000	254,162.56	
TRANSURBAN GROUP	102,793	6.110000	628,065.23	
TREASURY WINE ESTATES LTD	47,168	4.640000	218,859.52	
WESFARMERS LTD	74,823	37.950000	2,839,532.85	
WESTPAC BANKING CORP	229,831	27.550000	6,331,844.05	
WHITEHAVEN COAL LTD	38,500	3.500000	134,750.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	49,442	35.750000	1,767,551.50	
WOOLWORTHS LTD	92,158	31.610000	2,913,114.38	
WORLEYPARSONS LTD	15,483	24.320000	376,546.56	
オーストラリアドル 小計	4,501,433		67,479,608.34 (6,399,766,054)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	74,814	2.571000	192,346.79	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	65,035	4.154000	270,155.39	
ADMIRAL GROUP PLC	15,622	12.220000	190,900.84	
AGGREKO PLC	20,500	17.540000	359,570.00	
AMEC PLC	23,583	11.000000	259,413.00	
ANGLO AMERICAN PLC	104,030	18.860000	1,962,005.80	
ANTOFAGASTA PLC	30,767	12.570000	386,741.19	
ARM HOLDINGS PLC	103,732	8.705000	902,987.06	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,890	17.080000	442,201.20
ASTRAZENECA PLC	92,554	31.565000	2,921,467.01
AVIVA PLC	217,779	3.705000	806,871.19
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,898	10.120000	262,087.76
BAE SYSTEMS PLC	241,893	3.432000	830,176.77
BALFOUR BEATTY PLC	53,446	2.785000	148,847.11
BARCLAYS PLC	865,359	3.007000	2,602,134.51
BG GROUP PLC	254,249	11.655000	2,963,272.09
BHP BILLITON PLC	157,952	21.040000	3,323,310.08
BP PLC	1,420,298	4.653000	6,608,646.59
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144,617	32.620000	4,717,406.54
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	82,000	8.020000	657,640.00
BT GROUP PLC	589,900	2.531000	1,493,036.90
BUNZL PLC	24,504	11.160000	273,464.64
BURBERRY GROUP PLC	33,674	13.870000	467,058.38
CAPITA PLC	48,246	7.940000	383,073.24
CARNIVAL PLC	13,753	26.150000	359,640.95
CENTRICA PLC	389,137	3.469000	1,349,916.25
COBHAM PLC	79,780	2.165000	172,723.70
COMPASS GROUP PLC	139,597	7.590000	1,059,541.23
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,278	24.510000	251,913.78
DIAGEO PLC	186,416	18.570000	3,461,745.12
EURASIAN NATURAL RESOURCES	15,840	3.311000	52,446.24
EXPERIAN PLC	75,888	10.900000	827,179.20
FRESNILLO PLC	13,239	16.980000	224,798.22
G4S PLC	105,850	2.769000	293,098.65
GKN PLC	118,661	2.466000	292,618.02
GLAXOSMITHKLINE PLC	370,269	14.155000	5,241,157.69
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	283,886	3.926000	1,114,536.43
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,727	7.100000	111,661.70
HSBC HOLDINGS PLC	1,363,716	7.103000	9,686,474.74
ICAP PLC	41,055	3.292000	135,153.06
IMI PLC	23,237	11.930000	277,217.41
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	73,878	24.200000	1,787,847.60
INMARSAT PLC	33,703	6.250000	210,643.75
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20,114	18.800000	378,143.20
INTERTEK GROUP PLC	12,000	31.300000	375,600.00
INVENSYS PLC	62,894	3.445000	216,669.83
INVESTEC PLC	42,361	4.607000	195,157.12
ITV PLC	286,433	1.158000	331,689.41
JOHNSON MATTHEY PLC	15,286	23.900000	365,335.40
KAZAKHMYS PLC	14,604	7.535000	110,041.14
KINGFISHER PLC	176,441	2.774000	489,447.33
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	433,966	1.516000	657,892.45
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,129,095	0.534500	1,672,501.27
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,677	12.250000	155,293.25
MARKS & SPENCER GROUP PLC	118,098	3.842000	453,732.51
MEGGITT PLC	60,487	4.324000	261,545.78
MELROSE INDUSTRIES PLC	90,300	2.398000	216,539.40
NATIONAL GRID PLC	270,717	7.000000	1,895,019.00
NEXT PLC	12,236	40.590000	496,659.24
OLD MUTUAL PLC	365,841	1.876000	686,317.71
PEARSON PLC	61,404	11.850000	727,637.40
PETROFAC LTD	18,983	17.300000	328,405.90
PRUDENTIAL PLC	190,852	9.475000	1,808,322.70
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,635	60.200000	399,427.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	48,639	41.950000	2,040,406.05
REED ELSEVIER PLC	91,346	6.915000	631,657.59
RESOLUTION LTD	106,767	2.666000	284,640.82
REXAM PLC	66,364	4.692000	311,379.88
RIO TINTO PLC	100,218	35.180000	3,525,669.24
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	138,936	9.440000	1,311,555.84

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリスポンド					
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	155,454	3.659000	568,806.18	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	277,161	22.635000	6,273,539.23	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	196,476	23.155000	4,549,401.78	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	269,300	1.300000	350,090.00	
	SABMILLER PLC	71,282	30.645000	2,184,436.89	
	SAGE GROUP PLC/THE	90,532	3.257000	294,862.72	
	SAINSBURY (J) PLC	93,015	3.305000	307,414.57	
	SCHRODERS PLC	8,259	19.160000	158,242.44	
	SERCO GROUP PLC	35,290	5.610000	197,976.90	
	SEVERN TRENT PLC	18,744	16.470000	308,713.68	
	SHIRE PLC	41,656	21.100000	878,941.60	
	SMITH & NEPHEW PLC	67,930	7.235000	491,473.55	
	SMITHS GROUP PLC	29,471	12.440000	366,619.24	
	SSE PLC	70,068	13.860000	971,142.48	
	STANDARD CHARTERED PLC	178,588	16.645000	2,972,597.26	
	STANDARD LIFE PLC	178,616	3.457000	617,475.51	
	TATE & LYLE PLC	34,700	8.340000	289,398.00	
	TESCO PLC	601,084	3.556500	2,137,755.24	
	TUI TRAVEL PLC	32,165	2.931000	94,275.61	
	TULLOW OIL PLC	67,986	11.830000	804,274.38	
	UNILEVER PLC	96,008	25.330000	2,431,882.64	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,530	7.450000	383,898.50	
	VEDANTA RESOURCES PLC	7,455	11.800000	87,969.00	
	VODAFONE GROUP PLC	3,661,242	1.702500	6,233,264.50	
	WEIR GROUP PLC/THE	15,942	20.470000	326,332.74	
	WHITBREAD PLC	13,198	25.670000	338,792.66	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	166,884	2.574000	429,559.41	
	WOLSELEY PLC	20,393	30.000000	611,790.00	
	WPP PLC	93,614	9.800000	917,417.20	
	XSTRATA PLC	155,907	11.830000	1,844,379.81	
	イギリスポンド 小計	20,823,896		119,084,538.00 (17,101,730,502)	
スイスフラン					
	ABB LTD-REG	163,200	19.640000	3,205,248.00	
	ACTELION LTD-REG	7,979	46.200000	368,629.80	
	ADECCO SA-REG	10,297	52.200000	537,503.40	
	ARYZTA AG	6,650	51.650000	343,472.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,493	83.850000	292,888.05	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	200	488.750000	97,750.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	110	913.000000	100,430.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	38,812	77.400000	3,004,048.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	93,823	27.380000	2,568,873.74	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	500	230.100000	115,050.00	
	GEBERIT AG-REG	2,734	218.500000	597,379.00	
	GIVAUDAN-REG	646	1,025.000000	662,150.00	
	HOLCIM LTD-REG	17,059	71.700000	1,223,130.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,019	37.310000	597,668.89	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,257	109.700000	466,992.90	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	58	3,332.000000	193,256.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	37,270.000000	298,160.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,916	54.700000	214,205.20	
	NESTLE SA-REG	240,195	64.100000	15,396,499.50	
	NOVARTIS AG-REG	171,292	62.150000	10,645,797.80	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,257	68.000000	153,476.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,205	220.000000	265,100.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,357	203.500000	10,654,649.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,723	134.000000	230,882.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,733	136.600000	509,927.80	
	SGS SA-REG	414	2,196.000000	909,144.00	
	SIKA AG-BR	162	2,283.000000	369,846.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,559	108.200000	385,083.80	
	SULZER AG-REG	1,914	147.500000	282,315.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,308	504.500000	1,164,386.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,051	86.250000	263,148.75	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,256	138.500000	312,456.00	

SWISS PRIME SITE-REG	3,731	76.900000	286,913.90	
SWISS RE AG	26,379	70.000000	1,846,530.00	
SWISSCOM AG-REG	1,749	400.000000	699,600.00	
SYNGENTA AG-REG	6,965	401.500000	2,796,447.50	
TRANSOCEAN LTD	27,033	51.900000	1,403,012.70	
UBS AG-REG	271,320	16.090000	4,365,538.80	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,014	260.700000	2,871,349.80	
スイスフラン 小計	1,204,378		70,698,941.43 (6,939,808,090)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	810,600	30.850000	25,007,010.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,600	98.800000	1,541,280.00	
BANK OF EAST ASIA	94,020	31.800000	2,989,836.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	280,000	26.450000	7,406,000.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	15.500000	1,333,000.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	104,000	129.700000	13,488,800.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	38,000	47.450000	1,803,100.00	
CLP HOLDINGS LTD	131,500	65.300000	8,586,950.00	
FIRST PACIFIC CO	164,000	9.240000	1,515,360.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	154,000	34.400000	5,297,600.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	167,000	29.200000	4,876,400.00	
HANG SENG BANK LTD	58,600	124.500000	7,295,700.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	71,000	58.500000	4,153,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	393,482	21.550000	8,479,537.10	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	82,000	147.000000	12,054,000.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	40,000	32.500000	1,300,000.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	159,000	87.050000	13,840,950.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	44,000	38.800000	1,707,200.00	
KERRY PROPERTIES LTD	51,000	41.700000	2,126,700.00	
LI & FUNG LTD	446,000	11.520000	5,137,920.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	66,000	17.280000	1,140,480.00	
MTR CORP	113,500	31.350000	3,558,225.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	269,000	15.060000	4,051,140.00	
NWS HOLDINGS LTD	106,500	13.580000	1,446,270.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	16,500	54.900000	905,850.00	
PCCW LTD	333,000	3.280000	1,092,240.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,000	66.400000	6,839,200.00	
SANDS CHINA LTD	178,800	38.550000	6,892,740.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	16.880000	1,958,080.00	
SINO LAND CO	225,400	15.180000	3,421,572.00	
SJM HOLDINGS LTD	148,000	20.200000	2,989,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	129.900000	15,198,300.00	
SWIRE PACIFIC LTD-A	51,500	98.500000	5,072,750.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	82,600	28.350000	2,341,710.00	
WHARF HOLDINGS LTD	112,000	68.650000	7,688,800.00	
WHELOCK & CO LTD	69,000	43.950000	3,032,550.00	
WING HANG BANK LTD	15,500	81.600000	1,264,800.00	
WYNN MACAU LTD	120,400	20.850000	2,510,340.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	60,000	25.600000	1,536,000.00	
香港ドル 小計	5,693,502		202,881,490.10 (2,381,828,693)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	202,000	3.980000	803,960.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	95,000	2.140000	203,300.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	39,000	11.300000	440,700.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	157,000	1.880000	295,160.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,000	14.720000	2,001,920.00	
FRASER AND NEAVE LTD	72,000	9.550000	687,600.00	
GENTING SINGAPORE PLC	471,000	1.450000	682,950.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	160,000	2.730000	436,800.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	553,360	0.630000	348,616.80	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	52.250000	418,000.00	
KEPPEL CORP LTD	110,000	11.450000	1,259,500.00	
KEPPEL LAND LTD	60,000	4.140000	248,400.00	
NOBLE GROUP LTD	304,090	1.225000	372,510.25	
OLAM INTERNATIONAL LTD	117,000	1.630000	190,710.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	191,000	9.740000	1,860,340.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	72,000	5.510000	396,720.00	
SEMBCORP MARINE LTD	69,000	4.760000	328,440.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	43,340	11.080000	480,207.20	

