

## 【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26年4月25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証券に係るファンドの名称】	eMAXIS 全世界株式インデックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【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いただけます。

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://emaxis.muam.jp/>

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

なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。

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

### (5) 【申込手数料】

申込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26年4月26日から平成27年4月24日までです。

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

### (8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額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	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	年2回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株	年4回					
債券	年6回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ		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
一般	(隔月)	欧州				
公債	年12回	アジア				
社債	(毎月)	オセアニア				
その他債券	日々	中南米				
クレジット 属性 ( )	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東) エマージング				
不動産投信						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せん。

## 商品分類の定義

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

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

## 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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



## [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

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

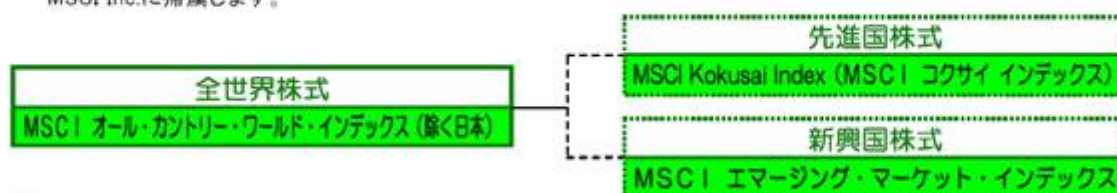
### 1 MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。

- 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)に対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。



**1** 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、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

### 3 原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

## ファンドの仕組み

運用は主に外国株式インデックスマザーファンドならびに新興国株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、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。



・ 外国株式インデッ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。

・ 新興国株式インデッ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を問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にも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

投資家（受益者）	
お申込金 収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
お申込金 収益分配金、解約代金等	
受託会社（受託者） 三菱UFJ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱UFJ投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資 損益	
マザーファンド	
投資 損益	
有価証券等	

## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「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26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26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ます。）

a. 有価証券先物取引等

b. スワップ取引

c. 金利先渡し取引および為替先渡し取引

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。

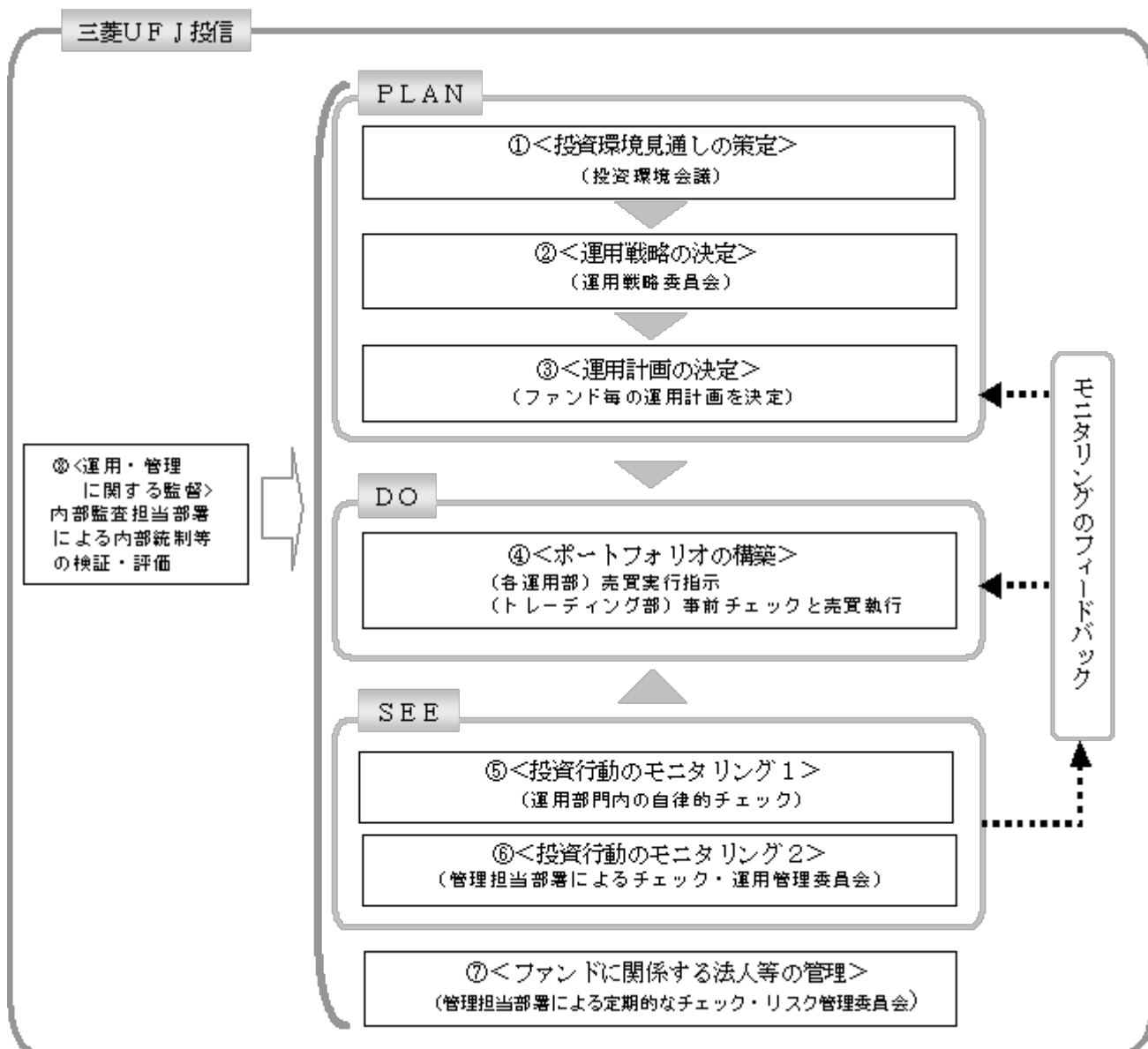
有価証券先物取引等を行うことができます。

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。

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

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(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26年4月26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、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## 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、
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（ 5 . に定めるものを除きます。）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、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。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が小さかった場合も同様です。

収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、MSCI 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)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0.648%（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0.2916% (税抜 年0.27%)	年0.2916% (税抜 年0.27%)	年0.0648% (税抜 年0.06%)
50億円以上100億円未満の部分	年0.2808% (税抜 年0.26%)	年0.3024% (税抜 年0.28%)	年0.0648% (税抜 年0.06%)
100億円以上の部分	年0.27% (税抜 年0.25%)	年0.3132% (税抜 年0.29%)	年0.0648% (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、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

##### 2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

#### 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26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26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	2,777,302,326	99.98
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		468,465	0.02
純資産総額		2,777,770,791	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26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(%)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
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		1,385,821,592	1.7195	2,383,051,677		88.91
					1.7821	2,469,672,659		
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		165,829,156	1.8250	302,648,400		11.07
					1.8551	307,629,667		

(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26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	99.98
合計	99.98

(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26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)
第4計算期間末日 (平成26年 1月27日)	2,592,035,257 (分配付) 2,592,035,257 (分配落)	17,429 (分配付) 17,429 (分配落)
平成25年 2月末日	1,781,893,396	13,880
3月末日	1,913,467,395	14,359
4月末日	2,058,844,311	15,212
5月末日	2,285,906,310	16,053
6月末日	2,134,690,575	14,941
7月末日	2,275,825,069	15,604
8月末日	2,296,832,691	15,378
9月末日	2,374,398,851	16,058
10月末日	2,532,739,141	16,857

11月末日	2,647,270,746	17,678
12月末日	2,555,101,943	18,433
平成26年 1月末日	2,619,419,571	17,441
2月末日	2,777,770,791	18,019

## 【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
第4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
第4計算期間	26.89

(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
第4計算期間	1,174,144,027	929,470,626	1,487,213,278



## &lt; 参考 &gt;

## 「外国株式インデックスマザーファンド」

## (1) 投資状況

平成26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	113,713,468,485	56.94
	イギリス	18,762,159,174	9.39
	カナダ	8,623,508,031	4.32
	フランス	8,266,884,661	4.14
	ドイツ	8,246,934,592	4.13
	スイス	8,124,646,594	4.07
	オーストラリア	6,221,911,151	3.12
	スペイン	3,028,203,498	1.52
	スウェーデン	2,890,795,848	1.45
	オランダ	2,780,850,865	1.39
	香港	2,396,566,246	1.20
	イタリア	1,983,543,478	0.99
	デンマーク	1,211,317,960	0.61
	シンガポール	1,186,939,471	0.59
	ベルギー	1,056,886,932	0.53
	フィンランド	805,831,126	0.40
	ノルウェー	709,358,215	0.36
	イスラエル	432,282,379	0.22
	アイルランド	294,174,612	0.15
	ルクセンブルグ	271,694,079	0.14
オーストリア	264,923,562	0.13	
ポルトガル	165,987,236	0.08	
ニュージーランド	109,717,363	0.05	
投資証券	アメリカ	2,726,771,186	1.37
	オーストラリア	436,565,635	0.22
	イギリス	267,823,893	0.13
	フランス	260,455,332	0.13
	香港	70,933,005	0.04
	シンガポール	65,031,283	0.03
	カナダ	38,365,691	0.02
	オランダ	19,774,664	0.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,274,678,526	2.13
純資産総額		199,708,984,773	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26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)	2,298,862,743	1.15

(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26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
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	287,018	9,188.87 9,769.92	2,637,371,548 2,804,145,653		1.40

アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	17,869	90,097.63 124,286.26	1,609,954,554 2,220,871,312	1.11
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	516,086	3,349.74 3,859.44	1,728,758,252 1,991,807,286	1.00
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	663,455	2,337.48 2,599.47	1,550,815,579 1,724,631,368	0.86
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	183,614	8,744.41 9,313.23	1,605,596,685 1,710,040,955	0.86
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	210,081	7,661.37 7,631.54	1,609,509,867 1,603,241,554	0.80
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	328,605	3,893.08 4,694.33	1,279,288,379 1,542,582,609	0.77
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	125,962	12,537.60 11,793.43	1,579,261,246 1,485,525,112	0.74
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	45,783	27,831.59 31,295.05	1,274,213,923 1,432,781,365	0.72
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	178,381	8,022.67 7,970.68	1,431,093,324 1,421,819,403	0.71
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	245,503	5,010.35 5,778.97	1,230,056,201 1,418,756,583	0.71
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	431,287	2,928.73 3,285.52	1,263,125,849 1,417,004,738	0.71
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,215,111	1,257.33 1,081.92	1,527,801,103 1,314,653,207	0.66
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	67,858	20,788.62 18,886.42	1,410,674,460 1,281,594,946	0.64
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	149,820	8,212.22 8,423.38	1,230,355,639 1,261,991,390	0.63
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	各種金融	700,976	1,330.31 1,680.99	932,520,289 1,178,334,066	0.59
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	346,158	3,796.24 3,285.52	1,314,100,784 1,137,311,178	0.57
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	190,645	4,696.37 5,775.92	895,340,564 1,101,150,344	0.55
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,229,803	789.44 856.31	970,867,486 1,053,098,287	0.53
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	259,772	4,285.55 3,880.85	1,113,267,868 1,008,137,672	0.50
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	198,432	4,977.73 4,963.45	987,740,959 984,909,016	0.49
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	249,103	3,799.22 3,712.45	946,398,644 924,783,628	0.46
イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	319,414	2,837.93 2,866.00	906,476,233 915,443,175	0.46
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	110,729	6,846.29 8,204.13	758,082,889 908,435,243	0.45
フランス	TOTAL SA	株式	エネルギー	139,664	5,433.48 6,476.01	758,861,550 904,466,158	0.45
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	226,648	3,465.96 3,970.56	785,552,902 899,920,162	0.45
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	185,322	5,375.29 4,842.15	996,160,642 897,356,922	0.45
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	23,853	27,034.48 36,711.65	644,853,642 875,683,039	0.44
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	105,437	9,486.53 8,234.71	1,000,231,938 868,243,455	0.43

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成26年2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	9.84
	素材	5.63
	資本財	7.55
	商業・専門サービス	0.91
	運輸	1.85
	自動車・自動車部品	1.78
	耐久消費財・アパレル	1.59
	消費者サービス	1.74
	メディア	2.99
	小売	3.09
	食品・生活必需品小売り	2.16

食品・飲料・タバコ	5.90
家庭用品・パーソナル用品	1.74
ヘルスケア機器・サービス	2.97
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.26
銀行	7.82
各種金融	5.74
保険	4.13
不動産	0.60
ソフトウェア・サービス	6.84
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.80
電気通信サービス	3.34
公益事業	3.16
半導体・半導体製造装置	1.48
小計	95.91
投資証券	1.95
合計	97.86

(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26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 (2014年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	29	アメリカドル	13,235,087.00	13,440,775.00	1,370,152,603	0.69
FTSE100 (2014年3月限)	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	20	イギリスポンド	1,350,275.00	1,358,100.00	231,067,134	0.12
SP/TSE60 (2014年3月限)	モントリオール取引所	買建	7	カナダドル	1,140,746.25	1,141,560.00	104,589,727	0.05
SPI 200 (2014年3月限)	シドニー先物取引所	買建	9	オーストラリアドル	1,138,311.00	1,214,100.00	110,968,740	0.06
EURO ST (2014年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	90	ユーロ	2,810,597.50	2,826,000.00	394,933,500	0.20
SWISS 1X (2014年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	9	スイスフラン	752,923.75	759,420.00	87,151,039	0.04

(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。

&lt; 参考 &gt;

「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26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	4,213,420,894	19.09
	韓国	3,474,455,083	15.74
	台湾	2,537,978,598	11.50
	ブラジル	2,189,471,864	9.92
	南アフリカ	1,569,817,571	7.11
	アメリカ	1,380,325,403	6.25
	インド	1,363,012,412	6.18
	メキシコ	1,042,021,712	4.72
	マレーシア	839,384,451	3.80
	インドネシア	551,753,092	2.50
	タイ	482,520,281	2.19
	ポーランド	389,723,578	1.77
	チリ	332,563,841	1.51
	トルコ	282,778,552	1.28
	フィリピン	206,908,062	0.94
	コロンビア	198,116,962	0.90
	ギリシャ	118,648,868	0.54
	チェコ	54,768,775	0.25
	ハンガリー	48,709,411	0.22
投資証券	南アフリカ	38,351,082	0.17
	メキシコ	24,467,865	0.11
	トルコ	12,386,660	0.06
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		719,276,619	3.25
純資産総額		22,070,861,636	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26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)	713,197,725	3.23

(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26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	6,280	140,816.54 128,736.00	884,327,935 808,462,080		3.66
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,388,000	383.60 363.96	532,468,667 505,176,480		2.29
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	58,400	3,827.55 8,100.81	223,529,000 473,087,304		2.14
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信 サービス	344,500	1,126.09 971.70	387,945,504 334,751,683		1.52
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	4,124,550	86.19 70.43	355,607,511 290,493,706		1.32
南アフリ カ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	22,600	6,428.95 12,471.20	145,295,313 281,849,120		1.28
アメリカ	GAZPROM OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	338,000	817.55 791.56	276,413,991 267,548,665		1.21
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	4,218,350	73.18 61.49	309,068,581 259,408,276		1.18

韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	8,830	18,505.72 23,376.00	163,406,174 206,410,080	0.94
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信 サービス	1,968,000	98.53 100.83	193,916,436 198,449,971	0.90
ブラジル	AMBEV SA	株式	食品・飲料・ タバコ	261,800	750.49 742.14	196,493,668 194,293,979	0.88
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	株式	銀行	140,380	1,381.03 1,381.03	193,900,284 193,869,580	0.88
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	4,309,000	49.80 43.23	214,635,218 186,280,655	0.84
南アフリ カ	MTN GROUP LTD	株式	電気通信 サービス	95,600	1,669.33 1,884.96	159,595,058 180,202,176	0.82
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	618,069	248.77 283.08	153,761,999 174,962,972	0.79
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,023,000	193.02 167.66	197,552,566 171,522,727	0.78
アメリカ	SBERBANK-SPONSORED ADR	株式	銀行	164,500	1,338.47 1,032.65	220,276,469 169,871,286	0.77
アメリカ	LUKOIL OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	29,600	6,416.10 5,641.35	189,931,200 166,984,244	0.76
インド	INFOSYS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	25,400	4,061.55 6,320.45	103,163,811 160,539,430	0.73
南アフリ カ	SASOL LTD	株式	エネルギー	30,630	3,982.40 5,185.73	121,982,874 158,839,044	0.72
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	株式	エネルギー	240,600	859.46 616.91	206,828,597 148,430,374	0.67
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	120,004	1,447.38 1,205.27	173,708,785 144,637,725	0.66
ブラジル	VALE SA-PREF	株式	素材	107,100	1,418.82 1,287.88	151,985,284 137,932,097	0.62
香港	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	株式	エネルギー	1,462,000	87.38 91.84	127,760,402 134,282,653	0.61
香港	PETROCHINA CO LTD-H	株式	エネルギー	1,209,000	132.71 107.09	160,475,083 129,473,019	0.59
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	426,000	291.31 297.62	124,131,118 126,786,546	0.57
韓国	NAVER CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	1,590	37,460.73 76,032.00	59,562,659 120,890,880	0.55
台湾	MEDIATEK INC	株式	半導体・ 半導体製造装置	80,236	1,203.42 1,499.65	96,560,237 120,325,917	0.55
韓国	SK HYNIX INC	株式	半導体・ 半導体製造装置	30,200	2,820.48 3,792.00	85,179,400 114,518,400	0.52
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,150	84,238.65 99,264.00	96,874,454 114,153,600	0.52

(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26年2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	10.42
	素材	9.22
	資本財	4.69
	商業・専門サービス	0.14
	運輸	1.53
	自動車・自動車部品	3.80
	耐久消費財・アパレル	0.97
	消費者サービス	0.75
	メディア	1.92
	小売	1.54
	食品・生活必需品小売り	2.04
	食品・飲料・タバコ	5.03
	家庭用品・パーソナル用品	0.97
	ヘルスケア機器・サービス	0.59
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.09
	銀行	17.58
	各種金融	2.43
	保険	3.26
	不動産	1.64
	ソフトウェア・サービス	4.78
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.38
電気通信サービス	6.81	
公益事業	3.33	
半導体・半導体製造装置	8.48	
小計	96.40	

投資証券		0.34
合計		96.74

(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26年2月28日現在

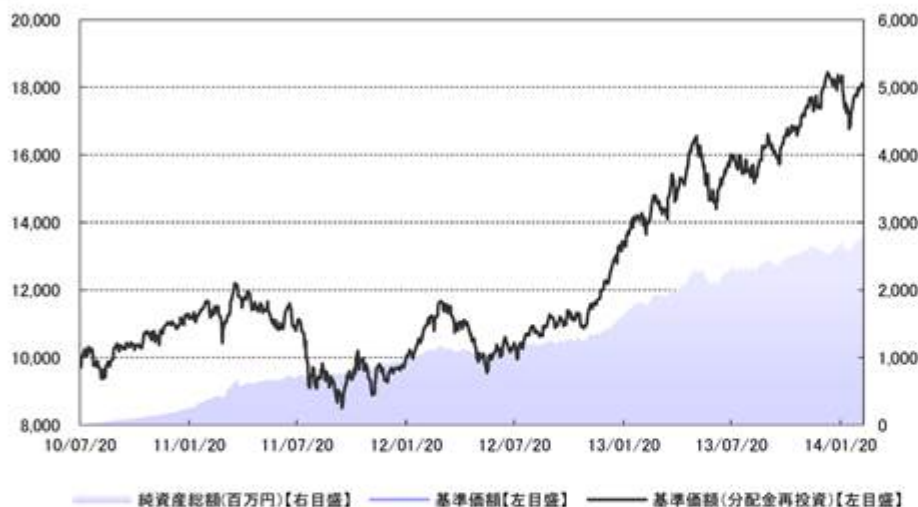
資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2014年3月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	145	アメリカドル	6,940,497.50	6,996,250.00	713,197,725	3.23

(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～2014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)を再投資したもとして計算

### 2 分配の推移

2014年 1月	0円
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(2014年2月28日現在)

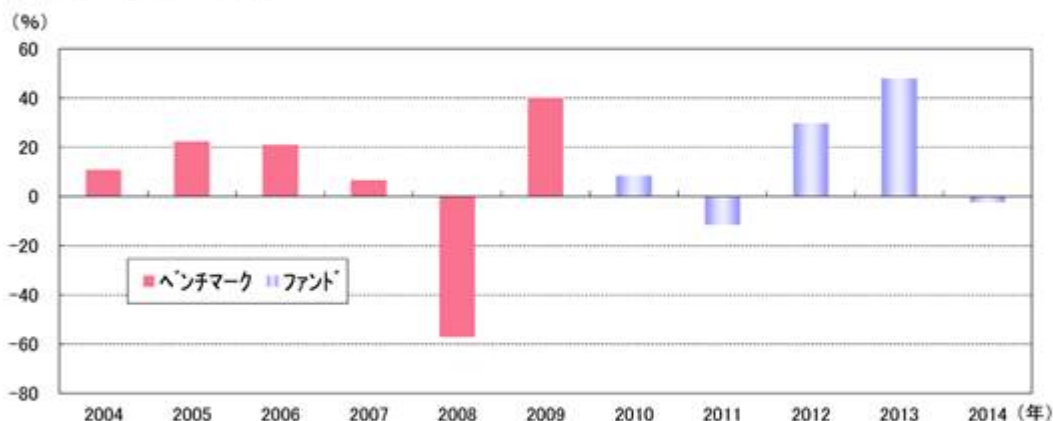
通貨別構成	比率
アメリカドル	53.3%
ユーロ	12.4%
イギリスポンド	8.6%
カナダドル	3.9%
スイスフラン	3.7%
香港ドル	3.3%
オーストラリアドル	3.0%
韓国ウォン	1.8%
その他	10.0%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
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%
2	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.2%
3	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.0%
4	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
5	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	0.8%
6	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.8%
7	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.7%
8	WELLS FARGO & CO	銀行	アメリカ	0.7%
9	CHEVRON CORP	エネルギー	アメリカ	0.7%
10	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	スイス	0.6%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	1.4%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

