

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年4月25日提出
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	e M A X I S 全世界株式インデックス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

e M A X I S 専用サイト <https://emaxis.jp/>

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

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

平成30年 4月26日から平成31年 4月26日まで

申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

### （８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の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:営業日の9:00~17:00)

## (9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## (10)【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

## (11)【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

## (12)【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、MSCI オール・カンントリー・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。

\* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券		
追加型	内外	不動産投信	MRF	特殊型 ( )
		その他資産 ( )	ETF	
		資産複合		

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ( )	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
不動産投信 その他資産 (投資信託証 券(株式一 般))					その他 (MSCI オール・カン トリー・ワ ールド・イン デックス(除 く日本、円換 算ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型  その他 ( )
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。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけ

ます。

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

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

#### 商品分類の定義

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

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

#### 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。

債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BBB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。	
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

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

## [ 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。

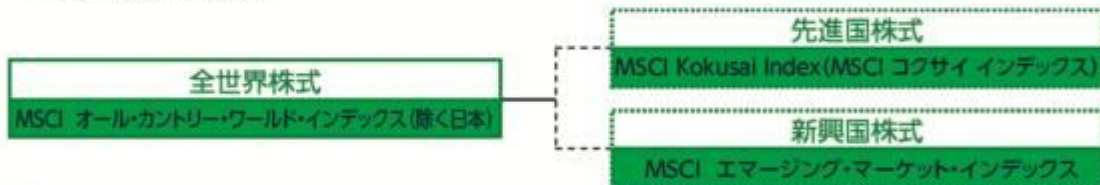
## ファンドの特色

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。

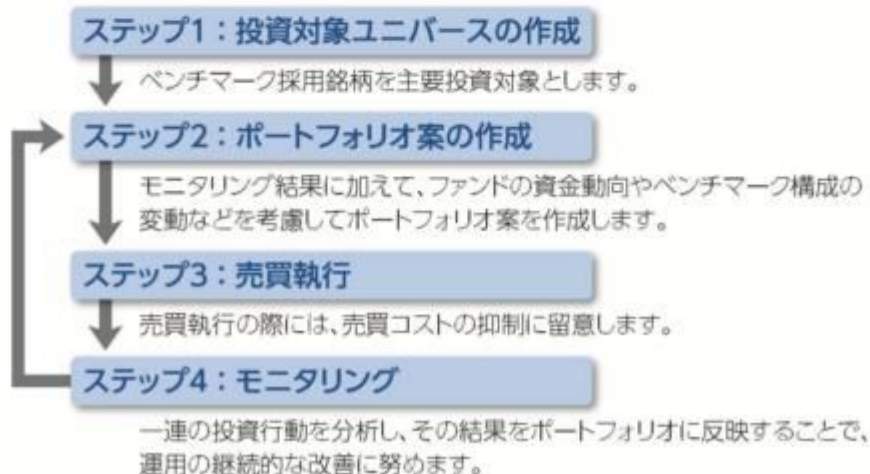
- MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。
- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

■ MSCI オール・カンントリー・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 (<https://www.am.mufig.jp/corp/operation/fm.html>) でご覧いただけます。



## 特色2

主として対象インデックスに採用されている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。
  - DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。
  - ※実際の運用は外国株式インデックスマザーファンドおよび新興国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

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

## ■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

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

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの獨創性、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、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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況（平成30年1月末現在）

- ・ 金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・ 設立年月日  
昭和60年 8月 1日
- ・ 資本金  
2,000百万円
- ・ 沿革  
平成 9年 5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始  
平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更  
平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更  
平成27年 7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・ 大株主の状況（平成30年 4月 2日現在）

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	211,581株	100.0%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券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、主として対象インデックスに採用されている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、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

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. 預託証券（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券
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

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

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

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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

##### （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とし

ます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 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

主として対象インデックスに採用されている新興国の株式等に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