SINGAPORE EXCHANGE LTD	69,000	7.700000	531,300.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,250	4.070000	501,627.50	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	121,000	3.840000	464,640.00	
SINGAPORE TELECOM LTD	595,260	3.450000	2,053,647.00	
STARHUB LTD	40,000	3.930000	157,200.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,000	18.860000	1,791,700.00	
UOL GROUP LTD	39,000	6.170000	240,630.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	148,000	3.840000	568,320.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	168,000	1.000000	168,000.00	
シンガポールドル 小計	4,258,300		17,932,898.75 (1,321,833,966)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81,688	2.795000	228,317.96	
CONTACT ENERGY LTD	26,093	5.160000	134,639.88	
FLETCHER BUILDING LTD	50,812	9.200000	467,470.40	
SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP	49,774	3.980000	198,100.52	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	129,226	2.380000	307,557.88	
ニュージーランドドル 小計	337,593		1,336,086.64 (101,662,832)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	24,444	139.700000	3,414,826.80	
ASSA ABLOY AB-B	25,146	244.300000	6,143,167.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	50,214	187.700000	9,425,167.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	28,507	167.900000	4,786,325.30	
BOLIDEN AB	20,204	118.700000	2,398,214.80	
ELECTROLUX AB-SER B	17,432	164.200000	2,862,334.40	
ELEKTA AB-B SHS	28,320	97.300000	2,755,536.00	
ERICSSON LM-B SHS	226,947	69.350000	15,738,774.45	
GETINGE AB-B SHS	15,461	206.600000	3,194,242.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	70,960	235.800000	16,732,368.00	
HEXAGON AB-B SHS	17,190	178.800000	3,073,572.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	29,317	40.170000	1,177,663.89	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	15,038	146.800000	2,207,578.40	
INVESTOR AB-B SHS	34,889	177.000000	6,175,353.00	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,150	168.300000	2,718,045.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,766	578.000000	2,754,748.00	
NORDEA BANK AB	198,198	66.350000	13,150,437.30	
RATOS AB-B SHS	15,854	62.500000	990,875.00	
SANDVIK AB	75,284	106.000000	7,980,104.00	
SCANIA AB-B SHS	24,907	138.500000	3,449,619.50	
SECURITAS AB-B SHS	20,695	59.800000	1,237,561.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	105,934	60.850000	6,446,083.90	
SKANSKA AB-B SHS	27,980	109.100000	3,052,618.00	
SKF AB-B SHARES	28,925	163.100000	4,717,667.50	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	43,360	150.500000	6,525,680.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	36,866	248.700000	9,168,574.20	
SWEDBANK AB - A SHARES	60,512	135.800000	8,217,529.60	
SWEDISH MATCH AB	15,894	233.700000	3,714,427.80	
TELE2 AB-B SHS	23,298	115.000000	2,679,270.00	
TELIASONERA AB	162,475	45.680000	7,421,858.00	
VOLVO AB-B SHS	105,332	97.200000	10,238,270.40	
スウェーデンクローネ 小計	1,570,499		174,548,494.44 (2,457,642,801)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	13,200	124.000000	1,636,800.00	
DNB ASA	74,639	76.200000	5,687,491.80	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,111	83.500000	1,094,768.50	
NORSK HYDRO ASA	70,019	26.940000	1,886,311.86	
ORKLA ASA	57,733	48.420000	2,795,431.86	
SEADRILL LTD	26,296	215.400000	5,664,158.40	
STATOIL ASA	83,692	146.500000	12,260,878.00	
SUBSEA 7 SA	21,777	140.200000	3,053,135.40	
TELENOR ASA	52,253	121.900000	6,369,640.70	
YARA INTERNATIONAL ASA	13,749	292.300000	4,018,832.70	
ノルウェークローネ 小計	426,469		44,467,449.22 (731,044,865)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	41	43,800.000000	1,795,800.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	100	46,080.000000	4,608,000.00	
CARLSBERG AS-B	7,890	598.500000	4,722,165.00	

COLOPLAST-B	8,520	289.200000	2,463,984.00	
DANSKE BANK A/S	48,919	106.700000	5,219,657.30	
DSV A/S	14,376	146.500000	2,106,084.00	
NOVO NORDISK A/S-B	30,358	1,016.000000	30,843,728.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	17,900	179.000000	3,204,100.00	
TDC A/S	40,164	41.900000	1,682,871.60	
TRYG A/S	1,908	418.900000	799,261.20	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,860	491.100000	913,446.00	
デンマーククローネ 小計	172,036		58,359,097.10 (958,256,374)	
イスラエルシェケル				
BANK HAPOLIM BM	90,170	15.760000	1,421,079.20	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	97,273	12.700000	1,235,367.10	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	143,512	4.320000	619,971.84	
ISRAEL CHEMICALS LTD	35,743	50.000000	1,787,150.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	227	2,614.000000	593,378.00	
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,800	181.800000	509,040.00	
NICE SYSTEMS LTD	4,700	135.400000	636,380.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	69,987	139.500000	9,763,186.50	
イスラエルシェケル 小計	444,412		16,565,552.64 (404,199,484)	
ユーロ				
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	27,742	12.890000	357,594.38	
ACCIONA SA	2,042	62.990000	128,625.58	
ACCOR SA	11,062	28.995000	320,742.69	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,024	18.225000	182,687.40	
ADIDAS AG	15,462	70.160000	1,084,813.92	
ADP	2,200	61.290000	134,838.00	
AEGON NV	128,092	4.939000	632,646.38	
AGEAS	17,646	24.355000	429,768.33	
AIR LIQUIDE SA	23,282	94.300000	2,195,492.60	
AKZO NOBEL	17,885	51.620000	923,223.70	
ALLIANZ SE-REG	33,932	105.200000	3,569,646.40	
ALSTOM	15,230	32.595000	496,421.85	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,576	18.995000	447,826.12	
ANDRITZ AG	5,327	48.990000	260,969.73	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	59,857	68.090000	4,075,663.13	
ARCELORMITTAL	75,079	13.165000	988,415.03	
ARKEMA	4,790	84.040000	402,551.60	
ASML HOLDING NV	23,364	54.700000	1,278,010.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	86,504	14.110000	1,220,571.44	
ATLANTIA SPA	24,178	13.450000	325,194.10	
ATOS	3,954	55.940000	221,186.76	
AXA SA	132,004	13.525000	1,785,354.10	
AXEL SPRINGER AG	3,401	34.810000	118,388.81	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	485,915	0.259800	126,240.71	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	406,396	7.811000	3,174,359.15	
BANCO DE SABADELL SA	208,527	2.155000	449,375.68	
BANCO POPOLARE SCARL	130,709	1.512000	197,632.00	
BANCO POPULAR ESPANOL	392,000	0.708000	277,536.00	
BANCO SANTANDER SA	771,331	6.539000	5,043,733.40	
BASF SE	68,434	75.600000	5,173,610.40	
BAYER AG-REG	61,709	75.920000	4,684,947.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,831	75.850000	1,883,431.35	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,702	50.700000	187,691.40	
BEIERSDORF AG	7,591	64.750000	491,517.25	
BELGACOM SA	11,168	22.590000	252,285.12	
BNP PARIBAS	75,020	46.665000	3,500,808.30	
BOSKALIS WESTMINSTER	5,800	34.065000	197,577.00	
BOUYGUES SA	13,649	21.870000	298,503.63	
BRENTAG AG	3,800	106.850000	406,030.00	
BUREAU VERITAS SA	4,037	88.290000	356,426.73	
CAIXABANK	64,431	3.083000	198,640.77	
CAP GEMINI	11,302	36.295000	410,206.09	
CARREFOUR SA	44,753	21.455000	960,175.61	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,324	73.430000	317,511.32	
CELESIO AG	6,516	13.620000	88,747.92	
CHRISTIAN DIOR	4,066	132.050000	536,915.30	
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	12,146	21.815000	264,964.99	
CNP ASSURANCES	11,531	12.435000	143,387.98	

COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	16,655	17.970000	299,290.35
COLRUYT SA	5,864	36.600000	214,622.40
COMMERZBANK AG	290,419	1.658000	481,514.70
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	29,532	31.625000	933,949.50
CONTINENTAL AG	8,240	85.710000	706,250.40
CREDIT AGRICOLE SA	73,425	7.578000	556,414.65
CRH PLC	54,553	15.770000	860,300.81
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	67,332	43.805000	2,949,478.26
DANONE	43,199	51.820000	2,238,572.18
DASSAULT SYSTEMES SA	4,676	84.290000	394,140.04
DE MASTER BLENDEERS1753 NV	45,640	9.069000	413,909.16
DELHAIZE GROUP	7,843	35.055000	274,936.36
DELTA LLOYD NV	8,059	14.715000	118,588.18
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	68,985	36.655000	2,528,645.17
DEUTSCHE BOERSE AG	14,321	49.180000	704,306.78
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,144	15.275000	277,149.60
DEUTSCHE POST AG-REG	67,458	17.535000	1,182,876.03
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	209,716	8.905000	1,867,520.98
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,659	5.450000	248,841.55
E.ON SE	133,616	13.315000	1,779,097.04
EADS NV	31,005	34.785000	1,078,508.92
EDENRED	12,975	23.885000	309,907.87
EDF	17,335	14.550000	252,224.25
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,121	2.360000	359,005.56
ELAN CORP PLC	38,783	7.630000	295,914.29
ELISA OYJ	11,720	17.300000	202,756.00
ENAGAS SA	13,875	18.010000	249,888.75
ENEL GREEN POWER SPA	136,769	1.533000	209,666.87
ENEL SPA	492,059	3.162000	1,555,890.55
ENI SPA	190,135	19.210000	3,652,493.35
ERSTE GROUP BANK AG	16,458	24.630000	405,360.54
ESSILOR INTERNATIONAL	15,122	77.560000	1,172,862.32
EURAZEO	2,151	39.500000	84,964.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,740	25.400000	247,396.00
EXOR SPA	5,660	22.250000	125,935.00
FERROVIAL SA	30,716	11.805000	362,602.38
FIAT INDUSTRIAL	63,049	9.490000	598,335.01
FIAT SPA	64,516	4.616000	297,805.85
FINMECCANICA SPA	31,249	5.010000	156,557.49
FORTUM OYJ	33,279	13.480000	448,600.92
FRANCE TELECOM SA	139,073	8.448000	1,174,888.70
FRAPORT AG	2,774	45.550000	126,355.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	16,000	51.950000	831,200.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,448	88.560000	836,714.88
FUGRO NV-CVA	5,393	46.295000	249,668.93
GALP ENERGIA SGPS SA	23,337	12.220000	285,178.14
GAS NATURAL SDG SA	26,655	14.795000	394,360.72
GDF SUEZ	95,227	15.320000	1,458,877.64
GEA GROUP AG	13,359	27.720000	370,311.48
GEMALTO	6,051	65.040000	393,557.04
GRIFOLS SA	11,671	25.400000	296,443.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,173	61.870000	381,923.51
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	43,627	6.460000	281,830.42
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,400	60.000000	264,000.00
HEIDELBERGCEMENT AG	10,630	45.925000	488,182.75
HEINEKEN HOLDING NV	7,371	43.015000	317,063.56
HEINEKEN NV	16,899	51.600000	871,988.40
HENKEL AG & CO KGAA	9,861	55.500000	547,285.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,413	65.260000	875,332.38
HOCHTIEF AG	2,392	48.290000	115,509.68
HUGO BOSS AG -ORD	1,750	88.240000	154,420.00
IBERDROLA SA	297,858	4.124000	1,228,366.39
ILIAD SA	1,783	138.100000	246,232.30
IMERYS SA	2,595	49.730000	129,049.35
IMMOFINANZ AG	72,491	3.262000	236,465.64
INDITEX	16,383	107.350000	1,758,715.05
INFINEON TECHNOLOGIES AG	80,419	6.695000	538,405.20
ING GROEP NV-CVA	284,598	7.361000	2,094,925.87
INTESA SANPAOLO	762,171	1.486000	1,132,586.10

