

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年4月25日
【計算期間】	第6期（自平成27年1月27日 至平成28年1月26日）
【ファンド名】	eMAXIS 全世界株式インデックス
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 金上 孝
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

【提出書類】	募集事項等記載書面
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年4月25日
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 金上 孝
【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

（注）金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条第12項の規定により、募集事項等記載書面を有価証券報告書と併せて提出することにより、有価証券届出書を提出したものとみなされます。

**【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国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：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国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：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28年4月26日から平成29年4月25日までです。

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034(受付時間: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。

## 【有価証券報告書】

## 第一部【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
	海外	債券		
追加型	内外	不動産投信	ETF	特殊型 ( )
		その他資産 ( )		
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
一般 大型株 中小型株	年2回 年4回 年6回	日本 北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
債券	年12回 (隔月)	欧州 アジア			その他 (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))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
一般 公債 社債 その他債券	年12回 (毎月) 日々 その他	オセアニア 中南米 アフリカ				その他 ( )
クレジット 属性 ( )	( )	中近東 (中東) エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証 券(株式一 般))						
資産複合 ( )						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

## 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の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

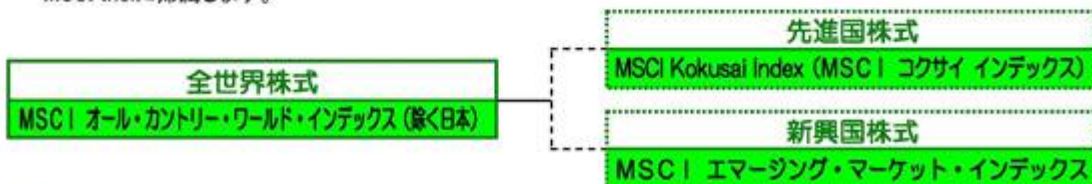
日本を除く先進国および新興国の株式市場の値動きに連動する投資成果をめざします。

## ファンドの特色

特色  
**1**

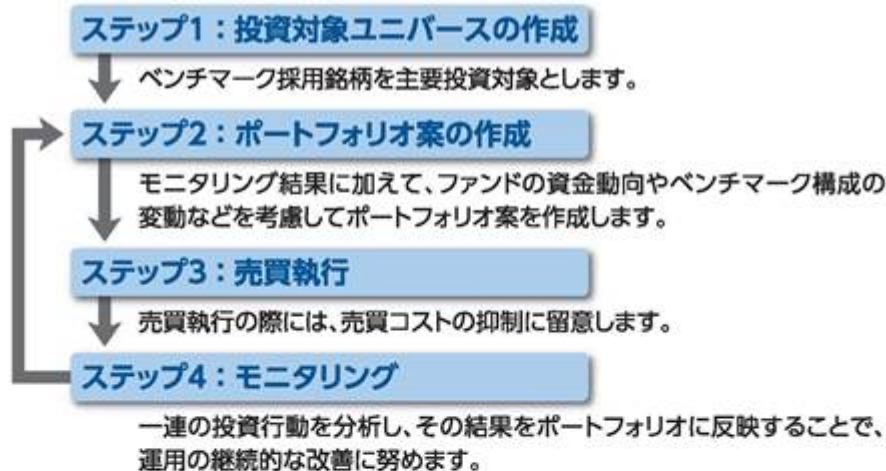
**MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。**

- 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。



■ 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。

### <運用プロセスのイメージ>



■ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。  
 ■ 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

特色  
**2**

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

- 対象インデックスとの連動性を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
  - DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

### 特色 3

## 原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

### ■ファンドの仕組み

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

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

## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「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28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
平成27年7月	三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更

## ・大株主の状況（平成28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	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
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	31,757株	15.0%

## 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. 金利先渡取引および為替先渡取引

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする外国株式インデックスマザーファンド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. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 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、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、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。

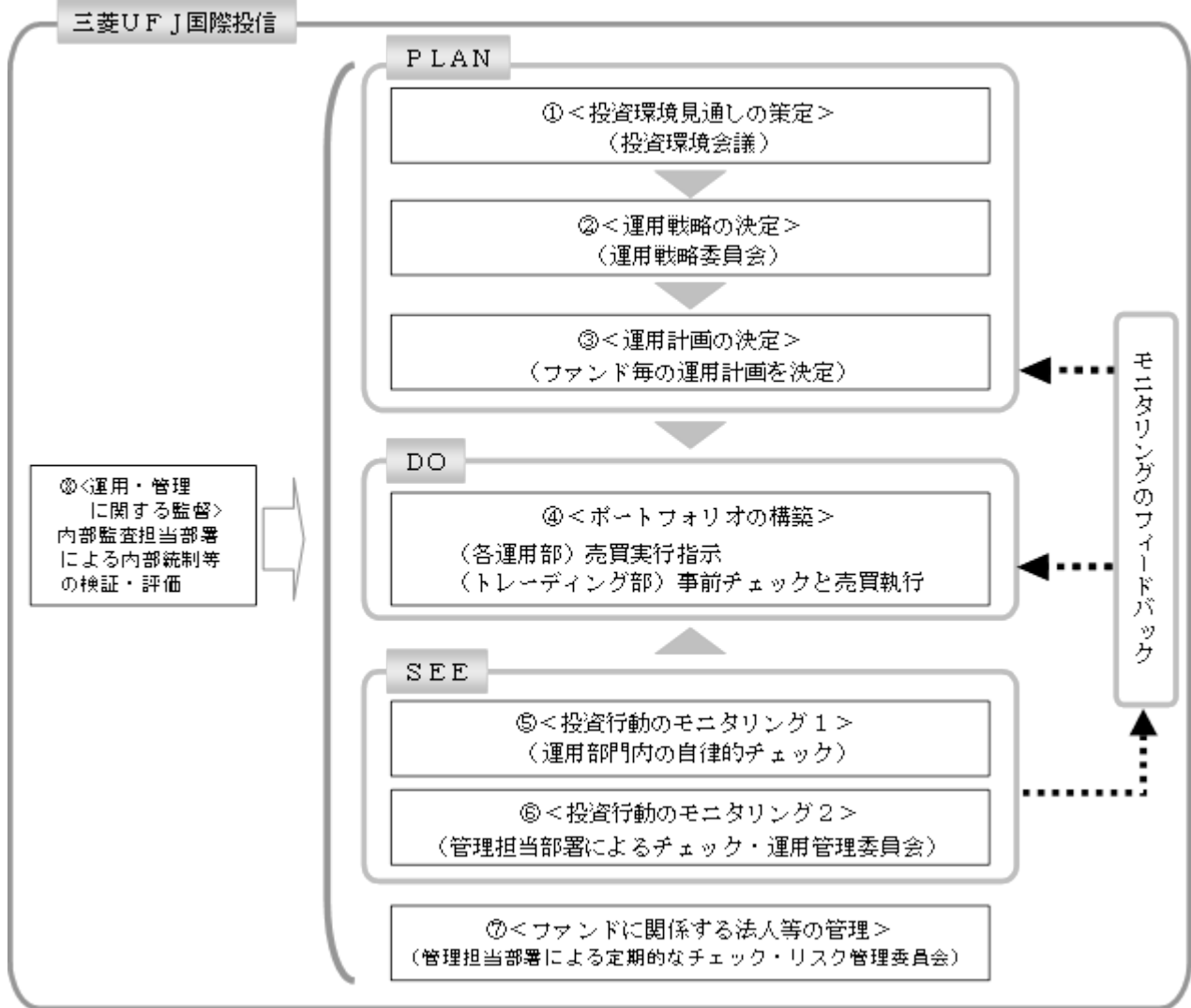
有価証券先物取引等を行うことができます。

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(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

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、今後変更される可能性があります。

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

#### (5)【投資制限】

##### <信託約款に定められた投資制限>

##### 新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

##### 投資信託証券

a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。))を除きます。以下a.およびb.において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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

##### 同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

##### 同一銘柄の転換社債等

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

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

##### スワップ取引

a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。))を行うことの指図をすることができます。

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

#### 信用取引

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

#### 外国為替予約取引

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

#### 有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

#### 資金の借入れ

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

る場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

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

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

デリバティブ取引等

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

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本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

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。

#### 価格変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 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、価格変動・為替変動・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、投資元本を割り込む可能性が高まることがあります。

#### 留意事項

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

### 価格変動リスク・為替変動リスク

価格変動リスク・為替変動リスクは、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、価格変動リスク・為替変動リスクは、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、価格変動リスク・為替変動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。



## (3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

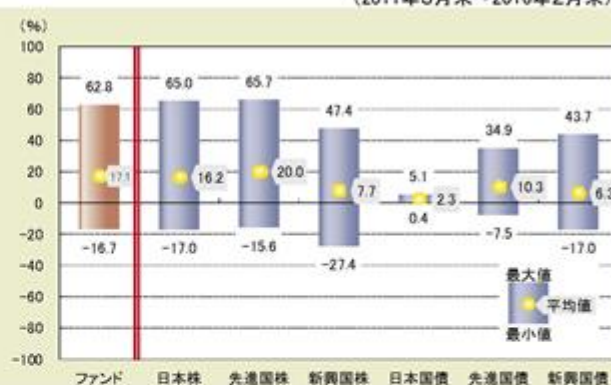
## ●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移



- ・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。
- ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ・2011年6月以前はベンチマークの年間騰落率を用いています。

## ●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年3月末～2016年2月末)



- ・グラフは、ファンド(ベンチマークの年間騰落率を含みます。以下同じ。)と代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- ・全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・2011年3月～2016年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込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%）

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 ×（保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

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 <sup>(注)</sup>	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。なお、当ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

## 費用または費用を対価とする役務の内容について

費用名	直接・間接	説明
申込手数料	直接	商品および投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等の対価
換金（解約）手数料	直接	商品の換金に関する事務手続等の対価
信託財産留保額	直接	信託期間の途中で換金する場合に、換金に必要な費用を賄うため換金代金から控除され、信託財産中に留保される額
信託報酬	間接	（委託会社（再委託先への報酬を含む場合があります。）） ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 （販売会社） 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の説明・情報提供等の対価 （受託会社） 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
監査報酬	間接	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
売買委託手数料	間接	有価証券等を売買する際に発生する費用
保管費用 （カストディフィー）	間接	外国での資産の保管等に要する費用

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

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

## １．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

## ２．解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算は



できません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本について

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

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

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

#### 収益分配金について

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

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

上記は平成28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28年2月29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	5,052,838,657	99.98
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		816,229	0.02
純資産総額		5,053,654,886	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28年2月29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		2,343,474,380	1.9522	4,575,157,241		89.58
					1.9318	4,527,123,807		
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		317,998,337	1.6609	528,187,765		10.40
					1.6532	525,714,850		

(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28年2月29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28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)
第5計算期間末日 (平成27年1月26日)	4,592,029,155 (分配付) 4,592,029,155 (分配落)	21,598 (分配付) 21,598 (分配落)
第6計算期間末日 (平成28年1月26日)	5,049,037,173 (分配付) 5,049,037,173 (分配落)	19,074 (分配付) 19,074 (分配落)
平成27年2月末日	4,851,494,590	22,663
3月末日	4,916,386,909	22,579
4月末日	5,084,085,949	22,964
5月末日	5,382,601,158	23,844
6月末日	5,309,142,943	22,846

7月末日	5,531,258,360	23,265
8月末日	5,246,598,868	21,342
9月末日	4,987,194,474	19,899
10月末日	5,631,261,606	22,043
11月末日	5,738,115,193	22,218
12月末日	5,659,600,295	21,633
平成28年 1月末日	5,233,261,821	19,693
2月末日	5,053,654,886	18,876

## 【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
第5計算期間	0円
第6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
第5計算期間	23.91
第6計算期間	11.68

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

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第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
第5計算期間	1,331,206,565	692,308,491	2,126,111,352
第6計算期間	1,196,209,334	675,187,922	2,647,132,764

&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28年2月29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	137,815,140,475	61.96
	イギリス	16,988,641,681	7.64
	スイス	8,325,852,041	3.74
	フランス	8,077,099,250	3.63
	ドイツ	7,839,319,053	3.52
	カナダ	7,741,785,421	3.48
	オーストラリア	5,423,722,500	2.44
	オランダ	3,070,505,126	1.38
	スペイン	2,729,301,129	1.23
	香港	2,618,799,098	1.18
	スウェーデン	2,613,307,216	1.17
	デンマーク	1,737,655,988	0.78
	イタリア	1,733,887,208	0.78
	ベルギー	1,264,112,117	0.57

	シンガポール	1,034,664,710	0.47
	フィンランド	911,874,850	0.41
	イスラエル	599,901,162	0.27
	ノルウェー	513,457,511	0.23
	アイルランド	444,045,609	0.20
	ルクセンブルグ	162,735,653	0.07
	オーストリア	157,087,687	0.07
	ニュージーランド	141,986,178	0.06
	ポルトガル	131,533,010	0.06
投資証券	アメリカ	4,289,877,272	1.93
	オーストラリア	564,556,095	0.25
	フランス	337,323,108	0.15
	イギリス	268,087,145	0.12
	香港	99,732,523	0.04
	シンガポール	99,579,849	0.04
	カナダ	49,033,459	0.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		4,632,571,322	2.11
純資産総額		222,417,175,446	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28年2月29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）	4,744,616,317	2.13

（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28年2月29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	397,022	13,662.80 11,010.91	5,424,479,114 4,371,575,177		1.97
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	528,933	5,484.43 5,828.70	2,901,192,987 3,082,994,950		1.39
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	290,276	9,553.16 9,288.43	2,773,361,901 2,696,209,758		1.21
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	192,753	11,401.76 12,018.72	2,197,895,189 2,316,645,030		1.04
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	657,086	3,113.18 3,340.42	2,045,759,000 2,194,948,472		0.99
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	339,474	6,179.79 5,461.71	2,098,036,010 1,854,109,694		0.83
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	149,456	9,757.68 12,261.87	1,458,488,054 1,832,610,102		0.82
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信 サービス	428,008	3,821.04 4,218.71	1,635,831,343 1,805,641,886		0.81
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・ タバコ	221,929	8,294.42 8,027.77	1,840,947,612 1,781,596,632		0.80
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	27,678	54,837.55 63,085.23	1,517,814,861 1,746,073,067		0.79
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・ パーソナル用品	188,809	8,972.57 9,214.58	1,694,210,409 1,739,796,012		0.78
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・ サービス	21,551	66,860.82 80,110.05	1,440,923,543 1,726,451,760		0.78
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	257,441	7,322.80 6,537.69	1,885,274,643 1,683,070,687		0.76
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・ サービス	20,179	68,648.06 82,358.59	1,385,260,327 1,661,914,052		0.75
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信 サービス	283,024	5,518.52 5,796.89	1,562,077,181 1,640,659,674		0.74

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	429,276	3,786.95 3,434.73	1,626,095,884 1,474,448,271	0.66
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	48,914	30,253.72 29,638.39	1,479,850,443 1,449,732,453	0.65
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	287,582	4,697.05 4,901.56	1,351,023,086 1,409,602,383	0.63
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	158,384	10,513.02 8,210.09	1,665,130,653 1,300,348,082	0.58
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	89,370	13,139.01 14,345.66	1,174,286,599 1,282,071,741	0.58
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	130,917	11,404.03 9,583.84	1,493,127,362 1,254,688,497	0.56
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	82,450	16,046.55 14,988.75	1,323,108,196 1,235,822,470	0.56
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	111,607	12,174.38 10,829.12	1,358,779,915 1,208,605,841	0.54
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	102,228	11,023.41 11,175.66	1,126,911,728 1,142,465,697	0.51
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	172,827	6,597.91 6,579.73	1,140,441,285 1,137,155,722	0.51
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	196,045	6,500.20 5,753.71	1,274,476,156 1,127,987,410	0.51
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	135,802	8,042.02 8,263.58	1,092,145,781 1,122,211,044	0.50
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	107,840	9,634.97 10,390.54	1,039,082,452 1,120,516,804	0.50
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	330,935	3,666.51 3,385.87	1,213,680,629 1,120,504,874	0.50
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	354,031	3,222.26 3,000.70	1,140,874,174 1,062,342,308	0.48

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

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年2月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	6.60
	素材	4.30
	資本財	7.06
	商業・専門サービス	0.89
	運輸	1.88
	自動車・自動車部品	1.54
	耐久消費財・アパレル	1.86
	消費者サービス	1.92
	メディア	3.03
	小売	3.94
	食品・生活必需品小売り	2.23
	食品・飲料・タバコ	6.55
	家庭用品・パーソナル用品	2.34
	ヘルスケア機器・サービス	3.70
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.82
	銀行	8.15
	各種金融	3.74
	保険	4.14
	不動産	0.62
	ソフトウェア・サービス	8.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.01
	電気通信サービス	3.38
	公益事業	3.41
半導体・半導体製造装置	1.72	
小計	95.35	
投資証券		2.57
合計		97.92

(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

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								
SP EMINI (2016年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	280	アメリカドル	26,522,690.30	27,198,500.00	3,090,293,570	1.39
FTSE100 (2016年3月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	39	イギリスポンド	2,275,197.50	2,371,200.00	373,511,424	0.17
SP/TSE60 (2016年3月限)	モントリオール取引所	買建	16	カナダドル	2,364,380.00	2,393,600.00	200,607,616	0.09
SPI 200 (2016年3月限)	シドニー先物取引所	買建	19	オーストラリアドル	2,288,451.00	2,305,175.00	186,603,916	0.08
EURO ST (2016年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	194	ユーロ	5,618,573.50	5,684,200.00	705,466,062	0.32
SWISS IX (2016年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	21	スイスフラン	1,661,938.75	1,651,020.00	188,133,729	0.08

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

## < 参考 >

### 「新興国株式インデックスマザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成28年2月29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	6,683,131,466	20.91
	韓国	4,657,917,059	14.57
	台湾	3,889,252,329	12.17
	インド	2,445,926,522	7.65
	アメリカ	2,201,339,868	6.89
	南アフリカ	1,981,121,238	6.20
	ブラジル	1,675,156,729	5.24
	メキシコ	1,335,040,664	4.18
	マレーシア	1,059,251,563	3.31
	インドネシア	889,921,567	2.78
	タイ	716,106,017	2.24
	フィリピン	449,830,838	1.41
	トルコ	437,872,036	1.37
	ポーランド	412,987,091	1.29
	チリ	399,929,401	1.25
	カタール	316,473,082	0.99
	アラブ首長国連邦	269,187,388	0.84
	コロンビア	135,243,649	0.42
	ギリシャ	105,421,861	0.33
	ハンガリー	86,492,781	0.27
チェコ	56,059,506	0.18	
投資証券	南アフリカ	94,494,426	0.30
	メキシコ	45,997,372	0.14
	トルコ	15,210,107	0.05
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,603,485,555	5.02
純資産総額		31,962,850,115	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28年2月29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）	1,684,114,270	5.27

（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28年2月29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)		
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体製 造装置	2,030,000	501.61 508.09	1,018,297,667 1,031,422,700		3.23
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	9,209	120,823.33 107,355.20	1,112,662,364 988,634,036		3.09
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	429,800	2,293.00 2,086.27	985,592,356 896,680,565		2.81
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信 サービス	510,500	1,556.88 1,234.65	794,797,914 630,293,419		1.97
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	6,995,550	106.14 66.95	742,788,425 468,419,229		1.47
南アフリ カ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	33,180	12,647.04 13,075.80	419,629,371 433,855,044		1.36
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	6,130,350	93.71 56.57	574,901,175 346,851,524		1.09
アメリカ	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	41,750	9,516.81 7,602.31	397,350,223 317,396,617		0.99
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	1,174,764	301.85 265.98	354,618,637 312,463,728		0.98
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	6,602,000	74.12 42.98	489,803,200 283,772,445		0.89
インド	INFOSYS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	149,170	1,662.70 1,849.89	248,025,704 275,949,210		0.86
アメリカ	BAIDU INC - SPON ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	11,500	24,389.66 19,747.15	280,490,122 227,092,294		0.71
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	124,550	2,033.24 1,738.60	253,240,727 216,543,252		0.68
香港	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	株式	保険	433,000	797.66 488.30	345,419,037 211,437,364		0.66
アメリカ	GAZPROM PAO -SPON ADR	株式	エネルギー	485,500	663.54 413.00	322,529,610 200,515,723		0.63
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信 サービス	2,619,000	92.61 76.07	242,573,646 199,228,901		0.62
ブラジル	AMBEV SA	株式	食品・飲料・ タバコ	383,900	562.23 500.86	215,841,594 192,283,340		0.60
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・ 自動車部品	13,210	15,342.17 13,465.20	202,670,139 177,875,292		0.56
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,484,000	181.87 119.73	269,974,239 177,690,895		0.56
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	株式	銀行	248,752	968.49 701.72	240,915,540 174,555,994		0.55
インド	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	エネルギー	106,080	1,483.53 1,568.07	157,373,021 166,341,661		0.52
メキシコ	FOMENTO ECONOMICO MEXICA- UBD	株式	食品・飲料・ タバコ	153,000	908.49 1,059.45	138,999,459 162,096,247		0.51
アメリカ	LUKOIL PJSC-SPON ADR	株式	エネルギー	40,750	5,825.29 3,897.16	237,424,402 158,809,514		0.50
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	619,000	542.69 253.80	335,993,974 157,104,180		0.49
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	1,634	92,651.56 89,035.20	151,392,765 145,483,516		0.46
インド	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	39,350	4,225.02 3,647.32	166,254,655 143,522,238		0.45
アメリカ	SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	株式	銀行	203,100	661.26 680.58	134,364,296 138,226,569		0.43
香港	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	株式	エネルギー	2,122,000	101.60 64.76	215,614,298 137,434,725		0.43
南アフリ カ	SASOL LTD	株式	エネルギー	44,900	3,186.98 3,052.70	143,095,410 137,066,553		0.43