### 4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2010年は設定日から年末までの、2014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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> eMAXIS専用サイト <a href="http://emaxis.muam.jp/">http://emaxis.muam.jp/</a>
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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>
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時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして扱います。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 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a>          eMAXIS専用サイト <a href="http://emaxis.muam.jp/">http://emaxis.muam.jp/</a></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、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"> <li>・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合</li> <li>・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</li> </ul> <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発送します。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。</p> <p>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	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。
公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 <a href="http://www.am.mufg.jp/">http://www.am.mufg.jp/</a> なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul> <p>「分配金再投資コース（累積投資コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> </ul>
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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
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"> <li>・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。</li> </ul> <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4期計算期間(平成25年1月29日から平成26年1月27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3期 [平成25年1月28日現在]	第4期 [平成26年1月27日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,853,680	16,716,116
親投資信託受益証券	1,706,031,067	2,591,094,992
未収利息	44	27
流動資産合計	1,722,884,791	2,607,811,135
資産合計	1,722,884,791	2,607,811,135
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,065,270	7,921,310
未払受託者報酬	418,270	781,429
未払委託者報酬	3,764,357	7,032,826
その他未払費用	21,545	40,313
流動負債合計	16,269,442	15,775,878
負債合計	16,269,442	15,775,878
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,242,539,877	1,487,213,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	464,075,472	1,104,821,979
(分配準備積立金)	347,415,553	512,698,172
元本等合計	1,706,615,349	2,592,035,257
純資産合計	1,706,615,349	2,592,035,257
負債純資産合計	1,722,884,791	2,607,811,135

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第 3 期	第 4 期
	自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日	自 平成25年 1月29日 至 平成26年 1月27日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,781	11,588
有価証券売買等損益	414,289,719	525,953,258
営業収益合計	414,295,500	525,964,846
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	758,333	1,418,678
委託者報酬	6,824,870	12,767,979
その他費用	39,049	73,178
営業費用合計	7,622,252	14,259,835
営業利益	406,673,248	511,705,011
経常利益	406,673,248	511,705,011
当期純利益	406,673,248	511,705,011
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	45,926,192	179,102,842
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	22,483,046	464,075,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,958,828	709,016,983
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	100,958,828	709,016,983
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,113,458	400,872,645
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,113,458	400,872,645
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	464,075,472	1,104,821,979

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は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、基準価額で評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成25年1月29日から平成26年1月27日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第3期 [平成25年1月28日現在]	第4期 [平成26年1月27日現在]
1 期首元本額	989,378,671円	1,242,539,877円
期中追加設定元本額	768,791,890円	1,174,144,027円
期中一部解約元本額	515,630,684円	929,470,626円
2 受益権の総数	1,242,539,877口	1,487,213,278口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3735円 (13,735円)	1.7429円 (17,429円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	

第4期(自平成25年1月29日至平成26年1月27日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	50,275,703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	282,326,466円
収益調整金額	C	592,123,807円
分配準備積立金額	D	180,096,003円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,104,821,979円
当ファンドの期末残存口数	F	1,487,213,278口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	7,428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3期 (自平成24年1月27日 至平成25年1月28日)	第4期 (自平成25年1月29日 至平成26年1月27日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、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。 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。 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  同左  同左



3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同 左  同 左
------------------	--	----------------

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 3 期 [ 平成25年1月28日現在 ]	第 4 期 [ 平成26年1月27日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	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	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 3 期 [ 平成25年1月28日現在 ]	第 4 期 [ 平成26年1月27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	400,663,076	450,162,943
合計	400,663,076	450,162,943

## (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	159,487,723	291,128,889	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,337,967,483	2,299,966,103	
	親投資信託受益証券 小計	1,497,455,206	2,591,094,992	
	合計	1,497,455,206	2,591,094,992	

## 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。

## &lt;参考&gt;

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。  
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の状況は以下の通りです。

「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25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	317,465,780	1,567,416,462
コール・ローン	312,264,272	429,631,721
株式	163,526,479,317	185,655,308,606
投資証券	3,782,024,296	3,842,332,279
派生商品評価勘定	28,792,271	11,607,027
未収入金	1,273,613,144	2,253,158
未収配当金	162,976,167	176,005,826
未収利息	819	718
差入委託証拠金	788,338,604	555,449,249
流動資産合計	170,191,954,670	192,240,005,046
資産合計	170,191,954,670	192,240,005,046
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	300,240	37,363,173
未払金		17,211,401
未払解約金	281,352,688	515,069,950
流動負債合計	281,652,928	569,644,524
負債合計	281,652,928	569,644,524
純資産の部		
元本等		
元本	1 130,314,013,541	111,499,140,094
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	39,596,288,201	80,171,220,428
元本等合計	169,910,301,742	191,670,360,522
純資産合計	169,910,301,742	191,670,360,522
負債純資産合計	170,191,954,670	192,240,005,046

(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	株式は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、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は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、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は個別法に基づき、金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は個別法に基づき、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。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成24年1月27日 152,966,217,901円	平成25年1月29日 130,314,013,541円
期首からの追加設定元本額	13,892,253,884円	20,155,965,454円
期首からの一部解約元本額	36,544,458,244円	38,970,838,901円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	38,411,836円	258,275,060円
eMAXIS 先進国株式インデックス	7,349,584,806円	7,837,448,019円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	84,916,884円	217,825,561円
eMAXIS バランス（波乗り型）	19,270,810円	261,300,005円
コアバランス		578,743円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,499,942,798円	1,974,353,137円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,129,171,481円	1,337,967,483円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）		43,411,748円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式重視型）		150,417,388円
三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）		17,260,271円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	46,305,295,275円	36,347,786,925円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	30,523,985,791円	21,912,154,002円

三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	863,771,127円	507,046,227円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	5,931,153,773円	4,048,630,313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)	6,752,005,577円	12,199,361,864円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	764,785,597円	557,291,889円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	487,917,822円	252,762,152円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,112,438,026円	2,755,203,702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)	1,743,323,566円	2,083,427,316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)	23,775,854円	74,418,059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)	5,805,181,219円	6,325,043,819円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,485,272,027円	2,148,752,228円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	44,784,745円	22,660,365円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	133,585,723円	90,051,132円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	200,683,389円	152,253,259円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	239,515,902円	183,142,037円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	2,434,162,777円	1,086,176,781円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	260,775,431円	115,639,747円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	2,087,096,357円	1,111,104,788円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	513,289,360円	250,983,389円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	2,470,816,153円	1,418,803,328円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,146,261,813円	3,313,336,027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)	292,250,258円	221,070,383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)	1,097,814,399円	906,822,488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)	858,261,533円	746,628,849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)	614,511,432円	569,751,610円
(合計)	130,314,013,541円	111,499,140,094円
2 受益権の総数	130,314,013,541口	111,499,140,094口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3039円 (13,039円)	1.7190円 (17,190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24年1月27日 至平成25年1月28日)	(自平成25年1月29日 至平成26年1月27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、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	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25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27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ぬ。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（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。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27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	19,306,743,255	14,156,116,558
投資証券	334,085,241	507,169,053
合計	19,640,828,496	13,648,947,505

(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	2,018,522,832		2,047,285,693	28,762,861
	合 計	2,018,522,832		2,047,285,693	28,762,861

区 分	種 類	[ 平成26年1月27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	2,214,861,575		2,187,200,404	27,661,171
	合 計	2,214,861,575		2,187,200,404	27,661,171

## (注) 時価の算定方法

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

## 通貨関連

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	270,830

区分	種類	[平成26年1月27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	93,147,300		92,079,000	1,068,300
	カナダドル	13,967,700		13,879,500	88,200
	オーストラリアドル	13,594,650		13,347,000	247,650
	ユーロ	42,499,560		41,994,000	505,560
	買建				
	アメリカドル	35,811,685		35,808,500	3,185
ユーロ	27,997,500		27,996,000	1,500	
合計		227,018,395		225,104,000	1,905,025

## (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。

## (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	42,381	130.220000	5,518,853.82	
	ABBOTT LABORATORIES	101,542	36.580000	3,714,406.36	
	ABBVIE INC	103,547	47.790000	4,948,511.13	
	ACCENTURE PLC-CL A	42,052	81.180000	3,413,781.36	
	ACE LTD	22,171	92.190000	2,043,944.49	
	ACTAVIS PLC	11,305	177.190000	2,003,132.95	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	30,018	16.670000	500,400.06	
	ADOBE SYSTEMS INC	31,041	59.090000	1,834,212.69	
	ADT CORP/THE	13,135	38.780000	509,375.30	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	4,663	115.980000	540,814.74	
	AES CORP	45,889	13.720000	629,597.08	
	AETNA INC	24,280	68.930000	1,673,620.40	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,468	200.470000	695,229.96	
	AFLAC INC	30,323	62.290000	1,888,819.67	
	AGCO CORP	6,502	53.080000	345,126.16	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,500	57.870000	1,244,205.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,615	106.710000	1,452,856.65	
	AIRGAS INC	4,220	108.820000	459,220.40	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	11,480	48.340000	554,943.20	
	ALBEMARLE CORP	5,405	63.310000	342,190.55	
	ALCOA INC	69,381	11.440000	793,718.64	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,694	133.640000	1,696,426.16	
	ALLEGHANY CORP	1,095	375.290000	410,942.55	
	ALLERGAN INC	19,372	114.870000	2,225,261.64	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,211	249.720000	801,850.92	
	ALLIANT ENERGY CORP	7,275	50.750000	369,206.25	
	ALLSTATE CORP	30,028	50.620000	1,520,017.36	
	ALTERA CORP	21,140	32.120000	679,016.80	
	ALTRIA GROUP INC	130,913	37.300000	4,883,054.90	
	AMAZON.COM INC	23,864	387.600000	9,249,686.40	
	AMEREN CORPORATION	15,965	35.910000	573,303.15	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	31,782	46.770000	1,486,444.14	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,407	86.950000	5,513,238.65	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	91,626	47.860000	4,385,220.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,732	41.830000	490,749.56
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,792	106.790000	1,366,057.68
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,955	67.250000	1,005,723.75
AMETEK INC	15,729	49.630000	780,630.27
AMGEN INC	49,183	119.290000	5,867,040.07
AMPHENOL CORP-CL A	10,526	85.890000	904,078.14
ANADARKO PETROLEUM CORP	32,815	81.090000	2,660,968.35
ANALOG DEVICES INC	19,906	48.250000	960,464.50
ANSYS INC	5,936	79.740000	473,336.64
AON PLC	19,012	78.410000	1,490,730.92
APACHE CORP	25,418	82.420000	2,094,951.56
APPLE INC	59,310	546.070000	32,387,411.70
APPLIED MATERIALS INC	77,904	17.170000	1,337,611.68
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,671	53.610000	464,852.31
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,946	39.570000	1,699,373.22
ARROW ELECTRONICS INC	6,511	51.780000	337,139.58
ASHLAND INC	4,787	95.160000	455,530.92
ASSURANT INC	4,938	64.140000	316,723.32
AT&T INC	346,694	33.420000	11,586,513.48
AUTODESK INC	14,712	50.440000	742,073.28
AUTOLIV INC	6,298	86.470000	544,588.06
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,392	76.970000	2,416,242.24
AUTOZONE INC	2,309	499.250000	1,152,768.25
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,187	54.490000	882,029.63
AVERY DENNISON CORP	6,332	49.130000	311,091.16
AVNET INC	9,000	41.970000	377,730.00
AVON PRODUCTS INC	28,588	15.500000	443,114.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,928	44.530000	308,503.84
B/E AEROSPACE INC	6,733	82.930000	558,367.69
BAKER HUGHES INC	28,787	56.430000	1,624,450.41
BALL CORP	9,075	48.600000	441,045.00
BANK OF AMERICA CORP	701,618	16.450000	11,541,616.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	74,989	32.340000	2,425,144.26
BAXTER INTERNATIONAL INC	35,453	67.640000	2,398,040.92
BB&T CORP	45,925	38.260000	1,757,090.50
BEAM INC	9,525	83.450000	794,861.25
BECTON DICKINSON AND CO	12,638	107.750000	1,361,744.50
BED BATH & BEYOND INC	14,156	64.590000	914,336.04
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	72,150	111.810000	8,067,091.50
BEST BUY CO INC	17,602	25.020000	440,402.04
BIOGEN IDEC INC	15,513	303.600000	4,709,746.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,247	70.850000	655,149.95
BLACKROCK INC	8,757	303.110000	2,654,334.27
BOEING CO/THE	46,792	136.650000	6,394,126.80
BORGWARNER INC	14,809	53.710000	795,391.39
BOSTON SCIENTIFIC CORP	88,595	13.340000	1,181,857.30
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,493	50.940000	5,475,693.42
BROADCOM CORP-CL A	34,251	29.390000	1,006,636.89
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,138	77.760000	632,810.88
BUNGE LTD	9,700	77.640000	753,108.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,342	57.210000	591,665.82
CA INC	21,026	32.660000	686,709.16
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,225	15.870000	194,010.75
CABOT OIL & GAS CORP	27,413	39.550000	1,084,184.15
CALPINE CORP	22,705	18.680000	424,129.40
CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,009	57.970000	928,041.73
CAMPBELL SOUP CO	13,576	42.290000	574,129.04
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,189	70.570000	2,694,997.73
CARDINAL HEALTH INC	22,076	65.420000	1,444,211.92
CAREFUSION CORP	14,035	39.100000	548,768.50
CARMAX INC	14,691	44.570000	654,777.87
CARNIVAL CORP	24,871	39.150000	973,699.65
CATERPILLAR INC	42,308	86.170000	3,645,680.36
CBRE GROUP INC - A	18,611	25.470000	474,022.17
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	36,852	58.390000	2,151,788.28
CELANESE CORP-SERIES A	10,459	52.670000	550,875.53

CELGENE CORP	26,843	161.220000	4,327,628.46
CENTERPOINT ENERGY INC	26,799	23.150000	620,396.85
CENTURYLINK INC	39,058	29.150000	1,138,540.70
CERNER CORP	19,994	54.710000	1,093,871.74
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,792	232.680000	882,322.56
CHARTER COMMUNICATION-A	4,051	131.420000	532,382.42
CHENIERE ENERGY INC	13,108	43.820000	574,392.56
CHESAPEAKE ENERGY CORP	34,388	26.880000	924,349.44
CHEVRON CORP	126,195	116.290000	14,675,216.55
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,383	75.780000	483,703.74
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,007	492.480000	988,407.36
CHUBB CORP	16,775	85.930000	1,441,475.75
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,089	65.050000	591,239.45
CIGNA CORP	18,420	86.700000	1,597,014.00
CIMAREX ENERGY CO	5,567	98.520000	548,460.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,306	48.810000	503,035.86
CINTAS CORP	6,885	57.160000	393,546.60
CISCO SYSTEMS INC	348,654	22.200000	7,740,118.80
CIT GROUP INC	12,440	47.950000	596,498.00
CITIGROUP INC	198,643	49.330000	9,799,059.19
CITRIX SYSTEMS INC	12,398	58.890000	730,118.22
CLOROX COMPANY	8,558	88.830000	760,207.14
CME GROUP INC	20,624	74.420000	1,534,838.08
CMS ENERGY CORP	17,197	26.540000	456,408.38
COACH INC	18,260	48.810000	891,270.60
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,571	17.170000	336,034.07
COCA-COLA CO/THE	260,590	38.840000	10,121,315.60
COCA-COLA ENTERPRISES	16,724	43.530000	727,995.72
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,631	97.280000	1,909,703.68
COLGATE-PALMOLIVE CO	60,572	62.390000	3,779,087.08
COMCAST CORP-CLASS A	139,601	52.400000	7,315,092.40
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	31,161	50.590000	1,576,434.99
COMERICA INC	12,344	47.230000	583,007.12
COMPUTER SCIENCES CORP	9,672	54.270000	524,899.44
CONAGRA FOODS INC	27,388	32.750000	896,957.00
CONCHO RESOURCES INC	6,815	96.890000	660,305.35
CONOCOPHILLIPS	75,882	66.570000	5,051,464.74
CONSOL ENERGY INC	14,695	37.470000	550,621.65
CONSOLIDATED EDISON INC	19,065	53.650000	1,022,837.25
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,908	75.800000	826,826.40
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,960	106.910000	316,453.60
CORE LABORATORIES N.V.	2,920	185.360000	541,251.20
CORNING INC	95,131	18.210000	1,732,335.51
COSTCO WHOLESALE CORP	28,506	112.130000	3,196,377.78
COVIDIEN PLC	30,019	68.000000	2,041,292.00
CR BARD INC	4,926	133.090000	655,601.34
CREE INC	7,986	61.620000	492,097.32
CROWN HOLDINGS INC	9,275	41.020000	380,460.50
CSX CORP	66,537	26.200000	1,743,269.40
CUMMINS INC	11,585	126.310000	1,463,301.35
CVS CAREMARK CORP	80,220	67.630000	5,425,278.60
DANAHER CORP	38,533	74.130000	2,856,451.29
DARDEN RESTAURANTS INC	8,394	50.100000	420,539.40
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	11,875	64.200000	762,375.00
DEERE & CO	23,756	85.550000	2,032,325.80
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,012	59.920000	1,139,199.04
DELTA AIR LINES INC	14,407	31.110000	448,201.77
DENBURY RESOURCES INC	24,028	16.210000	389,493.88
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,302	45.840000	426,403.68
DEVON ENERGY CORPORATION	25,148	59.520000	1,496,808.96
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,754	51.040000	242,644.16
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,692	52.430000	350,861.56
DIRECTV	34,057	69.350000	2,361,852.95
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	31,500	53.880000	1,697,220.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,692	78.990000	765,571.08
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,768	73.590000	424,467.12
DISH NETWORK CORP-A	14,407	54.600000	786,622.20



DOLLAR GENERAL CORP	20,210	57.350000	1,159,043.50
DOLLAR TREE INC	14,711	51.670000	760,117.37
DOMINION RESOURCES INC/VA	37,822	65.930000	2,493,604.46
DOVER CORP	11,001	90.330000	993,720.33
DOW CHEMICAL CO/THE	78,995	43.410000	3,429,172.95
DR HORTON INC	18,996	20.880000	396,636.48
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,330	48.470000	646,105.10
DTE ENERGY COMPANY	11,575	65.470000	757,815.25
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	60,254	59.970000	3,613,432.38
DUKE ENERGY CORP	46,154	68.260000	3,150,472.04
DUN & BRADSTREET CORP	2,581	113.300000	292,427.30
EASTMAN CHEMICAL CO	10,177	74.630000	759,509.51
EATON CORP PLC	30,900	73.130000	2,259,717.00
EATON VANCE CORP	7,664	39.320000	301,348.48
EBAY INC	76,030	54.350000	4,132,230.50
ECOLAB INC	17,616	99.350000	1,750,149.60
EDISON INTERNATIONAL	20,051	46.920000	940,792.92
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,184	68.810000	494,331.04
ELECTRONIC ARTS INC	19,607	23.840000	467,430.88
ELI LILLY & CO	66,217	54.120000	3,583,664.04
EMC CORP/MA	135,691	25.490000	3,458,763.59
EMERSON ELECTRIC CO	46,585	65.260000	3,040,137.10
ENERGEN CORP	4,648	69.380000	322,478.24
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,173	102.060000	425,896.38
ENSCO PLC-CL A	15,381	51.340000	789,660.54
ENTERGY CORP	11,822	61.280000	724,452.16
EOG RESOURCES INC	17,771	165.530000	2,941,633.63
EQT CORP	9,862	90.700000	894,483.40
EQUIFAX INC	8,044	69.770000	561,229.88
EQUINIX INC	3,243	183.880000	596,322.84
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,539	68.790000	1,068,927.81
EVEREST RE GROUP LTD	3,163	142.890000	451,961.07
EXELON CORP	55,991	28.270000	1,582,865.57
EXPEDIA INC	7,106	66.300000	471,127.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,751	42.000000	577,542.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	53,192	73.320000	3,900,037.44
EXXON MOBIL CORP	287,432	94.850000	27,262,925.20
F5 NETWORKS INC	5,220	104.880000	547,473.60
FACEBOOK INC-A	112,722	54.440000	6,136,585.68
FAMILY DOLLAR STORES	6,619	62.950000	416,666.05
FASTENAL CO	18,635	45.090000	840,252.15
FEDEX CORP	19,607	134.580000	2,638,710.06
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,034	30.130000	452,974.42
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	18,866	50.840000	959,147.44
FIFTH THIRD BANCORP	55,389	21.320000	1,180,893.48
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,147	50.710000	311,714.37
FIRSTENERGY CORP	27,147	31.070000	843,457.29
FISERV INC	16,772	56.400000	945,940.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,498	105.190000	473,144.62
FLEXTRONICS INTL LTD	41,336	7.500000	310,020.00
FLIR SYSTEMS INC	9,381	32.670000	306,477.27
FLOWSERVE CORP	9,191	72.990000	670,851.09
FLUOR CORP	10,727	77.480000	831,127.96
FMC CORP	8,758	71.620000	627,247.96
FMC TECHNOLOGIES INC	15,362	49.400000	758,882.80
FORD MOTOR CO	240,140	15.830000	3,801,416.20
FOREST LABORATORIES INC	15,574	64.950000	1,011,531.30
FOSSIL GROUP INC	3,387	113.280000	383,679.36
FRANKLIN RESOURCES INC	27,167	53.600000	1,456,151.20
FREEPORT-MCMORAN COPPER	67,711	32.770000	2,218,889.47
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	64,653	4.800000	310,334.40
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,786	36.520000	284,344.72
GAP INC/THE	20,157	37.210000	750,041.97
GARMIN LTD	7,549	45.210000	341,290.29
GENERAL DYNAMICS CORP	19,316	98.310000	1,898,955.96
GENERAL ELECTRIC CO	665,184	24.950000	16,596,340.80
GENERAL MILLS INC	41,767	48.280000	2,016,510.76