INTESA SANPAOLO-RSP	65,939	1.227000	80,907.15	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	69,461	2.614000	181,571.05	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248			
JERONIMO MARTINS	18,589	15.905000	295,658.04	
K+S AG-REG	12,544	34.450000	432,140.80	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,650	60.200000	400,330.00	
KBC GROEP NV	17,738	28.595000	507,218.11	
KERRY GROUP PLC-A	10,990	38.100000	418,719.00	
KESKO OYJ-B SHS	5,314	24.430000	129,821.02	
KONE OYJ-B	11,543	58.850000	679,305.55	
KONINKLIJKE AHOLD NV	73,424	10.875000	798,486.00	
KONINKLIJKE DSM NV	11,343	47.195000	535,332.88	
KONINKLIJKE KPN NV	72,214	4.243000	306,404.00	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	77,247	22.090000	1,706,386.23	
LAFARGE SA	13,931	46.870000	652,945.97	
LAGARDERE S.C.A.	9,629	26.290000	253,146.41	
LANXESS AG	6,085	64.490000	392,421.65	
LEGRAND SA	17,723	34.250000	607,012.75	
LINDE AG	13,842	136.650000	1,891,509.30	
L'OREAL	17,861	111.100000	1,984,357.10	
LUXOTTICA GROUP SPA	12,020	33.550000	403,271.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,991	140.850000	2,674,882.35	
MAN SE	3,277	88.740000	290,800.98	
MAPFRE SA	60,537	2.340000	141,656.58	
MEDIOBANCA SPA	38,192	5.490000	209,674.08	
MERCK KGAA	4,736	103.050000	488,044.80	
METRO AG	9,801	22.920000	224,638.92	
METSO OYJ	9,355	34.310000	320,970.05	
MICHELIN (CGDE)	13,464	70.480000	948,942.72	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,353	135.350000	1,807,328.55	
NATIXIS	68,194	2.943000	200,694.94	
NESTE OIL OYJ	10,293	11.010000	113,325.93	
NOKIA OYJ	277,638	3.080000	855,125.04	
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,978	32.900000	262,476.20	
OMV AG	11,398	30.685000	349,747.63	
ORION OYJ-CLASS B	7,072	20.910000	147,875.52	
PERNOD-RICARD SA	15,930	91.980000	1,465,241.40	
PEUGEOT SA	15,951	6.140000	97,939.14	
PIRELLI & C.	17,226	9.225000	158,909.85	
POHJOLA BANK PLC-A SHS	11,086	12.540000	139,018.44	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	11,500	65.670000	755,205.00	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	51,177	4.163000	213,049.85	
PPR	5,637	156.050000	879,653.85	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PRF	6,092	25.180000	153,396.56	
PRYSMIAN SPA	14,910	16.250000	242,287.50	
PUBLICIS GROUPE	13,262	49.155000	651,893.61	
QIAGEN N.V.	17,950	14.905000	267,544.75	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,565	33.000000	117,645.00	
RANDSTAD HOLDING NV	8,635	30.245000	261,165.57	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,782	42.000000	326,844.00	
REED ELSEVIER NV	52,490	11.530000	605,209.70	
REMY COINTREAU	1,488	93.300000	138,830.40	
RENAULT SA	13,980	43.995000	615,050.10	
REPSOL SA	62,308	17.450000	1,087,274.60	
REXEL SA	8,736	16.330000	142,658.88	
RWE AG	36,387	28.435000	1,034,664.34	
RWE AG-NON VTG PREF	2,346	26.600000	62,403.60	
SAFRAN SA	16,740	34.450000	576,693.00	
SAIPEM SPA	20,062	31.490000	631,752.38	
SALZGITTER AG	3,128	35.730000	111,763.44	
SAMPO OYJ-A SHS	31,153	25.810000	804,058.93	
SANOFI	88,835	73.090000	6,492,950.15	
SAP AG	68,502	60.040000	4,112,860.08	

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	SCHNEIDER ELECTRIC SA	39,157	56.300000	2,204,539.10	
	SCOR SE	12,398	21.010000	260,481.98	
	SES	22,479	21.685000	487,457.11	
	SIEMENS AG-REG	61,100	81.830000	4,999,813.00	
	SNAM SPA	127,832	3.728000	476,557.69	
	SOCIETE BIC SA	2,250	97.210000	218,722.50	
	SOCIETE GENERALE	52,103	33.725000	1,757,173.67	
	SODEXO	7,250	66.140000	479,515.00	
	SOLVAY SA	4,392	117.500000	516,060.00	
	STMICROELECTRONICS NV	48,058	6.420000	308,532.36	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	42,501	5.445000	231,417.94	
	SUEDZUCKER AG	6,399	30.550000	195,489.45	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	20,106	9.880000	198,647.28	
	TECHNIP SA	7,597	84.820000	644,377.54	
	TELECOM ITALIA SPA	685,560	0.723500	496,002.66	
	TELECOM ITALIA-RSP	454,039	0.628000	285,136.49	
	TELEFONICA SA	305,712	10.900000	3,332,260.80	
	TELEKOM AUSTRIA AG	15,491	5.513000	85,401.88	
	TELENET GROUP HOLDING NV	4,189	35.925000	150,489.82	
	TENARIS SA	35,899	15.740000	565,050.26	
	TERNA SPA	95,507	3.106000	296,644.74	
	THALES SA	6,433	26.995000	173,658.83	
	THYSSENKRUPP AG	28,811	17.745000	511,251.19	
	TNT EXPRESS NV	25,247	5.507000	139,035.22	
	TOTAL SA	159,100	39.825000	6,336,157.50	
	UBI BANCA SCPA	65,520	3.892000	255,003.84	
	UCB SA	7,990	42.845000	342,331.55	
	UMICORE	8,315	40.705000	338,462.07	
	UNICREDIT SPA	301,668	4.672000	1,409,392.89	
	UNILEVER NV-CVA	121,092	29.820000	3,610,963.44	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,427	17.180000	127,595.86	
	UPM-KYMMENE OYJ	38,542	9.550000	368,076.10	
	VALLOUREC	7,908	42.890000	339,174.12	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,852	9.461000	254,046.77	
VERBUND AG	4,728	16.610000	78,532.08		
VIENNA INSURANCE GROUP AG	2,881	39.050000	112,503.05		
VINCI SA	34,253	38.495000	1,318,569.23		
VIVENDI	97,269	15.860000	1,542,686.34		
VOESTALPINE AG	8,689	27.460000	238,599.94		
VOLKSWAGEN AG	2,159	172.750000	372,967.25		
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,771	184.650000	1,988,865.15		
VOPAK	5,118	50.310000	257,486.58		
WARTSILA OYJ ABP	12,374	36.010000	445,587.74		
WENDEL	2,600	82.510000	214,526.00		
WOLTERS KLUWER	22,853	15.130000	345,765.89		
ZARDOYA OTIS SA	11,750	11.650000	136,887.50		
ZIGGO NV	9,455	22.655000	214,203.02		
ZODIAC AEROSPACE	2,528	80.990000	204,742.72		
ユーロ 小計		12,981,000		184,085,743.08 (22,548,662,669)	
合計		77,982,343		163,526,479,317 (163,526,479,317)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨	銘柄	口数	評価額	備考
種類				
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,000.00	783,250.00	
	AMERICAN TOWER CORP	29,300.00	2,341,070.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	71,200.00	1,057,320.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,300.00	1,148,886.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,400.00	1,247,844.00	

CAMDEN PROPERTY TRUST		6,000.00	422,640.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC		9,000.00	651,060.00	
DUKE REALTY CORP		19,400.00	296,432.00	
EQUITY RESIDENTIAL		23,800.00	1,382,542.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		4,954.00	522,399.30	
GENERAL GROWTH PROPERTIES		31,100.00	612,048.00	
HCP INC		34,207.00	1,607,729.00	
HEALTH CARE REIT INC		19,097.00	1,202,156.15	
HOST HOTELS & RESORTS INC		54,000.00	928,260.00	
KIMCO REALTY CORP		30,200.00	625,140.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST		8,900.00	345,498.00	
MACERICH CO/THE		10,000.00	593,400.00	
PLUM CREEK TIMBER CO		12,458.00	589,387.98	
PROLOGIS INC		34,700.00	1,410,208.00	
PUBLIC STORAGE		10,800.00	1,649,160.00	
RAYONIER INC		9,000.00	488,430.00	
REALTY INCOME CORP		9,500.00	413,060.00	
REGENCY CENTERS CORP		6,700.00	336,742.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC		22,669.00	3,680,312.15	
SL GREEN REALTY CORP		6,900.00	561,936.00	
UDR INC		19,600.00	485,296.00	
VENTAS INC		21,900.00	1,459,635.00	
VORNADO REALTY TRUST		12,400.00	1,059,580.00	
WEYERHAEUSER CO		40,200.00	1,244,190.00	
投資証券 小計		602,685.00	29,145,611.58 (2,653,125,022)	
アメリカドル 小計		602,685.00	29,145,611.58 (2,653,125,022)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,100.00	145,302.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,600.00	257,568.00	
投資証券 小計		15,700.00	402,870.00 (36,391,247)	
カナダドル 小計		15,700.00	402,870.00 (36,391,247)	
オーストラリアドル				
投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	142,816.00	289,916.48	
	DEXUS PROPERTY GROUP	342,794.00	363,361.64	
	FEDERATION CENTRES	99,634.00	228,161.86	
	GOODMAN GROUP	125,866.00	566,397.00	
	GPT GROUP	104,969.00	387,335.61	
	MIRVAC GROUP	249,258.00	388,842.48	
	STOCKLAND	168,731.00	592,245.81	
	WESTFIELD GROUP	160,009.00	1,755,298.73	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	213,231.00	675,942.27	
投資証券 小計		1,607,308.00	5,247,501.88 (497,673,078)	
オーストラリアドル 小計		1,607,308.00	5,247,501.88 (497,673,078)	
イギリスポンド				
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	64,653.00	364,966.18	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	42,078.00	151,102.09	
	HAMMERSON PLC	52,875.00	259,669.12	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	57,984.00	471,989.76	
	SEGRO PLC	57,308.00	142,410.38	
投資証券 小計		274,898.00	1,390,137.53 (199,637,650)	
イギリスポンド 小計		274,898.00	1,390,137.53 (199,637,650)	
香港ドル				
投資証券	LINK REIT	168,500.00	6,689,450.00	
投資証券 小計		168,500.00	6,689,450.00 (78,534,143)	
香港ドル 小計		168,500.00	6,689,450.00 (78,534,143)	
シンガポールドル				
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	142,000.00	359,260.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	151,000.00	255,190.00	
	CAPITAMALL TRUST	180,000.00	381,600.00	

投資証券 小計		473,000.00	996,050.00 (73,418,845)
シンガポールドル 小計		473,000.00	996,050.00 (73,418,845)
ユーロ			
投資証券	CORIO NV	5,173.00	187,935.09
	FONCIERE DES REGIONS	1,756.00	110,786.04
	GECINA SA	1,635.00	142,245.00
	ICADE	1,941.00	128,106.00
	KLEPIERRE	7,368.00	217,798.08
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,861.00	1,198,959.75
投資証券 小計		24,734.00	1,985,829.96 (243,244,311)
ユーロ 小計		24,734.00	1,985,829.96 (243,244,311)
合 計			3,782,024,296 (3,782,024,296)

(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。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 575銘柄	97.24%		55.92%
	投資証券 29銘柄		2.76%	1.59%
カナダドル	株式 95銘柄	99.58%		5.16%
	投資証券 2銘柄		0.42%	0.02%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	92.78%		3.83%
	投資証券 9銘柄		7.22%	0.30%
イギリスポンド	株式 100銘柄	98.85%		10.22%
	投資証券 5銘柄		1.15%	0.12%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.00%		4.15%
香港ドル	株式 39銘柄	96.81%		1.42%
	投資証券 1銘柄		3.19%	0.05%
シンガポールドル	株式 27銘柄	94.74%		0.79%
	投資証券 3銘柄		5.26%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%		0.06%
スウェーデンクローネ	株式 31銘柄	100.00%		1.47%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%		0.44%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.00%		0.57%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%		0.24%
ユーロ	株式 228銘柄	98.93%		13.48%
	投資証券 6銘柄		1.07%	0.15%

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](#) [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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	285,596,161	580,333,506
コール・ローン	66,228,570	89,313,714
株式	12,517,424,739	20,628,179,002
投資証券	123,598,583	
派生商品評価勘定	46,637,666	5,647,501
未収配当金	13,525,326	16,499,069
未収利息	152	234
差入委託証拠金	123,010,487	47,452,672
流動資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698
資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,486,449
未払金		7,232
未払解約金	7,760,426	67,882,882
流動負債合計	7,760,426	71,376,563
負債合計	7,760,426	71,376,563
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,361,956,272	11,906,677,405
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,806,304,986	9,389,371,730
元本等合計	13,168,261,258	21,296,049,135
純資産合計	13,168,261,258	21,296,049,135
負債純資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698