韓国	SK HYNIX INC	株式	半導体・半導体製造装置	48,460	4,159.92 2,821.28	201,589,839 136,719,228		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28年2月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	7.08
	素材	6.07
	資本財	4.76
	商業・専門サービス	0.16
	運輸	1.64
	自動車・自動車部品	3.31
	耐久消費財・アパレル	1.46
	消費者サービス	0.75
	メディア	2.11
	小売	1.58
	食品・生活必需品小売り	1.77
	食品・飲料・タバコ	4.68
	家庭用品・パーソナル用品	1.58
	ヘルスケア機器・サービス	0.78
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.02
	銀行	16.13
	各種金融	2.84
	保険	3.56
	不動産	2.47
	ソフトウェア・サービス	7.66
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.14
	電気通信サービス	6.76
	公益事業	3.08
半導体・半導体製造装置	5.10	
小計	94.50	
投資証券		0.49
合計		94.98

(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

平成28年2月29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 (2016年3月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	403	アメリカドル	15,047,613.50	14,822,340.00	1,684,114,270	5.27

(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。

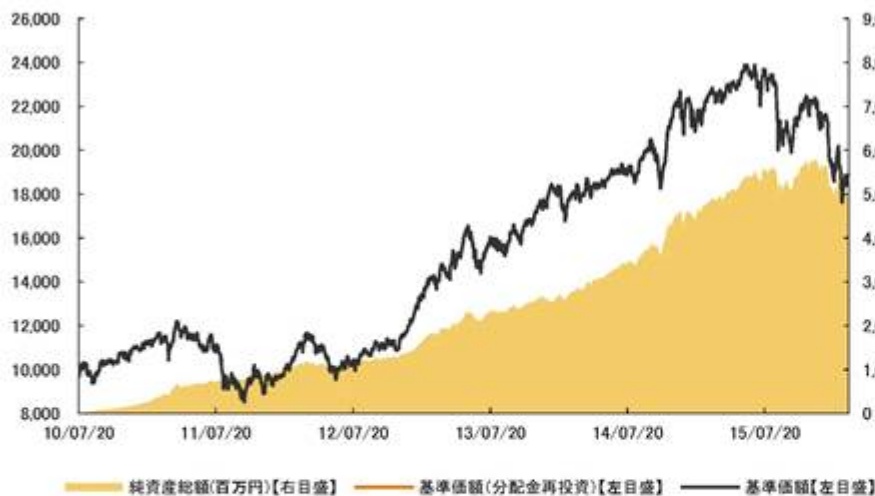


[ 参考情報 ]



## 運用実績

### ■ 基準価額・純資産の推移(設定日～2016年2月29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

### ■ 分配の推移

2016年 1月	0円
2015年 1月	0円
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

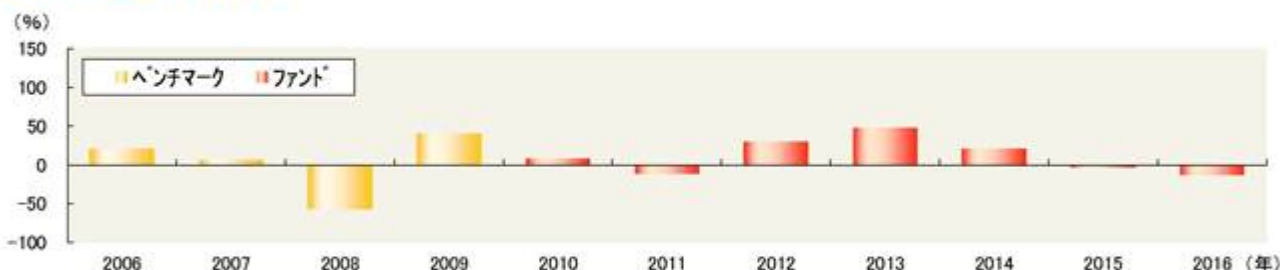
### ■ 主要な資産の状況(2016年2月29日現在)

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	59.3%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.8%
ユーロ	11.1%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.2%
イギリスポンド	7.1%	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.1%
スイスフラン	3.4%	4 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.9%
香港ドル	3.4%	5 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	0.9%
カナダドル	3.2%	6 WELLS FARGO & CO	銀行	アメリカ	0.7%
オーストラリアドル	2.5%	7 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%
韓国ウォン	1.6%	8 AT&T INC	電気通信サービス	アメリカ	0.7%
その他	8.4%	9 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.7%
合計	100.0%	10 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	2.5%

・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)

### ■ 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、2016年は2月29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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：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>
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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：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	<p>平成22年7月20日から無期限</p> <p>ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。</p>
------	--

## (4)【計算期間】

計算期間	<p>原則として、毎年1月27日から翌年1月26日まで</p> <p>上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとし、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。</p>
------	--

## (5) 【その他】

ファンドの償還条件等	<p>委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）</p> <ul style="list-style-type: none"> <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、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を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、議決権を行使することができる受益者の議決権の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、重大な約款変更等を行う場合、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。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。</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	<p>委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。</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	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
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、当期(平成27年1月27日から平成28年1月26日まで)の財務諸表について、PwC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5期 [平成27年1月26日現在]	第6期 [平成28年1月26日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	22,782,301	28,254,201
親投資信託受益証券	4,590,590,694	5,047,485,545
未収利息	35	46
流動資産合計	4,613,373,030	5,075,739,792
資産合計	4,613,373,030	5,075,739,792
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,213,456	8,881,020
未払受託者報酬	1,306,308	1,773,011
未払委託者報酬	11,756,682	15,957,042
その他未払費用	67,429	91,546
流動負債合計	21,343,875	26,702,619
負債合計	21,343,875	26,702,619
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,126,111,352	2,647,132,764
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,465,917,803	2,401,904,409
(分配準備積立金)	985,831,628	823,058,899
元本等合計	4,592,029,155	5,049,037,173
純資産合計	4,592,029,155	5,049,037,173
負債純資産合計	4,613,373,030	5,075,739,792



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期	第6期
	自平成26年1月28日 至平成27年1月26日	自平成27年1月27日 至平成28年1月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	11,155	15,089
有価証券売買等損益	789,748,053	667,177,763
営業収益合計	789,759,208	667,162,674
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,268,588	3,406,562
委託者報酬	20,417,090	30,658,964
その他費用	117,083	175,887
営業費用合計	22,802,761	34,241,413
営業利益又は営業損失( )	766,956,447	701,404,087
経常利益又は経常損失( )	766,956,447	701,404,087
当期純利益又は当期純損失( )	766,956,447	701,404,087
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	132,357,031	20,636,887
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,104,821,979	2,465,917,803
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,272,739,182	1,453,771,512
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,272,739,182	1,453,771,512
剰余金減少額又は欠損金増加額	546,242,774	795,743,932
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	546,242,774	795,743,932
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,465,917,803	2,401,904,409

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	第5期 [平成27年1月26日現在]	第6期 [平成28年1月26日現在]
1 期首元本額	1,487,213,278円	2,126,111,352円
期中追加設定元本額	1,331,206,565円	1,196,209,334円
期中一部解約元本額	692,308,491円	675,187,922円
2 受益権の総数	2,126,111,352口	2,647,132,764口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1598円 (21,598円)	1.9074円 (19,074円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期(自平成26年1月28日 至平成27年1月26日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	78,760,816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	555,838,600円
収益調整金額	C	1,480,086,175円
分配準備積立金額	D	351,232,212円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,465,917,803円
当ファンドの期末残存口数	F	2,126,111,352口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	11,598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6期(自平成27年1月27日 至平成28年1月26日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	84,112,085円
費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	1,578,845,510円
分配準備積立金額	D	738,946,814円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,401,904,409円
当ファンドの期末残存口数	F	2,647,132,764口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	9,073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5期 (自平成26年1月28日 至平成27年1月26日)	第6期 (自平成27年1月27日 至平成28年1月26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 5 期 [ 平成27年1月26日現在 ]	第 6 期 [ 平成28年1月26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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第 5 期 [ 平成27年1月26日現在 ]	第 6 期 [ 平成28年1月26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	757,338,583	668,259,087
合計	757,338,583	668,259,087

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## (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	314,672,616	522,608,280	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,317,953,622	4,524,877,265	
	親投資信託受益証券 小計	2,632,626,238	5,047,485,545	
	合計	2,632,626,238	5,047,485,545	

## 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27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,124,147,679	2,998,700,926
コール・ローン	535,621,171	1,333,438,301
株式	206,963,716,990	200,296,261,254
投資証券	5,149,579,324	5,480,947,269
派生商品評価勘定	78,172,527	6,344,659
未収入金	14,149,611	
未収配当金	188,656,326	191,755,278
未収利息	836	2,176
差入委託証拠金	558,812,150	1,073,291,905
流動資産合計	215,612,856,614	211,380,741,768
資産合計	215,612,856,614	211,380,741,768
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,389,367	58,929,009
未払金	2,782,451	1,059,075,613
未払解約金	557,186,961	387,141,758
流動負債合計	561,358,779	1,505,146,380
負債合計	561,358,779	1,505,146,380
純資産の部		
元本等		
元本	100,110,099,690	107,511,806,135
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	114,941,398,145	102,363,789,253
元本等合計	215,051,497,835	209,875,595,388
純資産合計	215,051,497,835	209,875,595,388
負債純資産合計	215,612,856,614	211,380,741,768

(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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。 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27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26日現在 ]
1 期首	平成26年1月28日	平成27年1月27日
期首元本額	111,499,140,094円	100,110,099,690円
期首からの追加設定元本額	25,227,228,097円	72,132,497,268円
期首からの一部解約元本額	36,616,268,501円	64,730,790,823円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	348,177,193円	649,033,027円
eMAXIS 先進国株式インデックス	12,148,601,425円	15,237,349,494円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	568,394,842円	1,021,572,741円
eMAXIS バランス(波乗り型)	202,010,871円	72,908,969円
コアバランス	407,457円	549,649円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)		58,435円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)		85,988円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)		103,243円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	3,522,640,695円	5,413,112,750円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,890,531,993円	2,317,953,622円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	976,921,684円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	2,288,255,644円	

三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	44,574,668円	
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,041,988円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	14,692,412円	
eMAXIS バランス(4資産均等型)		7,733,793円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	24,745,100,919円	15,902,160,897円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	18,345,275,872円	17,443,418,560円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	401,347,175円	355,149,969円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	3,201,710,391円	3,005,928,592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)	8,988,090,386円	23,587,088,214円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	411,405,326円	280,648,192円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	150,785,491円	121,757,212円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,179,036,763円	2,044,816,843円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	2,597,079,732円	3,183,054,988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)	76,137,077円	54,564,055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)	6,834,962,206円	6,735,356,980円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)		79,913,267円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)		442,804,033円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,950,940,838円	1,958,503,847円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	14,157,781円	9,308,688円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	60,003,397円	29,263,051円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	97,642,046円	60,989,072円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	74,729,159円	53,009,829円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	488,600,144円	206,546,992円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	52,942,563円	36,608,887円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	547,529,225円	318,527,633円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	128,889,246円	74,938,107円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	914,681,433円	568,235,734円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,843,634,914円	4,020,711,646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)	170,157,108円	187,390,081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)	691,817,486円	754,295,234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)	622,733,948円	700,041,098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)	514,458,192円	576,312,723円
(合計)	100,110,099,690円	107,511,806,135円
2 受益権の総数	100,110,099,690口	107,511,806,135口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1481円 (21,481円)	1.9521円 (19,521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26年1月28日 至平成27年1月26日)	(自平成27年1月27日 至平成28年1月26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。 当ファンドは、新株予約権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
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27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	[ 平成27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26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	12,452,994,956	25,794,981,643
投資証券	779,269,050	121,119,928
合計	13,232,264,006	25,916,101,571

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区 分	種 類	[ 平成27年1月26日現在 ]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,957,833,795	3,033,624,020	75,790,225
	合 計	2,957,833,795	3,033,624,020	75,790,225

区 分	種 類	[ 平成28年1月26日現在 ]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,232,217,580	4,183,399,260	48,818,320
	合 計	4,232,217,580	4,183,399,260	48,818,320

## （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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありませぬ。





## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成27年1月26日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			う ち 1 年 超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	71,115,900		70,596,000	519,900
	イギリスポンド	17,808,000		17,658,000	150,000
	ユーロ	13,467,000		13,132,000	335,000
	買建				
	アメリカドル	111,785,550		111,777,000	8,550
	イギリスポンド	12,361,055		12,360,600	455
	スウェーデンクローネ	11,288,160		11,288,000	160
	ユーロ	26,266,800		26,264,000	2,800
合 計	264,092,465		263,075,600	992,935	

区 分	種 類	[ 平成28年1月26日現在 ]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			う ち 1 年 超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	663,921,440		661,528,000	2,393,440
	カナダドル	33,547,280		33,076,000	471,280
	オーストラリアドル	24,866,700		24,603,000	263,700
	イギリスポンド	84,506,080		83,955,000	551,080
	スイスフラン	35,035,890		34,953,000	82,890
	香港ドル	15,150,000		15,150,000	
	スウェーデンクローネ	11,064,480		11,032,000	32,480
	デンマーククローネ	13,736,480		13,736,000	480
	ユーロ	115,305,680		115,335,000	29,320
	合 計	997,134,030		993,368,000	3,766,030

## (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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (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	40,445	137.570000	5,564,018.65	
	ABBOTT LABORATORIES	96,270	39.660000	3,818,068.20	
	ABBVIE INC	107,286	58.650000	6,292,323.90	
	ACCENTURE PLC-CL A	40,394	101.750000	4,110,089.50	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	33,094	34.730000	1,149,354.62	
	ACUITY BRANDS INC	2,823	192.380000	543,088.74	
	ADOBE SYSTEMS INC	32,218	86.770000	2,795,555.86	
	ADT CORP/THE	11,136	28.830000	321,050.88	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	4,723	144.720000	683,512.56	
	AERCAP HOLDINGS NV	5,700	30.800000	175,560.00	
	AES CORP	45,224	8.740000	395,257.76	
	AETNA INC	22,508	105.430000	2,373,018.44	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,532	128.180000	452,731.76	
	AFLAC INC	27,801	56.550000	1,572,146.55	
	AGCO CORP	4,395	44.250000	194,478.75	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,332	37.610000	802,296.52	

AGL RESOURCES INC	8,408	63.440000	533,403.52
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,224	116.310000	1,538,083.44
AIRGAS INC	4,346	137.910000	599,356.86
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	11,581	45.700000	529,251.70
ALBEMARLE CORP	7,345	49.980000	367,103.10
ALCOA INC	84,688	6.800000	575,878.40
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14,652	154.540000	2,264,320.08
ALKERMES PLC	9,664	35.940000	347,324.16
ALLEGHANY CORP	1,038	450.940000	468,075.72
ALLERGAN PLC	25,450	295.950000	7,531,927.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,004	245.390000	982,541.56
ALLIANT ENERGY CORP	7,553	62.360000	471,005.08
ALLSTATE CORP	25,869	57.700000	1,492,641.30
ALLY FINANCIAL INC	28,229	15.330000	432,750.57
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,989	75.520000	376,769.28
ALPHABET INC-CL A	18,782	733.620000	13,778,850.84
ALPHABET INC-CL C	20,073	711.670000	14,285,351.91
ALTRIA GROUP INC	127,035	58.400000	7,418,844.00
AMAZON.COM INC	25,768	596.530000	15,371,385.04
AMERCO	505	350.000000	176,750.00
AMEREN CORPORATION	15,924	42.670000	679,477.08
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,124	38.880000	432,501.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,993	57.750000	1,847,595.75
AMERICAN EXPRESS CO	58,344	55.020000	3,210,086.88
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	83,642	55.360000	4,630,421.12
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,894	61.440000	730,767.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,557	90.320000	1,043,828.24
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,295	91.270000	1,213,434.65
AMETEK INC	15,609	45.900000	716,453.10
AMGEN INC	49,131	153.430000	7,538,169.33
AMPHENOL CORP-CL A	19,888	48.180000	958,203.84
ANADARKO PETROLEUM CORP	33,074	32.310000	1,068,620.94
ANALOG DEVICES INC	20,103	51.050000	1,026,258.15
ANSYS INC	5,852	84.800000	496,249.60
ANTERO RESOURCES CORP	5,389	23.060000	124,270.34
ANTHEM INC	18,075	138.670000	2,506,460.25
AON PLC	18,132	85.740000	1,554,637.68
APACHE CORP	24,627	37.430000	921,788.61
APPLE INC	369,639	99.440000	36,756,902.16
APPLIED MATERIALS INC	77,593	16.910000	1,312,097.63
ARAMARK	14,829	31.180000	462,368.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,930	66.040000	523,697.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,568	32.430000	1,283,190.24
ARROW ELECTRONICS INC	6,185	48.660000	300,962.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,381	36.880000	419,731.28
ASHLAND INC	4,191	95.680000	400,994.88
ASSURANT INC	4,359	78.110000	340,481.49
AT&T INC	398,489	35.000000	13,947,115.00
AUTODESK INC	14,566	47.970000	698,731.02
AUTOLIV INC	5,722	112.300000	642,580.60
AUTOMATIC DATA PROCESSING	30,132	80.090000	2,413,271.88
AUTONATION INC	4,736	45.180000	213,972.48
AUTOZONE INC	1,998	728.520000	1,455,582.96
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	17,943	124.490000	2,233,724.07
AVERY DENNISON CORP	5,963	58.160000	346,808.08
AVNET INC	8,786	38.840000	341,248.24
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,119	23.510000	214,387.69
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,508	52.620000	342,450.96
B/E AEROSPACE INC	6,877	39.950000	274,736.15
BAKER HUGHES INC	28,341	39.180000	1,110,400.38
BALL CORP	8,508	66.630000	566,888.04
BANK OF AMERICA CORP	676,257	12.960000	8,764,290.72
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	71,534	34.670000	2,480,083.78
BAXALTA INC	35,231	41.620000	1,466,314.22
BAXTER INTERNATIONAL INC	35,323	36.050000	1,273,394.15
BB&T CORP	53,852	31.110000	1,675,335.72
BECTON DICKINSON AND CO	13,590	144.900000	1,969,191.00

BED BATH & BEYOND INC	10,988	43.390000	476,769.32
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	76,739	124.130000	9,525,612.07
BEST BUY CO INC	20,502	27.070000	554,989.14
BIOGEN INC	15,237	262.100000	3,993,617.70
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,515	85.010000	893,880.15
BLACKROCK INC	7,939	289.720000	2,300,087.08
BOEING CO/THE	41,806	124.010000	5,184,362.06
BORGWARNER INC	14,752	28.230000	416,448.96
BOSTON SCIENTIFIC CORP	86,991	17.530000	1,524,952.23
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	108,046	62.920000	6,798,254.32
BROADCOM CORP-CL A	35,845	54.050000	1,937,422.25
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,464	92.140000	687,732.96
BUNGE LTD	9,292	59.030000	548,506.76
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,214	62.720000	577,902.08
CA INC	21,336	26.250000	560,070.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,081	31.100000	406,819.10
CABOT OIL & GAS CORP	27,008	18.400000	496,947.20
CALPINE CORP	22,784	13.350000	304,166.40
CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,485	59.110000	737,988.35
CAMPBELL SOUP CO	12,026	54.610000	656,739.86
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,101	58.660000	2,059,024.66
CARDINAL HEALTH INC	21,126	81.200000	1,715,431.20
CARMAX INC	13,464	44.980000	605,610.72
CARNIVAL CORP	26,916	48.800000	1,313,500.80
CATERPILLAR INC	37,076	57.910000	2,147,071.16
CBRE GROUP INC - A	19,391	27.300000	529,374.30
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	28,844	46.290000	1,335,188.76
CDK GLOBAL INC	8,909	42.940000	382,552.46
CDW CORP/DE	9,470	37.950000	359,386.50
CELANESE CORP-SERIES A	9,909	59.640000	590,972.76
CELGENE CORP	51,229	106.700000	5,466,134.30
CENTENE CORP	7,370	61.380000	452,370.60
CENTERPOINT ENERGY INC	27,172	17.100000	464,641.20
CENTURYLINK INC	36,697	23.760000	871,920.72
CERNER CORP	20,147	56.180000	1,131,858.46
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	15,146	28.600000	433,175.60
CHARTER COMMUNICATION-A	5,443	172.340000	938,046.62
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,500	75.450000	339,525.00
CHENIERE ENERGY INC	14,688	29.390000	431,680.32
CHESAPEAKE ENERGY CORP	37,830	2.950000	111,598.50
CHEVRON CORP	121,824	80.890000	9,854,343.36
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,112	33.230000	203,101.76
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,027	442.170000	896,278.59
CHUBB LTD	31,388	108.000000	3,389,904.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,415	79.450000	668,571.75
CIGNA CORP	16,681	135.850000	2,266,113.85
CIMAREX ENERGY CO	6,133	75.600000	463,654.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,069	54.160000	545,337.04
CINTAS CORP	6,087	81.850000	498,220.95
CISCO SYSTEMS INC	329,465	23.170000	7,633,704.05
CIT GROUP INC	11,368	29.350000	333,650.80
CITIGROUP INC	194,981	39.550000	7,711,498.55
CITIZENS FINANCIAL GROUP	33,827	19.790000	669,436.33
CITRIX SYSTEMS INC	10,361	66.050000	684,344.05
CLOROX COMPANY	8,346	125.040000	1,043,583.84
CME GROUP INC	20,755	84.640000	1,756,703.20
CMS ENERGY CORP	18,297	36.380000	665,644.86
COACH INC	17,910	30.350000	543,568.50
COCA-COLA CO/THE	267,755	42.160000	11,288,550.80
COCA-COLA ENTERPRISES	13,921	45.620000	635,076.02
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,472	60.920000	2,404,634.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,356	63.930000	3,538,909.08
COLUMBIA PIPELINE GROUP	25,445	17.250000	438,926.25
COMCAST CORP-CLASS A	160,863	54.210000	8,720,383.23
COMERICA INC	11,561	32.040000	370,414.44
CONAGRA FOODS INC	28,055	39.080000	1,096,389.40
CONCHO RESOURCES INC	8,268	80.680000	667,062.24