GENERAL MOTORS CO	63,249	36.830000	2,329,460.67	
GENUINE PARTS CO	10,222	82.340000	841,679.48	
GILEAD SCIENCES INC	99,923	80.620000	8,055,792.26	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,879	167.640000	4,673,635.56	
GOOGLE INC-CL A	17,883	1,123.210000	20,086,364.43	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	8,302	78.680000	653,201.36	
H&R BLOCK INC	17,923	28.080000	503,277.84	
HALLIBURTON CO	55,130	48.610000	2,679,869.30	
HARLEY-DAVIDSON INC	14,685	64.020000	940,133.70	
HARRIS CORP	7,140	68.060000	485,948.40	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,114	32.770000	921,295.78	
HASBRO INC	7,752	51.270000	397,445.04	
HCA HOLDINGS INC	20,168	48.400000	976,131.20	
HELMERICH & PAYNE	7,064	86.010000	607,574.64	
HENRY SCHEIN INC	5,622	114.960000	646,305.12	
HERBALIFE LTD	5,670	60.060000	340,540.20	
HERSHEY CO/THE	9,931	98.120000	974,429.72	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	26,662	26.750000	713,208.50	
HESS CORP	20,169	76.250000	1,537,886.25	
HEWLETT-PACKARD CO	125,861	28.490000	3,585,779.89	
HOLLYFRONTIER CORP	12,255	46.690000	572,185.95	
HOLOGIC INC	17,361	21.240000	368,747.64	
HOME DEPOT INC	93,530	79.160000	7,403,834.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	48,649	88.470000	4,303,977.03	
HORMEL FOODS CORP	9,450	45.140000	426,573.00	
HOSPIRA INC	11,048	44.570000	492,409.36	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,205	9.040000	291,133.20	
HUMANA INC	10,142	96.000000	973,632.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,037	76.300000	460,623.10	
IHS INC-CLASS A	3,940	114.720000	451,996.80	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,685	79.210000	2,192,928.85	
ILLUMINA INC	8,261	138.620000	1,145,139.82	
INGERSOLL-RAND PLC	18,844	58.110000	1,095,024.84	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,287	53.610000	283,436.07	
INTEL CORP	324,942	24.810000	8,061,811.02	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GRO	7,436	204.360000	1,519,620.96	
INTERNATIONAL PAPER CO	27,907	45.560000	1,271,442.92	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,133	16.790000	472,353.07	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,948	179.640000	12,206,178.72	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,175	85.000000	439,875.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	16,799	15.040000	252,656.96	
INTUIT INC	18,250	73.240000	1,336,630.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,626	410.760000	1,078,655.76	
INVESCO LTD	28,747	33.480000	962,449.56	
IRON MOUNTAIN INC	9,624	27.410000	263,793.84	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,708	63.000000	548,604.00	
JM SMUCKER CO/THE	6,763	97.970000	662,571.11	
JOHNSON & JOHNSON	184,043	90.610000	16,676,136.23	
JOHNSON CONTROLS INC	44,598	48.210000	2,150,069.58	
JOY GLOBAL INC	6,956	52.700000	366,581.20	
JPMORGAN CHASE & CO	245,848	55.090000	13,543,766.32	
JUNIPER NETWORKS INC	33,540	27.720000	929,728.80	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,323	99.490000	728,565.27	
KBR INC	10,007	31.670000	316,921.69	
KELLOGG CO	16,385	59.830000	980,314.55	
KEYCORP	59,468	12.930000	768,921.24	
KIMBERLY-CLARK CORP	24,979	107.400000	2,682,744.60	
KINDER MORGAN INC	43,769	35.470000	1,552,486.43	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	7,097	77.030000	546,681.91	
KLA-TENCOR CORPORATION	10,826	62.070000	671,969.82	
KOHL'S CORP	13,809	50.220000	693,487.98	
KRAFT FOODS GROUP INC	38,844	52.880000	2,054,070.72	
KROGER CO	31,802	36.080000	1,147,416.16	
L BRANDS INC	15,883	52.640000	836,081.12	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,833	104.170000	607,623.61	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,918	90.100000	533,211.80	
LAM RESEARCH CORP	10,815	51.270000	554,485.05	

LAS VEGAS SANDS CORP	26,886	73.910000	1,987,144.26
LEGG MASON INC	7,136	42.230000	301,353.28
LEGGETT & PLATT INC	9,525	29.780000	283,654.50
LEIDOS HOLDINGS INC	4,743	45.480000	215,711.64
LENNAR CORP-A	10,613	37.030000	392,999.39
LEUCADIA NATIONAL CORP	20,407	27.410000	559,355.87
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	10,431	32.340000	337,338.54
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13,782	83.270000	1,147,627.14
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	10,940	78.800000	862,072.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	32,302	27.530000	889,274.06
LIBERTY MEDIA CORP - A	6,151	133.800000	823,003.80
LIFE TECHNOLOGIES CORP	11,315	75.960000	859,487.40
LINCOLN NATIONAL CORP	17,105	47.870000	818,816.35
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,304	44.820000	685,925.28
LINKEDIN CORP - A	6,434	217.390000	1,398,687.26
LKQ CORP	19,645	26.160000	513,913.20
LOCKHEED MARTIN CORP	17,795	147.760000	2,629,389.20
LOEWS CORP	21,780	44.650000	972,477.00
LORILLARD INC	24,270	49.530000	1,202,093.10
LOWE'S COS INC	68,628	47.830000	3,282,477.24
LSI CORP	35,346	11.000000	388,806.00
LULULEMON ATHLETICA INC	6,746	47.620000	321,244.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,723	75.920000	2,104,730.16
M & T BANK CORP	7,739	111.270000	861,118.53
MACY'S INC	24,567	54.420000	1,336,936.14
MANPOWERGROUP INC	5,076	80.140000	406,790.64
MARATHON OIL CORP	46,262	33.000000	1,526,646.00
MARATHON PETROLEUM CORP	20,362	82.980000	1,689,638.76
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,980	49.760000	795,164.80
MARSH & MCLENNAN COS	35,745	46.370000	1,657,495.65
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,010	104.320000	314,003.20
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,470	14.760000	390,697.20
MASCO CORP	23,066	21.450000	494,765.70
MASTERCARD INC-CLASS A	68,110	78.510000	5,347,316.10
MATTEL INC	22,301	43.000000	958,943.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	19,091	29.200000	557,457.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,794	68.990000	537,708.06
MCDONALD'S CORP	65,274	94.430000	6,163,823.82
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	16,941	73.270000	1,241,267.07
MCKESSON CORP	14,917	173.720000	2,591,381.24
MDU RESOURCES GROUP INC	12,128	31.060000	376,695.68
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,123	78.290000	1,027,399.67
MEADWESTVACO CORP	11,415	35.770000	408,314.55
MEDTRONIC INC	65,818	57.160000	3,762,156.88
MERCK & CO. INC.	191,171	51.980000	9,937,068.58
METLIFE INC	60,925	49.510000	3,016,396.75
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,995	243.440000	485,662.80
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,968	23.780000	617,519.04
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,518	80.070000	1,002,316.26
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,955	44.080000	571,056.40
MICRON TECHNOLOGY INC	67,606	22.920000	1,549,529.52
MICROSOFT CORP	516,626	36.810000	19,017,003.06
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,050	141.360000	572,508.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,934	53.820000	534,647.88
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,406	33.650000	3,715,161.90
MONSANTO CO	34,779	107.940000	3,754,045.26
MONSTER BEVERAGE CORP	9,392	67.550000	634,429.60
MOODY'S CORP	13,068	72.970000	953,571.96
MORGAN STANLEY	95,960	30.450000	2,921,982.00
MOSAIC CO/THE	19,584	45.380000	888,721.92
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,785	64.420000	1,016,869.70
MURPHY OIL CORP	11,858	60.500000	717,409.00
MYLAN INC	24,839	44.310000	1,100,616.09
NABORS INDUSTRIES LTD	20,008	17.040000	340,936.32
NASDAQ OMX GROUP/THE	7,747	37.600000	291,287.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,840	74.000000	2,060,160.00
NETAPP INC	22,045	43.960000	969,098.20

NETFLIX INC	3,444	386.080000	1,329,659.52	
NETSUITE INC	2,271	109.140000	247,856.94	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,703	16.790000	481,923.37	
NEWELL RUBBERMAID INC	18,459	30.950000	571,306.05	
NEWMONT MINING CORP	32,831	24.880000	816,835.28	
NEWS CORP - CLASS A	25,194	16.170000	407,386.98	
NEXTERA ENERGY INC	27,738	87.060000	2,414,870.28	
NIELSEN HOLDINGS NV	17,054	43.240000	737,414.96	
NIKE INC -CL B	46,461	71.650000	3,328,930.65	
NISOURCE INC	20,195	33.590000	678,350.05	
NOBLE CORP PLC	16,683	32.940000	549,538.02	
NOBLE ENERGY INC	23,287	62.970000	1,466,382.39	
NORDSTROM INC	10,095	58.160000	587,125.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,367	89.610000	1,825,086.87	
NORTHEAST UTILITIES	20,789	42.430000	882,077.27	
NORTHERN TRUST CORP	15,055	61.130000	920,312.15	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,202	113.450000	1,611,216.90	
NRG ENERGY INC	21,274	26.820000	570,568.68	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,282	15.510000	252,533.82	
NUCOR CORP	20,906	48.760000	1,019,376.56	
NVIDIA CORP	37,989	15.560000	591,108.84	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	52,630	88.000000	4,631,440.00	
OCEANEERING INTL INC	7,060	71.600000	505,496.00	
OCWEN FINANCIAL CORP	7,510	46.860000	351,918.60	
OGE ENERGY CORP	13,265	33.630000	446,101.95	
OMNICARE INC	6,893	62.700000	432,191.10	
OMNICOM GROUP	16,920	72.510000	1,226,869.20	
ONEOK INC	13,579	65.360000	887,523.44	
ORACLE CORP	226,752	37.110000	8,414,766.72	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,989	132.560000	926,461.84	
OWENS-ILLINOIS INC	10,158	32.030000	325,360.74	
P G & E CORP	29,021	40.820000	1,184,637.22	
PACCAR INC	23,018	56.230000	1,294,302.14	
PALL CORP	7,154	79.440000	568,313.76	
PARKER HANNIFIN CORP	9,671	114.630000	1,108,586.73	
PARTNERRE LTD	3,195	97.320000	310,937.40	
PATTERSON COS INC	5,355	39.990000	214,146.45	
PAYCHEX INC	21,518	42.080000	905,477.44	
PEABODY ENERGY CORP	17,282	16.870000	291,547.34	
PENTAIR LTD-REGISTERED	13,042	72.220000	941,893.24	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	21,360	14.580000	311,428.80	
PEPCO HOLDINGS INC	17,119	18.680000	319,782.92	
PEPSICO INC	100,723	81.430000	8,201,873.89	
PERRIGO CO PLC	8,608	152.790000	1,315,216.32	
PETSMART INC	6,333	62.600000	396,445.80	
PFIZER INC	432,419	30.090000	13,011,487.71	
PHARMACYCLICS INC	4,057	135.200000	548,506.40	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105,744	81.500000	8,618,136.00	
PHILLIPS 66	37,889	74.440000	2,820,457.16	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,238	52.010000	376,448.38	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,984	172.730000	1,551,806.32	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,811	81.030000	2,820,735.33	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,286	133.000000	570,038.00	
PPG INDUSTRIES INC	9,257	181.600000	1,681,071.20	
PPL CORPORATION	41,268	29.870000	1,232,675.16	
PRAXAIR INC	19,198	126.970000	2,437,570.06	
PRECISION CASTPARTS CORP	9,481	255.460000	2,422,016.26	
PRICELINE.COM INC	3,361	1,179.470000	3,964,198.67	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,355	43.970000	851,039.35	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	178,834	79.180000	14,160,076.12	
PROGRESSIVE CORP	36,857	24.800000	914,053.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,235	84.360000	2,550,624.60	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,817	33.020000	1,083,617.34	
PULTEGROUP INC	22,840	18.840000	430,305.60	
PVH CORP	5,347	120.810000	645,971.07	
QEP RESOURCES INC	11,646	30.840000	359,162.64	
QUALCOMM INC	111,866	74.080000	8,287,033.28	

QUANTA SERVICES INC	13,684	31.070000	425,161.88
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,789	53.710000	525,767.19
RACKSPACE HOSTING INC	7,834	37.130000	290,876.42
RALPH LAUREN CORP	4,024	157.620000	634,262.88
RANGE RESOURCES CORP	10,738	86.150000	925,078.70
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,183	52.560000	430,098.48
RAYTHEON COMPANY	20,917	88.130000	1,843,415.21
REALOGY HOLDINGS CORP	9,589	45.700000	438,217.30
RED HAT INC	12,473	56.730000	707,593.29
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,037	279.610000	1,408,395.57
REGIONS FINANCIAL CORP	91,958	10.550000	970,156.90
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	3,003	89.800000	269,669.40
REPUBLIC SERVICES INC	18,990	31.740000	602,742.60
RESMED INC	9,062	43.880000	397,640.56
REYNOLDS AMERICAN INC	21,100	49.100000	1,036,010.00
ROBERT HALF INTL INC	9,189	40.010000	367,651.89
ROCK TENN COMPANY -CL A	4,756	96.150000	457,289.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,988	112.990000	1,015,554.12
ROCKWELL COLLINS INC	8,205	77.070000	632,359.35
ROPER INDUSTRIES INC	6,500	135.670000	881,855.00
ROSS STORES INC	14,120	67.830000	957,759.60
ROWAN COMPANIES PLC-A	8,249	32.510000	268,174.99
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,887	47.130000	465,974.31
SAFEWAY INC	15,422	30.980000	477,773.56
SALESFORCE.COM INC	36,905	58.400000	2,155,252.00
SANDISK CORP	15,582	69.480000	1,082,637.36
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,267	89.950000	743,616.65
SCANA CORP	8,514	46.560000	396,411.84
SCHLUMBERGER LTD	86,376	88.150000	7,614,044.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	75,318	25.270000	1,903,285.86
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,318	73.610000	391,457.98
SEAGATE TECHNOLOGY	20,802	58.570000	1,218,373.14
SEALED AIR CORP	12,130	31.070000	376,879.10
SEARS HOLDINGS CORP	2,424	38.150000	92,475.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,794	33.760000	330,645.44
SEMPRA ENERGY	15,106	90.280000	1,363,769.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,999	37.010000	333,052.99
SERVICENOW INC	8,019	58.560000	469,592.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,663	190.800000	1,080,500.40
SIGMA-ALDRICH	7,938	91.430000	725,771.34
SIRIUS XM HOLDINGS INC	205,081	3.640000	746,494.84
SLM CORP	28,699	23.010000	660,363.99
SOUTHERN CO/THE	57,132	41.220000	2,354,981.04
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,455	20.840000	238,722.20
SOUTHWESTERN ENERGY CO	23,140	41.660000	964,012.40
SPECTRA ENERGY CORP	43,455	34.650000	1,505,715.75
SPRINT CORP	63,810	8.400000	536,004.00
SPX CORP	2,591	98.880000	256,198.08
ST JUDE MEDICAL INC	18,712	62.110000	1,162,202.32
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,030	77.810000	780,434.30
STAPLES INC	43,243	13.520000	584,645.36
STARBUCKS CORP	49,009	74.980000	3,674,694.82
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,834	76.610000	983,212.74
STATE STREET CORP	29,037	69.520000	2,018,652.24
STERICYCLE INC	5,496	116.340000	639,404.64
STRYKER CORP	19,891	76.130000	1,514,301.83
SUNTRUST BANKS INC	35,023	38.050000	1,332,625.15
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	10,636	24.360000	259,092.96
SYMANTEC CORP	46,244	23.300000	1,077,485.20
SYNOPSIS INC	10,355	40.110000	415,339.05
SYSCO CORP	38,584	35.480000	1,368,960.32
T ROWE PRICE GROUP INC	16,861	77.380000	1,304,704.18
TARGET CORP	39,117	57.720000	2,257,833.24
TD AMERITRADE HOLDING CORP	14,242	32.050000	456,456.10
TE CONNECTIVITY LTD	26,844	57.320000	1,538,698.08
TERADATA CORP	10,575	43.780000	462,973.50
TESLA MOTORS INC	5,512	174.600000	962,395.20

TESORO CORP	8,633	50.570000	436,570.81	
TEXAS INSTRUMENTS INC	71,577	42.950000	3,074,232.15	
TEXTRON INC	18,180	36.410000	661,933.80	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	23,513	109.950000	2,585,254.35	
TIFFANY & CO	8,423	83.130000	700,203.99	
TIME WARNER CABLE	18,652	133.700000	2,493,772.40	
TIME WARNER INC	60,023	63.320000	3,800,656.36	
TJX COMPANIES INC	46,613	57.750000	2,691,900.75	
T-MOBILE US INC	15,595	31.680000	494,049.60	
TOLL BROTHERS INC	10,518	35.570000	374,125.26	
TORCHMARK CORP	6,077	74.560000	453,101.12	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,354	30.960000	351,519.84	
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,234	122.000000	516,548.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,086	70.180000	637,655.48	
TRANSDIGM GROUP INC	3,259	169.100000	551,096.90	
TRAVELERS COS INC/THE	24,349	81.610000	1,987,121.89	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,131	32.520000	557,100.12	
TRIPADVISOR INC	7,523	80.360000	604,548.28	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,505	74.190000	556,795.95	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	28,808	30.690000	884,117.52	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	98,832	31.270000	3,090,476.64	
TYCO INTERNATIONAL LTD	29,953	39.400000	1,180,148.20	
TYSON FOODS INC-CL A	18,462	34.770000	641,923.74	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,044	83.930000	339,412.92	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,301	83.490000	442,580.49	
UNION PACIFIC CORP	30,313	171.640000	5,202,923.32	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,100	46.130000	281,393.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,186	96.330000	4,545,427.38	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,921	111.800000	6,363,767.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	66,410	71.600000	4,754,956.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,046	80.320000	485,614.72	
UNUM GROUP	17,370	32.160000	558,619.20	
URBAN OUTFITTERS INC	7,893	36.000000	284,148.00	
US BANCORP	120,371	40.140000	4,831,691.94	
VALERO ENERGY CORP	35,183	49.040000	1,725,374.32	
VANTIV INC - CL A	7,755	30.550000	236,915.25	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,036	81.800000	575,544.80	
VERISIGN INC	9,435	60.370000	569,590.95	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,003	63.570000	635,890.71	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	186,824	47.630000	8,898,427.12	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,331	79.770000	1,222,953.87	
VF CORP	23,672	57.770000	1,367,531.44	
VIACOM INC-CLASS B	27,753	81.410000	2,259,371.73	
VISA INC-CLASS A SHARES	33,587	221.250000	7,431,123.75	
VMWARE INC-CLASS A	5,523	94.940000	524,353.62	
VULCAN MATERIALS CO	8,464	59.570000	504,200.48	
WALGREEN CO	58,599	57.230000	3,353,620.77	
WAL-MART STORES INC	107,039	74.420000	7,965,842.38	
WALT DISNEY CO/THE	110,815	72.720000	8,058,466.80	
WASTE MANAGEMENT INC	28,896	41.640000	1,203,229.44	
WATERS CORP	5,508	103.020000	567,434.16	
WEATHERFORD INTL LTD	50,728	14.060000	713,235.68	
WELLPOINT INC	19,453	84.250000	1,638,915.25	
WELLS FARGO & CO	329,614	45.480000	14,990,844.72	
WESTERN DIGITAL CORP	13,822	85.000000	1,174,870.00	
WESTERN UNION CO	35,613	15.740000	560,548.62	
WHIRLPOOL CORP	5,224	145.680000	761,032.32	
WHITING PETROLEUM CORP	7,914	58.100000	459,803.40	
WHOLE FOODS MARKET INC	22,951	51.610000	1,184,501.11	
WILLIAMS COS INC	44,596	38.970000	1,737,906.12	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,957	43.690000	478,711.33	
WINDSTREAM HOLDINGS INC	38,133	7.560000	288,285.48	
WISCONSIN ENERGY CORP	14,669	41.430000	607,736.67	
WORKDAY INC-CLASS A	5,439	88.990000	484,016.61	
WR BERKLEY CORP	7,439	40.180000	298,899.02	
WW GRAINGER INC	3,881	241.850000	938,619.85	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	8,594	71.850000	617,478.90	