(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>(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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年1月27日	平成24年1月27日
期首元本額	4,566,156,095円	9,361,956,272円
期首からの追加設定元本額	5,227,468,376円	3,515,599,009円
期首からの一部解約元本額	431,668,199円	970,877,876円
元本の内訳*		
F P バランスファンド（安定型）	6,276,576円	5,784,651円
F P バランスファンド（安定成長型）	42,732,885円	31,068,433円
e M A X I S 新興国株式インデックス	7,938,153,268円	9,665,560,377円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	9,945,628円	60,856,926円
e M A X I S バランス（波乗り型）	2,388,202円	62,298,418円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）		264,392円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	518,388,873円	1,173,326,842円
新興国株式インデックスオープン	88,742,635円	99,900,371円
e M A X I S 全世界株式インデックス	101,760,173円	130,663,297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）	5,803,933円	5,684,274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）	647,764,099円	671,269,424円
（合計）	9,361,956,272円	11,906,677,405円
2 受益権の総数	9,361,956,272口	11,906,677,405口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4066円 （14,066円）	1.7886円 （17,886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1月27日 至平成24年1月26日）	（自平成24年1月27日 至平成25年1月28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1月26日現在]	[平成25年1月28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1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	628,717,128	1,855,060,107
投資証券	17,959,633	
合計	646,676,761	1,855,060,107

（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1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建	440,630,700		487,268,366	46,637,666
	合計	440,630,700		487,268,366	46,637,666

区分	種類	[平成25年1月28日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建	675,605,999		677,767,051	2,161,052
	合計	675,605,999		677,767,051	2,161,052

（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。

（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。

[前へ](#) [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	24.970000	124,850.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	7,199	18.820000	135,485.18	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	10,800	31.240000	337,392.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	43,132	5.575000	240,460.90	
	COMPANHIA DE BEBIDAS-PRF ADR	3,000	45.770000	137,310.00	
	CREDICORP LTD	3,800	156.490000	594,662.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	2,000	63.270000	126,540.00	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	75,000	2.568000	192,600.00	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	315,000	9.740000	3,068,100.00	
	HDFC BANK LTD-ADR	4,500	40.810000	183,645.00	
	HON HAI PRECISION-GDR REG S	43,366	5.635000	244,367.41	
	INFOSYS LTD-SP ADR	4,000	52.670000	210,680.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,000	5.839000	210,204.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	7,090	17.640000	125,067.60	
	LSR GROUP OJSC-GDR REGS	18,000	4.989000	89,802.00	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	30,400	67.400000	2,048,960.00	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	15,000	46.250000	693,750.00	
	MECHEL-SPONSORED ADR	18,400	6.820000	125,488.00	
	MEGAFON-GDR	4,500	27.000000	121,500.00	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	27,300	20.340000	555,282.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	30,000	19.210000	576,300.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,600	119.200000	667,520.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7,000	22.090000	154,630.00	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	6,900	38.250000	263,925.00	
	ORASCOM TELECOM-GDR REG S	40,000	3.168000	126,720.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	5,500	19.810000	108,955.00	
	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	6,000	34.070000	204,420.00	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	72,000	9.100000	655,200.00	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	10,500	24.800000	260,400.00	
	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	340	648.000000	220,320.00	
	SASOL LTD-SPONSORED ADR	2,000	42.650000	85,300.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	167,000	13.900000	2,321,300.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,000	12.920000	129,200.00	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	9,000	21.400000	192,600.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	10,107	41.250000	416,913.75	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	76,000	9.830000	747,080.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	7,614	17.750000	135,148.50	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	14,766	46.220000	682,484.52	
	TMK-GDR REG S	6,000	15.360000	92,160.00	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	15,400	38.250000	589,050.00	
	VALE SA-SP ADR	10,000	19.550000	195,500.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	89,000	3.880000	345,320.00	
	アメリカドル 小計	1,274,214		18,736,592.86 (1,705,592,048)	
香港ドル					
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	10.980000	1,317,600.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,230,000	4.220000	5,190,600.00	
	AIR CHINA LTD-H	26,000	6.660000	173,160.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.780000	793,800.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	6.060000	145,440.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	74,000	28.750000	2,127,500.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	65,000	6.890000	447,850.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	120,000	3.650000	438,000.00	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,330,000	3.760000	16,280,800.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	401,900	6.390000	2,568,141.00	
	BBMG CORPORATION-H	80,000	7.150000	572,000.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	130,000	6.380000	829,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	30,000	54.450000	1,633,500.00	
	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	255,000	17.300000	4,411,500.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	220,000	2.260000	497,200.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	150,000	10.060000	1,509,000.00	

BYD CO LTD-H	10,500	25.950000	272,475.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	134,000	4.720000	632,480.00
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	100,000	5.410000	541,000.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	450,000	5.230000	2,353,500.00
CHINA COAL ENERGY CO-H	230,000	8.520000	1,959,600.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	265,000	7.820000	2,072,300.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	170,000	4.460000	758,200.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,175,550	6.670000	27,850,918.50
CHINA COSCO HOLDINGS-H	70,000	4.300000	301,000.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	54,000	14.420000	778,680.00
CHINA FOODS LTD	56,000	7.120000	398,720.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	180,000	6.610000	1,189,800.00
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	9,300	14.800000	137,640.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	422,000	25.650000	10,824,300.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	106,000	6.380000	676,280.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	76,000	23.050000	1,751,800.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	209,550	18.440000	3,864,102.00
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	68,000	26.850000	1,825,800.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	280,000	10.860000	3,040,800.00
CHINA MOBILE LTD	349,500	84.000000	29,358,000.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	150,000	11.760000	1,764,000.00
CHINA OILFIELD SERVICES-H	68,000	16.480000	1,120,640.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	224,000	24.200000	5,420,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	138,000	30.700000	4,236,600.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	990,000	9.440000	9,345,600.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	120,000	8.160000	979,200.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	283,000	4.320000	1,222,560.00
CHINA RESOURCES CEMENT	140,000	4.890000	684,600.00
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	74,000	27.300000	2,020,200.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	60,000	16.760000	1,005,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	136,000	22.800000	3,100,800.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	110,000	20.400000	2,244,000.00
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	100,000	5.370000	537,000.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	192,000	32.350000	6,211,200.00
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	161,000	2.430000	391,230.00
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	40,000	4.510000	180,400.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	140,000	4.590000	642,600.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	100,000	10.160000	1,016,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,000	15.500000	403,000.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	830,000	4.190000	3,477,700.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	284,000	12.240000	3,476,160.00
CHINA VANKE CO LTD -B	84,951	16.160000	1,372,808.16
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	120,000	4.850000	582,000.00
CITIC PACIFIC LTD	50,000	12.520000	626,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	42,000	19.720000	828,240.00
CNOOC LTD	1,040,000	15.820000	16,452,800.00
COSCO PACIFIC LTD	80,000	12.240000	979,200.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	197,232	3.920000	773,149.44
CSR CORP LTD - H	80,000	6.260000	500,800.00
DAH CHONG HONG	70,000	8.820000	617,400.00
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	9.790000	587,400.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	200,000	3.090000	618,000.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	5,600	14.700000	82,320.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	168,000	12.220000	2,052,960.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	40,000	38.400000	1,536,000.00
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	240,000	4.140000	993,600.00
FAR EAST HORIZON LTD	70,000	5.710000	399,700.00
FOSUN INTERNATIONAL	93,000	5.400000	502,200.00
FRANSHION PROPERTIES	200,000	2.820000	564,000.00
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	400,000	2.140000	856,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	290,000	4.040000	1,171,600.00
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	40,000	17.780000	711,200.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	310,000	0.960000	297,600.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	29.900000	1,794,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	116,000	6.180000	716,880.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	130,675	6.380000	833,706.50
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	39,200	13.880000	544,096.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	65,000	12.400000	806,000.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	70,000	12.480000	873,600.00

HENGAN INTL GROUP CO LTD	40,000	76.350000	3,054,000.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	120,000	4.210000	505,200.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	196,000	7.270000	1,424,920.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,756,350	5.910000	22,200,028.50	
INTIME DEPARTMENT STORE	80,000	10.540000	843,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	70,000	7.850000	549,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	82,000	20.350000	1,668,700.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	45,000	26.200000	1,179,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	180,000	16.340000	2,941,200.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	170,000	5.080000	863,600.00	
LENOVO GROUP LTD	368,000	8.220000	3,024,960.00	
LONGFOR PROPERTIES	100,000	14.420000	1,442,000.00	
MMG LTD	140,000	3.090000	432,600.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	128,000	6.960000	890,880.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	64,000	6.200000	396,800.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,219,000	11.040000	13,457,760.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	160,000	11.500000	1,840,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	109,000	68.650000	7,482,850.00	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	90,000	5.950000	535,500.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	104,000	7.300000	759,200.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	300,000	3.220000	966,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	32,000	27.450000	878,400.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,000	16.080000	804,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	104,500	15.960000	1,667,820.00	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	168,000	3.210000	539,280.00	
SHUI ON LAND LTD	227,600	3.670000	835,292.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	160,000	3.390000	542,400.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	130,000	6.210000	807,300.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24,000	2.560000	61,440.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	30,000	24.500000	735,000.00	
SOHO CHINA LTD	150,000	6.960000	1,044,000.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	140,000	11.140000	1,559,600.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	59,000	267.200000	15,764,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	108,000	21.650000	2,338,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	45.700000	731,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	86,000	9.480000	815,280.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	335,000	10.420000	3,490,700.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	29,200	31.250000	912,500.00	
WUMART STORES INC-H	35,000	15.380000	538,300.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	126,000	13.160000	1,658,160.00	
YINGDE GASES GROUP COMPANY	80,000	8.340000	667,200.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	500,000	2.730000	1,365,000.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	50,000	11.640000	582,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	100,000	6.730000	673,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	52,000	11.880000	617,760.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	31,000	25.000000	775,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	240,000	3.010000	722,400.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	52,000	10.360000	538,720.00	
ZTE CORP-H	38,276	14.360000	549,643.36	
香港ドル 小計	34,283,884		326,348,330.46 (3,831,329,399)	
マレーシアリングット				
AIRASIA BHD	130,000	2.780000	361,400.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,000	4.270000	298,900.00	
AMMB HOLDINGS BHD	114,000	6.370000	726,180.00	
AXIATA GROUP BERHAD	150,000	6.370000	955,500.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	42,928	4.360000	187,166.08	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD-NEW	953	4.360000	4,155.08	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,000	58.340000	350,040.00	
BUMI ARMADA BERHAD	70,000	3.770000	263,900.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	276,800	7.210000	1,995,728.00	
DIGI.COM BHD	175,000	4.930000	862,750.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	70,000	4.590000	321,300.00	
GAMUDA BHD	105,000	3.640000	382,200.00	
GENTING BHD	114,900	9.600000	1,103,040.00	
GENTING MALAYSIA BHD	127,900	3.700000	473,230.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	15,000	8.550000	128,250.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	29,000	14.220000	412,380.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,000	13.700000	123,300.00	
IHH HEALTHCARE BHD	140,000	3.300000	462,000.00	

IJM CORP BHD	59,100	5.020000	296,682.00	
IOI CORPORATION BHD	176,400	4.930000	869,652.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	25,700	21.860000	561,802.00	
LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	25,000	9.400000	235,000.00	
MALAYAN BANKING BHD	236,000	8.900000	2,100,400.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	40,000	5.500000	220,000.00	
MAXIS BHD	138,000	6.380000	880,440.00	
MISC BHD	60,000	4.350000	261,000.00	
MMC CORP BHD	14,000	2.520000	35,280.00	
PARKSON HOLDINGS BHD	45,000	4.770000	214,650.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	145,000	6.070000	880,150.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	12,000	23.000000	276,000.00	
PETRONAS GAS BHD	33,700	18.900000	636,930.00	
PPB GROUP BERHAD	16,300	12.400000	202,120.00	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	60,000	15.660000	939,600.00	
RHB CAPITAL BHD	45,000	7.760000	349,200.00	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	130,000	2.950000	383,500.00	
SIME DARBY BERHAD	160,000	9.290000	1,486,400.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	60,000	5.570000	334,200.00	
TENAGA NASIONAL BHD	150,000	7.050000	1,057,500.00	
UEM LAND HOLDINGS BHD	120,000	2.190000	262,800.00	
UMW HOLDINGS BHD	35,000	12.100000	423,500.00	
YTL CORPORATION BERHAD	302,464	1.730000	523,262.72	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	200,000	1.550000	310,000.00	
マレーシアリングット 小計	3,935,145		23,151,487.88 (689,914,338)	
タイバーツ				
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	72,700	206.000000	14,976,200.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	32,000	108.000000	3,456,000.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	85,000	202.000000	17,170,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	24,000	129.000000	3,096,000.00	
BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	123,300	34.000000	4,192,200.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	6,000	392.000000	2,352,000.00	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	55,000	68.750000	3,781,250.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	50,000	82.500000	4,125,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	150,000	34.250000	5,137,500.00	
CP ALL PCL-NVDR	265,200	49.000000	12,994,800.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	40,000	77.250000	3,090,000.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	60,000	27.000000	1,620,000.00	
IRPC PCL - NVDR	650,000	4.320000	2,808,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	108,000	196.500000	21,222,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	200,000	23.700000	4,740,000.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	81,000	162.500000	13,162,500.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	81,561	79.500000	6,484,099.50	
PTT PCL-NVDR	51,000	333.000000	16,983,000.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	22,000	446.000000	9,812,000.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	97,000	178.000000	17,266,000.00	
SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	7,000	432.000000	3,024,000.00	
THAI OIL PCL-NVDR	70,000	73.000000	5,110,000.00	
タイバーツ 小計	2,330,761		176,602,549.50 (536,871,750)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	150,000	55.750000	8,362,500.00	
ABOITIZ POWER CORP	110,000	37.900000	4,169,000.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	300,000	17.480000	5,244,000.00	
AYALA CORPORATION	11,920	552.000000	6,579,840.00	
AYALA LAND INC	300,000	27.750000	8,325,000.00	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,000	105.000000	5,460,000.00	
BDO UNIBANK INC	70,000	76.150000	5,330,500.00	
DMCI HOLDINGS INC	60,000	54.300000	3,258,000.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	500,000	6.980000	3,490,000.00	
GLOBE TELECOM INC	2,000	1,168.000000	2,336,000.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	50,000	76.350000	3,817,500.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,200	107.100000	1,092,420.00	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,500	2,820.000000	7,050,000.00	
SAN MIGUEL CORP	30,000	105.900000	3,177,000.00	
SM INVESTMENTS CORP	9,400	944.000000	8,873,600.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	562,500	16.980000	9,551,250.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	55,000	86.200000	4,741,000.00	