CONOCOPHILLIPS	79,828	34.200000	2,730,117.60	
CONSOLIDATED EDISON INC	19,166	67.810000	1,299,646.46	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,140	148.250000	1,651,505.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,814	17.040000	99,070.56	
COOPER COS INC/THE	3,168	125.510000	397,615.68	
CORE LABORATORIES N.V.	2,670	89.730000	239,579.10	
CORNING INC	79,436	16.760000	1,331,347.36	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,453	150.780000	4,290,143.34	
CR BARD INC	4,770	184.100000	878,157.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,138	45.000000	411,210.00	
CSX CORP	63,918	21.970000	1,404,278.46	
CUMMINS INC	11,019	84.050000	926,146.95	
CVS HEALTH CORP	72,205	94.070000	6,792,324.35	
DANAHER CORP	39,767	84.380000	3,355,539.46	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,454	61.470000	458,197.38	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	11,124	65.950000	733,627.80	
DEERE & CO	20,216	71.780000	1,451,104.48	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	18,446	64.280000	1,185,708.88	
DELTA AIR LINES INC	13,140	45.940000	603,651.60	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,858	57.430000	508,714.94	
DEVON ENERGY CORP	25,220	22.770000	574,259.40	
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,879	36.130000	212,408.27	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,211	47.590000	1,342,561.49	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,408	26.250000	246,960.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,940	25.920000	465,004.80	
DISH NETWORK CORP-A	14,501	47.060000	682,417.06	
DOLLAR GENERAL CORP	19,097	72.180000	1,378,421.46	
DOLLAR TREE INC	14,462	76.600000	1,107,789.20	
DOMINION RESOURCES INC/VA	38,687	69.560000	2,691,067.72	
DOVER CORP	10,137	53.060000	537,869.22	
DOW CHEMICAL CO/THE	72,700	42.180000	3,066,486.00	
DR HORTON INC	21,376	26.400000	564,326.40	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,358	91.010000	1,124,701.58	
DTE ENERGY COMPANY	11,686	80.760000	943,761.36	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	58,414	52.990000	3,095,357.86	
DUKE ENERGY CORP	44,751	71.800000	3,213,121.80	
DUN & BRADSTREET CORP	2,330	95.030000	221,419.90	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,874	23.430000	442,217.82	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,621	60.760000	584,571.96	
EATON CORP PLC	30,292	47.270000	1,431,902.84	
EATON VANCE CORP	7,405	27.790000	205,784.95	
EBAY INC	70,773	26.135000	1,849,652.35	
ECOLAB INC	17,185	103.260000	1,774,523.10	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,051	71.880000	291,185.88	
EDISON INTERNATIONAL	21,319	59.920000	1,277,434.48	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,942	80.200000	1,118,148.40	
ELECTRONIC ARTS INC	20,209	69.920000	1,413,013.28	
ELI LILLY & CO	64,630	81.710000	5,280,917.30	
EMC CORP/MA	124,544	23.980000	2,986,565.12	
EMERSON ELECTRIC CO	42,550	42.290000	1,799,439.50	
ENDO INTERNATIONAL PLC	13,853	57.840000	801,257.52	
ENERGEN CORP	4,984	27.910000	139,103.44	
ENSCO PLC-CL A	15,014	8.860000	133,024.04	
ENERGY CORP	11,711	67.580000	791,429.38	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,211	23.150000	282,684.65	
EOG RESOURCES INC	35,552	61.590000	2,189,647.68	
EQT CORP	9,889	56.280000	556,552.92	
EQUIFAX INC	7,851	104.140000	817,603.14	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,645	83.470000	1,222,418.15	
EVEREST RE GROUP LTD	2,832	170.360000	482,459.52	
EVERSOURCE ENERGY	20,813	51.640000	1,074,783.32	
EXELON CORP	56,183	27.160000	1,525,930.28	
EXPEDIA INC	8,037	105.210000	845,572.77	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,323	43.100000	531,121.30	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	43,659	72.310000	3,156,982.29	
EXXON MOBIL CORP	270,179	73.980000	19,987,842.42	
F5 NETWORKS INC	4,628	93.920000	434,661.76	

FACEBOOK INC-A	139,110	97.010000	13,495,061.10
FASTENAL CO	17,761	36.820000	653,960.02
FEDEX CORP	17,398	126.040000	2,192,843.92
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	18,288	58.850000	1,076,248.80
FIFTH THIRD BANCORP	52,622	15.010000	789,856.22
FIREEYE INC	9,042	14.790000	133,731.18
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,245	63.290000	585,116.05
FIRSTENERGY CORP	27,399	31.820000	871,836.18
FISERV INC	15,154	90.160000	1,366,284.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,068	119.010000	603,142.68
FLEXTRONICS INTL LTD	37,197	9.360000	348,163.92
FLIR SYSTEMS INC	9,010	30.170000	271,831.70
FLOWSERVE CORP	8,724	35.920000	313,366.08
FLUOR CORP	9,444	42.350000	399,953.40
FMC CORP	8,717	33.650000	293,327.05
FMC TECHNOLOGIES INC	14,467	23.380000	338,238.46
FNF GROUP	16,343	31.570000	515,948.51
FOOT LOCKER INC	9,010	64.470000	580,874.70
FORD MOTOR CO	239,745	11.980000	2,872,145.10
FORTINET INC	9,353	27.210000	254,495.13
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	10,405	47.540000	494,653.70
FRANKLIN RESOURCES INC	25,922	32.530000	843,242.66
FREEMPORT-MCMORAN INC	68,593	3.940000	270,256.42
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	76,643	4.190000	321,134.17
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,687	25.060000	167,576.22
GAP INC/THE	16,299	23.060000	375,854.94
GARMIN LTD	7,322	33.200000	243,090.40
GARTNER INC	5,431	83.280000	452,293.68
GENERAL DYNAMICS CORP	17,729	124.600000	2,209,033.40
GENERAL ELECTRIC CO	611,757	28.040000	17,153,666.28
GENERAL MILLS INC	38,798	54.800000	2,126,130.40
GENERAL MOTORS CO	92,255	29.230000	2,696,613.65
GENUINE PARTS CO	9,740	79.300000	772,382.00
GILEAD SCIENCES INC	95,095	90.610000	8,616,557.95
GLOBAL PAYMENTS INC	8,411	57.660000	484,978.26
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,218	151.120000	3,810,944.16
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,554	27.810000	488,176.74
H&R BLOCK INC	15,289	32.470000	496,433.83
HALLIBURTON CO	59,076	29.280000	1,729,745.28
HANESBRANDS INC	25,930	29.080000	754,044.40
HARLEY-DAVIDSON INC	13,393	40.090000	536,925.37
HARMAN INTERNATIONAL	4,652	77.850000	362,158.20
HARRIS CORP	8,028	84.130000	675,395.64
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	26,849	37.630000	1,010,327.87
HASBRO INC	7,310	70.910000	518,352.10
HCA HOLDINGS INC	21,560	65.580000	1,413,904.80
HELMERICH & PAYNE	6,778	43.930000	297,757.54
HENRY SCHEIN INC	5,363	144.700000	776,026.10
HERSHEY CO/THE	9,829	83.770000	823,375.33
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,875	9.330000	241,413.75
HESS CORP	16,672	34.380000	573,183.36
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	117,863	13.340000	1,572,292.42
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	31,969	17.420000	556,899.98
HOLLYFRONTIER CORP	11,724	33.840000	396,740.16
HOLOGIC INC	15,541	35.690000	554,658.29
HOME DEPOT INC	83,178	121.710000	10,123,594.38
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	48,069	96.480000	4,637,697.12
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	38,000	5.950000	226,100.00
HORMEL FOODS CORP	9,343	75.520000	705,583.36
HP INC	117,409	9.490000	1,114,211.41
HUMANA INC	9,695	163.290000	1,583,096.55
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,108	68.830000	420,413.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	51,972	8.800000	457,353.60
IHS INC-CLASS A	4,464	96.560000	431,043.84
ILLINOIS TOOL WORKS	21,301	81.050000	1,726,446.05
ILLUMINA INC	9,385	174.480000	1,637,494.80
IMS HEALTH HOLDINGS INC	10,598	23.060000	244,389.88

INCYTE CORP	10,459	78.310000	819,044.29
INGERSOLL-RAND PLC	17,287	48.820000	843,951.34
INTEL CORP	307,730	29.600000	9,108,808.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,687	248.770000	1,912,294.99
INTERNATIONAL PAPER CO	25,799	32.580000	840,531.42
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,589	21.730000	577,778.97
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60,314	122.080000	7,363,133.12
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,213	110.400000	575,515.20
INTUIT INC	17,070	91.730000	1,565,831.10
INTUITIVE SURGICAL INC	2,401	558.220000	1,340,286.22
INVESCO LTD	27,548	28.650000	789,250.20
IONIS PHARMACEUTICALS INC	7,863	46.190000	363,191.97
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,073	36.720000	296,440.56
JARDEN CORP	12,958	50.800000	658,266.40
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,988	131.400000	524,023.20
JM SMUCKER CO/THE	7,401	121.850000	901,811.85
JOHNSON & JOHNSON	179,436	96.400000	17,297,630.40
JOHNSON CONTROLS INC	42,404	34.210000	1,450,640.84
JONES LANG LASALLE INC	2,924	134.840000	394,272.16
JPMORGAN CHASE & CO	239,575	55.660000	13,334,744.50
JUNIPER NETWORKS INC	22,406	26.190000	586,813.14
KANSAS CITY SOUTHERN	7,190	65.200000	468,788.00
KELLOGG CO	17,198	70.510000	1,212,630.98
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,453	88.910000	662,646.23
KEYCORP	54,198	10.850000	588,048.30
KIMBERLY-CLARK CORP	23,570	122.690000	2,891,803.30
KINDER MORGAN INC	121,062	14.190000	1,717,869.78
KLA-TENCOR CORP	10,189	64.650000	658,718.85
KOHL'S CORP	12,764	47.360000	604,503.04
KRAFT HEINZ CO/THE	39,289	74.030000	2,908,564.67
KROGER CO	60,305	36.670000	2,211,384.35
L BRANDS INC	16,094	95.270000	1,533,275.38
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,200	110.270000	573,404.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,513	110.990000	722,877.87
LAM RESEARCH CORP	10,190	68.000000	692,920.00
LAS VEGAS SANDS CORP	25,973	39.110000	1,015,804.03
LEAR CORP	4,992	100.080000	499,599.36
LEGG MASON INC	6,291	29.500000	185,584.50
LEGGETT & PLATT INC	8,951	39.350000	352,221.85
LENNAR CORP-A	11,336	40.600000	460,241.60
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,573	16.480000	355,523.04
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	19,705	46.750000	921,208.75
LIBERTY GLOBAL PLC-A	16,315	33.840000	552,099.60
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	39,800	32.700000	1,301,460.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	28,829	24.710000	712,364.59
LIBERTY MEDIA CORP - A	5,742	35.330000	202,864.86
LIBERTY MEDIA CORP - C	13,216	34.000000	449,344.00
LINCOLN NATIONAL CORP	16,161	38.530000	622,683.33
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,465	40.840000	631,590.60
LINKEDIN CORP - A	7,450	193.540000	1,441,873.00
LKQ CORP	19,811	26.060000	516,274.66
LOCKHEED MARTIN CORP	18,077	211.010000	3,814,427.77
LOEWS CORP	18,744	34.210000	641,232.24
LOWE'S COS INC	59,897	69.900000	4,186,800.30
LULULEMON ATHLETICA INC	7,365	57.630000	424,444.95
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,648	75.840000	1,945,144.32
M & T BANK CORP	9,330	101.790000	949,700.70
MACY'S INC	21,562	39.320000	847,817.84
MALLINCKRODT PLC	7,636	63.470000	484,656.92
MANPOWERGROUP INC	5,012	72.630000	364,021.56
MARATHON OIL CORP	44,415	8.140000	361,538.10
MARATHON PETROLEUM CORP	34,769	40.770000	1,417,532.13
MARKEL CORP	900	841.590000	757,431.00
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	13,688	60.120000	822,922.56
MARSH & MCLENNAN COS	34,285	51.570000	1,768,077.45
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,707	117.360000	435,053.52
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,210	8.180000	214,397.80

MASCO CORP	22,366	25.370000	567,425.42
MASTERCARD INC-CLASS A	64,655	86.770000	5,610,114.35
MATTEL INC	21,919	26.740000	586,114.06
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,395	31.630000	581,833.85
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,484	80.940000	605,754.96
MCDONALD'S CORP	60,989	119.200000	7,269,888.80
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	17,666	83.870000	1,481,647.42
MCKESSON CORP	15,026	170.170000	2,556,974.42
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,210	68.910000	910,301.10
MEDIVATION INC	10,694	36.570000	391,079.58
MEDNAX INC	6,108	68.540000	418,642.32
MEDTRONIC PLC	91,627	75.700000	6,936,163.90
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	6,000	13.400000	80,400.00
MERCK & CO. INC.	182,517	50.920000	9,293,765.64
METLIFE INC	61,348	43.000000	2,637,964.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,796	316.020000	567,571.92
MGM RESORTS INTERNATIONAL	29,196	18.890000	551,512.44
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,583	36.730000	462,173.59
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,657	43.200000	589,982.40
MICRON TECHNOLOGY INC	69,626	10.480000	729,680.48
MICROSOFT CORP	492,499	51.790000	25,506,523.21
MOBILEYE NV	5,400	28.770000	155,358.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,056	164.430000	666,928.08
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,942	87.600000	870,919.20
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	104,337	40.200000	4,194,347.40
MONSANTO CO	30,297	87.320000	2,645,534.04
MONSTER BEVERAGE CORP	9,345	140.090000	1,309,141.05
MOODY'S CORP	11,719	86.750000	1,016,623.25
MORGAN STANLEY	94,893	24.980000	2,370,427.14
MOSAIC CO/THE	20,759	22.400000	465,001.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,297	62.420000	642,738.74
MURPHY OIL CORP	10,487	16.810000	176,286.47
MYLAN NV	27,136	52.620000	1,427,896.32
NASDAQ INC	7,683	56.600000	434,857.80
NATIONAL OILWELL VARCO INC	24,666	29.690000	732,333.54
NAVIENT CORP	23,962	8.870000	212,542.94
NETAPP INC	19,567	21.220000	415,211.74
NETFLIX INC	26,224	99.120000	2,599,322.88
NETSUITE INC	2,520	67.920000	171,158.40
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,595	14.510000	458,443.45
NEWELL RUBBERMAID INC	17,315	37.130000	642,905.95
NEWMONT MINING CORP	34,270	17.670000	605,550.90
NEWS CORP - CLASS A	24,839	12.500000	310,487.50
NEXTERA ENERGY INC	29,391	106.420000	3,127,790.22
NIelsen HOLDINGS PLC	22,710	44.730000	1,015,818.30
NIKE INC -CL B	87,774	60.700000	5,327,881.80
NOBLE ENERGY INC	27,577	27.270000	752,024.79
NORDSTROM INC	9,183	46.870000	430,407.21
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,585	67.730000	1,326,492.05
NORTHERN TRUST CORP	14,367	58.790000	844,635.93
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,496	181.830000	2,090,317.68
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,402	47.320000	492,222.64
NRG ENERGY INC	21,348	8.980000	191,705.04
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,185	17.660000	285,827.10
NUCOR CORP	20,543	34.860000	716,128.98
NVIDIA CORP	34,996	28.420000	994,586.32
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,800	72.380000	636,944.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	61.790000	3,052,796.74
OCEANEERING INTL INC	6,256	31.120000	194,686.72
OGE ENERGY CORP	13,386	24.540000	328,492.44
OMNICOM GROUP	15,752	69.880000	1,100,749.76
ONEOK INC	13,865	23.620000	327,491.30
ORACLE CORP	224,834	34.340000	7,720,799.56
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,428	243.890000	1,567,724.92
P G & E CORP	31,908	51.610000	1,646,771.88
PACCAR INC	23,021	45.710000	1,052,289.91
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,376	50.190000	320,011.44

PALO ALTO NETWORKS INC	4,592	146.570000	673,049.44
PARKER HANNIFIN CORP	8,902	88.120000	784,444.24
PARTNERRE LTD	3,082	139.890000	431,140.98
PATTERSON COS INC	5,622	40.250000	226,285.50
PAYCHEX INC	21,066	47.410000	998,739.06
PAYPAL HOLDINGS INC	71,054	31.470000	2,236,069.38
PENTAIR PLC	11,682	43.580000	509,101.56
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	20,035	13.640000	273,277.40
PEPCO HOLDINGS INC	16,512	26.340000	434,926.08
PEPSICO INC	95,166	95.940000	9,130,226.04
PERRIGO CO PLC	9,500	149.060000	1,416,070.00
PFIZER INC	397,763	30.500000	12,131,771.50
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,404	86.680000	8,703,018.72
PHILLIPS 66	34,795	76.230000	2,652,422.85
PINNACLE WEST CAPITAL	7,390	63.750000	471,112.50
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,494	107.750000	1,130,728.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,172	82.730000	2,744,319.56
POLARIS INDUSTRIES INC	4,105	80.340000	329,795.70
PPG INDUSTRIES INC	17,525	91.110000	1,596,702.75
PPL CORP	43,777	33.760000	1,477,911.52
PRAXAIR INC	18,541	96.130000	1,782,346.33
PRECISION CASTPARTS CORP	8,958	231.210000	2,071,179.18
PRICELINE GROUP INC/THE	3,284	1,097.930000	3,605,602.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,954	37.230000	705,657.42
PROCTER & GAMBLE CO/THE	175,780	76.850000	13,508,693.00
PROGRESSIVE CORP	37,924	29.500000	1,118,758.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,171	67.880000	1,980,127.48
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,066	38.980000	1,288,912.68
PULTEGROUP INC	20,708	15.910000	329,464.28
PVH CORP	5,392	67.580000	364,391.36
QORVO INC	9,791	39.760000	389,290.16
QUALCOMM INC	101,845	47.580000	4,845,785.10
QUANTA SERVICES INC	12,570	17.830000	224,123.10
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,272	65.570000	607,965.04
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,033	63.000000	380,079.00
RALPH LAUREN CORP	3,896	106.530000	415,040.88
RANGE RESOURCES CORP	10,890	24.900000	271,161.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,444	42.800000	361,403.20
RAYTHEON COMPANY	19,622	118.570000	2,326,580.54
REALOGY HOLDINGS CORP	9,593	32.480000	311,580.64
RED HAT INC	11,959	71.740000	857,938.66
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,942	473.120000	2,338,159.04
REGIONS FINANCIAL CORP	85,091	7.570000	644,138.87
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,985	109.880000	327,991.80
REPUBLIC SERVICES INC	15,749	42.410000	667,915.09
RESMED INC	9,131	58.660000	535,624.46
REYNOLDS AMERICAN INC	55,527	46.890000	2,603,661.03
RITE AID CORP	65,957	7.710000	508,528.47
ROBERT HALF INTL INC	8,777	42.850000	376,094.45
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,625	90.660000	781,942.50
ROCKWELL COLLINS INC	8,495	80.480000	683,677.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,523	166.090000	1,083,405.07
ROSS STORES INC	26,800	53.620000	1,437,016.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,437	83.370000	953,502.69
SABRE CORP	11,731	25.310000	296,911.61
SALESFORCE.COM INC	40,352	69.920000	2,821,411.84
SANDISK CORP	13,325	61.740000	822,685.50
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,276	93.710000	775,543.96
SCANA CORP	8,987	60.540000	544,072.98
SCHLUMBERGER LTD	80,500	63.300000	5,095,650.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	76,692	25.170000	1,930,337.64
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,824	58.610000	282,734.64
SEAGATE TECHNOLOGY	19,531	26.400000	515,618.40
SEALED AIR CORP	13,381	38.970000	521,457.57
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,193	43.760000	402,285.68
SEMPRA ENERGY	15,418	92.070000	1,419,535.26
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	11,143	36.010000	401,259.43