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。

スワップ取引を行うことができます。

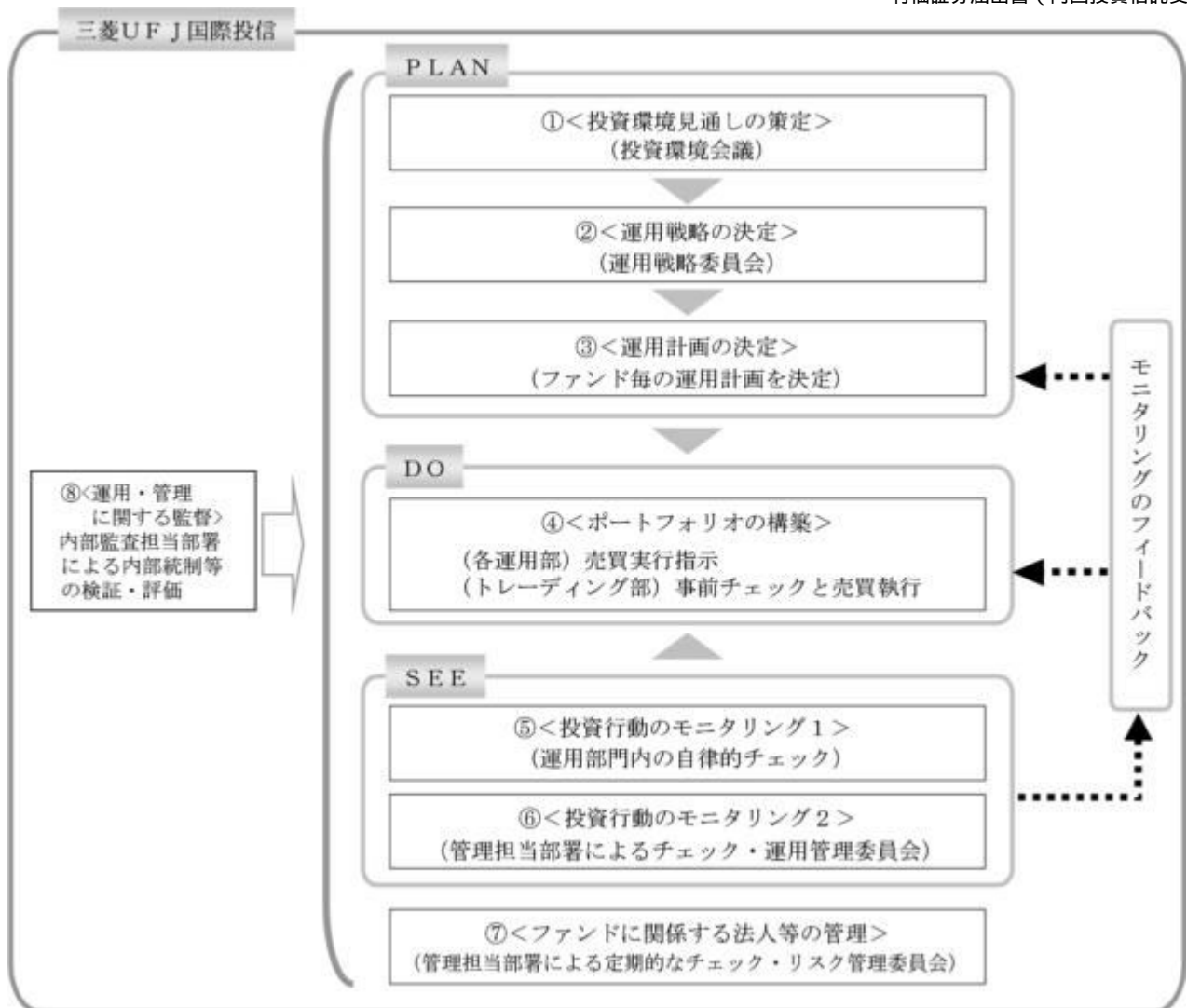
金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