フィリピンペソ 小計	2,275,520		90,857,610.00 (203,521,046)
インドネシアルピア			
ADARO ENERGY TBK PT	1,000,000	1,700.000000	1,700,000,000.00
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	36,000	19,350.000000	696,600,000.00
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,140,000	7,800.000000	8,892,000,000.00
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	720,000	9,350.000000	6,732,000,000.00
BANK DANAMON INDONESIA TBK	116,000	6,050.000000	701,800,000.00
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	477,000	8,800.000000	4,197,600,000.00
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	330,000	3,875.000000	1,278,750,000.00
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	670,000	7,850.000000	5,259,500,000.00
BUMI RESOURCES TBK PT	1,000,000	620.000000	620,000,000.00
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	420,000	3,650.000000	1,533,000,000.00
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	450,000	2,300.000000	1,035,000,000.00
GUDANG GARAM TBK PT	25,000	50,500.000000	1,262,500,000.00
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	22,000	40,400.000000	888,800,000.00
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	85,000	21,600.000000	1,836,000,000.00
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	247,000	6,000.000000	1,482,000,000.00
INDOSAT TBK PT	120,000	7,000.000000	840,000,000.00
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	150,000	5,150.000000	772,500,000.00
KALBE FARMA TBK PT	1,250,000	1,060.000000	1,325,000,000.00
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	260,000	2,425.000000	630,500,000.00
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	602,500	4,650.000000	2,801,625,000.00
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	180,000	15,450.000000	2,781,000,000.00
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	56,500	15,700.000000	887,050,000.00
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	590,000	9,800.000000	5,782,000,000.00
UNILEVER INDONESIA TBK PT	90,000	22,250.000000	2,002,500,000.00
UNITED TRACTORS TBK PT	95,000	20,000.000000	1,900,000,000.00
XL AXIATA TBK PT	130,000	5,300.000000	689,000,000.00
インドネシアルピア 小計	10,262,000		58,526,725,000.00 (550,151,215)
メキシコペソ			
ALFA S.A.B. -A	170,000	30.940000	5,259,800.00
ALPEK SA DE CV	35,000	32.500000	1,137,500.00
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,115,000	15.950000	33,734,250.00
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	19,866	95.920000	1,905,546.72
CEMEX SAB-CPO	671,031	13.620000	9,139,442.22
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	24,200	199.680000	4,832,256.00
COMPARTAMOS SAB DE CV	56,000	19.400000	1,086,400.00
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	11,000	139.570000	1,535,270.00
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	111,000	138.450000	15,367,950.00
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,000	152.560000	2,135,840.00
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	17,000	78.660000	1,337,220.00
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	108,000	33.360000	3,602,880.00
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	33,700	61.620000	2,076,594.00
GRUPO FIN SANTANDER-B	95,000	42.510000	4,038,450.00
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	112,000	89.770000	10,054,240.00
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	118,000	36.480000	4,304,640.00
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	226,770	49.730000	11,277,272.10
GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	34,200	114.760000	3,924,792.00
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	140,000	71.790000	10,050,600.00
INDUSTRIAS CH S.A.B.-SER B	11,000	101.960000	1,121,560.00
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,000	635.010000	5,080,080.00
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	84,600	34.550000	2,922,930.00
MEXICHEM SAB DE CV-*	65,000	73.250000	4,761,250.00
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	38,700	54.430000	2,106,441.00
WALMART DE MEXICO-SER V	307,000	40.990000	12,583,930.00
メキシコペソ 小計	4,626,067		155,377,134.04 (1,115,607,822)
ブラジルレアル			
AES TIETE SA-PREF	6,700	21.500000	144,050.00
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	33,000	8.570000	282,810.00
AMIL PARTICIPACOES SA	6,000	31.160000	186,960.00
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	9,000	35.900000	323,100.00
ARTERIS SA	8,000	19.700000	157,600.00
BANCO BRADESCO S.A.	28,800	36.350000	1,046,880.00
BANCO BRADESCO SA-PREF	108,186	37.750000	4,084,021.50
BANCO DO BRASIL S.A.	30,900	25.400000	784,860.00
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	10,000	17.500000	175,000.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	46,000	14.640000	673,440.00

BM&FBOVESPA SA	100,000	13.640000	1,364,000.00
BR MALLS PARTICIPACOES SA	25,000	26.850000	671,250.00
BR PROPERTIES SA	14,000	26.560000	371,840.00
BRADSPAR SA -PREF	9,000	30.520000	274,680.00
BRASKEM SA-PREF A	2,000	13.960000	27,920.00
BRF - BRASIL FOODS SA	36,500	45.600000	1,664,400.00
CCR SA	51,000	20.270000	1,033,770.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	18,500	7.250000	134,125.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	12,000	12.650000	151,800.00
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	14,000	24.720000	346,080.00
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	6,100	88.670000	540,887.00
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	42,500	92.400000	3,927,000.00
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	5,500	91.130000	501,215.00
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	8,700	20.900000	181,830.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	27,833	22.560000	627,912.48
CIA HERING	7,000	36.500000	255,500.00
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,000	33.220000	265,760.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	7,000	90.770000	635,390.00
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	4,500	46.900000	211,050.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,200	11.380000	480,236.00
CIELO SA	15,744	54.750000	861,984.00
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	7,500	44.490000	333,675.00
CPFL ENERGIA SA	14,500	21.470000	311,315.00
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	20,000	18.000000	360,000.00
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	10,000	13.220000	132,200.00
DURATEX SA	14,760	14.020000	206,935.20
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	12,000	17.460000	209,520.00
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,000	12.350000	222,300.00
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	6,000	14.150000	84,900.00
EMBRAER SA	33,000	15.930000	525,690.00
FIBRIA CELULOSE SA	11,000	26.200000	288,200.00
GERDAU SA-PREF	49,200	17.690000	870,348.00
HYPERMARCAS SA	21,000	16.480000	346,080.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	125,400	35.740000	4,481,796.00
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	138,972	10.490000	1,457,816.28
JBS SA	30,000	7.590000	227,700.00
KLABIN SA-PREF	25,000	13.680000	342,000.00
KROTON EDUCACIONAL SA	3,000	45.550000	136,650.00
LIGHT SA	5,000	21.250000	106,250.00
LOCALIZA RENT A CAR	6,000	36.400000	218,400.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	29,215	17.280000	504,835.20
LOJAS RENNER S.A.	7,500	78.270000	587,025.00
MARCOPOLO SA-PREF	15,000	13.150000	197,250.00
METALURGICA GERDAU SA-PREF	16,500	22.320000	368,280.00
MPX ENERGIA SA	13,500	11.400000	153,900.00
MRV ENGENHARIA	22,000	10.900000	239,800.00
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,000	57.190000	285,950.00
MULTIPLUS SA	3,500	43.950000	153,825.00
NATURA COSMETICOS SA	10,000	55.150000	551,500.00
ODONTOPREV S.A.	21,000	10.140000	212,940.00
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	68,000	4.820000	327,760.00
OI SA	5,589	9.050000	50,580.45
OI SA-PREFERENCE	63,815	7.960000	507,967.40
PDG REALTY SA	79,000	3.200000	252,800.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	171,000	19.920000	3,406,320.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	232,000	19.610000	4,549,520.00
PORTO SEGURO SA	8,900	24.080000	214,312.00
QUALICORP SA	6,000	21.330000	127,980.00
RAIA DROGASIL SA	9,000	22.900000	206,100.00
SOUZA CRUZ SA	21,000	32.300000	678,300.00
SUL AMERICA SA - UNITS	10,000	17.400000	174,000.00
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	16,975	50.520000	857,577.00
TIM PARTICIPACOES SA	54,377	8.600000	467,642.20