SERVICENOW INC	9,573	76.100000	728,505.30
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,133	244.140000	1,253,170.62
SIGNATURE BANK	3,312	128.660000	426,121.92
SIGNET JEWELERS LTD	4,886	118.710000	580,017.06
SIRIUS XM HOLDINGS INC	157,562	3.650000	575,101.30
SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,276	65.590000	805,182.84
SNAP-ON INC	3,766	153.430000	577,817.38
SOUTHERN CO/THE	59,090	47.390000	2,800,275.10
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,009	38.200000	420,543.80
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,231	7.930000	192,151.83
SPECTRA ENERGY CORP	43,636	26.360000	1,150,244.96
SPLUNK INC	8,216	48.660000	399,790.56
SPRINT CORP	49,727	2.520000	125,312.04
ST JUDE MEDICAL INC	18,278	54.160000	989,936.48
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,962	93.610000	932,542.82
STAPLES INC	44,262	8.680000	384,194.16
STARBUCKS CORP	96,117	57.710000	5,546,912.07
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,986	60.510000	664,762.86
STATE STREET CORP	26,435	54.220000	1,433,305.70
STERICYCLE INC	5,482	116.910000	640,900.62
STRYKER CORP	21,879	94.410000	2,065,596.39
SUNTRUST BANKS INC	33,200	34.120000	1,132,784.00
SYMANTEC CORP	43,944	18.820000	827,026.08
SYNCHRONY FINANCIAL	54,089	28.480000	1,540,454.72
SYNOPSIS INC	10,152	41.120000	417,450.24
SYSCO CORP	38,563	39.100000	1,507,813.30
T ROWE PRICE GROUP INC	16,542	65.410000	1,082,012.22
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,357	77.750000	261,006.75
TARGET CORP	38,631	68.920000	2,662,448.52
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	500	149.010000	74,505.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,590	28.460000	500,611.40
TE CONNECTIVITY LTD	26,037	56.370000	1,467,705.69
TEGNA INC	14,081	23.270000	327,664.87
TERADATA CORP	9,000	22.760000	204,840.00
TESLA MOTORS INC	6,330	196.380000	1,243,085.40
TESORO CORP	7,941	85.720000	680,702.52
TEXAS INSTRUMENTS INC	66,224	50.080000	3,316,497.92
TEXTRON INC	17,850	36.830000	657,415.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,800	134.730000	3,476,034.00
TIFFANY & CO	8,342	60.930000	508,278.06
TIME WARNER CABLE	18,277	179.800000	3,286,204.60
TIME WARNER INC	52,850	69.750000	3,686,287.50
TJX COMPANIES INC	43,645	68.760000	3,001,030.20
T-MOBILE US INC	18,404	37.890000	697,327.56
TOLL BROTHERS INC	10,953	26.950000	295,183.35
TORCHMARK CORP	8,146	52.220000	425,384.12
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,779	45.230000	487,534.17
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,748	83.520000	730,632.96
TRANSDIGM GROUP INC	3,472	220.130000	764,291.36
TRAVELERS COS INC/THE	20,088	102.080000	2,050,583.04
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,832	18.790000	316,273.28
TRIPADVISOR INC	7,653	69.490000	531,806.97
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	28,610	26.000000	743,860.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	78,954	26.000000	2,052,804.00
TWITTER INC	37,081	17.020000	631,118.62
TYCO INTERNATIONAL PLC	27,069	34.150000	924,406.35
TYSON FOODS INC-CL A	19,793	51.290000	1,015,182.97
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,932	175.660000	690,695.12
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,577	68.160000	789,088.32
UNION PACIFIC CORP	56,243	68.790000	3,868,955.97
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,338	46.440000	294,336.72
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	45,275	89.420000	4,048,490.50
UNITED RENTALS INC	6,256	54.640000	341,827.84
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,793	84.900000	4,651,925.70
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,972	126.940000	377,265.68
UNITEDHEALTH GROUP INC	61,688	113.380000	6,994,185.44
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,925	108.460000	642,625.50

UNUM GROUP	16,009	27.370000	438,166.33	
US BANCORP	113,904	38.290000	4,361,384.16	
VALERO ENERGY CORP	32,157	65.140000	2,094,706.98	
VANTIV INC - CL A	10,222	43.670000	446,394.74	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,403	75.550000	483,746.65	
VERISIGN INC	6,664	74.620000	497,267.68	
VERISK ANALYTICS INC	10,338	69.950000	723,143.10	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	263,516	47.030000	12,393,157.48	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,889	92.120000	1,463,694.68	
VF CORP	22,083	57.850000	1,277,501.55	
VIACOM INC-CLASS B	22,647	42.030000	951,853.41	
VISA INC-CLASS A SHARES	126,412	71.740000	9,068,796.88	
VMWARE INC-CLASS A	5,070	48.760000	247,213.20	
VOYA FINANCIAL INC	14,659	29.840000	437,424.56	
VULCAN MATERIALS CO	8,583	82.890000	711,444.87	
WABCO HOLDINGS INC	3,614	85.650000	309,539.10	
WABTEC CORP	6,315	62.580000	395,192.70	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	56,619	78.710000	4,456,481.49	
WAL-MART STORES INC	104,374	63.450000	6,622,530.30	
WALT DISNEY CO/THE	103,885	95.290000	9,899,201.65	
WASTE MANAGEMENT INC	29,233	52.240000	1,527,131.92	
WATERS CORP	5,315	127.620000	678,300.30	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	49,045	5.650000	277,104.25	
WEC ENERGY GROUP INC	20,694	53.210000	1,101,127.74	
WELLS FARGO & CO	315,947	47.660000	15,058,034.02	
WESTERN DIGITAL CORP	14,830	42.470000	629,830.10	
WESTERN UNION CO	33,162	16.940000	561,764.28	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,861	43.780000	125,254.58	
WESTROCK CO	16,888	32.110000	542,273.68	
WHIRLPOOL CORP	5,063	133.220000	674,492.86	
WHITELAVE FOODS CO	11,493	36.380000	418,115.34	
WHITING PETROLEUM CORP	12,559	6.130000	76,986.67	
WHOLE FOODS MARKET INC	23,035	28.850000	664,559.75	
WILLIAMS COS INC	46,058	18.310000	843,321.98	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,440	110.120000	929,412.80	
WORKDAY INC-CLASS A	7,219	67.370000	486,344.03	
WR BERKLEY CORP	6,454	47.950000	309,469.30	
WW GRAINGER INC	3,823	185.530000	709,281.19	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,677	63.780000	489,639.06	
WYNN RESORTS LTD	5,354	61.000000	326,594.00	
XCEL ENERGY INC	33,247	36.530000	1,214,512.91	
XEROX CORP	65,569	9.100000	596,677.90	
XILINX INC	16,675	47.500000	792,062.50	
XL GROUP PLC	19,408	34.740000	674,233.92	
XYLEM INC	11,844	33.740000	399,616.56	
YAHOO! INC	57,962	29.780000	1,726,108.36	
YUM! BRANDS INC	27,946	67.390000	1,883,280.94	
ZILLOW GROUP INC - C	6,521	19.750000	128,789.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,200	99.060000	1,109,472.00	
ZOETIS INC	30,744	43.200000	1,328,140.80	
アメリカドル 小計	20,562,082		1,091,089,699.54 (128,901,337,103)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	14,100	39.780000	560,898.00	
AGRIUM INC	8,800	120.910000	1,064,008.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	27,300	61.450000	1,677,585.00	
ALTAGAS LTD	9,300	30.390000	282,627.00	
ARC RESOURCES LTD	22,000	16.610000	365,420.00	
ATCO LTD -CLASS I	5,300	35.860000	190,058.00	
BANK OF MONTREAL	41,800	71.690000	2,996,642.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,500	52.920000	4,154,220.00	
BARRICK GOLD CORP	75,400	13.240000	998,296.00	
BCE INC	9,400	55.160000	518,504.00	
BLACKBERRY LTD	32,100	9.750000	312,975.00	
BOMBARDIER INC-B	125,000	1.020000	127,500.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	56,000	40.490000	2,267,440.00	
CAE INC	17,000	14.840000	252,280.00	

CAMECO CORP	25,900	15.960000	413,364.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,700	85.630000	2,200,691.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	51,800	70.150000	3,633,770.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	71,200	24.900000	1,772,880.00	
CANADIAN OIL SANDS LTD	31,400	8.350000	262,190.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,900	162.390000	1,607,661.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,800	107.670000	516,816.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,100	32.680000	264,708.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,800	212.980000	383,364.00	
CENOVUS ENERGY INC	54,100	17.300000	935,930.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	14,500	55.150000	799,675.00	
CI FINANCIAL CORP	15,400	28.610000	440,594.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	511.350000	613,620.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	32,700	12.780000	417,906.00	
DOLLARAMA INC	7,800	73.890000	576,342.00	
ELDORADO GOLD CORP	46,200	2.980000	137,676.00	
ELEMENT FINANCIAL CORP	25,300	14.460000	365,838.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	10,700	25.200000	269,640.00	
ENBRIDGE INC	55,800	44.980000	2,509,884.00	
ENCANA CORP	54,300	5.150000	279,645.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,400	717.500000	1,004,500.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	10,700	16.910000	180,937.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	7,100	18.240000	129,504.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	42,900	2.490000	106,821.00	
FORTIS INC	18,600	38.140000	709,404.00	
FRANCO-NEVADA CORP	10,200	60.730000	619,446.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,100	36.690000	554,019.00	
GOLDCORP INC	53,800	14.660000	788,708.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	19,400	33.420000	648,348.00	
HUSKY ENERGY INC	22,878	13.360000	305,650.08	
IGM FINANCIAL INC	6,200	32.780000	203,236.00	
IMPERIAL OIL LTD	18,900	39.420000	745,038.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,400	39.810000	254,784.00	
INTACT FINANCIAL CORP	8,400	84.120000	706,608.00	
INTER PIPELINE LTD	22,100	20.610000	455,481.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	5,400	18.620000	100,548.00	
KEYERA CORP	10,800	36.460000	393,768.00	
KINROSS GOLD CORP	74,100	2.180000	161,538.00	
LINAMAR CORP	3,100	56.930000	176,483.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,700	65.250000	959,175.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,400	48.670000	1,284,888.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	127,700	18.210000	2,325,417.00	
MEG ENERGY CORP	10,800	4.260000	46,008.00	
METHANEX CORP	5,600	35.940000	201,264.00	
METRO INC	16,000	41.880000	670,080.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	21,300	36.820000	784,266.00	
ONEX CORPORATION	5,500	83.130000	457,215.00	
OPEN TEXT CORP	8,000	66.690000	533,520.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	21,900	29.380000	643,422.00	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,500	27.810000	264,195.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	53,700	21.160000	1,136,292.00	
POWER CORP OF CANADA	24,300	27.790000	675,297.00	
POWER FINANCIAL CORP	16,300	30.240000	492,912.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	10,200	18.030000	183,906.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	13,210	47.960000	633,551.60	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	23,400	49.740000	1,163,916.00	
ROYAL BANK OF CANADA	96,000	67.030000	6,434,880.00	
SAPUTO INC	16,600	32.840000	545,144.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	10,200	14.080000	143,616.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,100	23.580000	615,438.00	
SILVER WHEATON CORP	25,300	15.120000	382,536.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,800	37.600000	368,480.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	39,700	38.200000	1,516,540.00	
SUNCOR ENERGY INC	100,000	29.940000	2,994,000.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	35,100	4.790000	168,129.00	
TELUS CORP	11,600	36.960000	428,736.00	
THOMSON REUTERS CORP	22,600	51.170000	1,156,442.00	

TORONTO-DOMINION BANK	119,900	50.180000	6,016,582.00	
TOURMALINE OIL CORP	11,800	24.740000	291,932.00	
TRANSCANADA CORP	46,000	45.910000	2,111,860.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	62,400	2.540000	158,496.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	21,100	132.370000	2,793,007.00	
VERESEN INC	19,300	7.450000	143,785.00	
VERMILION ENERGY INC	6,900	33.600000	231,840.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,600	44.350000	204,010.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,300	106.360000	350,988.00	
YAMANA GOLD INC	60,800	2.140000	130,112.00	
カナダドル 小計	2,585,688		82,057,345.68 (6,786,142,487)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	45,312	18.500000	838,272.00	
ALUMINA LTD	174,230	1.135000	197,751.05	
AMCOR LIMITED	77,331	13.270000	1,026,182.37	
AMP LTD	193,970	5.390000	1,045,498.30	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	35,565	9.990000	355,294.35	
ASCIANO LTD	44,994	8.510000	382,898.94	
ASX LTD	13,161	40.700000	535,652.70	
AURIZON HOLDINGS LTD	141,502	3.800000	537,707.60	
AUSNET SERVICES	136,056	1.480000	201,362.88	
AUST AND NZ BANKING GROUP	187,191	24.150000	4,520,662.65	
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,735	13.080000	323,533.80	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	29,949	10.700000	320,454.30	
BHP BILLITON LIMITED	208,940	15.280000	3,192,603.20	
BORAL LTD	50,171	5.500000	275,940.50	
BRAMBLES LTD	102,961	11.110000	1,143,896.71	
CALTEX AUSTRALIA LTD	17,919	36.480000	653,685.12	
CHALLENGER LTD	37,883	7.780000	294,729.74	
CIMIC GROUP LTD	6,693	24.530000	164,179.29	
COCA-COLA AMATIL LTD	37,884	8.280000	313,679.52	
COCHLEAR LTD	3,799	95.910000	364,362.09	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	110,386	79.000000	8,720,494.00	
COMPUTERSHARE LTD	31,245	10.730000	335,258.85	
CROWN RESORTS LTD	23,611	11.950000	282,151.45	
CSL LTD	30,207	107.590000	3,249,971.13	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	3,526	39.120000	137,937.12	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	102,208	1.520000	155,356.16	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	39,512	4.410000	174,247.92	
HEALTHSCOPE LTD	115,005	2.260000	259,911.30	
ILUKA RESOURCES LTD	28,067	5.680000	159,420.56	
INCITEC PIVOT LTD	113,091	3.140000	355,105.74	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	160,149	5.230000	837,579.27	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	30,104	16.270000	489,792.08	
LENDLEASE GROUP	36,754	12.970000	476,699.38	
MACQUARIE GROUP LTD	19,729	75.390000	1,487,369.31	
MEDIBANK PRIVATE LTD	181,703	2.520000	457,891.56	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	169,983	27.760000	4,718,728.08	
NEWCREST MINING LTD	50,240	13.100000	658,144.00	
OIL SEARCH LTD	90,213	6.280000	566,537.64	
ORICA LTD	24,122	14.470000	349,045.34	
ORIGIN ENERGY LTD	115,340	4.050000	467,127.00	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	16,889	6.810000	115,014.09	
QANTAS AIRWAYS LTD	39,699	3.860000	153,238.14	
QBE INSURANCE GROUP LTD	89,162	10.790000	962,057.98	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,484	61.550000	583,740.20	
REA GROUP LTD	3,738	53.090000	198,450.42	
RIO TINTO LTD	27,568	39.160000	1,079,562.88	
SANTOS LTD	108,473	2.960000	321,080.08	
SEEK LTD	21,444	14.490000	310,723.56	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,749	18.300000	471,206.70	
SOUTH32 LTD	343,457	0.995000	341,739.71	
SUNCORP GROUP LTD	84,211	11.550000	972,637.05	
SYDNEY AIRPORT	75,484	6.560000	495,175.04	
TABCORP HOLDINGS LTD	53,885	4.630000	249,487.55	
TATTS GROUP LTD	96,635	4.090000	395,237.15	

TELSTRA CORP LTD	281,926	5.580000	1,573,147.08
TPG TELECOM LTD	20,019	10.020000	200,590.38
TRANSURBAN GROUP	134,858	10.740000	1,448,374.92
TREASURY WINE ESTATES LTD	48,119	8.800000	423,447.20
WESFARMERS LTD	73,296	42.110000	3,086,494.56
WESTPAC BANKING CORP	216,083	30.910000	6,679,125.53
WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,577	26.420000	1,283,404.34
WOOLWORTHS LTD	82,736	24.290000	2,009,657.44
			64,380,707.00
オーストラリアドル 小計	4,946,933		(5,280,505,588)
イギリスポンド			
3I GROUP PLC	62,938	4.356000	274,157.92
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,396	2.257000	131,799.77
ADMIRAL GROUP PLC	13,615	16.940000	230,638.10
AGGREKO PLC	16,210	7.960000	129,031.60
AMEC FOSTER WHEELER PLC	24,256	3.812000	92,463.87
ANGLO AMERICAN PLC	91,502	2.266000	207,343.53
ANTOFAGASTA PLC	24,446	3.632000	88,787.87
ARM HOLDINGS PLC	91,017	10.100000	919,271.70
ASHTREAD GROUP PLC	32,772	9.700000	317,888.40
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,970	30.210000	693,923.70
ASTRAZENECA PLC	81,911	44.405000	3,637,257.95
AUTO TRADER GROUP PLC	49,438	3.936000	194,587.96
AVIVA PLC	262,119	4.640000	1,216,232.16
BABCOCK INTL GROUP PLC	16,050	9.200000	147,660.00
BAE SYSTEMS PLC	205,156	4.958000	1,017,163.44
BARCLAYS PLC	1,087,692	1.818500	1,977,967.90
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,441	5.785000	372,791.18
BG GROUP PLC	216,376	9.817000	2,124,163.19
BHP BILLITON PLC	137,369	6.398000	878,886.86
BP PLC	1,184,972	3.501500	4,149,179.45
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	120,892	36.570000	4,421,020.44
BT GROUP PLC	539,734	4.710000	2,542,147.14
BUNZL PLC	21,780	18.030000	392,693.40
BURBERRY GROUP PLC	28,910	11.780000	340,559.80
CAPITA PLC	42,934	11.650000	500,181.10
CARNIVAL PLC	11,880	36.000000	427,680.00
CENTRICA PLC	327,441	2.062000	675,183.34
COBHAM PLC	74,314	2.449000	181,994.98
COCA-COLA HBC AG-DI	12,840	13.790000	177,063.60
COMPASS GROUP PLC	106,880	11.220000	1,199,193.60
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,870	29.110000	258,205.70
DIAGEO PLC	163,154	18.415000	3,004,480.91
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	89,280	3.698000	330,157.44
DIXONS CARPHONE PLC	63,619	4.671000	297,164.34
EASYJET PLC	11,128	16.310000	181,497.68
EXPERIAN PLC	63,272	11.590000	733,322.48
FRESNILLO PLC	14,994	6.580000	98,660.52
G4S PLC	101,407	2.180000	221,067.26
GKN PLC	111,401	2.850000	317,492.85
GLAXOSMITHKLINE PLC	315,601	14.000000	4,418,414.00
GLENCORE PLC	787,571	0.808500	636,751.15
HARGREAVES LANSDOWN PLC	17,095	13.120000	224,286.40
HSBC HOLDINGS PLC	1,267,952	4.734500	6,003,118.74
ICAP PLC	35,282	4.536000	160,039.15
IMI PLC	17,217	7.650000	131,710.05
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	62,055	35.860000	2,225,292.30
INMARSAT PLC	29,306	10.700000	313,574.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	15,318	22.840000	349,863.12
INTERTEK GROUP PLC	10,527	27.800000	292,650.60
INVESTEC PLC	35,535	4.166000	148,038.81
ITV PLC	249,218	2.629000	655,194.12
JOHNSON MATTHEY PLC	13,362	24.390000	325,899.18
KINGFISHER PLC	148,140	3.239000	479,825.46
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	385,573	2.347000	904,939.83
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,702,404	0.631400	2,337,697.88
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,192	24.580000	496,319.36

MARKS & SPENCER GROUP PLC	105,942	4.178000	442,625.67	
MEGGITT PLC	49,509	3.621000	179,272.08	
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,016	2.782000	178,092.51	
MERLIN ENTERTAINMENT	45,679	4.130000	188,654.27	
MONDI PLC	23,908	11.920000	284,983.36	
NATIONAL GRID PLC	244,065	9.463000	2,309,587.09	
NEXT PLC	9,463	68.000000	643,484.00	
OLD MUTUAL PLC	317,204	1.547000	490,714.58	
PEARSON PLC	53,162	7.565000	402,170.53	
PERSIMMON PLC	19,827	19.480000	386,229.96	
PETROFAC LTD	16,327	7.190000	117,391.13	
PROVIDENT FINANCIAL PLC	9,637	29.170000	281,111.29	
PRUDENTIAL PLC	166,580	13.005000	2,166,372.90	
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,036	45.960000	277,414.56	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	41,444	61.440000	2,546,319.36	
RELX PLC	72,391	11.890000	860,728.99	
REXAM PLC	45,848	6.080000	278,755.84	
RIO TINTO PLC	81,212	16.090000	1,306,701.08	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	118,389	5.440000	644,036.16	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	223,974	2.513000	562,846.66	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	253,727	13.985000	3,548,372.09	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	154,626	14.020000	2,167,856.52	
ROYAL MAIL PLC	58,699	4.483000	263,147.61	
RSA INSURANCE GROUP PLC	66,378	4.010000	266,175.78	
SABMILLER PLC	62,671	41.895000	2,625,601.54	
SAGE GROUP PLC/THE	69,863	5.680000	396,821.84	
SAINSBURY (J) PLC	87,197	2.316000	201,948.25	
SCHROEDERS PLC	8,073	26.410000	213,207.93	
SEVERN TRENT PLC	15,945	21.290000	339,469.05	
SHIRE PLC	38,375	42.470000	1,629,786.25	
SKY PLC	67,353	10.500000	707,206.50	
SMITH & NEPHEW PLC	58,186	11.310000	658,083.66	
SMITHS GROUP PLC	25,746	8.915000	229,525.59	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	16,483	4.190000	69,063.77	
SSE PLC	65,078	13.850000	901,330.30	
ST JAMES'S PLACE PLC	34,147	9.090000	310,396.23	
STANDARD CHARTERED PLC	212,838	4.781500	1,017,684.89	
STANDARD LIFE PLC	127,007	3.584000	455,193.08	
TATE & LYLE PLC	29,734	5.955000	177,065.97	
TAYLOR WIMPEY PLC	210,376	1.837000	386,460.71	
TESCO PLC	530,380	1.557000	825,801.66	
TRAVIS PERKINS PLC	16,184	17.890000	289,531.76	
TUI AG-DI	32,238	12.170000	392,336.46	
UNILEVER PLC	83,158	29.505000	2,453,576.79	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	45,238	9.235000	417,772.93	
VODAFONE GROUP PLC	1,721,290	2.185000	3,761,018.65	
WEIR GROUP PLC/THE	13,420	8.435000	113,197.70	
WHITBREAD PLC	11,736	39.290000	461,107.44	
WILLIAM HILL PLC	57,354	3.775000	216,511.35	
WM MORRISON SUPERMARKETS	142,383	1.600000	227,812.80	
WOLSELEY PLC	16,934	34.260000	580,158.84	
WPP PLC	83,949	14.630000	1,228,173.87	
イギリス債券 小計	18,902,103		97,283,467.31 (16,335,839,830)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	142,507	16.620000	2,368,466.34	
ACTELION LTD-REG	6,702	134.900000	904,099.80	
ADECCO SA-REG	10,702	61.200000	654,962.40	
ARYZTA AG	5,583	44.690000	249,504.27	
BALOISE HOLDING AG - REG	3,233	121.300000	392,162.90	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	1,051.000000	156,599.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	62	5,575.000000	345,650.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	66,500.000000	465,500.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	33,825	63.750000	2,156,343.75	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	116,435	17.650000	2,055,077.75	
DUFREY AG-REG	2,609	110.800000	289,077.20	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	523	418.250000	218,744.75	