外国為替予約取引を行うことができます。

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## （3）【運用体制】



#### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

#### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

#### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

#### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

#### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

#### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに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。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

#### (4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

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

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

#### (5)【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

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

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

投資信託証券

a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(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、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。）について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、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. 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。

#### 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、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。

#### 信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### < その他法令等に定められた投資制限 >

#### ・ 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

## 3【投資リスク】

### (1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 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場合があります。

#### 留意事項

・ 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

・ 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。

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

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

下落要因となります。

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比の違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

### <流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立したリスク管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスの指数について

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

## （２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

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（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

## （３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.648%（税抜0.6%）以内の率を乗じて得た額とします。

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬率（税抜）の合計ならびに配分（委託会社および販売会社、受託会社）は、ファンドの純資産総額に応じて以下の通りとなります。

ファンドの純資産総額に応じて	信託報酬率（年率）		
	合計	委託会社および販売会社	受託会社
500億円未満の部分	0.6%	0.54%	0.06%
500億円以上1,000億円未満の部分	0.58%	0.53%	0.05%
1,000億円以上の部分	0.56%	0.52%	0.04%

委託会社および販売会社への配分（税抜）は、次の通りです。

各販売会社における取扱純資産総額に応じて	委託会社	販売会社
50億円未満の部分	信託報酬率から販売会社および受託会社の配分率を差し引いた率	0.27%
50億円以上100億円未満の部分		0.28%
100億円以上の部分		0.29%

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

## （４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ・信託財産に係る監査費用(消費税等相当額を含みます。)は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産(投資している投資信託を含みます。)の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等(消費税等相当額を含みます。)、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

(注)手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用(手数料等)の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

### 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。ファンドは「つみたてNISA(非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度)」の適用対象です。NISA、ジュニアNISAおよびつみたて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。

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

## 個別元本について

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

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

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

## 収益分配金について

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

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

上記は平成30年1月末現在のもので、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】

## 【eMAXIS 全世界株式インデックス】

## (1)【投資状況】

平成30年1月31日現在  
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,903,105,082	99.92
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		5,985,914	0.08
純資産総額		7,909,090,996	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成30年1月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	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		2,503,348,011	2.7827	6,966,068,420		86.82
					2.7431	6,866,933,928		
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		370,511,033	2.8534	1,057,253,230		13.10
					2.7966	1,036,171,154		

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

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成30年1月31日現在



種類 / 業種別	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

（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】

該当事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成30年1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)
第7計算期間末日 (平成29年 1月26日)	6,213,791,006 (分配付) 6,213,791,006 (分配落)	22,333 (分配付) 22,333 (分配落)
第8計算期間末日 (平成30年 1月26日)	8,008,560,050 (分配付) 8,008,560,050 (分配落)	27,435 (分配付) 27,435 (分配落)
平成29年 1月末日	6,194,981,511	22,254
2月末日	6,268,415,396	22,681
3月末日	6,330,833,327	22,934
4月末日	6,412,279,991	23,088
5月末日	6,425,978,554	23,473
6月末日	6,560,664,121	23,824
7月末日	6,688,117,043	24,084
8月末日	6,736,055,960	24,070
9月末日	7,019,613,562	25,061
10月末日	7,295,599,498	25,690
11月末日	7,405,751,101	25,874
12月末日	7,653,881,134	26,637
平成30年 1月末日	7,909,090,996	27,022

#### 【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
第7計算期間	0円
第8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
第7計算期間	17.08
第8計算期間	22.84

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）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
第7計算期間	721,636,113	586,457,449	2,782,311,428
第8計算期間	788,170,724	651,386,929	2,919,095,223