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ブラジルリアル					
	TOTVS SA	6,000	43.070000	258,420.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	7,500	36.030000	270,225.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	18,000	45.500000	819,000.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,000	10.570000	179,690.00	
	VALE SA	67,000	40.000000	2,680,000.00	
	VALE SA-PREF	113,000	38.630000	4,365,190.00	
	WEG SA	15,000	26.870000	403,050.00	
	ブラジルリアル 小計	2,426,366		57,300,865.71 (2,569,370,818)	
チリペソ					
	AES GENER SA	140,000	318.650000	44,611,000.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	180,000	348.600000	62,748,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,100,000	77.500000	85,250,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,522	35,399.000000	53,877,278.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	3,800,000	35.590000	135,242,000.00	
	CAP SA	4,500	17,500.000000	78,750,000.00	
	CENCOSUD SA	61,000	2,835.800000	172,983,800.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,900	7,603.300000	52,462,770.00	
	COLBUN SA	350,000	144.060000	50,421,000.00	
	CORPBANCA	6,000,000	6.571000	39,426,000.00	
	E.CL SA	30,000	1,124.500000	33,735,000.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	14,000	3,070.000000	42,980,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	200,000	809.390000	161,878,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	5,000	10,290.000000	51,450,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	64,000	1,863.800000	119,283,200.00	
	EMPRESAS COPEC SA	25,200	7,215.600000	181,833,120.00	
	ENERSIS SA	760,000	182.850000	138,966,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	16,500	11,688.000000	192,852,000.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	27,000	5,295.600000	142,981,200.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,300	27,080.000000	143,524,000.00	
	VINA CONCHA Y TORO SA	35,000	943.950000	33,038,250.00	
	チリペソ 小計	12,825,922		2,018,292,618.00 (389,328,646)	
韓国ウォン					
	AMOREPACIFIC CORP	150	1,062,000.000000	159,300,000.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	220	427,500.000000	94,050,000.00	
	BS FINANCIAL GROUP INC	9,500	14,450.000000	137,275,000.00	
	CELLTRION INC	5,250	25,000.000000	131,250,000.00	
	CELLTRION INC-NEW	779	25,000.000000	19,475,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	2,800	87,700.000000	245,560,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	6,500	20,800.000000	135,200,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	500	370,000.000000	185,000,000.00	
	CJ CORP	1,200	128,000.000000	153,600,000.00	
	COWAY CO LTD	1,800	46,350.000000	83,430,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2,000	88,100.000000	176,200,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,000	9,390.000000	84,510,000.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,618	36,450.000000	95,426,100.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	10,738	11,850.000000	127,245,300.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,500	29,350.000000	132,075,000.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	7,000	14,550.000000	101,850,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	2,050	46,000.000000	94,300,000.00	
	DOOSAN CORP	450	129,000.000000	58,050,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,100	45,600.000000	141,360,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	5,000	16,400.000000	82,000,000.00	
	E-MART CO LTD	1,200	221,500.000000	265,800,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,300	54,000.000000	70,200,000.00	
	GS HOLDINGS	2,500	68,600.000000	171,500,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	14,300	39,250.000000	561,275,000.00	
	HANKOOK TIRE CO LTD	4,476	45,600.000000	204,105,600.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	4,000	19,150.000000	76,600,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,500	32,550.000000	81,375,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,000	7,570.000000	98,410,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,200	62,600.000000	75,120,000.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	900	159,000.000000	143,100,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,400	21,750.000000	30,450,000.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,000	68,200.000000	272,800,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	750	189,000.000000	141,750,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,250	215,500.000000	484,875,000.00
HYUNDAI HYSKO	2,500	40,650.000000	101,625,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,500	34,900.000000	122,150,000.00
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,000	21,200.000000	84,800,000.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	550	120,500.000000	66,275,000.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	3,950	263,500.000000	1,040,825,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	8,750	201,000.000000	1,758,750,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2,100	73,500.000000	154,350,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,000	67,000.000000	134,000,000.00
HYUNDAI SECURITIES CO	8,500	8,690.000000	73,865,000.00
HYUNDAI STEEL CO	3,500	81,700.000000	285,950,000.00
HYUNDAI WIA CORP	800	140,000.000000	112,000,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	10,500	11,850.000000	124,425,000.00
KANGWON LAND INC	5,500	31,300.000000	172,150,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	21,200	39,500.000000	837,400,000.00
KCC CORP	60	283,000.000000	16,980,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	15,200	49,750.000000	756,200,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,500	25,000.000000	87,500,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,000	34,750.000000	556,000,000.00
KOREA EXCHANGE BANK	16,000	7,330.000000	117,280,000.00
KOREA GAS CORPORATION	1,400	70,600.000000	98,840,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,000	44,450.000000	133,350,000.00
KOREA ZINC CO LTD	350	385,000.000000	134,750,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,800	44,750.000000	125,300,000.00
KT CORP	2,500	38,150.000000	95,375,000.00
KT&G CORP	6,000	76,000.000000	456,000,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	650	123,000.000000	79,950,000.00
LG CHEM LTD	2,700	309,000.000000	834,300,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	750	94,000.000000	70,500,000.00
LG CORP	6,100	63,400.000000	386,740,000.00
LG DISPLAY CO LTD	12,500	27,850.000000	348,125,000.00
LG ELECTRONICS INC	5,471	72,600.000000	397,194,600.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	550	590,000.000000	324,500,000.00
LG INNOTEK CO LTD	850	77,300.000000	65,705,000.00
LG UPLUS CORP	11,000	8,160.000000	89,760,000.00
LOTTE CHEMICAL CORP	930	238,000.000000	221,340,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	55	1,656,000.000000	91,080,000.00
LOTTE SHOPPING CO	600	366,500.000000	219,900,000.00
LS CORP	1,330	87,600.000000	116,508,000.00
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	250	65,900.000000	16,475,000.00
MANDO CORP	500	117,500.000000	58,750,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	300	37,900.000000	11,370,000.00
NCSOFT CORPORATION	900	150,500.000000	135,450,000.00
NHN CORP	2,500	248,500.000000	621,250,000.00
OCI CO LTD	900	173,500.000000	156,150,000.00
ORION CORP	200	1,037,000.000000	207,400,000.00
POSCO	3,900	367,000.000000	1,431,300,000.00
S1 CORPORATION	1,300	69,400.000000	90,220,000.00
SAMSUNG C&T CORP	6,900	60,000.000000	414,000,000.00
SAMSUNG CARD CO	3,000	36,500.000000	109,500,000.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,200	93,200.000000	298,240,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,350	1,417,000.000000	8,997,950,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	980	828,000.000000	811,440,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,800	150,500.000000	270,900,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,850	221,500.000000	409,775,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	9,800	37,150.000000	364,070,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,700	108,500.000000	401,450,000.00
SAMSUNG SDI CO LTD	1,950	143,000.000000	278,850,000.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,863	56,200.000000	217,100,600.00
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,380	56,800.000000	135,184,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	24,700	40,500.000000	1,000,350,000.00
SHINSEGAE CO LTD	234	216,500.000000	50,661,000.00
SK C&C CO LTD	1,200	102,500.000000	123,000,000.00
SK HOLDINGS CO LTD	1,550	174,500.000000	270,475,000.00
SK HYNIX INC	29,000	24,200.000000	701,800,000.00
SK INNOVATION CO LTD	3,460	169,500.000000	586,470,000.00
SK NETWORKS CO LTD	9,000	8,130.000000	73,170,000.00

SK TELECOM	450	170,500.000000	76,725,000.00	
S-OIL CORPORATION	2,700	98,500.000000	265,950,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	21,500	12,550.000000	269,825,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,539	12,300.000000	105,029,700.00	
YUHAN CORPORATION	582	179,000.000000	104,178,000.00	
韓国ウォン 小計	476,015		35,070,717,900.00 (2,959,968,590)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	113,168	24.000000	2,716,032.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	352,589	24.100000	8,497,394.90	
ADVANTECH CO LTD	25,000	118.500000	2,962,500.00	
ASIA CEMENT CORP	124,915	36.450000	4,553,151.75	
ASUSTEK COMPUTER INC	36,774	337.500000	12,411,225.00	
AU OPTRONICS CORP	440,000	12.000000	5,280,000.00	
CAPITAL SECURITIES CORP	200,000	10.750000	2,150,000.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	34,000	127.000000	4,318,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	408,887	32.000000	13,084,384.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	50,000	76.900000	3,845,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	306,608	15.700000	4,813,745.60	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	103,968	74.000000	7,693,632.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	32,000	55.200000	1,766,400.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	41,400	75.900000	3,142,260.00	
CHINA AIRLINES LTD	180,000	12.700000	2,286,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	615,255	7.700000	4,737,463.50	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	112,784	27.850000	3,141,034.40	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	129,250	18.200000	2,352,350.00	
CHINA STEEL CORP	617,214	27.400000	16,911,663.60	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	669,605	16.600000	11,115,443.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	213,000	94.400000	20,107,200.00	
CLEVO COMPANY	8,403	38.800000	326,036.40	
COMPAL ELECTRONICS	231,775	20.700000	4,797,742.50	
CTCI CORP	50,000	57.300000	2,865,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	102,220	106.000000	10,835,320.00	
E INK HOLDINGS INC	48,000	20.150000	967,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	247,170	15.900000	3,930,003.00	
EPISTAR CORP	40,000	54.800000	2,192,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	132,000	18.150000	2,395,800.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	153,999	18.200000	2,802,781.80	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	71,656	28.700000	2,056,527.20	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	139,410	33.100000	4,614,471.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	88,000	74.000000	6,512,000.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	8,000	53.600000	428,800.00	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	7,000	52.000000	364,000.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	420,477	17.500000	7,358,347.50	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	181,000	77.400000	14,009,400.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,150	81.500000	4,983,725.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	222,000	78.800000	17,493,600.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	80,000	27.200000	2,176,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	50,300	83.800000	4,215,140.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	306,087	36.400000	11,141,566.80	
GIANT MANUFACTURING	12,000	152.500000	1,830,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	36,000	56.700000	2,041,200.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10,815	230.000000	2,487,450.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	486,336	83.400000	40,560,422.40	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	227.000000	2,951,000.00	
HTC CORP	38,744	284.000000	11,003,296.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	325,077	16.450000	5,347,516.65	
INNOLUX CORP	320,112	14.650000	4,689,640.80	
INVENTEC CORP	200,429	11.450000	2,294,912.05	
KINSUS INTERCONNECT TECH	25,000	89.600000	2,240,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,020	742.000000	4,466,840.00	
LCY CHEMICAL CORP	42,000	37.800000	1,587,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	123,182	40.200000	4,951,916.40	
MACRONIX INTERNATIONAL	186,836	8.620000	1,610,526.32	
MEDIA TEK INC	65,042	322.000000	20,943,524.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	436,754	23.200000	10,132,692.80	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	15,320	218.000000	3,339,760.00	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	53,104	33.550000	1,781,639.20	
NAN YA PLASTICS CORP	263,750	58.100000	15,323,875.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	36,000	113.000000	4,068,000.00	

ORIENTAL UNION CHEMICAL	40,000	34.650000	1,386,000.00	
PEGATRON CORP	86,976	38.800000	3,374,668.80	
PHISON ELECTRONICS CORP	7,000	207.000000	1,449,000.00	
POU CHEN	150,500	29.500000	4,439,750.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	36,300	45.300000	1,644,390.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	30,000	159.500000	4,785,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	132,150	63.600000	8,404,740.00	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	25,750	106.500000	2,742,375.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,350	61.100000	2,159,885.00	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	4,200	175.000000	735,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,000	61.900000	3,404,500.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	35,000	74.000000	2,590,000.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	19,000	67.900000	1,290,100.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	400,000	8.070000	3,228,000.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	175,000	30.400000	5,320,000.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	18,150	136.500000	2,477,475.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	308,800	12.550000	3,875,440.00	
STANDARD FOODS CORP	25,000	80.900000	2,022,500.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	68,137	58.100000	3,958,759.70	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	332,707	11.500000	3,826,130.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	240,000	8.690000	2,085,600.00	
TAIWAN CEMENT	155,706	39.100000	6,088,104.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	320,340	16.250000	5,205,525.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	70,000	71.000000	4,970,000.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	68,970	27.900000	1,924,263.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,400	107.000000	10,314,800.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,388,000	99.000000	137,412,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	140,000	23.700000	3,318,000.00	
TPK HOLDING CO LTD	11,442	492.500000	5,635,185.00	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	27,750	56.800000	1,576,200.00	
TSRC CORP	33,000	58.600000	1,933,800.00	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	60,000	29.200000	1,752,000.00	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	7,000	47.200000	330,400.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	95,000	28.550000	2,712,250.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	223,574	51.600000	11,536,418.40	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	720,000	11.250000	8,100,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	190,000	9.760000	1,854,400.00	
WINTEK CORP	76,994	13.650000	1,050,968.10	
WISTRON CORP	129,943	35.050000	4,554,502.15	
WPG HOLDINGS LTD	65,400	39.100000	2,557,140.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	436,909	15.150000	6,619,171.35	
YULON MOTOR COMPANY	58,000	52.700000	3,056,600.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,000	69.400000	1,388,000.00	
ニュー台湾ドル 小計	16,770,033		677,091,194.17 (2,098,982,701)	
インドルピー				
ACC LTD	2,200	1,326.750000	2,918,850.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,000	258.650000	3,362,450.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	35,000	199.150000	6,970,250.00	
ASIAN PAINTS LTD	2,000	4,405.700000	8,811,400.00	
AXIS BANK LTD	13,000	1,386.250000	18,021,250.00	
BAJAJ AUTO LTD	5,000	2,080.000000	10,400,000.00	
BANK OF BARODA	5,200	882.000000	4,586,400.00	
BANK OF INDIA	10,000	363.750000	3,637,500.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	22,500	229.400000	5,161,500.00	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,000	419.950000	5,039,400.00	
BHARTI AIRTEL LTD	30,000	360.500000	10,815,000.00	
CAIRN INDIA LTD	16,000	322.800000	5,164,800.00	
CIPLA LTD	25,000	397.900000	9,947,500.00	
COAL INDIA LTD	32,000	341.050000	10,913,600.00	
DABUR INDIA LTD	35,000	129.150000	4,520,250.00	
DLF LTD	30,000	259.750000	7,792,500.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,000	1,945.150000	11,670,900.00	
GAIL INDIA LTD	15,000	353.550000	5,303,250.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,000	724.900000	5,799,200.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,500	681.050000	9,194,175.00	
HDFC BANK LIMITED	71,000	665.050000	47,218,550.00	
HERO MOTOCORP LTD	3,500	1,764.900000	6,177,150.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	55,000	116.400000	6,402,000.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	52,000	476.500000	24,778,000.00	

HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	86,000	805.850000	69,303,100.00	
ICICI BANK LTD	25,000	1,172.950000	29,323,750.00	
IDEA CELLULAR LTD	50,000	113.400000	5,670,000.00	
IDFC LTD	50,000	169.650000	8,482,500.00	
INFOSYS LTD	20,100	2,814.650000	56,574,465.00	
ITC LTD	130,000	299.750000	38,967,500.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	80,000	86.800000	6,944,000.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,000	433.450000	5,634,850.00	
JSW STEEL LTD	5,600	864.950000	4,843,720.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,000	665.200000	8,647,600.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,000	1,611.300000	19,335,600.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	20,000	283.050000	5,661,000.00	
LUPIN LTD	10,000	599.450000	5,994,500.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	18,000	901.500000	16,227,000.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,000	1,599.450000	3,198,900.00	
NTPC LTD	45,000	159.350000	7,170,750.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	48,000	341.100000	16,372,800.00	
POWER FINANCE CORPORATION	20,000	206.200000	4,124,000.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	70,000	111.000000	7,770,000.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	8,000	455.800000	3,646,400.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	62,000	912.200000	56,556,400.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,000	540.150000	3,781,050.00	
RELIANCE POWER LTD	40,000	94.500000	3,780,000.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	23,000	240.800000	5,538,400.00	
SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	60,000	120.600000	7,236,000.00	
SESA GOA LTD	17,000	183.200000	3,114,400.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	10,000	758.750000	7,587,500.00	
SIEMENS LTD	6,000	641.500000	3,849,000.00	
STATE BANK OF INDIA	7,800	2,513.700000	19,606,860.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	90,000	112.300000	10,107,000.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,000	728.700000	10,930,500.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	25,500	1,340.500000	34,182,750.00	
TATA MOTORS LTD	45,000	301.000000	13,545,000.00	
TATA POWER CO LTD	75,000	105.950000	7,946,250.00	
TATA STEEL LTD	20,000	406.750000	8,135,000.00	
TITAN INDUSTRIES LTD	17,000	274.450000	4,665,650.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	2,300	1,916.650000	4,408,295.00	
UNITECH LTD	110,000	36.450000	4,009,500.00	
UNITED BREWERIES LTD	4,200	722.450000	3,034,290.00	
UNITED SPIRITS LTD	5,700	1,793.650000	10,223,805.00	
WIPRO LTD	32,000	407.650000	13,044,800.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	32,000	227.950000	7,294,400.00	
インドルピー 小計	1,944,100		801,075,160.00 (1,369,838,523)	
チェココルナ				
CEZ AS	10,000	617.000000	6,170,000.00	
KOMERCNI BANKA AS	1,000	3,899.000000	3,899,000.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	4,600	327.000000	1,504,200.00	
チェココルナ 小計	15,600		11,573,200.00 (55,435,628)	
コロンビアペソ				
ALMACENES EXITO SA	13,000	34,520.000000	448,760,000.00	
BANCO DAVIVIENDA SA	6,500	24,160.000000	157,040,000.00	
BANCOLOMBIA SA	14,000	30,660.000000	429,240,000.00	
BANCOLOMBIA SA-PREF	20,000	31,000.000000	620,000,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	26,000	10,880.000000	282,880,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	5,000	35,700.000000	178,500,000.00	
ECOPETROL SA	250,000	5,600.000000	1,400,000,000.00	
GRUPO ARGOS SA	18,000	22,300.000000	401,400,000.00	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	50,000	1,285.000000	64,250,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	15,000	37,320.000000	559,800,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	3,500	38,640.000000	135,240,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	25,000	9,900.000000	247,500,000.00	
ISAGEN SA ESP	60,000	2,550.000000	153,000,000.00	
コロンビアペソ 小計	506,000		5,077,610,000.00 (259,973,632)	
ハンガリーフォリント				
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	35,000	400.000000	14,000,000.00	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,200	18,600.000000	40,920,000.00	
OTP BANK PLC	13,000	4,590.000000	59,670,000.00	

ハンガリーフォリント 小計	50,200		114,590,000.00 (47,176,703)
ポーランドズロチ			
ASSECO POLAND SA	5,700	45.010000	256,557.00
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,900	96.250000	279,125.00
BANK MILLENNIUM SA	45,000	5.170000	232,650.00
BANK PEKAO SA	6,500	168.700000	1,096,550.00
BRE BANK SA	1,000	330.000000	330,000.00
CYFROWY POLSAT SA	16,200	17.100000	277,020.00
EUROCASH SA	6,500	48.000000	312,000.00
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	3,000	93.000000	279,000.00
KERNEL HOLDING SA	3,500	66.500000	232,750.00
KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,000	187.500000	1,312,500.00
PGE SA	39,500	18.150000	716,925.00
PKO BANK POLSKI SA	45,000	34.700000	1,561,500.00
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,500	51.700000	1,008,150.00
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	80,200	5.750000	461,150.00
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,100	404.000000	1,252,400.00
SYNTHOS SA	40,000	5.200000	208,000.00
TAURON POLSKA ENERGIA SA	60,000	4.680000	280,800.00
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	44,000	11.920000	524,480.00
ポーランドズロチ 小計	428,600		10,621,557.00 (312,486,206)
南アフリカランド			
ABSA GROUP LTD	15,400	168.000000	2,587,200.00
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	46,000	31.300000	1,439,800.00
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	201.230000	1,408,610.00
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,400	439.000000	1,931,600.00
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,300	251.400000	5,354,820.00
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	18,260	34.700000	633,622.00
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	16,000	164.260000	2,628,160.00
ASSORE LTD	3,000	433.000000	1,299,000.00
AVENG LTD	25,000	29.260000	731,500.00
BARLOWORLD LTD	15,000	88.770000	1,331,550.00
BIDVEST GROUP LTD	16,500	220.000000	3,630,000.00
DISCOVERY HOLDINGS LTD	20,000	66.290000	1,325,800.00
EXXARO RESOURCES LTD	6,000	169.480000	1,016,880.00
FIRSTRAND LTD	183,000	33.050000	6,048,150.00
GOLD FIELDS LTD	46,000	107.000000	4,922,000.00
HARMONY GOLD MINING CO LTD	22,000	64.250000	1,413,500.00
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	33,000	165.750000	5,469,750.00
IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,000	202.500000	2,025,000.00
INVESTEC LTD	13,000	65.200000	847,600.00
KUMBA IRON ORE LTD	4,500	582.120000	2,619,540.00
LIBERTY HOLDINGS LTD	10,000	114.500000	1,145,000.00
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	65,000	32.770000	2,130,050.00
MASSMART HOLDINGS LTD	6,930	187.500000	1,299,375.00
MMI HOLDINGS LTD	50,000	23.500000	1,175,000.00
MR PRICE GROUP LTD	15,000	127.850000	1,917,750.00
MTN GROUP LTD	99,000	176.500000	17,473,500.00
NASPERS LTD-N SHS	22,600	576.680000	13,032,968.00
NEDBANK GROUP LTD	11,500	195.420000	2,247,330.00
NETCARE LTD	55,900	19.940000	1,114,646.00
NORTHAM PLATINUM LTD	20,000	36.500000	730,000.00
PICK N PAY STORES LTD	19,000	46.500000	883,500.00
PPC LTD	24,200	33.190000	803,198.00
REMGRO LTD	24,000	166.700000	4,000,800.00
REUNERT LTD	11,000	74.890000	823,790.00
RMB HOLDINGS LTD	43,000	44.140000	1,898,020.00
RMI HOLDINGS	56,500	22.350000	1,262,775.00
SANLAM LTD	100,000	47.050000	4,705,000.00
SAPPI LIMITED	22,700	32.710000	742,517.00
SASOL LTD	30,800	379.510000	11,688,908.00
SHOPRITE HOLDINGS LTD	24,500	182.000000	4,459,000.00
SPAR GROUP LIMITED/THE	8,000	121.950000	975,600.00
STANDARD BANK GROUP LTD	71,334	117.210000	8,361,058.14
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	68,147	27.320000	1,861,776.04
THE FOSCHINI GROUP LTD	11,000	123.830000	1,362,130.00
TIGER BRANDS LTD	10,300	298.290000	3,072,387.00
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	27,700	105.910000	2,933,707.00

	VODACOM GROUP LTD	22,400	126.420000	2,831,808.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	41,000	65.890000	2,701,490.00	
	南アフリカランド 小計	1,496,871		146,297,165.18 (1,484,916,226)	
トルコリラ					
	AKBANK T.A.S.	100,666	9.860000	992,566.76	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	13,000	26.800000	348,400.00	
	ARCELIK AS	20,000	12.300000	246,000.00	
	ASYA KATILIM BANKASI AS	55,000	2.490000	136,950.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	6,000	89.500000	537,000.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,500	42.800000	192,600.00	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	15,554	5.660000	88,035.64	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	100,604	2.610000	262,576.44	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,500	21.750000	141,375.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	50,000	10.500000	525,000.00	
	KOC HOLDING AS	28,350	10.000000	283,500.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	2,500	45.700000	114,250.00	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	16,000	10.300000	164,800.00	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,500	52.000000	442,000.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,856	7.380000	50,597.28	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	30,000	3.490000	104,700.00	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	18,000	7.840000	141,120.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	46,000	12.000000	552,000.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	129,000	9.640000	1,243,560.00	
	TURKIYE HALK BANKASI	39,000	19.150000	746,850.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	92,726	7.160000	663,918.16	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,000	5.520000	281,520.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	40,000	5.620000	224,800.00	
	トルコリラ 小計	879,756		8,484,119.28 (436,932,142)	
ユーロ					
	MAROC TELECOM	9,000	9.780000	88,020.00	
	ユーロ 小計	9,000		88,020.00 (10,781,569)	
合計		96,816,054		20,628,179,002 (20,628,179,002)	

(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%	8.27%
香港ドル	株式 134銘柄	100.00%	18.57%
マレーシアリング	株式 42銘柄	100.00%	3.34%
タイバーツ	株式 22銘柄	100.00%	2.60%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.00%	0.99%
インドネシアルピア	株式 26銘柄	100.00%	2.67%
メキシコペソ	株式 25銘柄	100.00%	5.41%
ブラジルレアル	株式 80銘柄	100.00%	12.46%
チリペソ	株式 21銘柄	100.00%	1.89%
韓国ウォン	株式 105銘柄	100.00%	14.35%
ニュー台湾ドル	株式 105銘柄	100.00%	10.18%
インドルピー	株式 66銘柄	100.00%	6.64%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	0.27%
コロンビアペソ	株式 13銘柄	100.00%	1.26%
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 18銘柄	100.00%	1.51%
南アフリカランド	株式 48銘柄	100.00%	7.20%
トルコリラ	株式 23銘柄	100.00%	2.12%
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2月28日現在
(単位:円)

資産総額	1,795,790,403
負債総額	13,897,007
純資産総額(-)	1,781,893,396
発行済口数	1,283,799,934 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3880 (1万口当たり 13,880)

<参考>

「外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2月28日現在
(単位:円)

資産総額	166,402,831,251
負債総額	92,656,829
純資産総額(-)	166,310,174,422
発行済口数	125,911,257,460 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3209 (1万口当たり 13,209)

<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2月28日現在
(単位:円)

資産総額	21,812,963,852
負債総額	321,590,342
純資産総額(-)	21,491,373,510
発行済口数	12,029,903,660 口
1口当たり純資産価額(/)	1.7865 (1万口当たり 17,865)

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2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、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2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2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	408	6,534,457
追加型公社債投資信託	18	623,363
単位型株式投資信託	6	18,002
単位型公社債投資信託	3	82,958
合計	435	7,258,781

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度に係る中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)		第27期 (平成24年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	17,056,128	2	14,298,590
有価証券	2	10,000,000	2	8,000,000
前払費用		156,230		154,925
未収入金	2	19,641		13,813
未収委託者報酬		4,517,987		3,977,324
未収収益	2	63,656	2	42,563
繰延税金資産		429,080		339,052
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		28,070		27,621
流動資産合計		32,300,796		26,883,891
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	306,543	1	281,399
器具備品	1	184,985	1	177,757
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,696,560		1,664,188
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		909,905		881,368
ソフトウェア仮勘定		146,761		402,721
その他		68		24
無形固定資産合計		1,072,557		1,299,937
投資その他の資産				
投資有価証券		9,405,012		14,456,313
関係会社株式		431,812		320,136
長期性預金	2	7,000,000	2	8,500,000
長期差入保証金	2	797,041	2	837,456
長期前払費用		52		
繰延税金資産		442,254		139,650
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		18,091,208		24,268,591
固定資産合計		20,860,326		27,232,718
資産合計		53,161,123		54,116,609

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,528	79,079
未払金		
未払収益分配金	245,085	185,817
未払償還金	1,328,820	1,159,445
未払手数料	2 1,768,519	2 1,557,726
その他未払金	104,042	50,899
未払費用	2 1,240,586	2 1,174,572
未払消費税等	184,873	63,602
未払法人税等	2,228,870	1,532,874
賞与引当金	550,000	520,000
その他	227,518	278,521
流動負債合計	7,925,844	6,602,539
固定負債		
退職給付引当金	105,461	119,902
役員退職慰労引当金	76,024	49,735
時効後支払損引当金	196,123	195,228
固定負債合計	377,609	364,866
負債合計	8,303,454	6,967,405
(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	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計	42,243,903	44,203,921
株主資本合計	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券	391,537	723,054
評価差額金		
評価・換算差額等合計	391,537	723,054
純資産合計	44,857,668	47,149,203
負債純資産合計	53,161,123	54,116,609