WYNN RESORTS LTD	5,250	193.140000	1,013,985.00	
XCEL ENERGY INC	32,805	28.060000	920,508.30	
XEROX CORP	77,459	11.240000	870,639.16	
XILINX INC	17,472	46.860000	818,737.92	
XL GROUP PLC	19,145	28.810000	551,567.45	
XYLEM INC	12,399	33.680000	417,598.32	
YAHOO! INC	63,175	37.910000	2,394,964.25	
YUM! BRANDS INC	29,096	68.820000	2,002,386.72	
ZIMMER HOLDINGS INC	11,024	93.360000	1,029,200.64	
ZOETIS INC	32,554	31.460000	1,024,148.84	
アメリカドル 小計	19,725,716		1,072,351,124.62 (109,722,967,071)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	11,200	34.170000	382,704.00	
AGRIUM INC	9,600	98.780000	948,288.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,000	79.130000	712,170.00	
ALTAGAS LTD	7,700	40.520000	312,004.00	
ARC RESOURCES LTD	20,300	28.560000	579,768.00	
ATCO LTD -CLASS I	5,000	48.060000	240,300.00	
ATHABASCA OIL CORP	19,900	7.790000	155,021.00	
BANK OF MONTREAL	42,100	72.000000	3,031,200.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,600	63.050000	4,955,730.00	
BARRICK GOLD CORP	76,000	21.050000	1,599,800.00	
BAYTEX ENERGY CORP	8,300	41.100000	341,130.00	
BCE INC	16,900	46.030000	777,907.00	
BELL ALIANT INC	4,800	26.290000	126,192.00	
BLACKBERRY LTD	29,600	10.940000	323,824.00	
BOMBARDIER INC-B	95,700	3.860000	369,402.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	36,400	41.670000	1,516,788.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	17,900	20.410000	365,339.00	
CAE INC	16,600	14.240000	236,384.00	
CAMECO CORP	25,500	24.230000	617,865.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,100	88.280000	2,304,108.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,800	57.930000	3,174,564.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	70,800	35.470000	2,511,276.00	
CANADIAN OIL SANDS LTD	32,000	20.450000	654,400.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,400	156.880000	1,788,432.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,000	97.310000	486,550.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,100	36.700000	297,270.00	
CATAMARAN CORP	13,600	54.830000	745,688.00	
CENOVUS ENERGY INC	49,100	29.180000	1,432,738.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	13,500	34.880000	470,880.00	
CI FINANCIAL CORP	9,900	34.520000	341,748.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	25,500	39.360000	1,003,680.00	
DOLLARAMA INC	4,400	84.470000	371,668.00	
ELDORADO GOLD CORP	45,400	7.330000	332,782.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	3,700	70.330000	260,221.00	
ENBRIDGE INC	51,100	46.620000	2,382,282.00	
ENCANA CORP	48,600	20.180000	980,748.00	
ENERPLUS CORP	12,800	20.020000	256,256.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	700	424.570000	297,199.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	11,600	26.420000	306,472.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,200	17.450000	90,740.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	36,900	19.820000	731,358.00	
FORTIS INC	14,400	30.310000	436,464.00	
FRANCO-NEVADA CORP	9,600	51.910000	498,336.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,600	57.440000	436,544.00	
GOLDCORP INC	52,900	26.600000	1,407,140.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	19,700	31.630000	623,111.00	
HUSKY ENERGY INC	22,700	32.920000	747,284.00	
IGM FINANCIAL INC	6,200	54.890000	340,318.00	
IMPERIAL OIL LTD	19,500	45.820000	893,490.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,400	45.100000	288,640.00	
INTACT FINANCIAL CORP	8,300	68.160000	565,728.00	
KEYERA CORP	5,200	65.850000	342,420.00	
KINROSS GOLD CORP	74,900	5.150000	385,735.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,100	42.980000	305,158.00	

MAGNA INTERNATIONAL INC	14,700	95.950000	1,410,465.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	119,700	20.860000	2,496,942.00	
MEG ENERGY CORP	9,800	30.640000	300,272.00	
METHANEX CORP	6,200	62.220000	385,764.00	
METRO INC	6,100	63.500000	387,350.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	10,700	86.750000	928,225.00	
NEW GOLD INC	32,000	6.390000	204,480.00	
ONEX CORPORATION	6,100	56.400000	344,040.00	
OPEN TEXT CORP	3,800	111.000000	421,800.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	19,900	17.230000	342,877.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	20,400	37.830000	771,732.00	
PENGROWTH ENERGY CORP	33,700	7.190000	242,303.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	31,700	8.140000	258,038.00	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,200	33.730000	310,316.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	56,500	35.190000	1,988,235.00	
POWER CORP OF CANADA	23,200	30.890000	716,648.00	
POWER FINANCIAL CORP	16,500	34.750000	573,375.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	23,400	46.980000	1,099,332.00	
ROYAL BANK OF CANADA	94,100	70.490000	6,633,109.00	
SAPUTO INC	8,300	52.130000	432,679.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,600	24.800000	610,080.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	13,200	58.590000	773,388.00	
SILVER WHEATON CORP	23,400	24.410000	571,194.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,900	46.870000	464,013.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	39,300	36.860000	1,448,598.00	
SUNCOR ENERGY INC	97,900	36.910000	3,613,489.00	
TALISMAN ENERGY INC	66,900	12.560000	840,264.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	37,400	26.610000	995,214.00	
TELUS CORP	14,700	36.720000	539,784.00	
THOMSON REUTERS CORP	24,600	40.150000	987,690.00	
TIM HORTONS INC	9,900	58.730000	581,427.00	
TORONTO-DOMINION BANK	60,200	98.110000	5,906,222.00	
TOURMALINE OIL CORP	10,400	48.200000	501,280.00	
TRANSALTA CORP	18,600	14.310000	266,166.00	
TRANSCANADA CORP	46,000	48.440000	2,228,240.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	53,900	3.980000	214,522.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	20,700	146.490000	3,032,343.00	
VERMILION ENERGY INC	6,100	62.400000	380,640.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,200	77.280000	247,296.00	
YAMANA GOLD INC	49,200	10.570000	520,044.00	
カナダドル 小計	2,501,900		91,053,120.00 (8,426,055,724)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	36,529	15.140000	553,049.06	
ALS LTD	25,270	8.370000	211,509.90	
ALUMINA LTD	162,182	1.270000	205,971.14	
AMCOR LIMITED	77,753	10.730000	834,289.69	
AMP LTD	195,181	4.330000	845,133.73	
ASCIANO LTD	65,879	5.660000	372,875.14	
ASX LTD	12,747	36.000000	458,892.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	136,156	5.020000	683,503.12	
AUST AND NZ BANKING GROUP	179,334	30.650000	5,496,587.10	
BANK OF QUEENSLAND LTD	21,092	11.590000	244,456.28	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	27,396	11.620000	318,341.52	
BHP BILLITON LTD	209,536	37.040000	7,761,213.44	
BORAL LTD	52,651	4.720000	248,512.72	
BRAMBLES LTD	103,670	9.130000	946,507.10	
CALTEX AUSTRALIA LTD	8,675	19.070000	165,432.25	
COCA-COLA AMATIL LTD	38,863	11.980000	465,578.74	
COCHLEAR LTD	3,807	57.850000	220,234.95	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	105,368	74.740000	7,875,204.32	
COMPUTERSHARE LTD	31,092	11.260000	350,095.92	
CROWN RESORTS LTD	26,528	17.210000	456,546.88	
CSL LTD	31,715	70.870000	2,247,642.05	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	54,900	2.410000	132,309.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	3,676	45.750000	168,177.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	100,180	5.230000	523,941.40	



HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,152	3.060000	116,745.12	
ILUKA RESOURCES LTD	28,227	8.650000	244,163.55	
INCITEC PIVOT LTD	111,370	2.890000	321,859.30	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	137,320	5.600000	768,992.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	28,040	13.180000	369,567.20	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,366	16.140000	183,447.24	
LEND LEASE GROUP	35,737	10.910000	389,890.67	
MACQUARIE GROUP LTD	18,746	55.880000	1,047,526.48	
METCASH LTD	63,500	3.040000	193,040.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	153,557	33.820000	5,193,297.74	
NEWCREST MINING LTD	50,432	9.480000	478,095.36	
ORICA LTD	24,526	23.540000	577,342.04	
ORIGIN ENERGY LTD	72,803	13.880000	1,010,505.64	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.100000	93,123.80	
QBE INSURANCE GROUP LTD	80,700	11.710000	944,997.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,579	43.710000	374,988.09	
REA GROUP LTD	3,643	40.890000	148,962.27	
RIO TINTO LTD	28,358	65.160000	1,847,807.28	
SANTOS LTD	64,264	13.850000	890,056.40	
SEEK LTD	21,548	12.730000	274,306.04	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,095	16.770000	420,843.15	
SP AUSNET	121,578	1.205000	146,501.49	
SUNCORP GROUP LTD	84,870	12.480000	1,059,177.60	
SYDNEY AIRPORT	70,758	3.880000	274,541.04	
TABCORP HOLDINGS LTD	50,868	3.440000	174,985.92	
TATTS GROUP LTD	95,827	2.970000	284,606.19	
TELSTRA CORP LTD	287,156	5.150000	1,478,853.40	
TOLL HOLDINGS LTD	46,993	5.510000	258,931.43	
TRANSURBAN GROUP	95,083	6.920000	657,974.36	
TREASURY WINE ESTATES LTD	42,551	4.550000	193,607.05	
WESFARMERS LTD	64,736	42.950000	2,780,411.20	
WESTPAC BANKING CORP	202,906	31.120000	6,314,434.72	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	42,831	38.130000	1,633,146.03	
WOOLWORTHS LTD	81,350	33.980000	2,764,273.00	
WORLEYPARSONS LTD	14,384	16.730000	240,644.32	
オーストラリアドル 小計	4,102,692		65,937,648.57 (5,867,791,346)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	62,110	3.801000	236,080.11	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	61,830	3.973000	245,650.59	
ADMIRAL GROUP PLC	12,358	14.270000	176,348.66	
AGGREKO PLC	18,054	16.250000	293,377.50	
AMEC PLC	19,660	10.230000	201,121.80	
ANGLO AMERICAN PLC	90,951	13.400000	1,218,743.40	
ANTOFAGASTA PLC	25,511	8.070000	205,873.77	
ARM HOLDINGS PLC	90,957	9.780000	889,559.46	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	23,252	27.440000	638,034.88	
ASTRAZENECA PLC	81,777	38.910000	3,181,943.07	
AVIVA PLC	191,678	4.566000	875,201.74	
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,940	14.020000	321,618.80	
BAE SYSTEMS PLC	212,127	4.300000	912,146.10	
BARCLAYS PLC	999,182	2.722500	2,720,272.99	
BG GROUP PLC	222,288	12.550000	2,789,714.40	
BHP BILLITON PLC	137,872	17.915000	2,469,976.88	
BP PLC	1,231,245	4.866500	5,991,853.79	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	124,252	30.735000	3,818,885.22	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	67,004	8.520000	570,874.08	
BT GROUP PLC	515,403	3.802000	1,959,562.20	
BUNZL PLC	21,710	14.190000	308,064.90	
BURBERRY GROUP PLC	28,691	14.770000	423,766.07	
CAPITA PLC	42,484	10.260000	435,885.84	
CARNIVAL PLC	12,256	24.860000	304,684.16	
CENTRICA PLC	335,605	3.218000	1,079,976.89	
COBHAM PLC	70,600	2.815000	198,739.00	
COCA-COLA HBC AG-CDI	12,986	16.960000	220,242.56	
COMPASS GROUP PLC	117,264	9.365000	1,098,177.36	
CRODA INTERNATIONAL PLC	9,143	24.000000	219,432.00	

DIAGEO PLC	163,901	19.465000	3,190,332.96	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	72,879	2.608000	190,068.43	
EASYJET PLC	10,550	16.250000	171,437.50	
EXPERIAN PLC	65,161	10.720000	698,525.92	
FRESNILLO PLC	11,735	7.920000	92,941.20	
G4S PLC	99,260	2.530000	251,127.80	
GKN PLC	107,602	3.876000	417,065.35	
GLAXOSMITHKLINE PLC	320,054	16.245000	5,199,277.23	
GLENCORE XSTRATA PLC	692,620	3.254000	2,253,785.48	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,277	15.090000	215,439.93	
HSBC HOLDINGS PLC	1,219,230	6.459000	7,875,006.57	
ICAP PLC	37,394	4.156000	155,409.46	
IMI PLC	20,756	14.960000	310,509.76	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	63,222	22.620000	1,430,081.64	
INMARSAT PLC	29,031	7.270000	211,055.37	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	16,879	20.260000	341,968.54	
INTERTEK GROUP PLC	10,616	29.120000	309,137.92	
INVENSYS PLC	42,674	5.095000	217,424.03	
INVESTEC PLC	37,941	4.021000	152,560.76	
ITV PLC	240,941	1.941000	467,666.48	
JOHNSON MATTHEY PLC	13,495	32.960000	444,795.20	
KINGFISHER PLC	153,245	3.737000	572,676.56	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	384,259	2.181000	838,068.87	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,266,430	0.813600	2,657,567.44	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,117	18.110000	201,328.87	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105,623	4.793000	506,251.03	
MEGGITT PLC	51,359	5.260000	270,148.34	
MELROSE INDUSTRIES PLC	80,976	3.148000	254,912.44	
NATIONAL GRID PLC	243,946	7.900000	1,927,173.40	
NEXT PLC	10,334	62.800000	648,975.20	
OLD MUTUAL PLC	323,931	1.834000	594,089.45	
PEARSON PLC	53,009	11.710000	620,735.39	
PERSIMMON PLC	20,293	12.640000	256,503.52	
PETROFAC LTD	16,832	11.690000	196,766.08	
PRUDENTIAL PLC	167,028	12.620000	2,107,893.36	
RANDGOLD RESOURCES LTD	5,703	42.330000	241,407.99	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,176	46.930000	1,979,319.68	
REED ELSEVIER PLC	77,134	9.040000	697,291.36	
RESOLUTION LTD	94,345	3.519000	332,000.05	
REXAM PLC	51,407	5.000000	257,035.00	
RIO TINTO PLC	83,005	31.430000	2,608,847.15	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	122,491	11.720000	1,435,594.52	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	140,629	3.397000	477,716.71	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	249,262	21.705000	5,410,231.71	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	164,443	22.720000	3,736,144.96	
RSA INSURANCE GROUP PLC	239,239	1.017000	243,306.06	
SABMILLER PLC	62,783	28.890000	1,813,800.87	
SAGE GROUP PLC/THE	73,867	4.195000	309,872.06	
SAINSBURY (J) PLC	78,617	3.621000	284,672.15	
SCHRODERS PLC	6,913	25.140000	173,792.82	
SERCO GROUP PLC	33,489	5.090000	170,459.01	
SEVERN TRENT PLC	15,367	16.780000	257,858.26	
SHIRE PLC	36,043	29.340000	1,057,501.62	
SMITH & NEPHEW PLC	57,972	8.830000	511,892.76	
SMITHS GROUP PLC	25,774	14.700000	378,877.80	
SSE PLC	62,858	13.150000	826,582.70	
STANDARD CHARTERED PLC	158,626	13.095000	2,077,207.47	
STANDARD LIFE PLC	156,238	3.738000	584,017.64	
TATE & LYLE PLC	31,127	7.655000	238,277.18	
TESCO PLC	527,564	3.266500	1,723,287.80	
TRAVIS PERKINS PLC	16,302	17.510000	285,448.02	
TUI TRAVEL PLC	29,430	4.124000	121,369.32	
TULLOW OIL PLC	59,900	8.600000	515,140.00	
UNILEVER PLC	83,710	24.650000	2,063,451.50	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,959	7.005000	314,937.79	
VODAFONE GROUP PLC	3,162,637	2.325500	7,354,712.34	
WEIR GROUP PLC/THE	14,237	20.900000	297,553.30	

WHITBREAD PLC	11,865	38.240000	453,717.60	
WILLIAM HILL PLC	57,552	3.369000	193,892.68	
WM MORRISON SUPERMARKETS	142,811	2.451000	350,029.76	
WOLSELEY PLC	17,556	33.310000	584,790.36	
WPP PLC	86,797	13.000000	1,128,361.00	
イギリスポンド 小計	19,364,618		111,744,914.70 (18,855,836,906)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	143,226	22.720000	3,254,094.72	
ACTELION LTD-REG	6,789	84.000000	570,276.00	
ADECCO SA-REG	8,682	72.300000	627,708.60	
ARYZTA AG	5,516	71.300000	393,290.80	
BALOISE HOLDING AG - REG	3,243	108.300000	351,216.90	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	142	1,059.000000	150,378.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	33,988	85.550000	2,907,673.40	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	98,797	27.920000	2,758,412.24	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	533	308.000000	164,164.00	
GEBERIT AG-REG	2,409	263.200000	634,048.80	
GIVAUDAN-REG	546	1,271.000000	693,966.00	
HOLCIM LTD-REG	14,977	66.800000	1,000,463.60	
JULIUS BAER GROUP LTD	14,743	44.870000	661,518.41	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,443	120.800000	415,914.40	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	55	4,114.000000	226,270.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	49,080.000000	343,560.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,372	92.700000	312,584.40	
NESTLE SA-REG	210,484	66.850000	14,070,855.40	
NOVARTIS AG-REG	150,162	71.500000	10,736,583.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,800	72.850000	131,130.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,159	221.800000	257,066.20	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	45,873	243.300000	11,160,900.90	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,374	136.200000	187,138.80	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,132	133.400000	417,808.80	
SGS SA-REG	362	2,077.000000	751,874.00	
SIKA AG-BR	143	2,996.000000	428,428.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,309	123.800000	409,654.20	
SULZER AG-REG	1,571	132.700000	208,471.70	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,991	544.000000	1,083,104.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,877	94.700000	272,451.90	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,140	188.400000	403,176.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,553	69.550000	247,111.15	
SWISS RE AG	22,884	78.750000	1,802,115.00	
SWISSCOM AG-REG	1,539	493.900000	760,112.10	
SYNGENTA AG-REG	6,040	334.700000	2,021,588.00	
TRANSOCEAN LTD	23,412	39.580000	926,646.96	
UBS AG-REG	238,070	17.940000	4,270,975.80	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,690	263.200000	2,550,408.00	
スイスフラン 小計	1,072,033		68,563,140.18 (7,840,880,710)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	784,200	37.000000	29,015,400.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,100	75.350000	1,288,485.00	
BANK OF EAST ASIA	86,020	30.400000	2,615,008.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	244,000	24.100000	5,880,400.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	79,000	16.540000	1,306,660.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	90,000	117.900000	10,611,000.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	40,000	47.150000	1,886,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	117,500	60.000000	7,050,000.00	
FIRST PACIFIC CO	156,000	8.080000	1,260,480.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	136,000	73.550000	10,002,800.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	146,000	23.300000	3,401,800.00	
HANG SENG BANK LTD	49,100	122.500000	6,014,750.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	70,800	43.800000	3,101,040.00	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	137,000	7.800000	1,068,600.00	
HONG KONG & CHINA GAS	380,230	16.500000	6,273,795.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	72,500	125.100000	9,069,750.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	38,000	26.050000	989,900.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	138,000	101.900000	14,062,200.00	

HYSAN DEVELOPMENT CO	42,000	32.350000	1,358,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	42,000	25.100000	1,054,200.00	
LI & FUNG LTD	392,000	10.980000	4,304,160.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	60,800	31.550000	1,918,240.00	
MTR CORP	96,500	28.000000	2,702,000.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	241,000	10.120000	2,438,920.00	
NWS HOLDINGS LTD	90,500	11.380000	1,029,890.00	
PCCW LTD	247,000	3.490000	862,030.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,000	62.400000	5,678,400.00	
SANDS CHINA LTD	157,200	59.750000	9,392,700.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	13.220000	1,374,880.00	
SINO LAND CO	199,400	10.720000	2,137,568.00	
SJM HOLDINGS LTD	126,000	24.350000	3,068,100.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	96.850000	9,975,550.00	
SWIRE PACIFIC LTD-A	42,500	86.150000	3,661,375.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	76,200	20.750000	1,581,150.00	
WHARF HOLDINGS LTD	100,000	55.250000	5,525,000.00	
WHELOCK & CO LTD	60,000	32.400000	1,944,000.00	
WYNN MACAU LTD	102,400	33.750000	3,456,000.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	49,500	24.250000	1,200,375.00	
香港ドル 小計	5,204,450		179,561,306.00 (2,366,618,013)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	171,000	2.830000	483,930.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	84,000	1.835000	154,140.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	27,000	9.300000	251,100.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	138,000	1.925000	265,650.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	112,000	16.670000	1,867,040.00	
GENTING SINGAPORE PLC	410,000	1.430000	586,300.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	202,000	2.890000	583,780.00	
GOLDEN AGR I-RESOURCES LTD	479,360	0.515000	246,870.40	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	7,000	37.510000	262,570.00	
KEPPEL CORP LTD	97,000	10.680000	1,035,960.00	
KEPPEL LAND LTD	51,000	3.280000	167,280.00	
NOBLE GROUP LTD	296,090	0.955000	282,765.95	
OLAM INTERNATIONAL LTD	103,000	1.465000	150,895.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	169,000	9.500000	1,605,500.00	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	66,000	5.300000	349,800.00	
SEBACORP MARINE LTD	57,000	4.180000	238,260.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	39,340	9.830000	386,712.20	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,000	6.950000	403,100.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	111,250	3.980000	442,775.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	98,000	3.820000	374,360.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	518,260	3.520000	1,824,275.20	
STARHUB LTD	42,000	4.250000	178,500.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	84,000	20.190000	1,695,960.00	
UOL GROUP LTD	29,000	5.960000	172,840.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	131,000	3.200000	419,200.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	127,000	1.190000	151,130.00	
シンガポールドル 小計	3,707,300		14,580,693.75 (1,167,767,762)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	73,285	3.630000	266,024.55	
CONTACT ENERGY LTD	26,093	5.070000	132,291.51	
FLETCHER BUILDING LTD	43,776	8.880000	388,730.88	
RYMAN HEALTHCARE LTD	23,964	8.050000	192,910.20	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	122,309	2.365000	289,260.78	
ニュージーランドドル 小計	289,427		1,269,217.92 (106,880,841)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	20,633	156.600000	3,231,127.80	
ASSA ABLOY AB-B	21,672	331.600000	7,186,435.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	43,821	175.800000	7,703,731.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	25,519	163.900000	4,182,564.10	
BOLIDEN AB	17,138	100.500000	1,722,369.00	
ELECTROLUX AB-SER B	15,839	155.400000	2,461,380.60	
ELEKTA AB-B SHS	23,355	96.100000	2,244,415.50	
ERICSSON LM-B SHS	198,051	75.050000	14,863,727.55	