## &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30年1月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	258,098,444,182	63.12
	イギリス	28,397,568,573	6.94
	ドイツ	16,194,939,150	3.96
	フランス	16,050,130,205	3.93
	カナダ	14,941,270,230	3.65
	スイス	13,209,112,650	3.23
	オーストラリア	10,275,720,382	2.51
	オランダ	6,935,075,169	1.70
	スペイン	5,454,853,473	1.33
	香港	5,205,642,598	1.27
	スウェーデン	4,486,358,167	1.10
	イタリア	3,306,761,533	0.81
	デンマーク	2,987,771,829	0.73
	シンガポール	1,966,484,404	0.48
	ベルギー	1,815,457,986	0.44
	フィンランド	1,541,456,714	0.38
	ノルウェー	1,092,060,856	0.27
アイルランド	778,015,306	0.19	

	ルクセンブルグ	509,200,389	0.12
	オーストリア	449,243,541	0.11
	イスラエル	420,256,914	0.10
	ニュージーランド	262,804,171	0.06
	ポルトガル	253,094,873	0.06
投資証券	アメリカ	6,819,623,372	1.67
	オーストラリア	858,723,953	0.21
	フランス	545,414,245	0.13
	イギリス	335,377,112	0.08
	香港	204,694,343	0.05
	シンガポール	186,195,506	0.05
	カナダ	66,592,058	0.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		5,268,932,165	1.30
純資産総額		408,917,276,049	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

平成30年1月31日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	5,565,074,747	1.36

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## （2）投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成30年1月31日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
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	494,858	16,823.28 18,164.66	8,325,433,198 8,988,930,435		2.20
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	700,990	7,609.86 10,089.18	5,334,924,740 7,072,417,512		1.73
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	39,125	104,991.05 156,420.43	4,107,792,237 6,119,949,628		1.50
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・サービス	227,029	16,775.41 20,356.78	3,808,569,843 4,621,580,496		1.13
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	336,998	9,662.72 12,522.81	3,256,583,472 4,220,164,249		1.03
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	257,063	13,642.26 15,494.95	3,507,104,278 3,983,180,825		0.97
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	405,840	8,943.62 9,440.79	3,629,855,626 3,831,452,729		0.94
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	29,998	102,139.66 126,597.83	3,064,009,428 3,797,681,857		0.93
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	28,539	104,657.06 128,086.08	2,986,816,874 3,655,448,702		0.89
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	959,964	2,651.21 3,468.22	2,545,131,165 3,329,371,335		0.81
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	451,782	5,864.86 7,101.81	2,650,088,239 3,208,470,467		0.78
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	121,315	18,258.22 23,325.66	2,215,011,345 2,829,752,916		0.69
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	298,011	9,427.69 9,367.15	2,809,587,140 2,791,514,692		0.68
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	112,935	17,143.12 21,954.90	1,936,166,312 2,479,477,749		0.61
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	181,433	11,727.56 13,623.77	2,127,943,535 2,471,801,770		0.60
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	587,899	4,152.51 4,073.09	2,441,757,664 2,394,570,005		0.59
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	449,681	3,926.23 5,307.86	1,765,619,507 2,386,845,636		0.58
アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	92,559	19,497.34 25,745.15	1,804,730,846 2,382,945,662		0.58
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	175,141	10,288.27 13,441.00	1,802,074,884 2,354,070,969		0.58

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	569,308	3,635.76 4,112.26	2,069,963,687 2,341,143,654	0.57
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	244,200	9,475.60 9,459.29	2,314,077,328 2,309,958,740	0.56
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	390,687	5,047.85 5,863.78	1,972,190,732 2,290,903,007	0.56
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,924,669	1,062.39 1,171.09	2,046,617,038 2,253,971,820	0.55
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	260,895	6,817.86 8,553.06	1,778,855,299 2,231,453,145	0.55
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	478,437	3,652.08 4,596.37	1,747,613,573 2,199,077,061	0.54
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	212,956	9,256.55 10,016.77	1,971,472,776 2,133,132,720	0.52
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	450,571	4,270.00 4,606.16	1,924,082,343 2,075,405,992	0.51
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	388,096	4,795.46 5,157.73	1,861,458,848 2,001,695,895	0.49
アメリカ	BOEING CO/THE	株式	資本財	53,780	21,327.19 36,739.47	1,146,993,067 1,975,848,745	0.48
アメリカ	ABBVIE INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	152,671	7,519.56 12,606.58	1,148,052,570 1,924,659,969	0.47