GALENICA AG-REG	255	1,375.000000	350,625.00	
GEBERIT AG-REG	2,435	347.100000	845,188.50	
GIVAUDAN-REG	600	1,837.000000	1,102,200.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	14,462	42.070000	608,416.34	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,555	131.100000	466,060.50	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	27,555	42.170000	1,161,994.35	
LONZA GROUP AG-REG	3,447	158.100000	544,970.70	
NESTLE SA-REG	206,684	72.400000	14,963,921.60	
NOVARTIS AG-REG	147,489	82.900000	12,226,838.10	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,131	58.150000	123,917.65	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,049	359.250000	376,853.25	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	45,547	265.600000	12,097,283.20	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,365	150.700000	205,705.50	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,868	151.300000	433,928.40	
SGS SA-REG	355	1,931.000000	685,505.00	
SIKA AG-BR	139	3,500.000000	486,500.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,499	121.500000	425,128.50	
SULZER AG-REG	922	87.800000	80,951.60	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,979	328.900000	650,893.10	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,369	63.150000	212,752.35	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,074	255.900000	530,736.60	
SWISS PRIME SITE-REG	4,333	78.850000	341,657.05	
SWISS RE AG	22,767	92.700000	2,110,500.90	
SWISSCOM AG-REG	1,669	489.600000	817,142.40	
SYNGENTA AG-REG	6,026	361.300000	2,177,193.80	
TRANSOCEAN LTD	23,907	9.705000	232,017.43	
UBS GROUP AG-REG	236,996	16.530000	3,917,543.88	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,733	220.500000	2,146,126.50	
スイスフラン 小計	1,099,547		70,578,740.36 (8,223,129,039)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	781,800	42.450000	33,187,410.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,700	54.150000	850,155.00	
BANK OF EAST ASIA	76,620	22.800000	1,746,936.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	239,000	20.550000	4,911,450.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	84,000	12.400000	1,041,600.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	42,000	70.650000	2,967,300.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	176,368	40.000000	7,054,720.00	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,368	94.200000	16,519,665.60	
CLP HOLDINGS LTD	124,500	63.150000	7,862,175.00	
FIRST PACIFIC CO	170,000	4.770000	810,900.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	152,000	21.700000	3,298,400.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	147,000	14.680000	2,157,960.00	
HANG SENG BANK LTD	49,500	125.600000	6,217,200.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	74,868	38.750000	2,901,135.00	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	171,000	10.000000	1,710,000.00	
HONG KONG & CHINA GAS	456,578	13.420000	6,127,276.76	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	74,000	168.900000	12,498,600.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	41,000	29.200000	1,197,200.00	
KERRY PROPERTIES LTD	43,000	17.880000	768,840.00	
LI & FUNG LTD	378,000	4.450000	1,682,100.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	63,200	8.510000	537,832.00	
MTR CORP	96,500	35.000000	3,377,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	355,000	6.360000	2,257,800.00	
NWS HOLDINGS LTD	102,500	10.940000	1,121,350.00	
PCCW LTD	275,000	4.460000	1,226,500.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,000	68.250000	6,210,750.00	
SANDS CHINA LTD	159,200	23.550000	3,749,160.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	84,000	7.130000	598,920.00	
SINO LAND CO	203,400	9.540000	1,940,436.00	
SJM HOLDINGS LTD	130,000	4.740000	616,200.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	112,000	82.800000	9,273,600.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	38,000	72.800000	2,766,400.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	75,200	19.440000	1,461,888.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	91,000	29.900000	2,720,900.00	
WH GROUP LTD	373,500	4.400000	1,643,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	88,000	36.350000	3,198,800.00	

WHEELLOCK & CO LTD	59,000	28.100000	1,657,900.00	
WYNN MACAU LTD	101,200	7.620000	771,144.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	50,500	26.500000	1,338,250.00	
香港ドル 小計	6,020,502		161,979,753.36 (2,453,993,263)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	169,800	2.970000	504,306.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	26,200	6.760000	177,112.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	145,100	2.840000	412,084.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	114,400	14.150000	1,618,760.00	
GENTING SINGAPORE PLC	388,000	0.675000	261,900.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	209,700	1.730000	362,781.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	473,960	0.335000	158,776.60	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	34.480000	275,840.00	
KEPPEL CORP LTD	96,900	4.810000	466,089.00	
NOBLE GROUP LTD	317,090	0.285000	90,370.65	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	198,300	7.770000	1,540,791.00	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	62,400	2.310000	144,144.00	
SEBACORP MARINE LTD	58,400	1.495000	87,308.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	37,640	10.860000	408,770.40	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	52,700	6.910000	364,157.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	106,250	3.540000	376,125.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	102,700	2.890000	296,803.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	518,360	3.470000	1,798,709.20	
STARHUB LTD	41,500	3.370000	139,855.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	84,100	18.000000	1,513,800.00	
UOL GROUP LTD	30,900	5.500000	169,950.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	124,600	2.680000	333,928.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	130,800	0.925000	120,990.00	
シンガポールドル 小計	3,497,800		11,623,349.85 (958,810,129)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	63,724	5.580000	355,579.92	
CONTACT ENERGY LTD	49,979	4.690000	234,401.51	
FLETCHER BUILDING LTD	44,843	6.980000	313,004.14	
MERIDIAN ENERGY LTD	87,137	2.325000	202,593.52	
MIGHTY RIVER POWER	48,121	2.620000	126,077.02	
RYMAN HEALTHCARE LTD	24,756	8.160000	202,008.96	
SPARK NEW ZEALAND LTD	120,661	3.270000	394,561.47	
ニュージーランドドル 小計	439,221		1,828,226.54 (139,164,604)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	19,138	142.000000	2,717,596.00	
ASSA ABLOY AB-B	64,927	171.200000	11,115,502.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	43,688	188.000000	8,213,344.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	25,301	177.300000	4,485,867.30	
BOLIDEN AB	17,863	114.200000	2,039,954.60	
ELECTROLUX AB-SER B	15,683	180.000000	2,822,940.00	
ERICSSON LM-B SHS	197,386	80.050000	15,800,749.30	
GETINGE AB-B SHS	13,075	197.300000	2,579,697.50	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	61,545	292.800000	18,020,376.00	
HEXAGON AB-B SHS	16,825	282.600000	4,754,745.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	27,907	51.850000	1,446,977.95	
ICA GRUPPEN AB	5,160	285.100000	1,471,116.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,692	133.200000	1,424,174.40	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	15,265	224.300000	3,423,939.50	
INVESTOR AB-B SHS	29,203	285.300000	8,331,615.90	
LUNDIN PETROLEUM AB	13,816	111.600000	1,541,865.60	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,024	380.900000	1,532,741.60	
NORDEA BANK AB	196,767	88.600000	17,433,556.20	
SANDVIK AB	69,165	69.800000	4,827,717.00	
SECURITAS AB-B SHS	20,439	119.100000	2,434,284.90	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	97,603	80.400000	7,847,281.20	
SKANSKA AB-B SHS	24,641	156.500000	3,856,316.50	
SKF AB-B SHARES	25,866	128.000000	3,310,848.00	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	38,260	245.400000	9,389,004.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,434	101.900000	9,928,524.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	58,807	177.300000	10,426,481.10	



SWEDISH MATCH AB	12,791	289.000000	3,696,599.00	
TELE2 AB-B SHS	19,962	79.050000	1,577,996.10	
TELIASONERA AB	166,727	39.250000	6,544,034.75	
VOLVO AB-B SHS	99,107	77.200000	7,651,060.40	
スウェーデンクローネ 小計	1,509,067		180,646,906.80 (2,491,120,844)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	63,144	97.150000	6,134,439.60	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,692	133.000000	1,688,036.00	
NORSK HYDRO ASA	87,580	28.010000	2,453,115.80	
ORKLA ASA	53,043	67.800000	3,596,315.40	
SCHIBSTED ASA-B SHS	5,960	256.200000	1,526,952.00	
SCHIBSTED ASA-CL A	4,924	261.100000	1,285,656.40	
STATOIL ASA	71,845	106.600000	7,658,677.00	
TELENOR ASA	48,400	144.200000	6,979,280.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	11,616	339.200000	3,940,147.20	
ノルウェークローネ 小計	359,204		35,262,619.40 (475,340,109)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	254	8,135.000000	2,066,290.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	438	8,275.000000	3,624,450.00	
CARLSBERG AS-B	6,955	543.000000	3,776,565.00	
CHR HANSEN HOLDING A/S	6,487	414.800000	2,690,807.60	
COLOPLAST-B	7,221	552.500000	3,989,602.50	
DANSKE BANK A/S	45,926	181.600000	8,340,161.60	
DSV A/S	12,635	259.300000	3,276,255.50	
ISS A/S	9,768	236.000000	2,305,248.00	
NOVO NORDISK A/S-B	127,042	380.700000	48,364,889.40	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	15,093	279.700000	4,221,512.10	
PANDORA A/S	7,179	884.500000	6,349,825.50	
TDC A/S	51,930	34.860000	1,810,279.80	
TRYG A/S	7,289	127.500000	929,347.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,597	432.500000	6,313,202.50	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,526	620.500000	946,883.00	
デンマーククローネ 小計	314,340		99,005,320.00 (1,699,921,344)	
イスラエルシェケル				
AZRIELI GROUP	2,354	144.000000	338,976.00	
BANK HAPOALIM BM	67,761	18.440000	1,249,512.84	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,652	12.900000	1,169,410.80	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	123,664	8.200000	1,014,044.80	
DELEK GROUP LTD	322	611.700000	196,967.40	
ISRAEL CHEMICALS LTD	33,037	15.520000	512,734.24	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,528	43.600000	415,420.80	
NICE SYSTEMS LTD	3,624	226.300000	820,111.20	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	59,209	251.100000	14,867,379.90	
イスラエルシェケル 小計	390,151		20,584,557.98 (612,596,445)	
ユーロ				
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	33,901	13.130000	445,120.13	
ACCOR SA	13,617	32.965000	448,884.40	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,270	22.385000	274,663.95	
ADIDAS AG	13,546	92.210000	1,249,076.66	
ADP	1,928	101.150000	195,017.20	
AEGON NV	116,599	5.150000	600,484.85	
AENA SA	4,404	101.100000	445,244.40	
AGEAS	13,097	38.715000	507,050.35	
AIR LIQUIDE SA	22,297	95.590000	2,131,370.23	
AIRBUS GROUP SE	38,296	57.320000	2,195,126.72	
AKZO NOBEL	16,143	57.690000	931,289.67	
ALCATEL-LUCENT SA	35,865	3.670000	131,624.55	
ALLIANZ SE-REG	29,539	147.700000	4,362,910.30	
ALSTOM	14,169	24.625000	348,911.62	
ALTICE NV - A	23,819	12.350000	294,164.65	
ALTICE NV - B	7,310	12.565000	91,850.15	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	28,164	37.745000	1,063,050.18	
ANDRITZ AG	5,013	42.995000	215,533.93	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	52,148	112.550000	5,869,257.40	

ARCELORMITTAL	63,700	3.349000	213,331.30
ARKEMA	4,294	56.570000	242,911.58
ASML HOLDING NV	22,453	83.360000	1,871,682.08
ASSICURAZIONI GENERALI	75,403	14.610000	1,101,637.83
ATLANTIA SPA	26,907	23.710000	637,964.97
ATOS SE	5,673	72.290000	410,101.17
AXA SA	126,417	22.450000	2,838,061.65
AXEL SPRINGER SE	2,764	46.175000	127,627.70
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	167,382	0.725000	121,351.95
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	411,374	5.770000	2,373,627.98
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	2,552,968	0.037200	94,970.40
BANCO DE SABADELL SA	326,565	1.416000	462,416.04
BANCO POPOLARE SC	23,264	8.455000	196,697.12
BANCO POPULAR ESPANOL	112,234	2.258000	253,424.37
BANCO SANTANDER SA	935,066	3.855000	3,604,679.43
BANK OF IRELAND	1,828,092	0.296000	541,115.23
BANKIA SA	297,448	0.927000	275,734.29
BANKINTER SA	43,617	6.082000	265,278.59
BASF SE	59,486	61.680000	3,669,096.48
BAYER AG-REG	53,593	105.800000	5,670,139.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,479	78.920000	1,695,122.68
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,472	65.250000	226,548.00
BEIERSDORF AG	6,485	82.050000	532,094.25
BNP PARIBAS	68,618	43.175000	2,962,582.15
BOLLORE	55,898	3.762000	210,288.27
BOSKALIS WESTMINSTER	5,529	35.085000	193,984.96
BOUYGUES SA	13,161	35.400000	465,899.40
BRENNTAG AG	10,039	43.915000	440,862.68
BUREAU VERITAS SA	17,329	17.450000	302,391.05
CAIXABANK S.A	169,685	2.656000	450,683.36
CAP GEMINI	10,627	84.350000	896,387.45
CARREFOUR SA	36,141	25.010000	903,886.41
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,775	38.440000	145,111.00
CHRISTIAN DIOR SE	3,535	152.650000	539,617.75
CNH INDUSTRIAL NV	61,866	5.455000	337,479.03
CNP ASSURANCES	11,602	11.265000	130,696.53
COLRUYT SA	4,481	46.470000	208,232.07
COMMERZBANK AG	68,687	7.519000	516,457.55
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	31,651	36.595000	1,158,268.34
CONTINENTAL AG	7,134	196.100000	1,398,977.40
CREDIT AGRICOLE SA	67,931	9.041000	614,164.17
CRH PLC	54,385	24.335000	1,323,458.97
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	62,348	65.100000	4,058,854.80
DANONE	38,216	60.180000	2,299,838.88
DASSAULT SYSTEMES SA	8,255	70.230000	579,748.65
DELHAIZE GROUP	6,708	91.810000	615,861.48
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	89,439	16.610000	1,485,581.79
DEUTSCHE BOERSE AG	12,514	77.000000	963,578.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,318	14.100000	215,983.80
DEUTSCHE POST AG-REG	62,930	23.235000	1,462,178.55
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	208,932	15.925000	3,327,242.10
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	23,165	24.180000	560,129.70
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	39,044	4.863000	189,870.97
E.ON SE	130,610	9.004000	1,176,012.44
EDENRED	13,279	16.110000	213,924.69
EDF	15,648	11.655000	182,377.44
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	151,553	3.124000	473,451.57
ELISA OYJ	9,279	34.340000	318,640.86
ENAGAS SA	13,922	25.800000	359,187.60
ENDESA SA	20,423	16.820000	343,514.86
ENEL GREEN POWER SPA	115,138	1.776000	204,485.08
ENEL SPA	459,592	3.708000	1,704,167.13
ENGIE	95,493	14.175000	1,353,613.27
ENI SPA	164,467	12.810000	2,106,822.27
ERSTE GROUP BANK AG	18,217	26.755000	487,395.83
ESSILOR INTERNATIONAL	13,288	112.800000	1,498,886.40
EURAZEO	2,707	55.950000	151,456.65

EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,130	27.810000	309,525.30
EVONIK INDUSTRIES AG	8,911	27.875000	248,394.12
EXOR SPA	6,314	30.490000	192,513.86
FERRARI NV	8,282	37.450000	310,160.90
FERROVIAL SA	29,061	19.565000	568,578.46
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	58,822	6.605000	388,519.31
FINMECCANICA SPA	26,380	11.290000	297,830.20
FORTUM OYJ	29,306	13.650000	400,026.90
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	2,658	55.270000	146,907.66
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	14,167	77.930000	1,104,034.31
FRESENIUS SE & CO KGAA	24,696	60.960000	1,505,468.16
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,396	38.580000	169,597.68
GALP ENERGIA SGPS SA	24,826	9.902000	245,827.05
GAS NATURAL SDG SA	24,599	17.600000	432,942.40
GEA GROUP AG	11,876	36.745000	436,383.62
GEMALTO	5,127	58.250000	298,647.75
GRIFOLS SA	19,478	19.530000	380,405.34
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,228	69.690000	364,339.32
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	31,111	9.985000	310,643.33
HANNOVER RUECK SE	3,792	95.640000	362,666.88
HEIDELBERGCEMENT AG	9,080	66.020000	599,461.60
HEINEKEN HOLDING NV	6,575	68.280000	448,941.00
HEINEKEN NV	14,891	77.550000	1,154,797.05
HENKEL AG & CO KGAA	6,762	82.060000	554,889.72
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,532	94.490000	1,089,658.68
HERMES INTERNATIONAL	1,712	306.100000	524,043.20
HUGO BOSS AG -ORD	4,352	72.910000	317,304.32
IBERDROLA SA	358,352	6.313000	2,262,276.17
ILIAD SA	1,712	229.050000	392,133.60
IMERYS SA	2,382	57.640000	137,298.48
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	70,513	29.290000	2,065,325.77
INFINEON TECHNOLOGIES AG	72,446	12.325000	892,896.95
ING GROEP NV-CVA	250,971	10.645000	2,671,586.29
INGENICO GROUP	3,589	108.300000	388,688.70
INTESA SANPAOLO	822,892	2.638000	2,170,789.09
INTESA SANPAOLO-RSP	57,212	2.458000	140,627.09
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	54,095	7.387000	399,599.76
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JC DECAUX SA	5,003	33.215000	166,174.64
JERONIMO MARTINS	15,858	11.700000	185,538.60
K+S AG-REG	12,280	20.195000	247,994.60
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,410	114.450000	161,374.50
KBC GROEP NV	16,339	51.500000	841,458.50
KERING	4,876	151.550000	738,957.80
KERRY GROUP PLC-A	10,661	73.000000	778,253.00
KONE OYJ-B	21,622	37.830000	817,960.26
KONINKLIJKE AHOLD NV	53,803	19.855000	1,068,258.56
KONINKLIJKE DSM NV	11,736	43.780000	513,802.08
KONINKLIJKE KPN NV	206,624	3.390000	700,455.36
KONINKLIJKE PHILIPS NV	61,889	22.725000	1,406,427.52
LAGARDERE SCA	7,508	24.870000	186,723.96
LANXESS AG	5,864	38.220000	224,122.08
LEGRAND SA	17,310	48.345000	836,851.95
LINDE AG	12,047	122.650000	1,477,564.55
L'OREAL	16,322	152.100000	2,482,576.20
LUXOTTICA GROUP SPA	10,958	56.600000	620,222.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,105	143.900000	2,605,309.50
MAN SE	2,284	91.140000	208,163.76
MAPFRE SA	64,269	2.027000	130,273.26
MEDIOBANCA SPA	36,325	7.485000	271,892.62
MERCK KGAA	8,306	83.400000	692,720.40
METRO AG	11,583	26.190000	303,358.77
METSO OYJ	7,566	18.200000	137,701.20
MICHELIN (CGDE)	12,126	81.080000	983,176.08
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,771	173.400000	1,867,691.40
NATIXIS	61,493	4.260000	261,960.18
NESTE OYJ	8,217	28.430000	233,609.31