GETINGE AB-B SHS	13,332	226.000000	3,013,032.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	62,000	287.000000	17,794,000.00	
HEXAGON AB-B SHS	15,301	208.000000	3,182,608.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	25,418	39.740000	1,010,111.32	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,122	119.900000	973,827.80	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	14,306	257.300000	3,680,933.80	
INVESTOR AB-B SHS	29,159	213.500000	6,225,446.50	
LUNDIN PETROLEUM AB	15,205	118.800000	1,806,354.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,348	670.500000	2,915,334.00	
NORDEA BANK AB	199,354	90.200000	17,981,730.80	
SANDVIK AB	69,274	90.850000	6,293,542.90	
SCANIA AB-B SHS	20,957	125.700000	2,634,294.90	
SECURITAS AB-B SHS	21,223	69.400000	1,472,876.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	100,149	84.850000	8,497,642.65	
SKANSKA AB-B SHS	24,988	129.400000	3,233,447.20	
SKF AB-B SHARES	25,938	169.800000	4,404,272.40	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	37,882	192.800000	7,303,649.60	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	32,619	317.700000	10,363,056.30	
SWEDBANK AB - A SHARES	59,688	178.700000	10,666,245.60	
SWEDISH MATCH AB	13,129	197.500000	2,592,977.50	
TELE2 AB-B SHS	21,699	73.650000	1,598,131.35	
TELIASONERA AB	153,537	51.450000	7,899,478.65	
VOLVO AB-B SHS	98,926	87.750000	8,680,756.50	
スウェーデンクローネ 小計	1,432,582		177,819,501.52 (2,829,108,269)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	10,763	97.750000	1,052,083.25	
DNB ASA	64,793	109.500000	7,094,833.50	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,749	118.500000	1,510,756.50	
NORSK HYDRO ASA	85,835	29.970000	2,572,474.95	
ORKLA ASA	50,142	49.960000	2,505,094.32	
SEADRILL LTD	24,204	231.800000	5,610,487.20	
STATOIL ASA	72,666	149.000000	10,827,234.00	
SUBSEA 7 SA	17,214	114.600000	1,972,724.40	
TELENOR ASA	44,141	140.900000	6,219,466.90	
YARA INTERNATIONAL ASA	12,065	264.900000	3,196,018.50	
ノルウェークローネ 小計	394,572		42,561,173.52 (710,345,986)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	36	61,700.000000	2,221,200.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	86	64,450.000000	5,542,700.00	
CARLSBERG AS-B	7,096	575.000000	4,080,200.00	
COLOPLAST-B	7,394	378.000000	2,794,932.00	
DANSKE BANK A/S	43,525	127.700000	5,558,142.50	
DSV A/S	12,046	176.200000	2,122,505.20	
NOVO NORDISK A/S-B	129,950	210.100000	27,302,495.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,793	231.200000	3,420,141.60	
TDC A/S	53,073	50.550000	2,682,840.15	
TRYG A/S	1,510	498.000000	751,980.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,667	517.500000	862,672.50	
デンマーククローネ 小計	271,176		57,339,808.95 (1,075,694,815)	
イスラエルシェケル				
BANK HAPOLIM BM	69,870	18.150000	1,268,140.50	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	84,500	13.250000	1,119,625.00	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	128,223	5.450000	698,815.35	
DELEK GROUP LTD	260	1,289.000000	335,140.00	
ISRAEL CHEMICALS LTD	30,068	29.670000	892,117.56	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	171	1,843.000000	315,153.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,008	42.620000	341,300.96	
NICE SYSTEMS LTD	4,012	140.500000	563,686.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	55,088	149.500000	8,235,656.00	
イスラエルシェケル 小計	380,200		13,769,634.37 (403,312,590)	
ユーロ				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	26,578	16.375000	435,214.75	
ACCOR SA	10,439	34.950000	364,843.05	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,589	26.400000	253,149.60	

ADIDAS AG	13,609	86.120000	1,172,007.08
ADP	2,054	82.790000	170,050.66
AEGON NV	116,638	6.534000	762,112.69
AGEAS	14,872	31.605000	470,029.56
AIR LIQUIDE SA	20,309	95.020000	1,929,761.18
AIRBUS GROUP NV	38,518	52.780000	2,032,980.04
AKZO NOBEL	15,557	54.080000	841,322.56
ALCATEL-LUCENT	184,017	2.860000	526,288.62
ALLIANZ SE-REG	29,791	124.750000	3,716,427.25
ALSTOM	14,449	21.605000	312,170.64
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	25,365	29.835000	756,764.77
ANDRITZ AG	4,898	42.510000	208,213.98
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	52,513	72.300000	3,796,689.90
ARCELORMITTAL	65,100	12.055000	784,780.50
ARKEMA	4,154	75.800000	314,873.20
ASML HOLDING NV	23,264	64.390000	1,497,968.96
ASSICURAZIONI GENERALI	76,189	16.340000	1,244,928.26
ATLANTIA SPA	23,369	17.010000	397,506.69
ATOS	4,525	65.890000	298,152.25
AXA SA	117,180	18.730000	2,194,781.40
AXEL SPRINGER SE	2,446	46.655000	114,118.13
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	420,472	0.179700	75,558.81
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	380,085	8.850000	3,363,752.25
BANCO DE SABADELL SA	226,174	2.122000	479,941.22
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	117,388	1.153000	135,348.36
BANCO POPULAR ESPANOL	92,811	4.969000	461,177.85
BANCO SANTANDER SA	758,304	6.337000	4,805,372.44
BANK OF IRELAND	1,400,612	0.286000	400,575.03
BASF SE	59,972	77.810000	4,666,421.32
BAYER AG-REG	54,007	99.120000	5,353,173.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,680	81.970000	1,777,109.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,344	61.370000	205,221.28
BEIERSDORF AG	6,611	75.490000	499,064.39
BELGACOM SA	9,751	21.530000	209,939.03
BNP PARIBAS	65,154	56.670000	3,692,277.18
BOSKALIS WESTMINSTER	5,085	35.515000	180,593.77
BOUYGUES SA	12,536	28.605000	358,592.28
BRENNTAG AG	3,318	126.850000	420,888.30
BUREAU VERITAS SA	14,020	20.245000	283,834.90
CAIXABANK S.A	115,454	4.210000	486,061.34
CAP GEMINI	9,243	51.080000	472,132.44
CARREFOUR SA	40,165	25.015000	1,004,727.47
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,686	78.880000	290,751.68
CELESIO AG	5,450	24.905000	135,732.25
CGG	10,495	11.790000	123,736.05
CHRISTIAN DIOR	3,526	130.900000	461,553.40
CNH INDUSTRIAL NV	62,370	8.180000	510,186.60
CNP ASSURANCES	11,530	14.575000	168,049.75
COLRUYT SA	4,772	40.040000	191,070.88
COMMERZBANK AG	63,795	13.045000	832,205.77
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	26,993	39.090000	1,055,156.37
CONTINENTAL AG	7,142	159.300000	1,137,720.60
CREDIT AGRICOLE SA	65,496	10.000000	654,960.00
CRH PLC	49,138	19.190000	942,958.22
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	62,861	62.830000	3,949,556.63
DANONE	37,045	50.810000	1,882,256.45
DASSAULT SYSTEMES SA	4,096	86.700000	355,123.20
DELHAIZE GROUP	6,567	48.445000	318,138.31
DELTA LLOYD NV	12,125	18.415000	223,281.87
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	66,600	36.795000	2,450,547.00
DEUTSCHE BOERSE AG	12,666	57.020000	722,215.32
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,096	17.450000	263,425.20
DEUTSCHE POST AG-REG	59,206	25.305000	1,498,207.83
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	188,735	12.590000	2,376,173.65
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	19,441	14.080000	273,729.28
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	42,896	6.193000	265,654.92
E.ON SE	117,740	13.590000	1,600,086.60

EDENRED	13,304	22.225000	295,681.40
EDF	15,504	25.340000	392,871.36
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	132,083	2.766000	365,341.57
ELISA OYJ	9,600	18.950000	181,920.00
ENAGAS SA	13,318	20.000000	266,360.00
ENEL GREEN POWER SPA	117,337	1.876000	220,124.21
ENEL SPA	430,121	3.380000	1,453,808.98
ENI SPA	166,247	16.910000	2,811,236.77
ERSTE GROUP BANK AG	17,090	27.940000	477,494.60
ESSILOR INTERNATIONAL	13,309	77.610000	1,032,911.49
EURAZEO	2,020	53.290000	107,645.80
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,694	22.315000	216,321.61
EXOR SPA	6,408	29.540000	189,292.32
FERROVIAL SA	27,948	14.255000	398,398.74
FIAT SPA	58,619	7.360000	431,435.84
FINMECCANICA SPA	26,710	6.370000	170,142.70
FORTUM OYJ	29,290	16.420000	480,941.80
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	2,504	54.730000	137,043.92
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,973	53.540000	748,114.42
FRESENIUS SE & CO KGAA	8,176	116.450000	952,095.20
FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,290	68.740000	157,414.60
FUGRO NV-CVA	4,623	40.405000	186,792.31
GALP ENERGIA SGPS SA	23,338	11.815000	275,738.47
GAS NATURAL SDG SA	23,899	18.175000	434,364.32
GDF SUEZ	86,778	16.575000	1,438,345.35
GEA GROUP AG	11,726	35.285000	413,751.91
GEMALTO	5,161	86.490000	446,374.89
GRIFOLS SA	9,902	37.800000	374,295.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,177	67.440000	349,136.88
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	35,571	8.127000	289,085.51
HANNOVER RUECK SE	4,062	59.790000	242,866.98
HEIDELBERGCEMENT AG	9,255	57.360000	530,866.80
HEINEKEN HOLDING NV	6,576	44.900000	295,262.40
HEINEKEN NV	14,947	47.410000	708,637.27
HENKEL AG & CO KGAA	8,348	74.770000	624,179.96
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,593	82.530000	956,770.29
HOCHTIEF AG	2,051	60.110000	123,285.61
HUGO BOSS AG -ORD	2,055	95.220000	195,677.10
IBERDROLA SA	308,266	4.540000	1,399,527.64
ILIAD SA	1,679	172.600000	289,795.40
IMERYS SA	2,208	61.220000	135,173.76
IMMOFINANZ AG	63,562	3.508000	222,975.49
INDITEX	14,325	113.150000	1,620,873.75
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,385	7.378000	526,678.53
ING GROEP NV-CVA	250,948	9.933000	2,492,666.48
INTESA SANPAOLO	761,634	1.931000	1,470,715.25
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	65,640	4.896000	321,373.44
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JC DECAUX SA	4,629	30.720000	142,202.88
JERONIMO MARTINS	16,839	12.990000	218,738.61
K+S AG-REG	11,120	23.085000	256,705.20
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,411	96.300000	135,879.30
KBC GROEP NV	16,376	43.625000	714,403.00
KERING	4,993	149.000000	743,957.00
KERRY GROUP PLC-A	10,090	51.200000	516,608.00
KONE OYJ-B	20,577	32.870000	676,365.99
KONINKLIJKE AHOLD NV	65,362	12.630000	825,522.06
KONINKLIJKE DSM NV	10,082	48.755000	491,547.91
KONINKLIJKE KPN NV	210,490	2.697000	567,691.53
KONINKLIJKE PHILIPS NV	63,724	26.495000	1,688,367.38
LAFARGE SA	12,167	53.060000	645,581.02
LAGARDERE SCA	7,532	25.435000	191,576.42
LANXESS AG	5,416	45.020000	243,828.32
LEGRAND SA	17,082	39.605000	676,532.61
LINDE AG	12,107	146.550000	1,774,280.85
L'OREAL	15,788	124.900000	1,971,921.20
LUXOTTICA GROUP SPA	10,899	38.060000	414,815.94

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	16,564	124.200000	2,057,248.80
MAN SE	2,214	90.100000	199,481.40
MAPFRE SA	77,747	3.100000	241,015.70
MEDIOBANCA SPA	34,626	6.660000	230,609.16
MERCK KGAA	4,252	132.750000	564,453.00
METRO AG	8,427	32.415000	273,161.20
METSO OYJ	8,749	23.850000	208,663.65
MICHELIN (CGDE)	12,333	77.620000	957,287.46
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,709	151.150000	1,769,815.35
NATIXIS	59,551	4.462000	265,716.56
NESTE OIL OYJ	7,848	13.480000	105,791.04
NOKIA OYJ	244,226	5.065000	1,237,004.69
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,200	32.810000	236,232.00
OCI NV	5,821	33.800000	196,749.80
OMV AG	9,669	33.300000	321,977.70
ORANGE	120,334	9.178000	1,104,425.45
ORION OYJ-CLASS B	6,413	19.960000	128,003.48
OSRAM LICHT AG	5,496	45.085000	247,787.16
PERNOD RICARD SA	13,795	84.500000	1,165,677.50
PIRELLI & C.	15,660	12.240000	191,678.40
POHJOLA BANK PLC-A SHS	9,601	14.690000	141,038.69
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,097	75.920000	766,564.24
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	43,100	3.376000	145,505.60
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	12,172	33.130000	403,258.36
PRYSMIAN SPA	12,993	18.120000	235,433.16
PUBLICIS GROUPE	11,722	64.810000	759,702.82
QIAGEN N.V.	15,302	17.270000	264,265.54
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,565	30.700000	232,245.50
RANDSTAD HOLDING NV	7,935	46.280000	367,231.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,307	53.020000	387,417.14
REED ELSEVIER NV	44,878	15.415000	691,794.37
REMY COINTREAU	1,678	57.870000	97,105.86
RENAULT SA	12,522	63.780000	798,653.16
REPSOL SA	56,545	17.680000	999,715.60
REXEL SA	13,893	19.395000	269,454.73
RTL GROUP	2,438	88.470000	215,689.86
RWE AG	31,852	27.150000	864,781.80
SAFRAN SA	17,600	52.250000	919,600.00
SAIPEM SPA	17,577	16.770000	294,766.29
SAMPO OYJ-A SHS	27,186	34.580000	940,091.88
SANOFI	77,994	72.030000	5,617,907.82
SAP AG	60,138	56.780000	3,414,635.64
SCHNEIDER ELECTRIC SA	34,736	60.710000	2,108,822.56
SCOR SE	9,941	23.975000	238,335.47
SES	19,591	24.050000	471,163.55
SIEMENS AG-REG	51,781	96.330000	4,988,063.73
SKY DEUTSCHLAND AG	28,206	7.100000	200,262.60
SNAM SPA	131,733	4.072000	536,416.77
SOCIETE BIC SA	1,910	88.260000	168,576.60
SOCIETE GENERALE SA	47,011	42.800000	2,012,070.80
SODEXO	6,189	76.180000	471,478.02
SOLVAY SA	3,828	102.450000	392,178.60
STMICROELECTRONICS NV	41,164	5.633000	231,876.81
STORA ENSO OYJ-R SHS	36,148	7.130000	257,735.24
SUEDZUCKER AG	5,479	19.450000	106,566.55
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	17,836	13.560000	241,856.16
TECHNIP SA	6,572	64.820000	425,997.04
TELECOM ITALIA SPA	673,517	0.795000	535,446.01
TELECOM ITALIA-RSP	390,175	0.625000	243,859.37
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18,090	6.025000	108,992.25
TELEFONICA SA	268,175	11.550000	3,097,421.25
TELEKOM AUSTRIA AG	15,491	6.429000	99,591.63
TELENET GROUP HOLDING NV	3,389	43.645000	147,912.90
TENARIS SA	30,543	16.280000	497,240.04
TERNA SPA	99,733	3.586000	357,642.53
THALES SA	5,867	47.620000	279,386.54
THYSSENKRUPP AG	29,945	18.560000	555,779.20



TNT EXPRESS NV	24,263	6.593000	159,965.95	
TOTAL SA	139,760	42.880000	5,992,908.80	
UBI BANCA SCPA	55,162	5.350000	295,116.70	
UCB SA	7,117	52.580000	374,211.86	
UMICORE	7,607	31.545000	239,962.81	
UNICREDIT SPA	283,905	5.580000	1,584,189.90	
UNILEVER NV-CVA	106,553	28.980000	3,087,905.94	
UNIPOLSAI SPA	58,700	2.222000	130,431.40	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,028	31.775000	223,314.70	
UPM-KYMMENE OYJ	33,988	12.690000	431,307.72	
VALEO SA	4,925	81.410000	400,944.25	
VALLOUREC	7,200	38.020000	273,744.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,921	12.000000	287,052.00	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	2,427	37.240000	90,381.48	
VINCI SA	31,252	47.775000	1,493,064.30	
VIVENDI	78,480	19.370000	1,520,157.60	
VOESTALPINE AG	7,369	33.580000	247,451.02	
VOLKSWAGEN AG	1,920	185.000000	355,200.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	9,460	193.300000	1,828,618.00	
VOPAK	4,554	41.935000	190,971.99	
WARTSILA OYJ ABP	11,676	40.090000	468,090.84	
WENDEL	2,167	102.100000	221,250.70	
WOLTERS KLUWER	20,147	21.025000	423,590.67	
ZARDOYA OTIS SA	11,709	13.250000	155,144.25	
ZIGGO NV	9,590	33.250000	318,867.50	
ZODIAC AEROSPACE	2,245	127.600000	286,462.00	
ユーロ小計	13,260,166		187,742,328.55 (26,282,048,573)	
合計	71,706,832		185,655,308,606 (185,655,308,606)	

(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		口数	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,488.00	530,405.28	
	AMERICAN TOWER CORP	25,723.00	2,048,065.26	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	61,394.00	647,092.76	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,083.00	966,080.16	
	BOSTON PROPERTIES INC	10,044.00	1,053,515.16	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,741.00	344,689.64	
	COLE REAL ESTATE INVESTMENT	29,681.00	452,932.06	
	CROWN CASTLE INTL CORP	21,389.00	1,526,532.93	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,616.00	451,047.60	
	DUKE REALTY CORP	21,840.00	324,105.60	
	EQUITY RESIDENTIAL	22,163.00	1,190,153.10	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,281.00	458,409.48	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	31,282.00	613,440.02	
	HCP INC	29,518.00	1,139,394.80	
	HEALTH CARE REIT INC	18,874.00	1,055,434.08	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	49,307.00	926,478.53	
	KIMCO REALTY CORP	26,217.00	542,429.73	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,407.00	335,359.55	
	MACERICH CO/THE	9,284.00	530,116.40	
	PLUM CREEK TIMBER CO	11,446.00	490,804.48	
	PROLOGIS INC	32,363.00	1,189,016.62	
	PUBLIC STORAGE	9,480.00	1,444,941.60	
	RAYONIER INC	8,183.00	336,975.94	
	REALTY INCOME CORP	12,577.00	497,294.58	
	REGENCY CENTERS CORP	6,297.00	301,122.54	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,250.00	3,102,097.50	
	SL GREEN REALTY CORP	6,012.00	553,344.48	
	UDR INC	16,328.00	387,300.16	
	VENTAS INC	19,015.00	1,167,330.85	

	VORNADO REALTY TRUST	11,084.00	1,000,220.16	
	WEYERHAEUSER CO	37,775.00	1,140,427.25	
	投資証券 小計	609,142.00	26,746,558.30 (2,736,707,845)	
アメリカドル 小計		609,142.00	26,746,558.30 (2,736,707,845)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	9,100.00	191,282.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,400.00	230,394.00	
	投資証券 小計	18,500.00	421,676.00 (39,021,897)	
カナダドル 小計		18,500.00	421,676.00 (39,021,897)	
オーストラリアドル				
投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	145,918.00	286,728.87	
	DEXUS PROPERTY GROUP	302,384.00	308,431.68	
	FEDERATION CENTRES	98,514.00	227,567.34	
	GOODMAN GROUP	109,943.00	523,328.68	
	GPT GROUP	117,555.00	419,671.35	
	MIRVAC GROUP	241,789.00	411,041.30	
	STOCKLAND	151,874.00	561,933.80	
	WESTFIELD GROUP	135,637.00	1,352,300.89	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	190,496.00	575,297.92	
	投資証券 小計	1,494,110.00	4,666,301.83 (415,254,199)	
オーストラリアドル 小計		1,494,110.00	4,666,301.83 (415,254,199)	
イギリスポンド				
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	60,792.00	403,962.84	
	HAMMERSON PLC	44,858.00	234,158.76	
	INTU PROPERTIES PLC	44,849.00	139,525.23	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	51,306.00	538,713.00	
	SEGRO PLC	48,904.00	167,300.58	
	投資証券 小計	250,709.00	1,483,660.41 (250,352,857)	
イギリスポンド 小計		250,709.00	1,483,660.41 (250,352,857)	
香港ドル				
投資証券	LINK REIT	151,000.00	5,360,500.00	
	投資証券 小計	151,000.00	5,360,500.00 (70,651,390)	
香港ドル 小計		151,000.00	5,360,500.00 (70,651,390)	
シンガポールドル				
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	141,000.00	297,510.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	131,000.00	188,640.00	
	CAPITAMALL TRUST	165,000.00	311,850.00	
	投資証券 小計	437,000.00	798,000.00 (63,911,820)	
シンガポールドル 小計		437,000.00	798,000.00 (63,911,820)	
ユーロ				
投資証券	CORIO NV	4,759.00	156,523.51	
	FONCIERE DES REGIONS	1,900.00	117,667.00	
	GECINA SA	1,424.00	131,720.00	
	ICADE	2,293.00	149,480.67	
	KLEPIERRE	6,679.00	218,269.72	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,321.00	1,129,562.70	
	投資証券 小計	23,376.00	1,903,223.60 (266,432,271)	
ユーロ 小計		23,376.00	1,903,223.60 (266,432,271)	
合 計			3,842,332,279 (3,842,332,279)	

(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 579銘柄	97.57%		57.90%
	投資証券 31銘柄		2.43%	1.44%
カナダドル	株式 94銘柄	99.54%		4.45%
	投資証券 2銘柄		0.46%	0.02%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	93.39%		3.10%
	投資証券 9銘柄		6.61%	0.22%
イギリスポンド	株式 101銘柄	98.69%		9.95%
	投資証券 5銘柄		1.31%	0.13%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.00%		4.14%
香港ドル	株式 38銘柄	97.10%		1.25%
	投資証券 1銘柄		2.90%	0.04%
シンガポールドル	株式 26銘柄	94.81%		0.62%
	投資証券 3銘柄		5.19%	0.03%
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%		1.49%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%		0.37%
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 9銘柄	100.00%		0.21%
ユーロ	株式 230銘柄	99.00%		13.87%
	投資証券 6銘柄		1.00%	0.14%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。