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

### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年1月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
エネルギー	6.60
素材	5.05
資本財	7.53
商業・専門サービス	0.99
運輸	2.01
自動車・自動車部品	1.60
耐久消費財・アパレル	1.74
消費者サービス	1.84
メディア	2.28
小売	4.25
食品・生活必需品小売り	1.72
食品・飲料・タバコ	5.11
家庭用品・パーソナル用品	1.92
ヘルスケア機器・サービス	4.18
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.06
銀行	9.83
各種金融	4.64
保険	4.04
不動産	0.62
ソフトウェア・サービス	10.43
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.86
電気通信サービス	2.42
公益事業	2.85
半導体・半導体製造装置	2.91
小計	96.51
投資証券	2.20
合計	98.71

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

平成30年1月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引								
SP EMINI (2018年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	239	アメリカドル	33,179,437.39	33,752,775.00	3,671,964,392	0.90

FTSE100 (2018年3月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	33	イギリスポンド	2,516,752.50	2,489,025.00	383,235,179	0.09
SP/TSE60 (2018年3月限)	モントリオール取引所	買建	14	カナダドル	2,689,532.50	2,640,960.00	232,932,672	0.06
SPI 200 (2018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	2,852,026.00	2,831,000.00	248,533,490	0.06
EURO ST (2018年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	180	ユーロ	6,452,325.00	6,485,400.00	876,047,832	0.21
SWISS IX (2018年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	14	スイスフラン	1,315,432.50	1,308,720.00	152,361,182	0.04

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

## <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30年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	香港	15,970,719,353	21.85
	韓国	10,223,678,266	13.99
	アメリカ	8,171,012,592	11.18
	台湾	7,782,948,291	10.65
	インド	5,913,891,603	8.09
	ブラジル	5,078,246,537	6.95
	南アフリカ	4,449,082,665	6.09
	メキシコ	1,955,003,989	2.67
	マレーシア	1,638,256,500	2.24
	タイ	1,589,526,412	2.17
	インドネシア	1,481,496,330	2.03
	ポーランド	944,632,255	1.29
	チリ	844,397,756	1.16
	フィリピン	730,427,377	1.00
	トルコ	690,201,367	0.94
	カタール	375,751,253	0.51
	アラブ首長国連邦	369,615,363	0.51
	コロンビア	305,092,008	0.42
	ギリシャ	236,301,467	0.32
	ハンガリー	228,697,343	0.31
チェコ	130,544,287	0.18	
投資証券	南アフリカ	218,889,754	0.30
	メキシコ	54,172,783	0.07
	トルコ	20,036,417	0.03
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,689,625,290	5.05
純資産総額		73,092,247,258	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

平成30年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	3,806,210,164	5.21

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### (2) 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### a 評価額上位30銘柄

平成30年1月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)		
香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・サービス	621,100	3,826.36 6,423.63	2,376,600,245 3,989,721,561		5.46