NN GROUP NV	15,426	31.080000	479,440.08
NOKIA OYJ	351,069	6.645000	2,332,853.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,319	29.790000	218,033.01
NUMERICABLE-SFR	7,042	34.500000	242,949.00
OCI NV	5,200	16.485000	85,722.00
OMV AG	9,467	22.705000	214,948.23
ORANGE	128,733	15.800000	2,033,981.40
ORION OYJ-CLASS B	6,480	29.450000	190,836.00
OSRAM LICHT AG	5,667	38.620000	218,859.54
PERNOD RICARD SA	13,798	102.700000	1,417,054.60
PEUGEOT SA	28,834	13.695000	394,881.63
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,925	42.980000	426,576.50
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	14,146	45.125000	638,338.25
PROXIMUS	9,879	30.530000	301,605.87
PRYSMIAN SPA	12,465	18.430000	229,729.95
PUBLICIS GROUPE	12,167	52.440000	638,037.48
QIAGEN N.V.	14,501	21.140000	306,551.14
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,518	11.500000	86,457.00
RANDSTAD HOLDING NV	8,336	50.070000	417,383.52
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,017	73.250000	513,995.25
RELX NV	64,894	14.805000	960,755.67
REMY COINTREAU	1,606	63.660000	102,237.96
RENAULT SA	12,504	78.660000	983,564.64
REPSOL SA	75,692	8.653000	654,962.87
REXEL SA	19,259	10.170000	195,864.03
RTL GROUP	2,422	72.360000	175,255.92
RWE AG	32,015	12.040000	385,460.60
SAFRAN SA	20,318	59.260000	1,204,044.68
SAIPEM SPA	17,460	0.627000	10,947.42
SAIPEM SPA-RTS	17,460	2.940000	51,332.40
SAMPO OYJ-A SHS	28,999	44.090000	1,278,565.91
SANOFI	76,552	76.390000	5,847,807.28
SAP SE	63,679	72.680000	4,628,189.72
SCHNEIDER ELECTRIC SE	36,187	47.090000	1,704,045.83
SCOR SE	9,978	31.500000	314,307.00
SES	21,168	23.865000	505,174.32
SIEMENS AG-REG	51,351	83.410000	4,283,186.91
SNAM SPA	138,239	5.020000	693,959.78
SOCIETE BIC SA	1,868	145.550000	271,887.40
SOCIETE GENERALE SA	46,989	34.910000	1,640,385.99
SODEXO	6,086	87.840000	534,594.24
SOLVAY SA	4,833	76.890000	371,609.37
STMICROELECTRONICS NV	40,736	5.860000	238,712.96
STORA ENSO OYJ-R SHS	35,724	7.370000	263,285.88
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	19,945	16.705000	333,181.22
SYMRISE AG	8,023	58.970000	473,116.31
TECHNIP SA	6,548	38.945000	255,011.86
TELECOM ITALIA SPA	740,729	1.028000	761,469.41
TELECOM ITALIA-RSP	390,830	0.831000	324,779.73
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,631	4.547000	171,108.15
TELEFONICA SA	291,504	9.416000	2,744,801.66
TELENET GROUP HOLDING NV	3,619	46.735000	169,133.96
TENARIS SA	30,219	9.100000	274,992.90
TERNA SPA	100,252	4.726000	473,790.95
THALES SA	6,792	70.990000	482,164.08
THYSSENKRUPP AG	24,031	14.970000	359,744.07
TNT EXPRESS NV	32,244	7.775000	250,697.10
TOTAL SA	140,723	38.525000	5,421,353.57
UBI BANCA SPA	59,002	4.390000	259,018.78
UCB SA	8,184	81.480000	666,832.32
UMICORE	6,087	34.710000	211,279.77
UNICREDIT SPA	307,980	3.738000	1,151,229.24
UNILEVER NV-CVA	105,615	39.655000	4,188,162.82
UNIPOLSAI SPA	71,281	2.010000	143,274.81
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,036	46.860000	376,566.96
UPM-KYMMENE OYJ	34,414	14.820000	510,015.48
VALEO SA	5,143	122.250000	628,731.75

VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,494	21.370000	630,286.78	
VINCI SA	30,994	61.630000	1,910,160.22	
VIVENDI	73,578	19.615000	1,443,232.47	
VOESTALPINE AG	7,221	24.470000	176,697.87	
VOLKSWAGEN AG	2,313	123.000000	284,499.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	12,046	110.750000	1,334,094.50	
VONOVIA SE	32,205	27.630000	889,824.15	
VOPAK	4,446	37.940000	168,681.24	
WARTSILA OYJ ABP	9,612	37.980000	365,063.76	
WENDEL	1,848	91.940000	169,905.12	
WOLTERS KLUWER	19,546	30.265000	591,559.69	
ZALANDO SE	5,486	31.630000	173,522.18	
ZARDOYA OTIS SA	11,705	9.450000	110,612.25	
ZODIAC AEROSPACE	12,970	19.005000	246,494.85	
ユーロ小計	17,217,755		202,406,246.35 (25,938,360,469)	
合計	77,844,393		200,296,261,254 (200,296,261,254)	

(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	22,277.00	362,892.33	
	AMERICAN TOWER CORP	27,372.00	2,494,136.64	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	60,631.00	539,009.59	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,552.00	1,490,357.04	
	BOSTON PROPERTIES INC	9,934.00	1,170,324.54	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,725.00	299,222.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,626.00	403,102.90	
	CROWN CASTLE INTL CORP	21,538.00	1,748,670.22	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,763.00	663,534.36	
	DUKE REALTY CORP	22,494.00	436,158.66	
	EQUINIX INC	4,303.00	1,290,598.79	
	EQUITY RESIDENTIAL	23,457.00	1,834,337.40	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,270.00	952,679.70	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,523.00	659,014.80	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,463.00	664,362.18	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	37,450.00	1,008,154.00	
	HCP INC	29,920.00	1,096,268.80	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	48,353.00	656,150.21	
	IRON MOUNTAIN INC	13,131.00	331,820.37	
	KIMCO REALTY CORP	26,554.00	695,449.26	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,588.00	271,052.76	
	MACERICH CO/THE	8,672.00	674,161.28	
	PLUM CREEK TIMBER CO	11,360.00	444,403.20	
	PROLOGIS INC	33,728.00	1,289,084.16	
	PUBLIC STORAGE	9,479.00	2,346,147.29	
	REALTY INCOME CORP	15,082.00	812,768.98	
	REGENCY CENTERS CORP	6,132.00	426,541.92	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,024.00	3,707,443.60	
	SL GREEN REALTY CORP	6,439.00	654,588.74	
	UDR INC	16,920.00	599,137.20	
	VENTAS INC	21,380.00	1,175,472.40	
	VEREIT INC	59,032.00	431,523.92	
	VORNADO REALTY TRUST	11,011.00	992,751.76	
	WELLTOWER INC	22,704.00	1,515,492.00	
	WEYERHAEUSER CO	32,957.00	807,776.07	
	投資証券 小計	682,844.00	34,944,589.07 (4,128,353,752)	
アメリカドル 小計		682,844.00	34,944,589.07 (4,128,353,752)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	8,300.00	151,724.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,700.00	234,255.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	4,100.00	122,631.00	
	投資証券 小計	22,100.00	508,610.00 (42,062,047)	
カナダドル 小計		22,100.00	508,610.00 (42,062,047)	
オーストラリアドル				
投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	65,373.00	475,915.44	
	GOODMAN GROUP	117,599.00	712,649.94	
	GPT GROUP	119,394.00	568,315.44	
	MIRVAC GROUP	248,761.00	463,939.26	
	SCENTRE GROUP	350,464.00	1,496,481.28	
	STOCKLAND	158,061.00	644,888.88	
	VICINITY CENTRES	224,148.00	643,304.76	
	WESTFIELD CORP	128,679.00	1,264,914.57	
	投資証券 小計	1,412,479.00	6,270,409.57 (514,298,992)	
オーストラリアドル 小計		1,412,479.00	6,270,409.57 (514,298,992)	
イギリスポンド				

投資証券	BRITISH LAND CO PLC	62,672.00	460,639.20
	HAMMERSON PLC	50,917.00	291,754.41
	INTU PROPERTIES PLC	60,242.00	177,292.20
	LAND SECURITIES GROUP PLC	50,707.00	554,734.58
	SEGRO PLC	47,918.00	203,699.41
投資証券 小計		272,456.00	1,688,119.80 (283,469,076)
イギリスポンド 小計		272,456.00	1,688,119.80 (283,469,076)
香港ドル			
投資証券	LINK REIT	147,000.00	6,445,950.00
	投資証券 小計	147,000.00	6,445,950.00 (97,656,142)
香港ドル 小計		147,000.00	6,445,950.00 (97,656,142)
シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,600.00	307,692.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	139,000.00	182,785.00
	CAPITALAND MALL TRUST	158,900.00	312,238.50
	SUNTEC REIT	166,800.00	253,536.00
投資証券 小計		603,300.00	1,056,251.50 (87,130,186)
シンガポールドル 小計		603,300.00	1,056,251.50 (87,130,186)
ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	1,887.00	145,978.32
	GECINA SA	2,199.00	252,005.40
	ICADE	2,221.00	140,633.72
	KLEPIERRE	14,240.00	551,301.60
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,379.00	1,469,402.65
投資証券 小計		26,926.00	2,559,321.69 (327,977,074)
ユーロ 小計		26,926.00	2,559,321.69 (327,977,074)
合計			5,480,947,269 (5,480,947,269)

(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 602銘柄	96.90%		62.64%
	投資証券 35銘柄		3.10%	2.01%
カナダドル	株式 91銘柄	99.38%		3.30%
	投資証券 3銘柄		0.62%	0.02%
オーストラリアドル	株式 62銘柄	91.12%		2.57%
	投資証券 8銘柄		8.88%	0.25%
イギリスポンド	株式 108銘柄	98.29%		7.94%
	投資証券 5銘柄		1.71%	0.14%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%		4.00%
香港ドル	株式 39銘柄	96.17%		1.19%
	投資証券 1銘柄		3.83%	0.05%
シンガポールドル	株式 23銘柄	91.67%		0.47%
	投資証券 4銘柄		8.33%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%		0.07%
スウェーデンクローネ	株式 30銘柄	100.00%		1.21%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%		0.23%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	100.00%		0.83%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.00%		0.30%
ユーロ	株式 234銘柄	98.75%		12.61%
	投資証券 5銘柄		1.25%	0.16%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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





「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27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	938,781,796	697,374,078
コール・ローン	99,246,322	132,131,255
株式	32,807,367,840	30,434,498,477
投資証券	173,248,855	144,792,975
派生商品評価勘定	60,499,442	1,403,503
未収入金		11,496,039
未収配当金	25,089,431	26,263,470
未収利息	154	215
差入委託証拠金	105,722,890	151,965,806
流動資産合計	34,209,956,730	31,599,925,818
資産合計	34,209,956,730	31,599,925,818
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	53,252	72,217,210
未払金	14,953	7,699,254
未払解約金	35,375,453	49,702,158
流動負債合計	35,443,658	129,618,622
負債合計	35,443,658	129,618,622
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,232,834,584	18,949,314,185
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	18,941,678,488	12,520,993,011
元本等合計	34,174,513,072	31,470,307,196
純資産合計	34,174,513,072	31,470,307,196
負債純資産合計	34,209,956,730	31,599,925,818

(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	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。 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27年1月26日現在 ]	[ 平成28年1月26日現在 ]
1 期首	平成26年1月28日	平成27年1月27日
期首元本額	11,728,135,634円	15,232,834,584円
期首からの追加設定元本額	4,815,626,488円	6,299,860,421円
期首からの一部解約元本額	1,310,927,538円	2,583,380,820円
元本の内訳*		
FPバランスファンド(安定型)	6,773,020円	8,880,990円
FPバランスファンド(安定成長型)	30,139,204円	40,209,656円
eMAXIS 新興国株式インデックス	10,825,174,383円	12,515,846,853円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	558,240,152円	1,206,860,785円
eMAXIS バランス(波乗り型)	61,130,731円	87,567,311円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	21,799,376円	127,656,595円
コアバランス	102,726円	
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	2,418,330,415円	3,297,224,701円
新興国株式インデックスオープン	197,286,806円	225,930,152円
eMAXIS 全世界株式インデックス	236,032,503円	314,672,616円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)		97,283,614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)	24,545,153円	21,575,442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）	853,280,115円	910,637,251円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）		14,499,686円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）		80,468,533円
（合計）	15,232,834,584円	18,949,314,185円
2 受益権の総数	15,232,834,584口	18,949,314,185口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2435円 (22,435円)	1.6608円 (16,608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26年1月28日 至平成27年1月26日）	（自平成27年1月27日 至平成28年1月26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。 当ファンドは、新株予約権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 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 同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年1月26日現在]	[平成28年1月26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	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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成27年1月26日現在]	[平成28年1月26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	1,483,312,003	8,472,532,317
投資証券	17,170,229	20,403,769
合計	1,500,482,232	8,492,936,086

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

区分	種類	[平成27年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,150,496,068		1,210,942,558	60,446,490
	合計	1,150,496,068		1,210,942,558	60,446,490

区分	種類	[平成28年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	985,949,775		915,136,068	70,813,707
	合計	985,949,775		915,136,068	70,813,707

## (注)時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

区分	種類	[平成27年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 チェココルナ	4,750,300		4,750,000	300
	合計	4,750,300		4,750,000	300

区分	種類	[平成28年1月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 香港ドル	45,450,000		45,450,000	
	合計	45,450,000		45,450,000	

## (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。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (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。

## (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	58.COM INC-ADR	3,000	56.740000	170,220.00	
	AK TRANSNEFT OAO-PREF	130	2,538.244963	329,971.84	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	41,750	69.720000	2,910,810.00	
	ALROSA PAO	151,000	0.725982	109,623.22	
	AMBEV SA-ADR	8,500	4.090000	34,765.00	

AMERICA MOVIL-SPN ADR CL L	800	12.60000	10,080.00	
BAIDU INC - SPON ADR	11,500	167.540000	1,926,710.00	
BANCO BRADESCO-ADR	3,501	4.120000	14,424.12	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	15,300	3.740000	57,222.00	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	91,497	3.720000	340,368.84	
CREDICORP LTD	5,670	90.270000	511,830.90	
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	11,850	42.920000	508,602.00	
DP WORLD LTD	13,800	17.750000	244,950.00	
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	1,400	5.580000	7,812.00	
GAZPROM PAO	36,000	1.704122	61,348.39	
GAZPROM PAO -SPON ADR	485,500	3.305500	1,604,820.25	
GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR	62,000	1.100000	68,200.00	
HON HAI PRECISION-GDR REG S	10,422	4.655000	48,514.41	
INFOSYS LTD-SP ADR	3,600	17.810000	64,116.00	
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR	3,990	5.620000	22,423.80	
JD.COM INC-ADR	14,200	27.030000	383,826.00	
LUKOIL PJSC	1,950	30.097614	58,690.34	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	40,750	29.570000	1,204,977.50	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	21,560	34.570000	745,329.20	
MEGAFON-REG S GDR	7,550	10.200000	77,010.00	
MMC NORILSK NICKEL PJSC	4,630	115.957178	536,881.73	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	43,350	6.020000	260,967.00	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	93,000	1.153165	107,244.37	
NETEASE INC-ADR	3,260	158.480000	516,644.80	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	5,500	29.400000	161,700.00	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	7,570	75.050000	568,128.50	
PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	4,000	2.920000	11,680.00	
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	3,900	71.430000	278,577.00	
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	2,200	44.190000	97,218.00	
RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	850	29.400000	24,990.00	
ROSNEFT OAO	97,900	3.267302	319,868.82	
ROSTELECOM PJSC	65,000	1.085385	70,550.01	
RUSHYDRO PJSC	9,500,000	0.008302	78,864.25	
SAMSUNG ELECTR-GDR	80	480.500000	38,440.00	
SASOL LTD-SPONSORED ADR	1,100	23.140000	25,454.00	
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	50,000	1.165978	58,298.91	
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	203,100	4.874500	990,010.95	
SEVERSTAL PAO	17,580	8.305353	146,008.10	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	42,000	3.336000	140,112.00	
SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	14,300	5.430000	77,649.00	
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	10,000	6.110000	61,100.00	
SOUTHERN COPPER CORP	13,407	23.490000	314,930.43	
SURGUTNEFTEGAS	593,000	0.453386	268,857.95	
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	574,000	0.581067	333,532.51	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	4,214	21.790000	91,823.06	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	1,750	43.990000	76,982.50	
TATNEFT PAO-CLS	117,400	4.098221	481,131.18	
VALE SA-SP ADR	2,000	2.150000	4,300.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	16,300	13.620000	222,006.00	
VTB BANK PJSC	434,000,000	0.000877	380,618.00	
YOUKU TUDOU INC-ADR	4,900	27.210000	133,329.00	
YY INC-ADR	1,200	58.500000	70,200.00	
アメリカドル 小計	446,544,711		18,464,743.88 (2,181,424,841)	
香港ドル				
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	61,000	49.900000	3,043,900.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,910,000	2.710000	5,176,100.00	
AIR CHINA LTD-H	154,000	5.160000	794,640.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	204,000	4.330000	883,320.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	850,000	1.660000	1,411,000.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	322,000	2.370000	763,140.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	102,500	16.100000	1,650,250.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	83,000	18.420000	1,528,860.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	176,000	5.490000	966,240.00	
BANK OF CHINA LTD-H	6,602,000	3.020000	19,938,040.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	731,900	4.640000	3,396,016.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	124,000	7.190000	891,560.00	

BEIJING ENTERPRISES HLDGS	42,500	38.900000	1,653,250.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	364,000	4.580000	1,667,120.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	389,000	5.120000	1,991,680.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	252,000	7.830000	1,973,160.00	
BYD CO LTD-H	53,500	36.300000	1,942,050.00	
CAR INC	68,000	10.120000	688,160.00	
CGN POWER CO LTD-H	750,000	2.360000	1,770,000.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	722,000	2.380000	1,718,360.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	678,000	4.440000	3,010,320.00	
CHINA COAL ENERGY CO-H	222,000	2.630000	583,860.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	371,000	6.330000	2,348,430.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	208,000	2.800000	582,400.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	114,000	13.100000	1,493,400.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,995,550	4.610000	32,249,485.50	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	204,000	2.880000	587,520.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	288,000	3.560000	1,025,280.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	206,000	8.230000	1,695,380.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	76,000	15.400000	1,170,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	278,000	5.560000	1,545,680.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	144,000	9.920000	1,428,480.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	524,000	2.950000	1,545,800.00	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	41,300	12.420000	512,946.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	280,000	2.020000	565,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	619,000	19.320000	11,959,080.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	266,000	4.550000	1,210,300.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	93,000	9.010000	837,930.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	230,000	11.080000	2,548,400.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	381,550	14.900000	5,685,095.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	98,000	20.800000	2,038,400.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	493,600	6.700000	3,307,120.00	
CHINA MOBILE LTD	510,500	83.750000	42,754,375.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	248,000	3.230000	801,040.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	150,000	5.260000	789,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	328,000	21.450000	7,035,600.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	220,200	26.150000	5,758,230.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,122,000	4.290000	9,103,380.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	274,000	3.440000	942,560.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	166,000	7.230000	1,200,180.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	334,000	4.880000	1,629,920.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	100,000	12.300000	1,230,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	74,000	19.200000	1,420,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	232,000	18.060000	4,189,920.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	158,000	12.960000	2,047,680.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	283,500	11.240000	3,186,540.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	315,000	1.570000	494,550.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	152,000	4.730000	718,960.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	150,000	12.200000	1,830,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	136,000	17.800000	2,420,800.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,160,000	3.420000	3,967,200.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	496,000	8.310000	4,121,760.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	108,951	17.700000	1,928,432.70	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	69,000	14.390000	992,910.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	212,000	3.820000	809,840.00	
CITIC LTD	362,000	10.840000	3,924,080.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	178,000	14.500000	2,581,000.00	
CNOOC LTD	1,484,000	7.270000	10,788,680.00	
COSCO PACIFIC LTD	144,000	8.380000	1,206,720.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	467,232	2.990000	1,397,023.68	
CRRC CORP LTD - H	365,550	7.300000	2,668,515.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	342,000	6.960000	2,380,320.00	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H	49,000	36.550000	1,790,950.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	236,000	2.040000	481,440.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	228,000	9.440000	2,152,320.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	62,000	34.750000	2,154,500.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	364,000	5.160000	1,878,240.00	
FAR EAST HORIZON LTD	147,000	6.070000	892,290.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	175,500	10.180000	1,786,590.00	

GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,066,000	0.990000	1,055,340.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	445,000	3.380000	1,504,100.00
GF SECURITIES CO LTD-H	112,000	16.420000	1,839,040.00
GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS	118,000	6.530000	770,540.00
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	1,008,000	1.120000	1,128,960.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	261,000	7.190000	1,876,590.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	236,000	9.650000	2,277,400.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	182,675	6.570000	1,200,174.75
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	82,000	8.050000	660,100.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	105,000	12.880000	1,352,400.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	53,000	9.170000	486,010.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	271,600	11.180000	3,036,488.00
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.910000	3,753,600.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	61,500	67.750000	4,166,625.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	136,000	4.330000	588,880.00
HUANENG POWER INTL INC-H	348,000	6.100000	2,122,800.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	334,000	1.670000	557,780.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	84,800	14.000000	1,187,200.00
IMPERIAL PACIFIC INTERNATION	4,600,000	0.158000	726,800.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	6,130,350	3.950000	24,214,882.50
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	102,000	9.020000	920,040.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	109,000	8.020000	874,180.00
KINGSOFT CORP LTD	69,000	15.780000	1,088,820.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	272,000	5.510000	1,498,720.00
LENOVO GROUP LTD	558,000	6.960000	3,883,680.00
LONGFOR PROPERTIES	122,000	9.690000	1,182,180.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	6.480000	699,840.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	65,000	27.100000	1,761,500.00
NEW WORLD CHINA LAND LTD	216,000	7.510000	1,622,160.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	136,000	4.840000	658,240.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	548,000	3.070000	1,682,360.00
PETROCHINA CO LTD-H	1,755,000	4.640000	8,143,200.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	324,000	13.420000	4,348,080.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	433,000	35.150000	15,219,950.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,200,000	0.680000	1,496,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	156,000	4.970000	775,320.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	232,000	3.400000	788,800.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	33,500	16.800000	562,800.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	40,000	16.940000	677,600.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	56,000	14.040000	786,240.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	47,000	39.400000	1,851,800.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	115,000	10.700000	1,230,500.00
SHUI ON LAND LTD	297,600	1.800000	535,680.00
SIHUA PHARMACEUTICAL HLDGS	316,000	4.377000	1,383,132.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	372,000	5.220000	1,941,840.00
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	288,000	3.820000	1,100,160.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	101,000	6.360000	642,360.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	297,000	3.100000	920,700.00
SINOPHARM GROUP CO-H	99,600	27.650000	2,753,940.00
SINOTRANS LIMITED-H	159,000	3.420000	543,780.00
SOHO CHINA LTD	172,000	3.410000	586,520.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	202,000	4.400000	888,800.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	154,000	4.720000	726,880.00
TENCENT HOLDINGS LTD	429,800	144.300000	62,020,140.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	164,000	9.070000	1,487,480.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	76,000	11.500000	874,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	30,000	28.800000	864,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	495,000	4.960000	2,455,200.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	82,400	7.300000	601,520.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	152,000	3.110000	472,720.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	570,000	1.110000	632,700.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	122,000	7.160000	873,520.00
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	44,000	36.050000	1,586,200.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	488,000	1.810000	883,280.00
ZTE CORP-H	63,131	13.880000	876,258.28
香港ドル 小計	68,841,789		459,143,029.41 (6,956,016,895)