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,622		47,476,170
投資顧問料		16,400		15,335
その他営業収益		236,596		153,305
営業収益合計		48,664,618		47,644,812
営業費用				
支払手数料	2	19,778,797	2	19,292,904
広告宣伝費		696,640		516,886
公告費		7,795		7,961
調査費				
調査費		895,558		909,999
委託調査費		8,991,373		9,975,300
事務委託費		243,109		306,137
営業雑経費				
通信費		98,144		90,066
印刷費		569,763		400,552
協会費		37,616		40,636
諸会費		6,248		7,593
事務機器関連費		880,509		958,507
その他営業雑経費				16,396
営業費用合計		32,205,558		32,522,943
一般管理費				
給料				
役員報酬		199,168		202,812
給料・手当		3,576,037		3,623,556
賞与引当金繰入		550,000		520,000
福利厚生費		492,032		520,897
交際費		23,412		26,743
旅費交通費		156,920		153,892
租税公課		108,850		102,255
不動産賃借料		655,939		698,539
退職給付費用		163,440		142,883
役員退職慰労引当金繰入		18,106		22,805
固定資産減価償却費		406,176		481,601
諸経費		369,603		247,162
一般管理費合計		6,719,689		6,743,148
営業利益		9,739,370		8,378,719

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		29,543		153,215
有価証券利息	2	11,040	2	8,160
受取利息	2	20,465	2	25,661
投資有価証券償還益		371,171		1,876
収益分配金等時効完成分		438,693		318,285
その他		8,257		7,856
営業外収益合計		879,170		515,056
営業外費用				
投資有価証券償還損		192,004		
時効後支払損引当金繰入		666		15,288
事務過誤費		32,187		7,845
その他		7,757		82
営業外費用合計		232,615		23,216
経常利益		10,385,925		8,870,559
特別利益				
投資有価証券売却益		351,930		150,103
特別利益合計		351,930		150,103
特別損失				
投資有価証券売却損		127,114		153,276
関係会社株式売却損				13,563
投資有価証券評価損				1,925
過年度時効後支払損引当金繰入		204,138		
固定資産除却損	1	3,431	1	17,034
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		37,264		
その他		2,429		412
特別損失合計		374,378		186,212
税引前当期純利益		10,363,477		8,834,449
法人税、住民税及び事業税		4,027,373		3,510,046
法人税等調整額		25,800		175,067
法人税等合計		4,001,573		3,685,113
当期純利益		6,361,903		5,149,336

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24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	31,383,254	34,903,313
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計		
当期首残高	38,723,843	42,243,903
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	42,243,903	44,203,921
株主資本合計		
当期首残高	40,946,071	44,466,131
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,277,237	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	885,699	331,516
当期変動額合計	885,699	331,516
当期末残高	391,537	723,054
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	62,258	

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	62,258	
当期変動額合計	62,258	
当期末残高		
評価・換算差額等合計		
当期首残高	1,214,979	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	823,441	331,516
当期末残高	391,537	723,054
純資産合計		
当期首残高	42,161,050	44,857,668
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	2,696,617	2,291,534
当期末残高	44,857,668	47,149,203

[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によっております。

(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)によっております。

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

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. 外貨建の資産又は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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
建物	181,085千円	208,976千円
器具備品	227,109千円	294,294千円

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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
預金	13,335,700千円	11,773,728千円
有価証券	10,000,000千円	8,000,000千円
未収入金	1,500千円	-
未収収益	63,656千円	42,563千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	7,000,000千円	8,500,000千円
長期差入保証金	788,590千円	828,908千円
未払手数料	986,786千円	851,491千円
未払費用	134,713千円	135,926千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
器具備品	3,431千円	1,144千円
ソフトウェア	-	15,890千円
計	3,431千円	17,034千円

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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払手数料	11,685,424千円	10,760,427千円
有価証券利息	8,718千円	6,532千円
受取利息	20,465千円	25,661千円

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日至平成23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22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	2,841,844千円
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1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
配当の原資	利益剰余金
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

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

（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26期（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	17,056,128	17,056,128	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,517,987	4,517,987	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,010,576	10,576
(5) 投資有価証券	9,140,755	9,140,755	-
資産計	47,714,871	47,725,447	10,576
(1) 未払手数料	1,768,519	1,768,519	-
(2) 未払法人税等	2,228,870	2,228,870	-
負債計	3,997,389	3,997,389	-

第27期（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(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	-

（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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
非上場株式	264,257	38,900
子会社株式	431,812	160,600
関連会社株式	-	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26期（平成23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	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
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	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

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

(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431,812千円）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26期（平成23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	4,026,733	3,476,499	550,234
	小計	4,026,733	3,476,499	550,234
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	5,114,022	5,236,164	122,142
	小計	5,114,022	5,236,164	122,142
	合計	9,140,755	8,712,663	428,091

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

3. 売却したその他有価証券

第26期（自平成22年4月1日至平成23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	4,283,999	392,809	127,114
合計	4,283,999	392,809	127,114

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

(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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(1)退職給付債務	567,377	475,564
(2)年金資産	309,065	198,994
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	258,311	276,569
(4)未認識数理計算上の差異	152,850	156,666
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	105,461	119,902
(6)退職給付引当金	105,461	119,902

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
(1)勤務費用	28,585	27,806
(2)利息費用	9,774	8,420
(3)期待運用収益	6,248	4,635
(4)数理計算上の差異の費用処理額	37,969	13,599
(5)退職給付費用	70,080	45,191
(6)その他	93,360	97,692
(7)合計	163,440	142,883

(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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1.5%	1.5%

(3) 期待運用収益率

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24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26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	651,260 千円	557,868 千円
投資有価証券評価損	408,754	362,665
ゴルフ会員権評価損	9,710	8,505
未払事業税	172,269	109,608
賞与引当金	223,795	197,652
役員退職慰労引当金	30,934	17,725
退職給付引当金	42,912	42,783
減価償却超過額	39,127	19,890
委託者報酬	92,577	99,265
長期差入保証金	20,080	21,895
時効後支払損引当金	79,802	69,579
その他	34,708	39,304
繰延税金資産 小計	1,805,934	1,546,744
評価性引当額	898,045	813,923
繰延税金資産 合計	907,888	732,821
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	36,553	254,118
繰延税金負債 合計	36,553	254,118
繰延税金資産(負債)の純額	871,334	478,702

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
法定実効税率 (調整)	40.7 %	法定実効税率と税効果会計 適用後の法人税等の負担税率 との間の差異が法定実効税率 の100分の5以下であるため注 記を省略しております。
投資有価証券評価損認容	2.9	
その他	0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6	

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引き下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は39,177千円減少し、法人税等調整額が75,184千円、その他有価証券評価差額金が36,007千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24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26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24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

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

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26期（自平成22年4月1日至平成23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	
主要株主	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 30.0%	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	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	投資助言料	189,915 千円	未払費用	88,454 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	8,718 千円	未収利息	675 千円
								マルチコーラブル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	18,499 千円	未収利息	3,069 千円
								長期性預金	7,000,000 千円		

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	未収利息	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
							マルチコー ラブル預金 に係る受取 利息	24,415 千円	長期性預金	8,500,000 千円
			未収利息	2,886 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26期（自平成22年4月1日至平成23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	3,000 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	4,447,569 千円	未払手数料	408,084 千円

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

(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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	361,469.71円	379,935.23円
1株当たり当期純利益金額	51,265.16円	41,494.11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、記載していません。

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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益金額（千円）	6,361,903	5,149,336
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）	6,361,903	5,149,336
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。

[次へ](#)

中間財務諸表
(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金		16,996,643
有価証券		8,000,000
前払費用		336,791
未収入金		221,616
未収委託者報酬		3,698,009
未収収益		39,360
繰延税金資産		374,925
金銭の信託		30,000
その他		27,966
流動資産合計		29,725,313

固定資産

有形固定資産

建物	1	269,044
器具備品	1	174,256
土地		1,205,031
有形固定資産合計		1,648,332

無形固定資産

電話加入権		15,822
ソフトウェア		874,592
ソフトウェア仮勘定		414,462
その他		9
無形固定資産合計		1,304,887

投資その他の資産

投資有価証券		13,875,312
関係会社株式		320,136
長期性預金		5,500,000
長期差入保証金		831,857
繰延税金資産		297,670
その他		15,035

投資その他の資産合計

投資その他の資産合計		20,840,011
固定資産合計		23,793,231
資産合計		53,518,545

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

(負債の部)	
流動負債	
預り金	66,078
未払金	
未払収益分配金	33,785
未払償還金	1,070,895
未払手数料	1,435,205
その他未払金	72,465
未払費用	1,101,885
未払消費税等	2 104,706
未払法人税等	1,639,933
賞与引当金	561,000
その他	314,314
流動負債合計	6,400,270
固定負債	
退職給付引当金	120,928
役員退職慰労引当金	53,934
時効後支払損引当金	197,702
固定負債合計	372,564
負債合計	6,772,834
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	222,096
資本剰余金合計	222,096
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	36,823,991
利益剰余金合計	44,164,581
株主資本合計	46,386,809
評価・換算差額等	
その他有価証券	358,901
評価差額金	
評価・換算差額等合計	358,901
純資産合計	46,745,710
負債純資産合計	53,518,545

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	22,860,446
投資顧問料	5,548
その他営業収益	64,404
営業収益合計	22,930,399
営業費用	
支払手数料	9,329,547
広告宣伝費	253,610
公告費	1,748
調査費	
調査費	465,037
委託調査費	4,927,785
事務委託費	118,017
営業雑経費	
通信費	44,970
印刷費	216,082
協会費	19,981
諸会費	3,788
事務機器関連費	479,500
その他営業雑経費	8,157
営業費用合計	15,868,227
一般管理費	
給料	
役員報酬	97,198
給料・手当	1,581,710
賞与引当金繰入	561,000
福利厚生費	296,584
交際費	11,132
旅費交通費	66,127
租税公課	57,963
不動産賃借料	349,740
退職給付費用	80,723
役員退職慰労引当金繰入	7,838
固定資産減価償却費	1 223,128
諸経費	135,324
一般管理費合計	3,468,471
営業利益	3,593,700

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(自平成24年4月1日
至平成24年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	104,164
有価証券利息	3,543
受取利息	12,662
収益分配金等時効完成分	328,544
その他	1,102
営業外収益合計	450,017
営業外費用	
投資有価証券償還損	8,428
時効後支払損引当金繰入	6,591
その他	46
営業外費用合計	15,067
経常利益	4,028,650
特別利益	
投資有価証券売却益	141,172
特別利益合計	141,172
特別損失	
投資有価証券売却損	32,155
特別損失合計	32,155
税引前中間純利益	4,137,667
法人税、住民税及び事業税	1,626,136
法人税等調整額	30,367
法人税等合計	1,595,768
中間純利益	2,541,898

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,131
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
資本剰余金合計	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	342,589
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	6,998,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	6,998,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	36,863,331
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	36,823,991
利益剰余金合計	
当期首残高	44,203,921
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	44,164,581
株主資本合計	
当期首残高	46,426,148
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	46,386,809
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	723,054
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
評価・換算差額等合計	
当期首残高	723,054

当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
純資産合計	
当期首残高	47,149,203
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	403,492
当中間期末残高	46,745,710

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

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. 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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

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、内規に基づく中間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。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

[会計方針の変更]

第28期中間会計期間
(自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30日)

(減価償却方法の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、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、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)
建物	221,331千円
器具備品	322,980千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
有形固定資産	41,040千円
無形固定資産	182,088千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

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

(金融商品関係)

第28期中間会計期間(平成24年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計 上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	16,996,643	16,996,643	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,698,009	3,698,009	-
(4) 長期性預金	5,500,000	5,506,492	6,492
(5) 投資有価証券	13,875,312	13,875,312	-
資産計	48,069,965	48,076,457	6,492
(1) 未払手数料	1,435,205	1,435,205	-
(2) 未払法人税等	1,639,933	1,639,933	-
負債計	3,075,139	3,075,139	-

（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

非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）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、「(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（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,899,973	6,184,088	715,884
	小計	6,899,973	6,184,088	715,884
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,936,438	7,202,827	266,389
	小計	6,936,438	7,202,827	266,389
合計		13,836,412	13,386,916	449,495

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

重要な取引はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)
1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	376,683.83円
純資産の部の合計額(千円)	46,745,710
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	46,745,710
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	124,098

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	20,482.99円
中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株式の期中平均株式数(株)	124,098

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下

において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成24年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成24年9月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社北都銀行	11,000 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社荘内銀行	7,000 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。
カブドットコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三オンライン証券株式会社	8,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	7,425 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成25年2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）、株式会社三菱東京UFJ銀行は25.0%（31,023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、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（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3月6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eMAXIS 全世界株式インデックスの平成24年1月27日から平成25年1月28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、eMAXIS 全世界株式インデックスの平成25年1月28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24年6月26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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27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24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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6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期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。

[前へ](#)