「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25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	580,333,506	599,151,657
コール・ローン	89,313,714	92,551,064
株式	20,628,179,002	20,625,310,179
投資証券		72,923,032
派生商品評価勘定	5,647,501	36,000
未収入金		3,589,626
未収配当金	16,499,069	10,602,286
未収利息	234	154
差入委託証拠金	47,452,672	113,208,286
流動資産合計	21,367,425,698	21,517,372,284
資産合計	21,367,425,698	21,517,372,284
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,486,449	40,327,151
未払金	7,232	41,141,500
未払解約金	67,882,882	26,963,521
流動負債合計	71,376,563	108,432,172
負債合計	71,376,563	108,432,172
純資産の部		
元本等		
元本	1 11,906,677,405	11,728,135,634
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	9,389,371,730	9,680,804,478
元本等合計	21,296,049,135	21,408,940,112
純資産合計	21,296,049,135	21,408,940,112
負債純資産合計	21,367,425,698	21,517,372,284

(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	株式は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、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は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、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は個別法に基づき、金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は個別法に基づき、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。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成25年1月28日現在 ]	[ 平成26年1月27日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成24年1月27日 9,361,956,272円	平成25年1月29日 11,906,677,405円
期首からの追加設定元本額	3,515,599,009円	2,377,060,863円
期首からの一部解約元本額	970,877,876円	2,555,602,634円
元本の内訳*		
F Pバランスファンド(安定型)	5,784,651円	5,934,172円
F Pバランスファンド(安定成長型)	31,068,433円	25,212,234円
e M A X I S 新興国株式インデックス	9,665,560,377円	8,836,170,340円
e M A X I S バランス(8資産均等型)	60,856,926円	205,901,684円
e M A X I S バランス(波乗り型)	62,298,418円	58,401,720円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	264,392円	6,233,482円
コアバランス		132,494円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	1,173,326,842円	1,505,801,732円
新興国株式インデックスオープン	99,900,371円	142,122,041円
e M A X I S 全世界株式インデックス	130,663,297円	159,487,723円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)		5,614,970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)	5,684,274円	23,339,763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）	671,269,424円	753,783,279円
（合計）	11,906,677,405円	11,728,135,634円
2 受益権の総数	11,906,677,405口	11,728,135,634口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7886円 （17,886円）	1.8254円 （18,254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24年1月27日 至平成25年1月28日）	（自平成25年1月29日 至平成26年1月27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、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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 同左 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25年1月28日現在]	[平成26年1月27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ぬ。	同左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、（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。 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25年1月28日現在]	[平成26年1月27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	1,855,060,107	506,411,759
投資証券		11,797,706
合計	1,855,060,107	518,209,465

（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25年1月28日現在]		
		契約額等(円)		評価損益(円)
		うち1年超	時価(円)	
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

区分	種類	[平成26年1月27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	757,911,866		717,744,615	40,167,251
	合計	757,911,866		717,744,615	40,167,251

(注)時価の算定方法

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

通貨関連

[平成25年1月28日現在]

該当事項はありません。

区分	種類	[平成26年1月27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 買建 香港ドル 韓国ウォン	13,339,900 18,884,000		13,180,000 18,920,000	159,900 36,000
	合計	32,223,900		32,100,000	123,900

(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。

(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	AMBEV SA-ADR	7,000	6.720000	47,040.00	
	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	2,000	21.180000	42,360.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	2,918	10.910000	31,835.38	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	10,800	13.310000	143,748.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	56,698	4.400000	249,471.20	
	CREDICORP LTD	3,880	135.380000	525,274.40	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	1,400	34.040000	47,656.00	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	336,000	8.500000	2,856,000.00	
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	40,000	3.315000	132,600.00	
	HON HAI PRECISION-GDR REG S	10,202	5.550000	56,621.10	
	INFOSYS LTD-SP ADR	900	59.530000	53,577.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	59,000	1.634000	96,406.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	3,299	12.070000	39,818.93	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	29,100	56.500000	1,644,150.00	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	15,000	53.750000	806,250.00	
	MEGAFON-REG S GDR	5,500	30.150000	165,825.00	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	32,000	15.910000	509,120.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	29,000	18.550000	537,950.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,300	130.000000	689,000.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	2,000	11.760000	23,520.00	
	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	2,300	27.260000	62,698.00	

ROSNEFT OJSC-REG S GDR	69,500	7.150000	496,925.00	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	11,000	19.310000	212,410.00	
RUSHYDRO JSC-ADR	75,000	1.597000	119,775.00	
SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	80	599.000000	47,920.00	
SASOL LTD-SPONSORED ADR	1,000	49.200000	49,200.00	
SBERBANK-SPONSORED ADR	164,500	11.380000	1,872,010.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	13,000	8.660000	112,580.00	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	7,300	27.120000	197,976.00	
SOUTHERN COPPER CORP	9,107	27.920000	254,267.44	
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	78,500	8.160000	640,560.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	3,614	17.570000	63,497.98	
TATNEFT-SPONSORED ADR	13,766	34.440000	474,101.04	
URALKALI-SPON GDR-REG S	15,800	26.150000	413,170.00	
VALE SA-SP ADR	4,000	12.900000	51,600.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S	153,000	2.664000	407,592.00	
アメリカドル 小計	1,273,464		14,174,505.47 (1,450,335,399)	
香港ドル				
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	38,500	35.450000	1,364,825.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	76,000	7.300000	554,800.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,226,000	3.390000	4,156,140.00	
AIR CHINA LTD-H	116,000	5.130000	595,080.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	2.920000	613,200.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	69,000	31.050000	2,142,450.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	48,000	11.140000	534,720.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	120,000	4.520000	542,400.00	
BANK OF CHINA LTD-H	4,245,000	3.310000	14,050,950.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	491,900	5.090000	2,503,771.00	
BBMG CORPORATION-H	56,000	6.300000	352,800.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	100,000	6.020000	602,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	30,000	65.400000	1,962,000.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	180,000	4.460000	802,800.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	267,000	9.000000	2,403,000.00	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	10,000	67.300000	673,000.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	168,000	12.140000	2,039,520.00	
BYD CO LTD-H	30,500	35.700000	1,088,850.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	134,000	3.500000	469,000.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	100,000	4.520000	452,000.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	456,000	3.810000	1,737,360.00	
CHINA COAL ENERGY CO-H	218,000	4.010000	874,180.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	239,000	5.670000	1,355,130.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	130,000	4.280000	556,400.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,064,550	5.400000	21,948,570.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	124,000	3.410000	422,840.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	158,000	10.020000	1,583,160.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	54,000	10.860000	586,440.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	110,000	10.960000	1,205,600.00	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	27,300	19.220000	524,706.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	421,000	22.450000	9,451,450.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	154,000	9.770000	1,504,580.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	77,000	36.550000	2,814,350.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	262,550	13.740000	3,607,437.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	62,000	27.450000	1,701,900.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	292,000	7.480000	2,184,160.00	
CHINA MOBILE LTD	340,000	76.150000	25,891,000.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	166,000	7.770000	1,289,820.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	104,000	23.500000	2,444,000.00	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	36,000	6.500000	234,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	232,000	21.650000	5,022,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	150,000	28.050000	4,207,500.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,442,000	6.290000	9,070,180.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	120,000	6.750000	810,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	3.630000	834,900.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	110,000	5.590000	614,900.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	64,000	23.500000	1,504,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	50,000	25.400000	1,270,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	116,000	18.920000	2,194,720.00	

CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	112,000	19.340000	2,166,080.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	192,000	21.250000	4,080,000.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	241,000	1.890000	455,490.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	100,000	14.040000	1,404,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	44,000	14.120000	621,280.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	792,000	3.680000	2,914,560.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	260,000	10.320000	2,683,200.00	
CHINA VANKE CO LTD -B	72,951	13.130000	957,846.63	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	47,000	14.100000	662,700.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	152,000	3.310000	503,120.00	
CITIC PACIFIC LTD	80,000	9.850000	788,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,000	18.640000	1,192,960.00	
CNOOC LTD	1,010,000	12.660000	12,786,600.00	
COSCO PACIFIC LTD	100,000	10.200000	1,020,000.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	257,232	4.330000	1,113,814.56	
CSR CORP LTD - H	100,000	6.090000	609,000.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	164,000	3.270000	536,280.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	152,000	11.740000	1,784,480.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	44,000	53.350000	2,347,400.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	364,000	2.840000	1,033,760.00	
FAR EAST HORIZON LTD	70,000	5.770000	403,900.00	
FOSUN INTERNATIONAL	93,000	8.670000	806,310.00	
FRANSHION PROPERTIES	200,000	2.650000	530,000.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	490,000	2.700000	1,323,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	290,000	3.240000	939,600.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	40,000	10.620000	424,800.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	520,000	1.310000	681,200.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	59,500	35.150000	2,091,425.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	33,000	11.020000	363,660.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	136,000	7.530000	1,024,080.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	114,675	8.040000	921,987.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	56,000	10.360000	580,160.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	43,000	22.950000	986,850.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	18,000	17.160000	308,880.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	70,000	11.940000	835,800.00	
HANERGY SOLAR GROUP LTD	640,000	1.000000	640,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	41,500	82.200000	3,411,300.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	176,000	7.540000	1,327,040.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,158,350	4.760000	19,793,746.00	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	56,000	7.700000	431,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	70,000	9.490000	664,300.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	72,000	14.240000	1,025,280.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	41,000	17.800000	729,800.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	186,000	13.480000	2,507,280.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	100,000	5.340000	534,000.00	
LENOVO GROUP LTD	350,000	10.440000	3,654,000.00	
LONGFOR PROPERTIES	78,000	11.140000	868,920.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	35,500	24.000000	852,000.00	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	66,000	3.930000	259,380.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	90,000	7.000000	630,000.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	248,000	3.420000	848,160.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,193,000	7.870000	9,388,910.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	176,000	10.400000	1,830,400.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	106,500	65.950000	7,023,675.00	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	126,000	3.810000	480,060.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	88,000	9.800000	862,400.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	150,000	2.510000	376,500.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	26,000	26.600000	691,600.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	39,000	19.760000	770,640.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	30,000	26.900000	807,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	80,500	17.700000	1,424,850.00	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	168,000	2.260000	379,680.00	
SHUI ON LAND LTD	227,600	2.310000	525,756.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	115,000	7.570000	870,550.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	168,000	6.380000	1,071,840.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	180,000	4.540000	817,200.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	54,000	10.620000	573,480.00	



SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	161,000	2.250000	362,250.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	54,800	22.350000	1,224,780.00	
SOHO CHINA LTD	110,000	6.140000	675,400.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	140,000	10.760000	1,506,400.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	57,600	501.000000	28,857,600.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	112,000	21.700000	2,430,400.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	56.900000	1,138,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	60,000	6.950000	417,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	329,000	11.000000	3,619,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	29,200	29.750000	868,700.00	
WUMART STORES INC-H	23,000	11.400000	262,200.00	
YANTAI CHANGYU PIONEER-B	13,000	21.600000	280,800.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	106,000	6.100000	646,600.00	
YINGDE GASES GROUP CO LTD	60,000	7.420000	445,200.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	280,000	1.700000	476,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	76,000	6.900000	524,400.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	30,000	11.380000	341,400.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	31,000	25.050000	776,550.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	290,000	1.710000	495,900.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	86,000	6.490000	558,140.00	
ZTE CORP-H	38,276	16.280000	623,133.28	
香港ドル 小計	35,749,484		309,832,412.47 (4,083,591,196)	
マレーシアリングgit				
AIRASIA BHD	70,000	2.340000	163,800.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	59,000	4.570000	269,630.00	
AMMB HOLDINGS BHD	93,000	7.270000	676,110.00	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	85,000	2.970000	252,450.00	
AXIATA GROUP BERHAD	140,000	6.570000	919,800.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	43,881	4.000000	175,524.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,800	61.020000	414,936.00	
BUMI ARMADA BERHAD	57,000	4.060000	231,420.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	253,000	6.900000	1,745,700.00	
DIALOG GROUP BHD	105,000	3.330000	349,650.00	
DIGI.COM BHD	190,000	4.670000	887,300.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	70,000	4.400000	308,000.00	
GAMUDA BHD	91,000	4.340000	394,940.00	
GENTING BHD	117,600	10.360000	1,218,336.00	
GENTING MALAYSIA BHD	162,900	4.330000	705,357.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	15,000	10.460000	156,900.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	30,500	14.140000	431,270.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,500	15.200000	205,200.00	
IHH HEALTHCARE BHD	140,000	3.780000	529,200.00	
IJM CORP BHD	59,100	5.750000	339,825.00	
IOI CORPORATION BHD	169,400	4.210000	713,174.00	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	55,800	2.850000	159,030.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	27,000	23.740000	640,980.00	
LAFARGE MALAYSIA BHD	19,000	8.300000	157,700.00	
MALAYAN BANKING BHD	242,500	9.650000	2,340,125.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	32,000	8.840000	282,880.00	
MAXIS BHD	130,000	7.000000	910,000.00	
MISC BHD	60,000	5.600000	336,000.00	
MMC CORP BHD	46,000	2.790000	128,340.00	
PARKSON HOLDINGS BHD	30,000	2.960000	88,800.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	162,000	6.660000	1,078,920.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	14,800	30.680000	454,064.00	
PETRONAS GAS BHD	34,400	23.060000	793,264.00	
PPB GROUP BERHAD	26,800	15.640000	419,152.00	
PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	58,000	19.120000	1,108,960.00	
RHB CAPITAL BHD	36,000	7.790000	280,440.00	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	208,000	4.510000	938,080.00	
SIME DARBY BERHAD	155,000	9.050000	1,402,750.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	60,000	5.510000	330,600.00	
TENAGA NASIONAL BHD	160,500	11.480000	1,842,540.00	
UEM SUNRISE BHD	86,000	2.080000	178,880.00	
UMW HOLDINGS BHD	30,000	11.480000	344,400.00	
YTL CORPORATION BERHAD	257,464	1.570000	404,218.48	

YTL POWER INTERNATIONAL BHD	120,000	1.900000	228,000.00	
マレーシアリングット 小計	4,022,945		25,936,645.48 (793,920,718)	
タイバーツ				
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	57,000	215.000000	12,255,000.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	25,000	175.500000	4,387,500.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	82,200	178.000000	14,631,600.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	17,000	119.000000	2,023,000.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	72,000	28.500000	2,052,000.00	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	55,000	48.000000	2,640,000.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	330,000	8.350000	2,755,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	68,000	40.000000	2,720,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	146,000	30.000000	4,380,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	254,200	40.000000	10,168,000.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	27,000	68.500000	1,849,500.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	151,667	9.050000	1,372,586.35	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	90,000	21.700000	1,953,000.00	
IRPC PCL - NVDR	650,000	3.300000	2,145,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	102,500	175.500000	17,988,750.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	196,000	17.800000	3,488,800.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	85,000	21.900000	1,861,500.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	78,000	165.000000	12,870,000.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	90,561	74.000000	6,701,514.00	
PTT PCL-NVDR	49,200	291.000000	14,317,200.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,100	416.000000	10,441,600.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	101,000	155.000000	15,655,000.00	
THAI OIL PCL-NVDR	51,000	55.000000	2,805,000.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	720,000	2.300000	1,656,000.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	280,000	7.550000	2,114,000.00	
タイバーツ 小計	3,803,428		155,232,050.35 (482,771,676)	
フィリピンペン				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	110,000	54.200000	5,962,000.00	
ABOITIZ POWER CORP	110,000	36.650000	4,031,500.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	100,000	27.150000	2,715,000.00	
AYALA CORPORATION	10,320	544.000000	5,614,080.00	
AYALA LAND INC	334,000	27.550000	9,201,700.00	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	40,000	89.000000	3,560,000.00	
BDO UNIBANK INC	76,000	81.750000	6,213,000.00	
DMCI HOLDINGS INC	43,000	62.000000	2,666,000.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	340,000	5.350000	1,819,000.00	
GLOBE TELECOM INC	2,000	1,753.000000	3,506,000.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	43,000	98.900000	4,252,700.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	120,000	41.800000	5,016,000.00	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	23,500	164.700000	3,870,450.00	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	550,000	4.450000	2,447,500.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	19,500	79.000000	1,540,500.00	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,550	2,748.000000	7,007,400.00	
SM INVESTMENTS CORP	8,600	722.500000	6,213,500.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	347,500	14.800000	5,143,000.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	47,500	124.300000	5,904,250.00	
フィリピンペン 小計	2,327,470		86,683,580.00 (195,038,055)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	820,000	1,040.000000	852,800,000.00	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	22,000	22,750.000000	500,500,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,126,000	6,525.000000	7,347,150,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	705,000	10,175.000000	7,173,375,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	206,000	4,220.000000	869,320,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	509,000	8,675.000000	4,415,575,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	400,000	4,300.000000	1,720,000,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	608,000	8,400.000000	5,107,200,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	380,000	1,440.000000	547,200,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	420,000	3,885.000000	1,631,700,000.00	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	330,000	1,855.000000	612,150,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	24,500	42,150.000000	1,032,675,000.00	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	22,000	26,875.000000	591,250,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	85,000	21,300.000000	1,810,500,000.00	

INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	65,000	11,200.000000	728,000,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	232,000	7,275.000000	1,687,800,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	105,000	5,325.000000	559,125,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	1,360,000	1,410.000000	1,917,600,000.00	
LIPPO KARAWACI TBK PT	1,130,000	980.000000	1,107,400,000.00	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	90,000	12,025.000000	1,082,250,000.00	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	260,000	2,385.000000	620,100,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	638,500	4,700.000000	3,000,950,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	160,000	14,550.000000	2,328,000,000.00	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	240,000	2,630.000000	631,200,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	56,500	9,600.000000	542,400,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	2,600,000	2,210.000000	5,746,000,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	90,000	6,400.000000	576,000,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	88,000	28,075.000000	2,470,600,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	92,000	19,700.000000	1,812,400,000.00	
XL AXIATA TBK PT	130,000	5,025.000000	653,250,000.00	
インドネシアルピア 小計	12,994,500		59,674,470,000.00 (501,265,548)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B. -A	162,000	36.240000	5,870,880.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,968,000	14.250000	28,044,000.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	16,866	73.240000	1,235,265.84	
CEMEX SAB-CPO	641,872	16.660000	10,693,587.52	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	24,500	143.050000	3,504,725.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	56,000	24.290000	1,360,240.00	
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	24,000	49.510000	1,188,240.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	11,000	138.650000	1,525,150.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	110,300	121.760000	13,430,128.00	
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	42,500	34.170000	1,452,225.00	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	16,000	71.310000	1,140,960.00	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	12,000	153.770000	1,845,240.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	91,500	34.570000	3,163,155.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	29,700	66.310000	1,969,407.00	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,000	39.030000	741,570.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	98,000	32.810000	3,215,380.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	141,500	89.010000	12,594,915.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	130,000	33.180000	4,313,400.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	211,770	41.650000	8,820,220.50	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	145,900	77.060000	11,243,054.00	
INDUSTRIAS CH S.A.B. -SER B	8,200	78.050000	640,010.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,300	307.030000	2,241,319.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	90,000	34.180000	3,076,200.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	61,000	50.390000	3,073,790.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	38,700	22.610000	875,007.00	
OHL MEXICO SAB DE CV	40,500	34.210000	1,385,505.00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	15,500	161.260000	2,499,530.00	
WALMART DE MEXICO-SER V	295,000	31.760000	9,369,200.00	
メキシコペソ 小計	4,508,608		140,512,303.86 (1,067,893,509)	
ブラジルリアル				
AES TIETE SA-PREF	6,700	18.170000	121,739.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	25,000	6.500000	162,500.00	
AMBEV SA	258,300	16.430000	4,243,869.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	23,000	13.120000	301,760.00	
BANCO BRADESCO S.A.	33,860	28.590000	968,057.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	117,804	26.340000	3,102,957.36	
BANCO DO BRASIL S.A.	32,400	21.170000	685,908.00	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	10,000	11.410000	114,100.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	53,000	12.090000	640,770.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	34,500	23.290000	803,505.00	
BM&FBOVESPA SA	107,500	9.700000	1,042,750.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	22,500	16.300000	366,750.00	
BR PROPERTIES SA	11,300	17.220000	194,586.00	
BRADESCO SA -PREF	13,500	21.360000	288,360.00	
BRASKEM SA-PREF A	8,000	18.990000	151,920.00	
BRF SA	37,200	43.420000	1,615,224.00	
CCR SA	49,000	16.000000	784,000.00	

CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	18,500	5.160000	95,460.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	12,000	8.960000	107,520.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,000	22.730000	250,030.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	7,700	95.820000	737,814.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	8,700	21.460000	186,702.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	38,473	13.690000	526,695.37	
CIA HERING	7,200	27.600000	198,720.00	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	29.250000	160,875.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,600	23.500000	460,600.00	
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	3,300	32.600000	107,580.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,400	11.800000	500,320.00	
CIELO SA	19,552	63.730000	1,246,048.96	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	7,500	36.200000	271,500.00	
CPFL ENERGIA SA	14,500	18.280000	265,060.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	16,500	14.680000	242,220.00	
DURATEX SA	16,236	12.280000	199,378.08	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	9,000	12.860000	115,740.00	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	13,000	9.700000	126,100.00	
EMBRAER SA	33,000	19.260000	635,580.00	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	14,000	18.980000	265,720.00	
FIBRIA CELULOSE SA	13,500	25.480000	343,980.00	
GERDAU SA-PREF	47,200	16.950000	800,040.00	
HYPERMARCAS SA	18,500	15.820000	292,670.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	138,380	29.260000	4,048,998.80	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	162,969	8.200000	1,336,345.80	
JBS SA	42,000	8.250000	346,500.00	
KLABIN SA-PREF	26,000	12.490000	324,740.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	10,200	35.980000	366,996.00	
LOCALIZA RENT A CAR	8,300	30.900000	256,470.00	
LOJAS AMERICANAS SA	3,000	12.450000	37,350.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	27,215	14.740000	401,149.10	
LOJAS RENNER S.A.	6,700	57.250000	383,575.00	
M DIAS BRANCO SA	1,900	89.770000	170,563.00	
MARCOPOLO SA-PREF	21,000	5.130000	107,730.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	17,200	21.310000	366,532.00	
MRV ENGENHARIA	17,000	8.760000	148,920.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	4,900	45.700000	223,930.00	
NATURA COSMETICOS SA	10,000	38.520000	385,200.00	
ODONTOPREV S.A.	14,000	8.750000	122,500.00	
OI SA-PREFERENCE	40,815	4.250000	173,463.75	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	166,000	14.080000	2,337,280.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	235,100	15.100000	3,550,010.00	
PORTO SEGURO SA	6,400	28.900000	184,960.00	
QUALICORP SA	10,000	20.920000	209,200.00	
RAIA DROGASIL SA	12,800	14.050000	179,840.00	
SOUZA CRUZ SA	21,000	22.270000	467,670.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	7,406	13.900000	102,943.40	
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	16,000	9.080000	145,280.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	17,175	46.720000	802,416.00	
TIM PARTICIPACOES SA	44,877	12.810000	574,874.37	
TOTVS SA	7,500	33.090000	248,175.00	
TRACTEBEL ENERGIA SA	8,500	33.680000	286,280.00	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	5,000	17.400000	87,000.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	18,000	52.780000	950,040.00	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	20,500	12.450000	255,225.00	
VALE SA	71,700	31.250000	2,240,625.00	
VALE SA-PREF	104,800	28.630000	3,000,424.00	
WEG SA	12,800	28.290000	362,112.00	
ブラジルリアル 小計	2,577,562		48,910,427.39 (2,087,986,145)	
チリペソ				
AES GENER SA	140,000	261.060000	36,548,400.00	
AGUAS ANDINAS SA-A	130,000	334.830000	43,527,900.00	
BANCO DE CHILE	972,378	71.850000	69,865,359.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,926	31,178.000000	60,048,828.00	
BANCO SANTANDER CHILE	3,880,000	29.320000	113,761,600.00	
CAP SA	4,500	8,456.900000	38,056,050.00	

CENCOSUD SA	62,000	1,595.100000	98,896,200.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	9,000	5,904.200000	53,137,800.00	
COLBUN SA	410,000	119.920000	49,167,200.00	
CORPBANCA	7,600,000	7.236000	54,993,600.00	
E.CL SA	30,000	695.140000	20,854,200.00	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	14,000	2,064.200000	28,898,800.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	190,000	776.920000	147,614,800.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	7,400	7,085.000000	52,429,000.00	
EMPRESAS CMPC SA	65,000	1,269.400000	82,511,000.00	
EMPRESAS COPEC SA	26,000	6,896.800000	179,316,800.00	
ENERSIS SA	1,075,000	158.400000	170,280,000.00	
LATAM AIRLINES GROUP SA	19,000	8,426.200000	160,097,800.00	
S.A.C.I. FALABELLA	40,500	4,224.600000	171,096,300.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,400	14,448.000000	78,019,200.00	
VINA CONCHA Y TORO SA	24,000	1,017.300000	24,415,200.00	
チリペソ 小計	14,706,104		1,733,536,037.00 (322,437,702)	
韓国ウォン				
AMOREPACIFIC CORP	175	1,030,000.000000	180,250,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	150	477,500.000000	71,625,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	9,500	15,850.000000	150,575,000.00	
CELLTRION INC	3,618	45,000.000000	162,810,000.00	
CELLTRION INC-NEW	108	45,000.000000	4,860,000.00	
CHEIL INDUSTRIES INC	2,550	76,400.000000	194,820,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	5,300	27,350.000000	144,955,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	420	264,500.000000	111,090,000.00	
CJ CORP	800	119,000.000000	95,200,000.00	
COWAY CO LTD	3,000	65,000.000000	195,000,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,650	81,400.000000	134,310,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	5,500	6,100.000000	33,550,000.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,618	40,450.000000	105,898,100.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	10,738	8,710.000000	93,527,980.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	5,100	35,950.000000	183,345,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	7,100	16,250.000000	115,375,000.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,550	53,000.000000	135,150,000.00	
DOOSAN CORP	450	132,000.000000	59,400,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	2,700	36,050.000000	97,335,000.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	8,200	13,000.000000	106,600,000.00	
E-MART CO LTD	1,210	244,000.000000	295,240,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	2,200	33,300.000000	73,260,000.00	
GS HOLDINGS	2,750	53,100.000000	146,025,000.00	
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	2,000	37,000.000000	74,000,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	15,700	40,550.000000	636,635,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	4,076	64,000.000000	260,864,000.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	5,100	20,750.000000	105,825,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,500	36,900.000000	92,250,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,000	7,170.000000	93,210,000.00	
HITE JINRO CO LTD	1,600	21,750.000000	34,800,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	1,220	68,600.000000	83,692,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	900	143,500.000000	129,150,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	3,500	24,650.000000	86,275,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,170	58,400.000000	243,528,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	750	223,000.000000	167,250,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,390	230,000.000000	549,700,000.00	
HYUNDAI HYSKO	511	41,400.000000	21,155,400.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,500	30,900.000000	108,150,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,000	12,200.000000	48,800,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	550	174,000.000000	95,700,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	3,860	292,500.000000	1,129,050,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	8,760	228,000.000000	1,997,280,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2,100	124,000.000000	260,400,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1,250	115,500.000000	144,375,000.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	8,500	5,820.000000	49,470,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	3,701	79,300.000000	293,489,300.00	
HYUNDAI WIA CORP	840	168,000.000000	141,120,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	8,700	12,350.000000	107,445,000.00	
KANGWON LAND INC	5,500	34,300.000000	188,650,000.00	

KB FINANCIAL GROUP INC	21,550	37,800.000000	814,590,000.00	
KCC CORP	260	481,000.000000	125,060,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	15,000	52,700.000000	790,500,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,200	31,700.000000	69,740,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	14,400	33,950.000000	488,880,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,450	68,800.000000	99,760,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,200	39,700.000000	87,340,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	440	331,000.000000	145,640,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,555	33,800.000000	52,559,000.00	
KT CORP	1,650	30,200.000000	49,830,000.00	
KT&G CORP	6,050	74,800.000000	452,540,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	700	88,000.000000	61,600,000.00	
LG CHEM LTD	2,580	268,500.000000	692,730,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	480	139,000.000000	66,720,000.00	
LG CORP	5,200	60,800.000000	316,160,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	12,700	26,750.000000	339,725,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,871	69,800.000000	409,795,800.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	540	491,000.000000	265,140,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	600	88,900.000000	53,340,000.00	
LG UPLUS CORP	11,500	10,300.000000	118,450,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	1,010	210,500.000000	212,605,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	40	1,816,000.000000	72,640,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	630	369,000.000000	232,470,000.00	
LS CORP	980	83,600.000000	81,928,000.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	950	66,800.000000	63,460,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,600	36,500.000000	58,400,000.00	
NAVER CORP	1,590	679,000.000000	1,079,610,000.00	
NCSOFT CORPORATION	800	206,500.000000	165,200,000.00	
NHN ENTERTAINMENT CORP	787	81,500.000000	64,140,500.00	
OCI CO LTD	950	192,500.000000	182,875,000.00	
ORION CORP	200	863,000.000000	172,600,000.00	
POSCO	3,700	304,500.000000	1,126,650,000.00	
S-1 CORPORATION	950	74,900.000000	71,155,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	7,200	56,800.000000	408,960,000.00	
SAMSUNG CARD CO	2,000	35,650.000000	71,300,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,500	69,300.000000	242,550,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,185	1,307,000.000000	8,083,795,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,150	970,000.000000	1,115,500,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,800	71,700.000000	129,060,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,000	246,000.000000	492,000,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	9,150	35,200.000000	322,080,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,300	101,500.000000	334,950,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,980	150,500.000000	297,990,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,513	43,700.000000	153,518,100.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	1,950	53,900.000000	105,105,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	24,200	44,200.000000	1,069,640,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	384	218,000.000000	83,712,000.00	
SK C&C CO LTD	1,230	131,000.000000	161,130,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,430	183,500.000000	262,405,000.00	
SK HYNIX INC	30,200	35,900.000000	1,084,180,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	3,440	131,000.000000	450,640,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	6,600	8,440.000000	55,704,000.00	
SK TELECOM	510	212,500.000000	108,375,000.00	
S-OIL CORPORATION	2,400	69,900.000000	167,760,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	20,000	12,400.000000	248,000,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	6,539	9,340.000000	61,074,260.00	
YUHAN CORPORATION	432	192,000.000000	82,944,000.00	
韓国ウォン 小計	449,271		34,708,670,440.00 (3,283,440,223)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	153,168	18.100000	2,772,340.80	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	327,589	28.500000	9,336,286.50	
ADVANTECH CO LTD	16,000	195.500000	3,128,000.00	
ASIA CEMENT CORP	126,413	37.700000	4,765,770.10	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	90,000	15.100000	1,359,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	36,774	289.000000	10,627,686.00	
AU OPTRONICS CORP	506,000	9.210000	4,660,260.00	

CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	37,000	205.000000	7,585,000.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	438,825	46.900000	20,580,892.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	44,000	76.800000	3,379,200.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	240,070	18.400000	4,417,288.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	94,413	77.800000	7,345,331.40
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	20,000	65.800000	1,316,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	26,664	78.600000	2,095,790.40
CHINA AIRLINES LTD	120,000	10.650000	1,278,000.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	763,255	9.150000	6,983,783.25
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	128,573	29.400000	3,780,046.20
CHINA MOTOR CORP	36,000	28.200000	1,015,200.00
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	89,250	13.500000	1,204,875.00
CHINA STEEL CORP	661,086	26.800000	17,717,104.80
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	216,000	91.700000	19,807,200.00
CLEVO COMPANY	28,403	64.300000	1,826,312.90
COMPAL ELECTRONICS	239,775	23.600000	5,658,690.00
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	757,377	20.300000	15,374,753.10
CTCI CORP	33,000	42.400000	1,399,200.00
DELTA ELECTRONICS INC	104,220	170.000000	17,717,400.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	271,887	19.000000	5,165,853.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	10,000	335.500000	3,355,000.00
EPISTAR CORP	52,000	70.000000	3,640,000.00
EVA AIRWAYS CORP	97,000	16.300000	1,581,100.00
EVERGREEN MARINE CORP LTD	91,999	18.200000	1,674,381.80
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	53,805	27.500000	1,479,637.50
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	164,998	32.000000	5,279,936.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	90,000	60.100000	5,409,000.00
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	21,000	48.500000	1,018,500.00
FENG HSIN IRON & STEEL CO	26,000	53.300000	1,385,800.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	376,808	18.400000	6,933,267.20
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	180,430	81.500000	14,705,045.00
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,000	336.000000	672,000.00
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	67,150	76.500000	5,136,975.00
FORMOSA PLASTICS CORP	235,600	80.100000	18,871,560.00
FORMOSA TAFFETA CO.	42,000	32.300000	1,356,600.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	44,815	69.100000	3,096,716.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	378,087	43.300000	16,371,167.10
GIANT MANUFACTURING	17,000	197.000000	3,349,000.00
HERMES MICROVISION INC	2,000	915.000000	1,830,000.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	18,000	60.800000	1,094,400.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	11,139	273.000000	3,040,947.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	604,069	85.000000	51,345,865.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	374.500000	4,868,500.00
HTC CORP	39,744	139.500000	5,544,288.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	311,330	17.500000	5,448,275.00
INNOLUX CORP	405,112	10.650000	4,314,442.80
INVENTEC CORP	135,429	29.100000	3,940,983.90
KINSUS INTERCONNECT TECH	16,000	106.000000	1,696,000.00
LARGAN PRECISION CO LTD	6,020	1,160.000000	6,983,200.00
LCY CHEMICAL CORP	26,000	39.300000	1,021,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	111,795	45.700000	5,109,031.50
MEDIATEK INC	72,042	407.500000	29,357,115.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	517,754	24.700000	12,788,523.80
MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	195.500000	2,150,500.00
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	10,320	332.000000	3,426,240.00
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	33,104	37.150000	1,229,813.60
NAN YA PLASTICS CORP	271,557	67.100000	18,221,474.70
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	31,000	122.000000	3,782,000.00
PEGATRON CORP	81,976	40.550000	3,324,126.80
PHISON ELECTRONICS CORP	7,000	194.000000	1,358,000.00
POU CHEN	120,500	42.750000	5,151,375.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	36,300	42.550000	1,544,565.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	31,000	202.500000	6,277,500.00
QUANTA COMPUTER INC	139,150	77.000000	10,714,550.00
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,522	134.500000	3,567,209.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	23,703	83.700000	1,983,941.10
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	39,000	53.000000	2,067,000.00

RUENTEX INDUSTRIES LTD	25,000	74.700000	1,867,500.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	9,760	87.000000	849,120.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	350,496	10.400000	3,645,158.40	
SILICONWARE PRECISION INDS	155,000	37.500000	5,812,500.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	14,150	140.500000	1,988,075.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	351,694	14.450000	5,081,978.30	
STANDARD FOODS CORP	17,250	89.700000	1,547,325.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	67,137	53.900000	3,618,684.30	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	366,347	14.600000	5,348,666.20	
TAIWAN BUSINESS BANK	179,600	9.140000	1,641,544.00	
TAIWAN CEMENT	191,706	45.350000	8,693,867.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	304,560	16.450000	5,010,012.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	42,000	64.100000	2,692,200.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	50,970	30.700000	1,564,779.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	89,400	90.000000	8,046,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,369,000	108.000000	147,852,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	100,000	34.700000	3,470,000.00	
TPK HOLDING CO LTD	13,442	203.000000	2,728,726.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	14,000	91.000000	1,274,000.00	
TSRC CORP	33,000	43.950000	1,450,350.00	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	27,000	53.300000	1,439,100.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	71,000	23.650000	1,679,150.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	250,488	50.200000	12,574,497.60	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	660,000	12.850000	8,481,000.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	42,000	34.400000	1,444,800.00	
WALSIN LIHWA CORP	190,000	9.760000	1,854,400.00	
WAN HAI LINES LTD	30,000	15.250000	457,500.00	
WISTRON CORP	114,440	25.000000	2,861,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	85,400	36.050000	3,078,670.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	88,000	13.400000	1,179,200.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	486,909	17.100000	8,326,143.90	
YULON MOTOR COMPANY	44,000	53.200000	2,340,800.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	76.900000	845,900.00	
ニュー台湾ドル 小計	16,552,749		741,539,264.05 (2,506,402,712)	
インドルビー				
ACC LTD	1,000	999.450000	999,450.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,000	249.800000	1,249,000.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	24,000	145.000000	3,480,000.00	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,000	1,100.150000	2,200,300.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	35,000	162.950000	5,703,250.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	4,000	941.900000	3,767,600.00	
ASIAN PAINTS LTD	16,500	478.100000	7,888,650.00	
BAJAJ AUTO LTD	5,000	1,931.700000	9,658,500.00	
BANK OF BARODA	2,200	602.500000	1,325,500.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	33,500	165.000000	5,527,500.00	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	11,200	343.150000	3,843,280.00	
BHARTI AIRTEL LTD	33,000	313.150000	10,333,950.00	
CAIRN INDIA LTD	28,000	324.850000	9,095,800.00	
CIPLA LTD	20,000	414.400000	8,288,000.00	
COAL INDIA LTD	27,000	257.900000	6,963,300.00	
DABUR INDIA LTD	10,000	163.950000	1,639,500.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,500	1,326.900000	3,317,250.00	
DLF LTD	23,000	153.050000	3,520,150.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	5,500	2,660.950000	14,635,225.00	
GAIL INDIA LTD	19,500	350.100000	6,826,950.00	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	550	4,363.350000	2,399,842.50	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,700	705.050000	4,723,835.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	12,000	1,411.850000	16,942,200.00	
HDFC BANK LIMITED	66,800	673.400000	44,983,120.00	
HERO MOTOCORP LTD	4,300	2,036.650000	8,757,595.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	55,000	114.000000	6,270,000.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	36,500	565.800000	20,651,700.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	83,700	844.700000	70,701,390.00	
ICICI BANK LTD	12,200	1,058.200000	12,910,040.00	
IDEA CELLULAR LTD	37,000	152.450000	5,640,650.00	
INFOSYS LTD	25,000	3,758.150000	93,953,750.00	



ITC LTD	123,000	324.250000	39,882,750.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	54,000	46.700000	2,521,800.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	21,000	262.050000	5,503,050.00	
JSW STEEL LTD	4,300	970.050000	4,171,215.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	18,500	684.750000	12,667,875.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	16,800	1,006.350000	16,906,680.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	15,000	207.200000	3,108,000.00	
LUPIN LTD	2,100	913.750000	1,918,875.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	16,000	246.000000	3,936,000.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,700	884.800000	14,776,160.00	
NESTLE INDIA LTD	600	5,081.200000	3,048,720.00	
NTPC LTD	55,000	131.500000	7,232,500.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	44,000	283.200000	12,460,800.00	
OIL INDIA LTD	6,500	471.150000	3,062,475.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,700	546.700000	2,022,790.00	
POWER FINANCE CORPORATION	13,000	137.100000	1,782,300.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	76,000	98.100000	7,455,600.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	8,000	336.350000	2,690,800.00	
RELIANCE CAPITAL LTD	6,000	340.100000	2,040,600.00	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	29,000	129.250000	3,748,250.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	67,500	867.650000	58,566,375.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,000	398.650000	2,790,550.00	
RELIANCE POWER LTD	40,000	66.700000	2,668,000.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	16,000	179.750000	2,876,000.00	
SESA STERLITE LTD	61,000	202.700000	12,364,700.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,000	619.200000	4,334,400.00	
SIEMENS LTD	3,800	578.750000	2,199,250.00	
STATE BANK OF INDIA	7,800	1,621.200000	12,645,360.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	35,800	603.600000	21,608,880.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	26,600	2,248.700000	59,815,420.00	
TATA MOTORS LTD	41,500	370.400000	15,371,600.00	
TATA POWER CO LTD	55,000	75.650000	4,160,750.00	
TATA STEEL LTD	17,000	376.000000	6,392,000.00	
TECH MAHINDRA LTD	6,000	1,793.550000	10,761,300.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	2,300	1,699.750000	3,909,425.00	
UNITED BREWERIES LTD	4,200	802.800000	3,371,760.00	
UNITED SPIRITS LTD	5,000	2,695.650000	13,478,250.00	
WIPRO LTD	34,500	572.850000	19,763,325.00	
YES BANK LTD	10,000	348.050000	3,480,500.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	13,000	278.850000	3,625,050.00	
インドルピー 小計	1,637,850		813,317,412.50 (1,333,840,556)	
チェココルナ				
CEZ AS	9,400	522.900000	4,915,260.00	
KOMERCNI BANKA AS	820	4,350.000000	3,567,000.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	6,800	294.900000	2,005,320.00	
チェココルナ 小計	17,020		10,487,580.00 (53,381,782)	
コロンビアペソ				
ALMACENES EXITO SA	11,900	27,000.000000	321,300,000.00	
BANCO DAVIVIENDA SA	5,200	21,960.000000	114,192,000.00	
BANCOLOMBIA SA	11,700	21,820.000000	255,294,000.00	
BANCOLOMBIA SA-PREF	18,500	22,800.000000	421,800,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	23,000	8,780.000000	201,940,000.00	
CEMEX LATAM HOLDINGS SA	9,000	14,260.000000	128,340,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	4,134	37,500.000000	155,025,000.00	
ECOPETROL SA	254,500	3,390.000000	862,755,000.00	
GRUPO ARGOS SA	16,600	18,680.000000	310,088,000.00	
GRUPO ARGOS SA-PRF	7,300	18,300.000000	133,590,000.00	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	90,000	1,170.000000	105,300,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,200	31,000.000000	409,200,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	5,300	31,600.000000	167,480,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	20,600	8,280.000000	170,568,000.00	
ISAGEN SA ESP	44,000	3,240.000000	142,560,000.00	
コロンビアペソ 小計	534,934		3,899,432,000.00 (200,040,861)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,250	13,965.000000	31,421,250.00	

OTP BANK PLC	12,200	4,350.000000	53,070,000.00	
RICHTER GEDEON NYRT	8,000	4,744.000000	37,952,000.00	
ハンガリーフォリント 小計	22,450		122,443,250.00 (56,225,940)	
ポーランドズロチ				
ALIOR BANK SA	2,700	86.830000	234,441.00	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,800	107.000000	192,600.00	
BANK MILLENNIUM SA	23,000	8.060000	185,380.00	
BANK PEKAO SA	7,500	180.800000	1,356,000.00	
BANK ZACHODNI WBK SA	1,550	392.600000	608,530.00	
CYFROWY POLSAT SA	9,500	19.900000	189,050.00	
ENEA SA	8,000	12.810000	102,480.00	
EUROCASH SA	4,100	40.600000	166,460.00	
GRUPA AZOTY SA	1,800	47.650000	85,770.00	
GRUPA LOTOS SA	4,000	36.170000	144,680.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,200	47.000000	103,400.00	
KERNEL HOLDING SA	3,500	40.000000	140,000.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,800	110.000000	858,000.00	
MBANK	840	494.000000	414,960.00	
ORANGE POLSKA SA	33,000	9.600000	316,800.00	
PGE SA	42,000	16.600000	697,200.00	
PKO BANK POLSKI SA	48,600	40.500000	1,968,300.00	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,100	38.980000	705,538.00	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	102,200	4.730000	483,406.00	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,100	423.000000	1,311,300.00	
SYNTHOS SA	29,000	5.190000	150,510.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	60,000	4.040000	242,400.00	
ポーランドズロチ 小計	414,290		10,657,205.00 (354,991,498)	
南アフリカランド				
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	78,000	11.000000	858,000.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	6,100	216.990000	1,323,639.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,900	437.990000	1,708,161.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,300	158.000000	3,365,400.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	19,550	252.630000	4,938,916.50	
ASSORE LTD	1,800	394.420000	709,956.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	17,900	133.230000	2,384,817.00	
BARLOWORLD LTD	12,700	105.170000	1,335,659.00	
BIDVEST GROUP LTD	16,900	258.880000	4,375,072.00	
DISCOVERY LTD	17,200	80.000000	1,376,000.00	
EXXARO RESOURCES LTD	8,100	155.020000	1,255,662.00	
FIRSTSTRAND LTD	177,000	32.890000	5,821,530.00	
GOLD FIELDS LTD	42,500	38.990000	1,657,075.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	22,000	33.100000	728,200.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	30,000	126.100000	3,783,000.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,300	197.170000	2,030,851.00	
INVESTEC LTD	13,000	72.760000	945,880.00	
KUMBA IRON ORE LTD	4,600	456.000000	2,097,600.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,000	124.000000	744,000.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	55,000	36.850000	2,026,750.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	5,530	123.940000	685,388.20	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	19,700	70.870000	1,396,139.00	
MMI HOLDINGS LTD	65,000	24.440000	1,588,600.00	
MR PRICE GROUP LTD	13,700	149.150000	2,043,355.00	
MTN GROUP LTD	95,600	209.620000	20,039,672.00	
NAMPAK LTD	34,000	38.500000	1,309,000.00	
NASPERS LTD-N SHS	22,300	1,089.610000	24,298,303.00	
NEDBANK GROUP LTD	10,800	202.000000	2,181,600.00	
NETCARE LTD	55,900	23.940000	1,338,246.00	
NORTHAM PLATINUM LTD	15,500	46.100000	714,550.00	
PICK N PAY STORES LTD	13,000	47.420000	616,460.00	
PPC LTD	32,000	30.330000	970,560.00	
REMGRO LTD	27,500	198.000000	5,445,000.00	
REUNERT LTD	11,000	65.890000	724,790.00	
RMB HOLDINGS LTD	38,000	45.990000	1,747,620.00	
RMI HOLDINGS	37,500	26.280000	985,500.00	
SANLAM LTD	100,500	48.850000	4,909,425.00	