マレーシアリングット				
AIRASIA BHD	100,000	1.340000	134,000.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	92,000	3.190000	293,480.00	
AMMB HOLDINGS BHD	163,000	4.320000	704,160.00	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	127,000	2.560000	325,120.00	
AXIATA GROUP BERHAD	217,000	6.140000	1,332,380.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	55,293	3.000000	165,879.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	10,600	55.500000	588,300.00	
BUMI ARMADA BERHAD	205,500	0.920000	189,060.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	360,000	4.120000	1,483,200.00	
DIALOG GROUP BHD	324,680	1.510000	490,266.80	
DIGI.COM BHD	294,000	5.120000	1,505,280.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	102,000	1.500000	153,000.00	
GAMUDA BHD	139,000	4.450000	618,550.00	
GENTING BHD	188,600	7.260000	1,369,236.00	
GENTING MALAYSIA BHD	246,900	4.190000	1,034,511.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	19,500	10.200000	198,900.00	
HAP SENG CONSOLIDATED	44,000	6.650000	292,600.00	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	52,000	5.950000	309,400.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	54,000	12.900000	696,600.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	18,500	13.220000	244,570.00	
IHH HEALTHCARE BHD	207,000	6.550000	1,355,850.00	
IJM CORP BHD	256,600	3.350000	859,610.00	
IOI CORP BHD	241,400	4.340000	1,047,676.00	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	132,800	2.140000	284,192.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,300	22.700000	801,310.00	
LAFARGE MALAYSIA BHD	33,500	8.740000	292,790.00	
MALAYAN BANKING BHD	399,000	8.310000	3,315,690.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	68,000	5.680000	386,240.00	
MAXIS BHD	158,000	6.550000	1,034,900.00	
MISC BHD	94,000	8.690000	816,860.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	235,000	6.900000	1,621,500.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	20,300	24.240000	492,072.00	
PETRONAS GAS BHD	58,200	21.200000	1,233,840.00	
PPB GROUP BERHAD	38,800	16.100000	624,680.00	
PUBLIC BANK BERHAD	211,400	18.200000	3,847,480.00	
RHB CAPITAL BHD	46,000	5.130000	235,980.00	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	271,000	1.620000	439,020.00	
SIME DARBY BERHAD	259,500	7.350000	1,907,325.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	92,000	6.560000	603,520.00	
TENAGA NASIONAL BHD	281,300	12.800000	3,600,640.00	
UMW HOLDINGS BHD	49,000	6.780000	332,220.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	84,000	3.860000	324,240.00	
YTL CORP BHD	358,464	1.520000	544,865.28	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	162,000	1.410000	228,420.00	
マレーシアリングット 小計	6,606,137		38,359,413.08 (1,057,569,018)	
タイパーツ				
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	87,200	155.000000	13,516,000.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	36,000	347.000000	12,492,000.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	20,600	145.500000	2,997,300.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	309,000	21.900000	6,767,100.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	555,000	5.400000	2,997,000.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	86,000	15.300000	1,315,800.00	
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	83,000	29.750000	2,469,250.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	492,000	8.200000	4,034,400.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	30,000	221.000000	6,630,000.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	113,800	44.000000	5,007,200.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	264,000	17.900000	4,725,600.00	
CP ALL PCL-NVDR	368,200	41.500000	15,280,300.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	43,000	77.000000	3,311,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	97,000	21.700000	2,104,900.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	43,500	75.500000	3,284,250.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	332,001	6.650000	2,207,806.65	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	120,000	20.700000	2,484,000.00	
IRPC PCL - NVDR	830,000	4.360000	3,618,800.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	144,000	157.500000	22,680,000.00	

KRUNG THAI BANK - NVDR	294,000	17.700000	5,203,800.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	144,500	32.750000	4,732,375.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	116,700	50.500000	5,893,350.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	170,561	50.000000	8,528,050.00	
PTT PCL-NVDR	83,600	222.000000	18,559,200.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	34,200	420.000000	14,364,000.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	130,500	120.000000	15,660,000.00	
THAI OIL PCL-NVDR	69,200	65.250000	4,515,300.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	146,000	17.700000	2,584,200.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,110,000	2.560000	2,841,600.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	700,000	6.550000	4,585,000.00	
タイパーツ 小計	7,053,562		205,389,581.65 (673,677,827)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	160,000	56.950000	9,112,000.00	
ABOITIZ POWER CORP	122,000	41.000000	5,002,000.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	182,000	14.000000	2,548,000.00	
AYALA CORPORATION	18,220	659.000000	12,006,980.00	
AYALA LAND INC	614,000	30.750000	18,880,500.00	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	66,000	86.500000	5,709,000.00	
BDO UNIBANK INC	134,500	99.200000	13,342,400.00	
DMCI HOLDINGS INC	325,000	10.960000	3,562,000.00	
ENERGY DEVELOPMENT CORP	800,000	5.540000	4,432,000.00	
GLOBE TELECOM INC	2,800	1,749.000000	4,897,200.00	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,650	1,233.000000	8,199,450.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	45,000	60.000000	2,700,000.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	210,000	61.700000	12,957,000.00	
JOLLIBEE FOODS CORP	35,700	200.200000	7,147,140.00	
MEGAWORLD CORP	910,000	3.360000	3,057,600.00	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,120,000	5.320000	5,958,400.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	26,500	71.300000	1,889,450.00	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	8,150	2,068.000000	16,854,200.00	
ROBINSONS LAND CO	130,000	24.000000	3,120,000.00	
SM INVESTMENTS CORP	13,400	782.000000	10,478,800.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	684,500	20.200000	13,826,900.00	
UNIVERSAL ROBINA CORP	73,000	185.700000	13,556,100.00	
フィリピンペソ 小計	5,687,420		179,237,120.00 (440,923,315)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	1,240,000	498.000000	617,520,000.00	
AKR CORPORINDO TBK PT	140,000	7,150.000000	1,001,000,000.00	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	34,000	16,800.000000	571,200,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,681,000	6,125.000000	10,296,125,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,025,000	13,125.000000	13,453,125,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	281,000	3,475.000000	976,475,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	776,000	9,525.000000	7,391,400,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	627,000	5,025.000000	3,150,675,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	922,000	11,425.000000	10,533,850,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	620,000	1,650.000000	1,023,000,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	610,000	3,280.000000	2,000,800,000.00	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	580,000	830.000000	481,400,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	40,000	54,975.000000	2,199,000,000.00	
HM SAMPOERNA TBK PT	31,000	93,975.000000	2,913,225,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	120,000	19,550.000000	2,346,000,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	99,000	14,300.000000	1,415,700,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	361,000	5,700.000000	2,057,700,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	170,000	5,725.000000	973,250,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	1,740,000	1,355.000000	2,357,700,000.00	
LIPPO KARAWACI TBK PT	1,640,000	1,040.000000	1,705,600,000.00	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	194,000	15,900.000000	3,084,600,000.00	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	385,000	1,340.000000	515,900,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	908,500	2,490.000000	2,262,165,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	245,000	10,300.000000	2,523,500,000.00	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	850,000	1,465.000000	1,245,250,000.00	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	500,000	2,750.000000	1,375,000,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	4,183,000	3,205.000000	13,406,515,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	155,000	5,650.000000	875,750,000.00	



UNILEVER INDONESIA TBK PT	128,000	35,625.000000	4,560,000,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	137,000	16,925.000000	2,318,725,000.00	
XL AXIATA TBK PT	245,000	3,600.000000	882,000,000.00	
インドネシアルピア 小計	20,667,500		100,514,150,000.00 (854,370,275)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B.-A	236,700	31.300000	7,408,710.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,619,000	11.780000	30,851,820.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	33,866	104.370000	3,534,594.42	
CEMEX SAB-CPO	1,116,346	7.470000	8,339,104.62	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	41,800	121.440000	5,076,192.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	15,800	197.260000	3,116,708.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	153,000	163.720000	25,049,160.00	
GENTERA SAB DE CV	88,000	30.820000	2,712,160.00	
GRUMA S.A.B.-B	16,300	253.060000	4,124,878.00	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	26,800	147.110000	3,942,548.00	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	16,500	237.980000	3,926,670.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	137,400	47.100000	6,471,540.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	48,200	67.140000	3,236,148.00	
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	29,000	47.280000	1,371,120.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	153,500	27.260000	4,184,410.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	207,800	86.030000	17,877,034.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	195,000	27.880000	5,436,600.00	
GRUPO LALA SAB DE CV	52,000	40.610000	2,111,720.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	316,870	34.180000	10,830,616.60	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	203,500	96.580000	19,654,030.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	11,800	156.650000	1,848,470.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	126,500	42.140000	5,330,710.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	86,000	36.180000	3,111,480.00	
OHL MEXICO SAB DE CV	67,000	16.520000	1,106,840.00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	20,500	202.440000	4,150,020.00	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	436,000	43.830000	19,109,880.00	
メキシコペソ 小計	6,455,182		203,913,163.64 (1,294,848,589)	
ブラジルリアル				
AMBEV SA	383,900	16.850000	6,468,715.00	
B2W CIA DIGITAL	8,500	13.040000	110,840.00	
BANCO BRADESCO S.A.	59,792	18.500000	1,106,152.00	
BANCO BRADESCO S.A.- RIGHTS	6,946	0.310000	2,153.26	
BANCO BRADESCO S.A.-RTS	1,958	0.020000	39.16	
BANCO BRADESCO SA-PREF	219,044	17.360000	3,802,603.84	
BANCO DO BRASIL S.A.	71,900	13.000000	934,700.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	34,500	13.060000	450,570.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	58,500	21.980000	1,285,830.00	
BM&FBOVESPA SA	144,400	10.040000	1,449,776.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	37,000	10.800000	399,600.00	
BRASKEM SA-PREF A	12,800	23.960000	306,688.00	
BRF SA	54,400	47.000000	2,556,800.00	
CCR SA	74,300	11.140000	827,702.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	17,000	8.620000	146,540.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	18,800	38.140000	717,032.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	13,200	34.000000	448,800.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	15,000	11.800000	177,000.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	61,873	4.470000	276,572.31	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	9,100	19.000000	172,900.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	28,000	19.490000	545,720.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	54,900	3.450000	189,405.00	
CIELO SA	71,024	32.450000	2,304,728.80	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	10,100	23.450000	236,845.00	
CPFL ENERGIA SA	16,749	14.740000	246,880.26	
DURATEX SA	25,859	4.890000	126,450.51	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	20,200	10.900000	220,180.00	
EMBRAER SA	55,700	27.910000	1,554,587.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,000	34.210000	513,150.00	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	24,000	11.000000	264,000.00	
FIBRIA CELULOSE SA	20,900	44.450000	929,005.00	
GERDAU SA-PREF	72,900	3.320000	242,028.00	

HYPERMARCAS SA	28,600	21.400000	612,040.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	248,752	23.340000	5,805,871.68	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	292,516	6.400000	1,872,102.40	
JBS SA	61,500	10.640000	654,360.00	
KLABIN SA - UNIT	45,400	20.200000	917,080.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	115,892	7.740000	897,004.08	
LOCALIZA RENT A CAR	12,300	20.490000	252,027.00	
LOJAS AMERICANAS SA	12,500	10.620000	132,750.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	41,218	17.720000	730,382.96	
LOJAS RENNER S.A.	53,500	16.700000	893,450.00	
M DIAS BRANCO SA	3,000	58.890000	176,670.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	6,700	39.200000	262,640.00	
NATURA COSMETICOS SA	14,700	21.600000	317,520.00	
ODONTOPREV S.A.	22,000	9.270000	203,940.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	229,100	6.210000	1,422,711.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	338,900	4.410000	1,494,549.00	
PORTO SEGURO SA	9,200	23.000000	211,600.00	
QUALICORP SA	18,400	12.750000	234,600.00	
RAIA DROGASIL SA	18,100	38.860000	703,366.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	15,006	15.850000	237,845.10	
SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	31,000	14.980000	464,380.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	32,375	33.950000	1,099,131.25	
TIM PARTICIPACOES SA	70,377	6.170000	434,226.09	
TOTVS SA	10,000	28.600000	286,000.00	
TRACTEBEL ENERGIA SA	13,400	30.800000	412,720.00	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500	15.500000	116,250.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	30,300	57.280000	1,735,584.00	
VALE SA	103,700	9.030000	936,411.00	
VALE SA-PREF	163,800	6.730000	1,102,374.00	
WEG SA	46,480	14.750000	685,580.00	
ブラジルリアル 小計	3,814,461		54,319,158.70 (1,569,280,494)	
チリペソ				
AES GENER SA	205,000	303.630000	62,244,150.00	
AGUAS ANDINAS SA-A	221,000	350.010000	77,352,210.00	
BANCO DE CHILE	1,975,386	69.880000	138,039,973.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,751	26,859.000000	73,889,109.00	
BANCO SANTANDER CHILE	5,520,000	29.910000	165,103,200.00	
CENCOSUD SA	107,000	1,385.800000	148,280,600.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	12,500	7,136.200000	89,202,500.00	
COLBUN SA	670,000	166.230000	111,374,100.00	
CORPBANCA	12,550,000	5.197000	65,222,350.00	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	22,000	1,798.600000	39,569,200.00	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	272,500	863.310000	235,251,975.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	9,800	6,485.900000	63,561,820.00	
EMPRESAS CMPC SA	103,500	1,455.600000	150,654,600.00	
EMPRESAS COPEC SA	38,000	5,633.100000	214,057,800.00	
ENERSIS SA	1,641,000	162.430000	266,547,630.00	
LATAM AIRLINES GROUP SA	25,500	3,525.600000	89,902,800.00	
S.A.C.I. FALABELLA	41,000	4,568.300000	187,300,300.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	8,000	11,133.000000	89,064,000.00	
SONDA SA	40,000	1,137.600000	45,504,000.00	
チリペソ 小計	23,464,937		2,312,122,317.00 (378,956,847)	
韓国ウォン				
AMOREPACIFIC CORP	2,670	399,000.000000	1,065,330,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	750	210,000.000000	157,500,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	2,335	145,000.000000	338,575,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	700	209,000.000000	146,300,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	21,500	8,370.000000	179,955,000.00	
CELLTRION INC	5,587	113,200.000000	632,448,400.00	
CELLTRION INC-NEW	167	113,200.000000	18,904,400.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	6,600	21,700.000000	143,220,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	666	410,000.000000	273,060,000.00	
CJ CORP	1,215	278,500.000000	338,377,500.00	
CJ E&M CORP	1,550	90,500.000000	140,275,000.00	
CJ KOREA EXPRESS CORP	580	210,500.000000	122,090,000.00	

COWAY CO LTD	4,520	97,400.000000	440,248,000.00
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2,350	73,500.000000	172,725,000.00
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	8,900	5,530.000000	49,217,000.00
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	3,768	13,950.000000	52,563,600.00
DAEWOO SECURITIES CO LTD	14,838	7,790.000000	115,588,020.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	14,300	8,790.000000	125,697,000.00
DONGBU INSURANCE CO LTD	3,570	64,700.000000	230,979,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	2,980	32,300.000000	96,254,000.00
DOOSAN CORP	650	75,200.000000	48,880,000.00
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	4,100	16,000.000000	65,600,000.00
E-MART INC	1,750	172,000.000000	301,000,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,100	23,450.000000	96,145,000.00
GS HOLDINGS	4,310	49,050.000000	211,405,500.00
GS RETAIL CO LTD	2,150	62,000.000000	133,300,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	24,750	20,750.000000	513,562,500.00
HANKOOK TIRE CO LTD	6,156	45,150.000000	277,943,400.00
HANMI PHARM CO LTD	438	728,000.000000	318,864,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	979	162,500.000000	159,087,500.00
HANON SYSTEMS	3,180	52,500.000000	166,950,000.00
HANSSEM CO LTD	785	266,500.000000	209,202,500.00
HANWIHA CHEMICAL CORP	8,880	25,650.000000	227,772,000.00
HANWIHA CORPORATION	3,700	33,800.000000	125,060,000.00
HANWIHA LIFE INSURANCE CO LTD	17,900	6,800.000000	121,720,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	2,795	68,500.000000	191,457,500.00
HYOSUNG CORPORATION	1,890	114,500.000000	216,405,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,250	123,000.000000	153,750,000.00
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	4,700	43,100.000000	202,570,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	6,620	32,550.000000	215,481,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,570	202,000.000000	317,140,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,525	87,600.000000	308,790,000.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	5,200	30,600.000000	159,120,000.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	5,660	247,500.000000	1,400,850,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	13,210	137,500.000000	1,816,375,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2,710	98,800.000000	267,748,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1,850	97,300.000000	180,005,000.00
HYUNDAI STEEL CO	6,731	47,300.000000	318,376,300.00
HYUNDAI WIA CORP	1,390	105,000.000000	145,950,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,350	11,150.000000	260,352,500.00
KAKAO CORP	2,490	113,100.000000	281,619,000.00
KANGWON LAND INC	9,850	39,400.000000	388,090,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	32,150	29,650.000000	953,247,500.00
KCC CORP	485	423,500.000000	205,397,500.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	1,870	99,400.000000	185,878,000.00
KIA MOTORS CORP	21,920	48,100.000000	1,054,352,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,710	68,500.000000	254,135,000.00
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21,480	50,600.000000	1,086,888,000.00
KOREA GAS CORPORATION	2,250	33,550.000000	75,487,500.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,230	43,750.000000	141,312,500.00
KOREA ZINC CO LTD	710	427,500.000000	303,525,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,095	24,300.000000	75,208,500.00
KT CORP	2,250	26,800.000000	60,300,000.00
KT&G CORP	9,110	97,000.000000	883,670,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,150	49,300.000000	56,695,000.00
LG CHEM LTD	3,860	302,000.000000	1,165,720,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	630	227,500.000000	143,325,000.00
LG CORP	7,950	70,100.000000	557,295,000.00
LG DISPLAY CO LTD	19,450	21,900.000000	425,955,000.00
LG ELECTRONICS INC	8,841	56,800.000000	502,168,800.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	777	986,000.000000	766,122,000.00
LG INNOTEK CO LTD	1,160	85,500.000000	99,180,000.00
LG UPLUS CORP	17,800	9,320.000000	165,896,000.00
LOTTE CHEMICAL CORP	1,290	259,000.000000	334,110,000.00
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	50	2,161,000.000000	108,050,000.00
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	61	2,306,000.000000	140,666,000.00
LOTTE SHOPPING CO	925	229,000.000000	211,825,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	5,051	19,250.000000	97,231,750.00
NAVER CORP	2,329	673,000.000000	1,567,417,000.00