アメリカ	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	125,610	14,192.74 21,721.01	1,782,817,935 2,728,376,241	3.73
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	10,606	235,335.16 252,984.00	2,495,965,647 2,683,148,304	3.67
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・半導体 製造装置	2,677,000	786.33 941.16	2,105,104,628 2,519,485,320	3.45
南アフリ カ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	47,781	25,198.63 31,192.07	1,204,016,584 1,490,388,296	2.04
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	9,161,550	90.13 123.24	826,580,412 1,129,093,242	1.54
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	8,025,350	73.16 101.12	587,794,756 811,569,136	1.11
アメリカ	BAIDU INC - SPON ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	29,896	21,152.03 26,552.37	632,391,761 793,809,811	1.09
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信サービ ス	668,500	1,177.75 1,142.70	787,348,970 763,899,295	1.05
香港	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	株式	保険	567,500	699.39 1,254.68	396,939,452 712,032,035	0.97
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	株式	銀行	352,387	1,368.68 1,760.95	482,384,679 620,538,706	0.85
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	1,696,840	389.33 348.19	660,682,494 590,826,113	0.81
アメリカ	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	株式	銀行	269,050	1,347.90 2,128.47	362,666,336 572,666,561	0.78
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	8,625,000	52.99 64.40	457,480,026 555,478,462	0.76
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	165,204	2,745.58 3,332.50	453,584,148 550,542,330	0.75
ブラジル	VALE SA	株式	素材	346,530	961.70 1,418.27	333,302,712 491,474,489	0.67
韓国	SK HYNIX INC	株式	半導体・半導体 製造装置	63,132	6,015.43 7,426.96	379,772,084 468,878,838	0.64
インド	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	エネルギー	284,277	1,230.12 1,634.68	349,698,049 464,704,200	0.64
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	320,099	1,084.14 1,381.68	347,085,512 442,274,386	0.61
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	株式	テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	1,909	180,596.74 208,280.00	344,759,230 397,606,520	0.54
インド	INFOSYS LTD	株式	ソフトウェア・ サービス	195,065	1,637.71 2,013.51	319,461,655 392,766,888	0.54
ブラジル	AMBEV SA	株式	食品・飲料・タ バコ	514,300	673.05 747.95	346,293,528 384,672,742	0.53
アメリカ	JD.COM INC-ADR	株式	小売	71,359	4,375.53 5,358.99	312,251,265 382,412,552	0.52
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C- SER L	株式	電気通信サービ ス	3,674,600	85.43 101.32	313,951,533 372,332,519	0.51
アメリカ	LUKOIL PJSC-SPON ADR	株式	エネルギー	46,760	5,468.87 7,182.31	255,748,679 335,845,086	0.46
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,940,000	127.41 171.37	247,300,501 332,460,128	0.45
アメリカ	GAZPROM PAO -SPON ADR	株式	エネルギー	572,037	486.29 550.47	278,269,674 314,893,440	0.43
韓国	POSCO	株式	素材	8,066	28,791.40 38,557.20	232,231,572 311,002,375	0.43
アメリカ	NETEASE INC-ADR	株式	ソフトウェア・ サービス	8,678	30,809.32 35,117.41	267,371,488 304,748,901	0.42
韓国	KB FINANCIAL GROUP INC	株式	銀行	43,259	5,615.83 6,797.04	242,936,156 294,033,153	0.40

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

## b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年1月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
エネルギー	6.69
素材	6.96
資本財	3.39
商業・専門サービス	0.09
運輸	1.51
自動車・自動車部品	2.86
耐久消費財・アパレル	0.96
消費者サービス	1.12
メディア	2.42
小売	1.99
食品・生活必需品小売り	1.53
食品・飲料・タバコ	3.29
家庭用品・パーソナル用品	1.09
ヘルスケア機器・サービス	0.54

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.03
	銀行	16.97
	各種金融	2.60
	保険	3.47
	不動産	2.29
	ソフトウェア・サービス	13.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.49
	電気通信サービス	4.39
	公益事業	2.15
	半導体・半導体製造装置	5.17
	小計	94.55
投資証券		0.40
合計		94.95

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

平成30年1月31日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2018年3月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	561	アメリカドル	34,779,589.50	34,986,765.00	3,806,210,164	5.21