SAPPI LIMITED	30,500	34.300000	1,046,150.00	
SASOL LTD	30,200	552.920000	16,698,184.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	23,400	152.330000	3,564,522.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	9,800	122.010000	1,195,698.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	67,534	122.950000	8,303,305.30	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	74,147	45.800000	3,395,932.60	
THE FOSCHINI GROUP LTD	11,000	96.990000	1,066,890.00	
TIGER BRANDS LTD	9,500	275.000000	2,612,500.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	24,700	76.460000	1,888,562.00	
VODACOM GROUP LTD	20,600	126.750000	2,611,050.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	43,000	68.440000	2,942,920.00	
南アフリカランド 小計	1,505,761		159,786,090.60 (1,470,032,033)	
トルコリラ				
AKBANK T.A.S.	98,666	6.100000	601,862.60	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	11,000	22.550000	248,050.00	
ARCELIK AS	13,000	12.400000	161,200.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,400	39.800000	493,520.00	
COCA-COLA ICECEK AS	3,600	45.000000	162,000.00	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	20,275	6.960000	141,114.00	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	83,952	2.800000	235,065.60	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,800	19.400000	73,720.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	45,000	7.630000	343,350.00	
KOC HOLDING AS	33,350	7.460000	248,791.00	
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	2,500	20.350000	50,875.00	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	8,500	16.450000	139,825.00	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	8,000	10.600000	84,800.00	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	7,200	37.660000	271,152.00	
TURK HAVA YOLLARI AO	29,334	7.070000	207,391.38	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	31,419	2.510000	78,861.69	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	25,000	5.900000	147,500.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	42,500	11.390000	484,075.00	
TURKIYE GARANTI BANKASI	130,000	6.400000	832,000.00	
TURKIYE HALK BANKASI	36,700	12.250000	449,575.00	
TURKIYE IS BANKASI-C	92,726	4.370000	405,212.62	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	43,000	3.740000	160,820.00	
ULKER BISKUVI SANAYI	7,500	14.150000	106,125.00	
YAPI VE KREDI BANKASI	45,000	3.470000	156,150.00	
トルコリラ 小計	834,422		6,283,035.89 (275,636,784)	
ユーロ				
ALPHA BANK A.E.	85,000	0.646000	54,910.00	
FOLLI FOLLIE SA	1,600	24.640000	39,424.00	
HELLENIC PETROLEUM SA	4,200	7.300000	30,660.00	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,000	10.300000	144,200.00	
JUMBO SA	5,500	12.600000	69,300.00	
NATIONAL BANK OF GREECE	19,000	3.670000	69,730.00	
OPAP SA	13,100	9.970000	130,607.00	
PIRAEUS BANK S.A	58,000	1.700000	98,600.00	
PUBLIC POWER CORP	6,500	9.900000	64,350.00	
TITAN CEMENT CO. S.A.	2,800	19.990000	55,972.00	
ユーロ 小計	209,700		757,753.00 (106,077,842)	
合計	104,142,012		20,625,310,179 (20,625,310,179)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨種類	銘柄	口数	評価額	備考
メキシコペソ				
投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	76,000.00	3,396,440.00	
	投資証券 小計	76,000.00	3,396,440.00 (25,812,944)	
メキシコペソ 小計		76,000.00	3,396,440.00 (25,812,944)	

南アフリカランド				
投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	101,500.00	2,329,425.00	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	170,000.00	1,552,100.00	
投資証券 小計		271,500.00	3,881,525.00 (35,710,030)	
南アフリカランド 小計		271,500.00	3,881,525.00 (35,710,030)	
トルコリラ				
投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	122,000.00	259,860.00	
	投資証券 小計	122,000.00	259,860.00 (11,400,058)	
トルコリラ 小計		122,000.00	259,860.00 (11,400,058)	
合 計			72,923,032 (72,923,032)	

(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 36銘柄	100.00%		7.01%
香港ドル	株式 137銘柄	100.00%		19.73%
マレーシアリングgit	株式 44銘柄	100.00%		3.84%
タイバーツ	株式 25銘柄	100.00%		2.33%
フィリピンペソ	株式 19銘柄	100.00%		0.94%
インドネシアルピア	株式 30銘柄	100.00%		2.42%
メキシコペソ	株式 28銘柄	97.64%		5.16%
	投資証券 1銘柄		2.36%	0.12%
ブラジルリアル	株式 75銘柄	100.00%		10.09%
チリペソ	株式 21銘柄	100.00%		1.56%
韓国ウォン	株式 106銘柄	100.00%		15.86%
ニュー台湾ドル	株式 107銘柄	100.00%		12.11%
インドルピー	株式 71銘柄	100.00%		6.44%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%		0.26%
コロンビアペソ	株式 15銘柄	100.00%		0.97%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.27%
ポーランドズロチ	株式 22銘柄	100.00%		1.72%
南アフリカランド	株式 48銘柄	97.63%		7.10%
	投資証券 2銘柄		2.37%	0.17%
トルコリラ	株式 24銘柄	96.03%		1.33%
	投資証券 1銘柄		3.97%	0.06%
ユーロ	株式 10銘柄	100.00%		0.51%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成26年2月28日現在

(単位:円)

資産総額	2,787,388,640
負債総額	9,617,849
純資産総額( - )	2,777,770,791
発行済口数	1,541,607,805 口
1口当たり純資産価額( / )	1.8019 ( 1万口当たり 18,019 )

## &lt;参考&gt;

## 「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26年2月28日現在

(単位:円)

資産総額	199,953,372,590
負債総額	244,387,817
純資産総額( - )	199,708,984,773
発行済口数	112,064,301,767 口
1口当たり純資産価額( / )	1.7821 ( 1万口当たり 17,821 )

## &lt;参考&gt;

## 「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26年2月28日現在

(単位:円)

資産総額	22,458,347,883
負債総額	387,486,247
純資産総額( - )	22,070,861,636
発行済口数	11,897,164,775 口
1口当たり純資産価額( / )	1.8551 ( 1万口当たり 18,551 )

## 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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### （5）受益権の譲渡の対抗要件

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

### （6）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26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。

###### ファンドに関係する法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（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26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26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	477	6,809,598
追加型公社債投資信託	18	723,171
単位型株式投資信託	21	430,189
単位型公社債投資信託	5	185,525
合計	521	8,148,482

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28期事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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29期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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27期 (平成24年3月31日現在)		第28期 (平成25年3月31日現在)	
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
現金及び預金	2	14,298,590	2	22,261,065
有価証券	2	8,000,000	2	8,000,000
前払費用		154,925		159,117
未収入金		13,813		5,504
未収委託者報酬		3,977,324		4,489,181
未収収益	2	42,563	2	47,936
繰延税金資産		339,052		402,791
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		27,621		39,167
流動資産合計		26,883,891		35,434,764
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	281,399	1	270,058
器具備品	1	177,757	1	171,754
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,664,188		1,646,844
<b>無形固定資産</b>				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		881,368		857,424
ソフトウェア仮勘定		402,721		430,432
その他		24		
無形固定資産合計		1,299,937		1,303,679
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		14,456,313		15,689,317
関係会社株式		320,136		320,136
長期性預金	2	8,500,000	2	3,500,000
長期差入保証金	2	837,456	2	825,804
繰延税金資産		139,650		
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		24,268,591		20,350,294
固定資産合計		27,232,718		23,300,818
資産合計		54,116,609		58,735,583

(単位：千円)

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
<b>(負債の部)</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	79,079	75,221
未払金		
未払収益分配金	185,817	33,936
未払償還金	1,159,445	1,004,879
未払手数料	2 1,557,726	2 1,761,746
その他未払金	50,899	84,763
未払費用	2 1,174,572	2 1,333,574
未払消費税等	63,602	128,077
未払法人税等	1,532,874	1,686,070
賞与引当金	520,000	594,000
その他	278,521	348,389
流動負債合計	6,602,539	7,050,661
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	119,902	119,776
役員退職慰労引当金	49,735	65,103
時効後支払損引当金	195,228	201,877
繰延税金負債		251,776
固定負債合計	364,866	638,533
負債合計	6,967,405	7,689,194
<b>(純資産の部)</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計	44,203,921	47,026,806
株主資本合計	46,426,148	49,249,033
評価・換算差額等		
その他有価証券	723,054	1,797,355
評価差額金		
評価・換算差額等合計	723,054	1,797,355
純資産合計	47,149,203	51,046,388
負債純資産合計	54,116,609	58,735,583

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	34,903,313	36,863,331
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	36,863,331	39,686,216
利益剰余金合計		
当期首残高	42,243,903	44,203,921
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	44,203,921	47,026,806
株主資本合計		
当期首残高	44,466,131	46,426,148
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
当期変動額合計	1,960,017	2,822,884
当期末残高	46,426,148	49,249,032
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	391,537	723,054

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
評価・換算差額等合計		
当期首残高	391,537	723,054
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	331,516	1,074,300
当期末残高	723,054	1,797,355
純資産合計		
当期首残高	44,857,668	47,149,203
当期変動額		
剰余金の配当	3,189,318	2,581,238
当期純利益	5,149,336	5,404,123
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	331,516	1,074,300
当期変動額合計	2,291,534	3,897,185
当期末残高	47,149,203	51,046,388

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (2) 退職給付引当金

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

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

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## (4) 時効後支払損引当金

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

## 5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

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

## （会計方針の変更）

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

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。



## (未適用の会計基準等)

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

## (1)概要

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

## (2)適用予定日

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

## (3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中です。

## (貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

## (損益計算書関係)

## 1.固定資産除却損の内訳

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

## 2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

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

第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,581,238千円
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

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

平成25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

### 第27期(平成24年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

### 第28期(平成25年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	22,261,065	22,261,065	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,489,181	4,489,181	-
(4) 長期性預金	3,500,000	3,505,795	5,795
(5) 投資有価証券	15,650,417	15,650,417	-
資産計	53,900,663	53,906,459	5,795
(1) 未払手数料	1,761,746	1,761,746	-
(2) 未払法人税等	1,686,070	1,686,070	-
負債計	3,447,816	3,447,816	-

### (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

#### 資産

#### (1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

#### (4) 長期性預金

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

#### (5) 投資有価証券

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

#### 負債

#### (1) 未払手数料、(2) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

区分	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
非上場株式	38,900	38,900
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

第28期(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	22,261,065	-	-	-
未収委託者報酬	4,489,181	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	4,150,204	2,167,462	2,151,428
長期性預金	-	3,500,000	-	-
合計	34,750,246	7,650,204	2,167,462	2,151,428

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第27期(平成24年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるも の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
貸借対照表計上額が 取得原価を超えない もの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,325,285	3,446,474	121,188
	小計	3,325,285	3,446,474	121,188
合計		14,417,413	13,440,240	977,173

第28期(平成25年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるも の	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	12,625,086	10,181,990	2,443,096
	小計	12,625,086	10,181,990	2,443,096
貸借対照表計上額が 取得原価を超えない もの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,025,331	3,033,767	8,436
	小計	3,025,331	3,033,767	8,436
合計		15,650,417	13,215,757	2,434,660

## 3. 売却したその他有価証券

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合計	3,195,269	150,103	153,276

第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	7,033,368	334,775	32,155
合計	7,033,368	334,775	32,155

（デリバティブ取引関係）  
重要な取引はありません。

（退職給付関係）

#### 1.採用している退職給付制度の概要

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

#### 2.退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

#### 3.退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

#### 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（1）退職給付見込額の期間配分方法  
期間定額基準

（2）割引率

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

（3）期待運用収益率

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

（4）数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

#### 1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第27期 (平成24年3月31日現在)	第28期 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		

	557,868 千円	542,460 千円
減損損失	557,868 千円	542,460 千円
投資有価証券評価損	362,665	226,404
ゴルフ会員権評価損	8,505	8,505
未払事業税	109,608	140,336
賞与引当金	197,652	225,779
役員退職慰労引当金	17,725	23,202
退職給付引当金	42,783	45,495
減価償却超過額	19,890	10,083
委託者報酬	99,265	124,166
長期差入保証金	21,895	26,203
時効後支払損引当金	69,579	71,948
その他	39,304	48,666
繰延税金資産 小計	1,546,744	1,493,253
評価性引当額	813,923	704,932
繰延税金資産 合計	732,821	788,320
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	254,118	637,305
繰延税金負債 合計	254,118	637,305
繰延税金資産の純額	478,702	151,015

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)及び第28期(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)  
 当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円	
							事務所の賃借	667,780 千円	長期差入保証金	812,027 千円	
							投資の助言	168,292 千円	未払費用	81,330 千円	
							株式の売却	98,112 千円			
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	6,532 千円	未収収益	544 千円
								マルチコーラブル預金の預入	7,000,000 千円	現金及び預金	5,500,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	24,415 千円	未収収益	2,886 千円
							長期性預金	8,500,000 千円			



## 第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	当社投資信託 の募集の取扱 及び投資信託 に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	4,556,241 千円	未払手数料	324,725 千円
						事務所の賃借	事務所賃借 料	671,086 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	167,142 千円	未払費用	85,301 千円
主要 株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託 の募集の取扱 及び投資信託 に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,674,726 千円	未払手数料	602,382 千円
						取引銀行	譲渡性預金 の預入	30,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金 に係る受取 利息	5,170 千円	未収収益	717 千円
							マルチコーラ ブル預金の預 入	5,500,000 千円	現金及び 預金	10,500,000 千円
							マルチコーラ ブル預金に係 る受取利息	24,246 千円	未収収益	2,301 千円
								長期性預金	3,500,000 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、市場実勢を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等  
第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,914,481 千円	未払手数料	285,874 千円

## 第28期（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,513,173 千円	未払手数料	321,822 千円

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## (1株当たり情報)

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	379,935.23円	411,339.33円
1株当たり当期純利益金額	41,494.11円	43,547.22円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第28期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	5,149,336	5,404,123
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	5,149,336	5,404,123
期中平均株式数 (株)	124,098	124,098

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)	
<b>(資産の部)</b>	
<b>流動資産</b>	
現金及び預金	23,548,500
有価証券	6,562,983
前払費用	236,694
未収入金	335,237
未収委託者報酬	4,948,498
未収収益	56,552
繰延税金資産	385,903
金銭の信託	30,000
その他	57,563
<b>流動資産合計</b>	<b>36,161,935</b>
<b>固定資産</b>	
<b>有形固定資産</b>	
建物	1 259,238
器具備品	1 174,123
土地	1,205,031
<b>有形固定資産合計</b>	<b>1,638,393</b>
<b>無形固定資産</b>	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,060,576
ソフトウェア仮勘定	242,958
<b>無形固定資産合計</b>	<b>1,319,357</b>
<b>投資その他の資産</b>	
投資有価証券	16,782,208
関係会社株式	320,136
長期性預金	2,000,000
長期差入保証金	819,880
繰延税金資産	49,612
その他	15,035
<b>投資その他の資産合計</b>	<b>19,986,873</b>
<b>固定資産合計</b>	<b>22,944,625</b>
<b>資産合計</b>	<b>59,106,560</b>

(単位：千円)

第29期中間会計期間

(平成25年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		61,657
未払金		
未払収益分配金		63,875
未払償還金		946,113
未払手数料		1,982,655
その他未払金		72,079
未払費用		1,409,174
未払消費税等	2	176,997
未払法人税等		1,913,828
賞与引当金		534,891
その他		400,856
流動負債合計		<u>7,562,129</u>

## 固定負債

退職給付引当金		246,154
役員退職慰労引当金		53,775
時効後支払損引当金		198,603
固定負債合計		<u>498,533</u>

## 負債合計

8,060,662

## (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		<u>222,096</u>
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		39,994,517
利益剰余金合計		<u>47,335,107</u>
株主資本合計		<u>49,557,335</u>

## 評価・換算差額等

その他有価証券		1,488,562
評価差額金		
評価・換算差額等合計		<u>1,488,562</u>

## 純資産合計

51,045,897

## 負債純資産合計

59,106,560

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
<b>営業収益</b>		
委託者報酬		26,575,676
投資顧問料		53,790
その他営業収益		55,619
営業収益合計		26,685,086
<b>営業費用</b>		
支払手数料		10,846,750
広告宣伝費		330,957
公告費		1,062
調査費		
調査費		486,652
委託調査費		5,888,736
事務委託費		116,669
営業雑経費		
通信費		46,024
印刷費		243,552
協会費		20,030
諸会費		4,256
事務機器関連費		509,881
その他営業雑経費		4,944
営業費用合計		18,499,516
<b>一般管理費</b>		
給料		
役員報酬		103,937
給料・手当		1,649,702
賞与引当金繰入		534,891
福利厚生費		294,158
交際費		10,544
旅費交通費		75,335
租税公課		62,774
不動産賃借料		349,810
退職給付費用		192,772
役員退職慰労引当金繰入		11,027
固定資産減価償却費	1	214,015
諸経費		136,511
一般管理費合計		3,635,481
営業利益		4,550,087

(単位：千円)

第29期中間会計期間	
(自 平成25年4月1日	
至 平成25年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	150,506
有価証券利息	2,185
受取利息	10,693
投資有価証券償還益	1,862
収益分配金等時効完成分	54,825
その他	1,293
営業外収益合計	221,366
営業外費用	
その他	4,535
営業外費用合計	4,535
経常利益	4,766,918
特別利益	
投資有価証券売却益	177,223
特別利益合計	177,223
特別損失	
投資有価証券売却損	34,236
固定資産除却損	462
特別損失合計	34,698
税引前中間純利益	4,909,443
法人税、住民税及び事業税	1,913,166
法人税等調整額	17,360
法人税等合計	1,895,805
中間純利益	3,013,637

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25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	39,686,216
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	39,994,517
利益剰余金合計	
当期首残高	47,026,806
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	47,335,107
株主資本合計	
当期首残高	49,249,033
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	49,557,335
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	1,797,355



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)	308,792
当中間期変動額合計	308,792
当中間期末残高	1,488,562
評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,797,355
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)	308,792
当中間期変動額合計	308,792
当中間期末残高	1,488,562
純資産合計	
当期首残高	51,046,388
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	308,792
当中間期変動額合計	490
当中間期末残高	51,045,897

## [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、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

## (会計上の見積もりの変更)

数理計算上の差異は、従来、発生年度の従業員の平均支払期間内の一定の年数(8年)により費用処理しておりましたが、当中間会計期間において、平均支払期間が8年を下回ったことから、数理計算上の差異を一括費用処理する方法に見直し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税金等調整前中間純利益はそれぞれ108百万円減少しております。

## (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、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## [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29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)	
建物	245,895千円
器具備品	349,802千円

## 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29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)	
有形固定資産	39,230千円
無形固定資産	174,785千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日至平成25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25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

## (金融商品関係)

第29期中間会計期間(平成25年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	23,548,500	23,548,500	-
(2) 有価証券	6,562,983	6,562,983	-
(3) 未収委託者報酬	4,948,498	4,948,498	-
(4) 長期性預金	2,000,000	2,000,898	898
(5) 投資有価証券	16,743,308	16,743,308	-
資産計	53,803,291	53,804,190	898
(1) 未払手数料	1,982,655	1,982,655	-
(2) 未払法人税等	1,913,828	1,913,828	-
負債計	3,896,483	3,896,483	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券

譲渡性預金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、投資信託は基準価額によっております。

## (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29期中間会計期間（平成25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	11,667,373	9,779,767	1,887,605
	小計	11,667,373	9,779,767	1,887,605
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	5,638,918	5,667,796	28,877
	小計	5,638,918	5,667,796	28,877
合計		17,306,292	15,447,564	1,858,727

（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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25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29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)
1株当たり純資産額	411,335.37円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	51,045,897
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	51,045,897
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29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	24,284.33円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	3,013,637
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)	3,013,637
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25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25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。
株式会社横浜銀行	215,628 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	29,249 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。
エース証券株式会社	8,831 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。
立花証券株式会社	6,695 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。
東洋証券株式会社	13,494 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。
野村證券株式会社	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。
ひろぎんウツミ屋証券株式会社	6,100 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せん。
-----------------------	------------	--------------------------------

## 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26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6月24日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成26年3月5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 和田 渉 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25年1月29日から平成26年1月27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26年1月27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、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成25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	樋口 誠之	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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成25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25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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