NCSOFT CORP	1,440	229,500.000000	330,480,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,139	8,950.000000	108,644,050.00	
OCI CO LTD	1,350	65,000.000000	87,750,000.00	
ORION CORP	300	1,013,000.000000	303,900,000.00	
OTTOGI CORPORATION	95	1,377,000.000000	130,815,000.00	
PARADISE CO LTD	3,700	14,400.000000	53,280,000.00	
POSCO	5,790	170,000.000000	984,300,000.00	
S-1 CORPORATION	1,550	98,000.000000	151,900,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,299	150,000.000000	944,850,000.00	
SAMSUNG CARD CO	2,850	30,300.000000	86,355,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	4,980	54,100.000000	269,418,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,209	1,162,000.000000	10,700,858,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,634	975,000.000000	1,593,150,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2,955	287,000.000000	848,085,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	12,300	10,100.000000	124,230,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	6,690	98,400.000000	658,296,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,599	102,500.000000	471,397,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,590	260,000.000000	673,400,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,763	35,950.000000	171,229,850.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	35,510	37,650.000000	1,336,951,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	574	212,500.000000	121,975,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,925	230,000.000000	672,750,000.00	
SK HYNIX INC	48,460	28,000.000000	1,356,880,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	5,360	136,500.000000	731,640,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	9,700	5,240.000000	50,828,000.00	
SK TELECOM	818	194,000.000000	158,692,000.00	
S-OIL CORP	3,730	80,700.000000	301,011,000.00	
WOORI BANK	27,807	8,450.000000	234,969,150.00	
YUHAN CORP	647	316,500.000000	204,775,500.00	
韓国ウォン 小計	672,513		50,123,747,220.00 (4,937,189,101)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	239,168	11.150000	2,666,723.20	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	527,589	34.800000	18,360,097.20	
ADVANTECH CO LTD	25,889	203.000000	5,255,467.00	
ASIA CEMENT CORP	197,281	25.300000	4,991,209.30	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	160,000	10.900000	1,744,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	58,774	271.500000	15,957,141.00	
AU OPTRONICS CORP	727,000	8.870000	6,448,490.00	
CASETEK HOLDINGS LTD	12,000	150.500000	1,806,000.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,000	228.500000	12,567,500.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	672,366	35.250000	23,700,901.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	83,464	52.300000	4,365,167.20	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	390,942	15.550000	6,079,148.10	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	136,413	49.900000	6,807,008.70	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	38,970	66.500000	2,591,505.00	
CHINA AIRLINES LTD	226,000	11.150000	2,519,900.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,128,255	7.270000	8,202,413.85	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	267,393	22.950000	6,136,669.35	
CHINA STEEL CORP	986,947	17.850000	17,617,003.95	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	316,000	102.000000	32,232,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	356,775	18.250000	6,511,143.75	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,282,848	14.850000	19,050,292.80	
DELTA ELECTRONICS INC	160,220	139.500000	22,350,690.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	600,072	17.000000	10,201,224.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	15,400	420.000000	6,468,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	159,000	17.350000	2,758,650.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	133,318	11.400000	1,519,825.20	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	266,138	23.650000	6,294,163.70	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	132,000	69.700000	9,200,400.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	24,720	165.000000	4,078,800.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	739,529	14.400000	10,649,217.60	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	267,430	70.500000	18,853,815.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	94,150	81.000000	7,626,150.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	343,600	76.000000	26,113,600.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	61,000	27.850000	1,698,850.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,240	62.000000	4,726,880.00	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	547,087	36.200000	19,804,549.40	
GIANT MANUFACTURING	23,000	209.500000	4,818,500.00	
HERMES MICROVISION INC	3,250	761.000000	2,473,250.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	65,000	29.450000	1,914,250.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,028	119.000000	2,026,332.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,174,764	76.000000	89,282,064.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20,000	330.000000	6,600,000.00	
HTC CORP	54,744	76.800000	4,204,339.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	540,394	14.550000	7,862,732.70	
INNOLUX CORP	697,112	9.380000	6,538,910.56	
INOTERA MEMORIES INC	188,000	28.400000	5,339,200.00	
INVENTEC CORP	195,429	24.150000	4,719,610.35	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,420	2,075.000000	17,471,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	173,236	32.500000	5,630,170.00	
MEDIATEK INC	123,236	214.500000	26,434,122.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	903,754	20.000000	18,075,080.00	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	17,700	140.000000	2,478,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	394,557	56.400000	22,253,014.80	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	48,000	121.500000	5,832,000.00	
OBI PHARMA INC	8,000	565.000000	4,520,000.00	
PEGATRON CORP	160,976	75.100000	12,089,297.60	
PHISON ELECTRONICS CORP	11,000	228.500000	2,513,500.00	
POU CHEN	184,500	37.250000	6,872,625.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	55,300	66.600000	3,682,980.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,000	211.000000	9,917,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	226,150	51.000000	11,533,650.00	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	36,522	61.600000	2,249,755.20	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	38,703	76.600000	2,964,649.80	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	69,000	37.750000	2,604,750.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	41,000	53.300000	2,185,300.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	689,281	6.300000	4,342,470.30	
SILICONWARE PRECISION INDS	183,000	51.300000	9,387,900.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	23,150	97.400000	2,254,810.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	797,741	8.460000	6,748,888.86	
STANDARD FOODS CORP	30,582	77.400000	2,367,046.80	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	111,137	30.350000	3,373,007.95	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	659,664	10.550000	6,959,455.20	
TAIWAN BUSINESS BANK	348,852	7.710000	2,689,648.92	
TAIWAN CEMENT	274,706	25.850000	7,101,150.10	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	594,077	13.150000	7,812,112.55	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	65,000	41.300000	2,684,500.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	138,400	99.900000	13,826,160.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,026,000	139.500000	282,627,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	158,000	24.450000	3,863,100.00	
TRANSCEND INFORMATION INC	15,000	85.100000	1,276,500.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	400,624	53.300000	21,353,259.20	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,012,000	11.450000	11,587,400.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	66,000	39.600000	2,613,600.00	
WISTRON CORP	204,927	17.250000	3,534,990.75	
WPG HOLDINGS LTD	120,400	31.300000	3,768,520.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	739,321	10.300000	7,615,006.30	
YULON MOTOR COMPANY	70,000	28.300000	1,981,000.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	34,000	66.100000	2,247,400.00	
ニュー台湾ドル 小計	25,796,615		1,065,056,106.94 (3,748,997,496)	
インドルピー				
ACC LTD	3,800	1,245.000000	4,731,000.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	69,185	218.400000	15,110,004.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	57,500	196.950000	11,324,625.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	6,500	1,421.100000	9,237,150.00	
ASHOK LEYLAND LTD	94,000	86.750000	8,154,500.00	
ASIAN PAINTS LTD	24,160	878.600000	21,226,976.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,100	818.950000	18,098,795.00	
BAJAJ AUTO LTD	6,950	2,327.300000	16,174,735.00	
BHARAT FORGE LTD	8,550	813.200000	6,952,860.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	48,000	145.250000	6,972,000.00	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	14,700	877.900000	12,905,130.00	

BHARTI AIRTEL LTD	100,300	297.500000	29,839,250.00	
BHARTI INFRATEL LTD	40,100	367.250000	14,726,725.00	
BOSCH LTD	635	17,485.850000	11,103,514.75	
CADILA HEALTHCARE LTD	16,500	303.100000	5,001,150.00	
CAIRN INDIA LTD	37,000	118.950000	4,401,150.00	
CIPLA LTD	29,200	580.600000	16,953,520.00	
COAL INDIA LTD	58,500	304.900000	17,836,650.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,600	1,210.600000	3,147,560.00	
DABUR INDIA LTD	44,400	237.250000	10,533,900.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	6,600	1,087.100000	7,174,860.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	9,850	2,903.250000	28,597,012.50	
EICHER MOTORS LTD	1,005	16,416.150000	16,498,230.75	
GAIL INDIA LTD	31,600	356.700000	11,271,720.00	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	860	5,605.500000	4,820,730.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,800	754.300000	8,900,740.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	9,800	1,149.800000	11,268,040.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	47,100	838.700000	39,502,770.00	
HERO MOTOCORP LTD	4,150	2,525.200000	10,479,580.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	96,000	72.000000	6,912,000.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	63,400	783.300000	49,661,220.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	124,550	1,174.600000	146,296,430.00	
ICICI BANK LTD	92,700	236.050000	21,881,835.00	
IDEA CELLULAR LTD	90,500	106.950000	9,678,975.00	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	24,650	708.150000	17,455,897.50	
INFOSYS LTD	149,170	1,137.650000	169,703,250.50	
ITC LTD	187,900	309.400000	58,136,260.00	
JSW STEEL LTD	7,500	1,107.250000	8,304,375.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	26,500	1,114.150000	29,524,975.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	23,350	482.250000	11,260,537.50	
LUPIN LTD	18,500	1,699.050000	31,432,425.00	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	23,300	201.400000	4,692,620.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	31,200	1,178.300000	36,762,960.00	
MARICO LTD	38,200	214.950000	8,211,090.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,800	4,081.350000	35,915,880.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	26,750	259.000000	6,928,250.00	
NESTLE INDIA LTD	1,950	5,461.350000	10,649,632.50	
NTPC LTD	97,200	137.950000	13,408,740.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	72,000	219.650000	15,814,800.00	
PANTALOONS FASHIONS AND RETA	16,120	211.000000	3,401,320.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,700	942.800000	5,373,960.00	
POWER FINANCE CORPORATION	21,500	162.200000	3,487,300.00	
RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	76,000	65.550000	4,981,800.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	106,080	1,003.950000	106,499,016.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	25,200	186.550000	4,701,060.00	
SHREE CEMENT LTD	700	10,015.050000	7,010,535.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12,300	749.300000	9,216,390.00	
SIEMENS LTD	6,150	1,008.100000	6,199,815.00	
STATE BANK OF INDIA	126,400	182.950000	23,124,880.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	80,660	807.250000	65,112,785.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	39,350	2,304.650000	90,687,977.50	
TATA MOTORS LTD	67,700	332.600000	22,517,020.00	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	31,000	257.600000	7,985,600.00	
TATA POWER CO LTD	93,000	61.350000	5,705,550.00	
TATA STEEL LTD	25,300	254.900000	6,448,970.00	
TECH MAHINDRA LTD	19,470	514.550000	10,018,288.50	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,010	2,750.450000	8,278,854.50	
UNITED BREWERIES LTD	5,600	784.400000	4,392,640.00	
UNITED SPIRITS LTD	4,900	2,700.000000	13,230,000.00	
UPL LTD	23,600	401.600000	9,477,760.00	
VEDANTA LTD	73,500	64.400000	4,733,400.00	
WIPRO LTD	51,800	547.050000	28,337,190.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	48,700	391.250000	19,053,875.00	
インドルピー 小計	2,975,305		1,545,553,017.50 (2,720,173,310)	
チェココルナ				
CEZ AS	13,500	381.100000	5,144,850.00	
KOMERCNI BANKA AS	1,280	4,853.000000	6,211,840.00	

02 CZECH REPUBLIC AS	5,000	252.000000	1,260,000.00	
チェココルナ 小計	19,780		12,616,690.00 (59,803,110)	
コロンビアペソ				
BANCOLOMBIA SA-PREF	36,000	22,780.000000	820,080,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	32,800	9,450.000000	309,960,000.00	
CORP FIN COLOMBIANA-CD	6,550	37,440.000000	245,232,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA-NEW	60	38,400.000000	2,304,000.00	
ECOPETROL SA	377,000	958.000000	361,166,000.00	
GRUPO ARGOS SA	24,300	15,880.000000	385,884,000.00	
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	295,420	1,040.000000	307,236,800.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	19,700	34,320.000000	676,104,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	7,700	33,440.000000	257,488,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,300	7,090.000000	236,097,000.00	
コロンビアペソ 小計	832,830		3,601,551,800.00 (125,334,002)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,050	13,725.000000	41,861,250.00	
OTP BANK PLC	18,800	5,753.000000	108,156,400.00	
RICHTER GEDEON NYRT	11,700	5,410.000000	63,297,000.00	
ハンガリーフォリント 小計	33,550		213,314,650.00 (87,586,995)	
ディルハム				
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	164,000	5.650000	926,600.00	
ALDAR PROPERTIES PJSC	259,000	2.100000	543,900.00	
ARABTEC HOLDING CO PJSC	190,450	1.150000	219,017.50	
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	167,000	1.050000	175,350.00	
DUBAI ISLAMIC BANK	83,000	5.150000	427,450.00	
EMAAR MALLS GROUP PJSC	160,000	2.140000	342,400.00	
EMAAR PROPERTIES PJSC	293,500	4.580000	1,344,230.00	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	143,000	15.750000	2,252,250.00	
FIRST GULF BANK	76,100	10.250000	780,025.00	
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	58,400	7.010000	409,384.00	
ディルハム 小計	1,594,450		7,420,606.50 (239,091,941)	
ポーランドズロチ				
ALIOR BANK SA	4,200	56.350000	236,670.00	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,600	70.480000	183,248.00	
BANK MILLENNIUM SA	52,000	4.750000	247,000.00	
BANK PEKAO SA	10,970	129.250000	1,417,872.50	
BANK ZACHODNI WBK SA	2,910	239.050000	695,635.50	
CCC SA	2,000	119.000000	238,000.00	
CYFROWY POLSAT SA	16,300	21.020000	342,626.00	
ENEA SA	19,000	11.400000	216,600.00	
ENERGA SA	17,500	13.230000	231,525.00	
EUROCASH SA	7,100	48.000000	340,800.00	
GRUPA AZOTY SA	3,700	99.720000	368,964.00	
GRUPA LOTOS SA	7,800	26.820000	209,196.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,750	55.240000	649,070.00	
LPP SA	106	5,293.200000	561,079.20	
MBANK SA	1,250	286.050000	357,562.50	
ORANGE POLSKA SA	52,500	6.160000	323,400.00	
PGE SA	69,600	13.410000	933,336.00	
PKO BANK POLSKI SA	72,400	23.380000	1,692,712.00	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,800	65.860000	1,765,048.00	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	147,200	4.830000	710,976.00	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	46,350	32.290000	1,496,641.50	
SYNTHOS SA	43,000	3.850000	165,550.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	86,000	2.750000	236,500.00	
ポーランドズロチ 小計	703,036		13,620,012.20 (389,532,348)	
南アフリカランド				
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,500	186.490000	839,205.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	34,000	134.900000	4,586,600.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	28,600	254.810000	7,287,566.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	28,500	127.350000	3,629,475.00	
BARLOWORLD LTD	18,000	63.500000	1,143,000.00	
BIDVEST GROUP LTD	26,400	335.100000	8,846,640.00	

BRAIT SE	28,400	152.000000	4,316,800.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,980	451.000000	1,343,980.00	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	18,500	50.950000	942,575.00	
DISCOVERY LTD	29,800	120.100000	3,578,980.00	
EXXARO RESOURCES LTD	12,100	48.300000	584,430.00	
FIRSTRAND LTD	279,200	40.630000	11,343,896.00	
FORTRESS INCOME FUND LTD	57,700	32.280000	1,862,556.00	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	79,800	14.500000	1,157,100.00	
GOLD FIELDS LTD	64,000	51.800000	3,315,200.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	46,100	25.000000	1,152,500.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	15,000	108.840000	1,632,600.00	
INVESTEC LTD	20,000	99.300000	1,986,000.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	9,500	105.830000	1,005,385.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	78,000	32.620000	2,544,360.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	8,630	86.890000	749,860.70	
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	40,900	122.500000	5,010,250.00	
MMI HOLDINGS LTD	94,000	20.900000	1,964,600.00	
MONDI LTD	9,900	282.930000	2,801,007.00	
MR PRICE GROUP LTD	20,150	146.300000	2,947,945.00	
MTN GROUP LTD	136,800	124.880000	17,083,584.00	
NASPERS LTD-N SHS	33,180	1,820.000000	60,387,600.00	
NEDBANK GROUP LTD	16,600	170.000000	2,822,000.00	
NETCARE LTD	77,900	30.570000	2,381,403.00	
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	18,000	173.630000	3,125,340.00	
PICK N PAY STORES LTD	19,500	54.140000	1,055,730.00	
PIONEER FOODS GROUP LTD	10,750	127.950000	1,375,462.50	
PSG GROUP LTD	7,450	181.900000	1,355,155.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	56,500	36.450000	2,059,425.00	
REMGRO LTD	39,900	234.960000	9,374,904.00	
RMB HOLDINGS LTD	59,700	50.790000	3,032,163.00	
SANLAM LTD	144,900	54.080000	7,836,192.00	
SAPPI LIMITED	45,500	70.900000	3,225,950.00	
SASOL LTD	44,900	388.900000	17,461,610.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,400	132.500000	5,088,000.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	13,800	167.600000	2,312,880.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	100,884	99.500000	10,037,958.00	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	199,847	73.500000	14,688,754.50	
TELKOM SA SOC LTD	19,000	59.900000	1,138,100.00	
THE FOSCHINI GROUP LTD	17,100	111.610000	1,908,531.00	
TIGER BRANDS LTD	13,700	276.030000	3,781,611.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	35,800	88.680000	3,174,744.00	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	29,500	21.580000	636,610.00	
VODACOM GROUP LTD	30,800	144.410000	4,447,828.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	80,700	91.000000	7,343,700.00	
南アフリカランド 小計	2,345,771		263,707,745.70 (1,882,873,304)	
トルコリラ				
AKBANK T.A.S.	184,066	6.800000	1,251,648.80	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	16,800	17.320000	290,976.00	
ARCELIK AS	19,700	14.450000	284,665.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	17,820	48.740000	868,546.80	
COCA-COLA ICECEK AS	6,400	31.100000	199,040.00	
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	45,106	4.030000	181,777.18	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	114,952	3.050000	350,603.60	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,800	31.200000	180,960.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	76,600	7.990000	612,034.00	
KOC HOLDING AS	52,450	11.240000	589,538.00	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	34,800	5.080000	176,784.00	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	14,000	16.900000	236,600.00	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	10,000	19.800000	198,000.00	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10,500	73.450000	771,225.00	
TURK HAVA YOLLARI AO	44,834	7.120000	319,218.08	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	55,880	2.930000	163,728.40	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	38,400	5.130000	196,992.00	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	73,000	9.950000	726,350.00	
TURKIYE GARANTI BANKASI	193,500	7.110000	1,375,785.00	
TURKIYE HALK BANKASI	51,000	9.790000	499,290.00	



TURKIYE IS BANKASI-C	130,726	4.420000	577,808.92	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	61,000	3.660000	223,260.00	
ULKER BISKUVI SANAYI	12,700	17.680000	224,536.00	
YAPI VE KREDI BANKASI	74,500	3.490000	260,005.00	
トルコリラ 小計	1,344,534		10,759,371.78 (420,691,436)	
ユーロ				
ALPHA BANK AE	102,700	1.800000	184,860.00	
EUROBANK ERGASIAS SA	138,770	0.722000	100,191.94	
FF GROUP	2,700	13.250000	35,775.00	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,400	7.760000	158,304.00	
JUMBO SA	8,550	9.670000	82,678.50	
NATIONAL BANK OF GREECE	368,433	0.255000	93,950.41	
OPAP SA	17,900	6.490000	116,171.00	
PIRAEUS BANK S.A	506,630	0.163000	82,580.69	
PUBLIC POWER CORP	10,000	3.230000	32,300.00	
TITAN CEMENT CO. S.A.	3,850	16.840000	64,834.00	
ユーロ 小計	1,179,933		951,645.54 (121,953,375)	
カタールリアル				
BARWA REAL ESTATE CO	8,300	31.600000	262,280.00	
COMMERCIAL BANK QSC	13,410	40.200000	539,082.00	
DOHA BANK QSC	10,350	36.350000	376,222.50	
EZDAN HOLDING GROUP	66,600	12.450000	829,170.00	
INDUSTRIES QATAR	12,650	95.000000	1,201,750.00	
MASRAF AL RAYAN	30,700	32.500000	997,750.00	
OOREDOO QSC	6,600	73.600000	485,760.00	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,300	184.900000	425,270.00	
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	22,000	19.760000	434,720.00	
QATAR INSURANCE CO	7,700	74.000000	569,800.00	
QATAR ISLAMIC BANK	4,950	82.500000	408,375.00	
QATAR NATIONAL BANK	14,640	152.000000	2,225,280.00	
VODAFONE QATAR	28,500	10.420000	296,970.00	
カタールリアル 小計	228,700		9,052,429.50 (294,203,958)	
合計	626,862,716		30,434,498,477 (30,434,498,477)	

(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	200,300.00	7,052,563.00	
	投資証券 小計	200,300.00	7,052,563.00 (44,783,775)	
メキシコペソ 小計		200,300.00	7,052,563.00 (44,783,775)	
南アフリカランド				
投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	193,300.00	4,252,600.00	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	20,500.00	1,953,035.00	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	347,000.00	3,123,000.00	
	RESILIENT REIT LTD	23,700.00	2,523,813.00	
	投資証券 小計	584,500.00	11,852,448.00 (84,626,478)	
南アフリカランド 小計		584,500.00	11,852,448.00 (84,626,478)	
トルコリラ				
投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	158,000.00	393,420.00	
	投資証券 小計	158,000.00	393,420.00 (15,382,722)	
トルコリラ 小計		158,000.00	393,420.00 (15,382,722)	
合計			144,792,975 (144,792,975)	

(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 57銘柄	100.00%		7.13%
香港ドル	株式 144銘柄	100.00%		22.75%
マレーシアリングgit	株式 44銘柄	100.00%		3.46%
タイバーツ	株式 30銘柄	100.00%		2.20%
フィリピンペソ	株式 22銘柄	100.00%		1.44%
インドネシアルピア	株式 31銘柄	100.00%		2.79%
メキシコペソ	株式 26銘柄	96.66%		4.23%
	投資証券 1銘柄		3.34%	0.15%
ブラジルレアル	株式 62銘柄	100.00%		5.13%
チリペソ	株式 19銘柄	100.00%		1.24%
韓国ウォン	株式 108銘柄	100.00%		16.15%
ニュー台湾ドル	株式 88銘柄	100.00%		12.26%
インドルピー	株式 73銘柄	100.00%		8.90%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%		0.20%
コロンビアペソ	株式 10銘柄	100.00%		0.41%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.29%
ディルハム	株式 10銘柄	100.00%		0.78%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	100.00%		1.27%
南アフリカランド	株式 50銘柄	95.70%		6.16%
	投資証券 4銘柄		4.30%	0.28%
トルコリラ	株式 24銘柄	96.47%		1.38%
	投資証券 1銘柄		3.53%	0.05%
ユーロ	株式 10銘柄	100.00%		0.40%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.00%		0.96%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

2【ファンドの現況】  
【純資産額計算書】

平成28年2月29日現在  
(単位：円)

資産総額	5,063,395,829
負債総額	9,740,943
純資産総額( - )	5,053,654,886
発行済口数	2,677,344,749 口
1口当たり純資産価額( / )	1.8876 ( 1万口当たり 18,876 )

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成28年2月29日現在  
(単位：円)

資産総額	222,435,843,112
負債総額	18,667,666
純資産総額( - )	222,417,175,446
発行済口数	115,137,508,794 口
1口当たり純資産価額( / )	1.9318 ( 1万口当たり 19,318 )

<参考>

「新興国株式インデックスマザーファンド」の現況  
純資産額計算書

平成28年2月29日現在  
(単位：円)

資産総額	32,016,752,249
負債総額	53,902,134
純資産総額( - )	31,962,850,115
発行済口数	19,333,587,970 口
1口当たり純資産価額( / )	1.6532 ( 1万口当たり 16,532 )

## 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。

## 第二部【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】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

報告書代替書面については、（<http://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>）でもご覧いただけます。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

#### 3【委託会社等の経理状況】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

##### （1）【貸借対照表】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（1）「貸借対照表」の記載のとおりです。

##### （2）【損益計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（2）「損益計算書」の記載のとおりです。

##### （3）【株主資本等変動計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（3）「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

#### 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27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27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。
ソニー銀行株式会社	31,000 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。
株式会社福岡銀行	82,329 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社親和銀行	36,878 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社熊本銀行	33,847 百万円	銀行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	8,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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	12,200 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
フィデリティ証券株式会社	7,007 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。
ふくおか証券株式会社	2,198 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。



## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成28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51.0%(107,855株)、株式会社三菱東京UFJ銀行は15.0%(31,757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【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成27年10月23日 半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成27年6月30日 有価証券届出書の訂正届出書

平成27年4月24日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 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本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
  - ・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28年3月2日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwC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 大畑 茂 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27年1月27日から平成28年1月26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28年1月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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