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

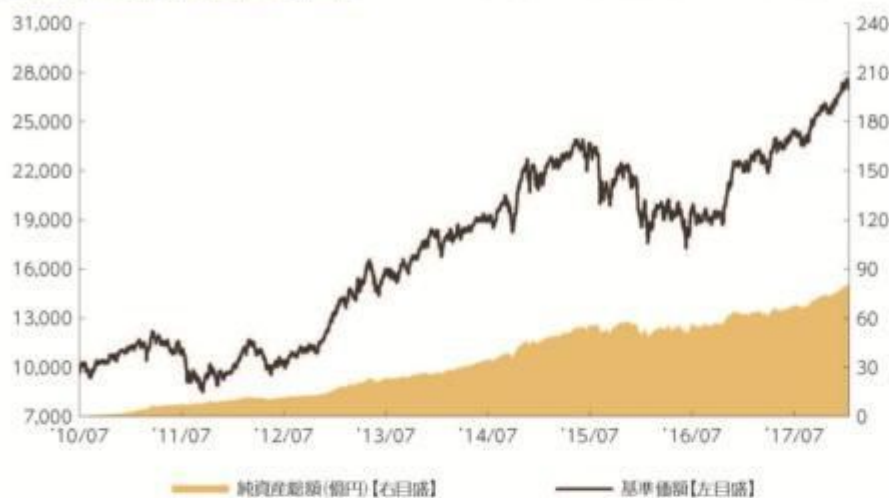
### 参考情報



## 運用実績

2018年1月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2010年7月20日(設定日)～2018年1月31日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

### ■基準価額・純資産

基準価額	27,022円
純資産総額	79.0億円

### ■分配の推移

2018年1月	0円
2017年1月	0円
2016年1月	0円
2015年1月	0円
2014年1月	0円
2013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

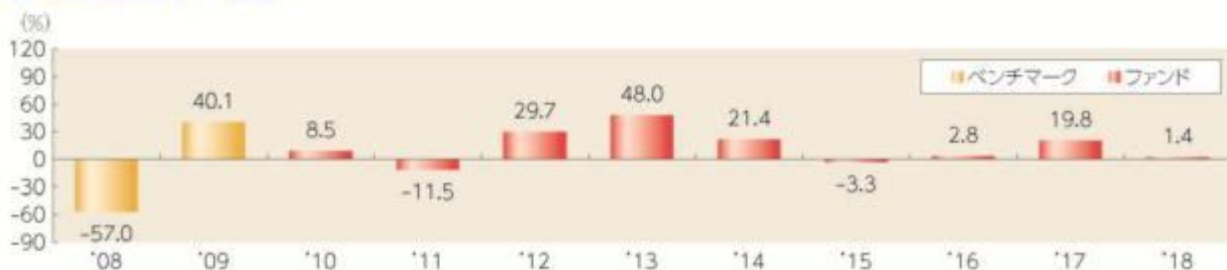
通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	58.7%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.9%
ユーロ	11.6%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.5%
イギリスポンド	6.2%	3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.3%
香港ドル	4.2%	4 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.0%
カナダドル	3.2%	5 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.9%
スイスフラン	2.8%	6 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.8%
オーストラリアドル	2.4%	7 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.8%
韓国ウォン	1.9%	8 ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
その他	9.0%	9 ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
合計	100.0%	10 TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	香港	0.7%

#### ■その他資産の状況

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.9%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

### ■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2010年は設定日から年末までの、2018年は年初から1月31日までの収益率を表示
- 2009年以前はベンチマークの年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。  
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。  
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。



## 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

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

#### 申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

#### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

#### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 申込単位・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：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 <https://www.am.mufg.jp/>
- eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

#### 申込手数料

ありません。

#### 申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（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。

#### 申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があります。

#### 取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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の受付を取り消すことがあります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。  
ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

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

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せん。

### 解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

### 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

### 信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.05%をかけた額

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

### 支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

### 解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

### 解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（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。  
また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### 基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

#### （資産の評価方法）

##### ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

##### ・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

##### ・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

##### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

##### ・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

##### ・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

##### ・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

## ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

## 基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

## 基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

## （２）【保管】

該当事項はありません。

## （３）【信託期間】

無期限（平成22年7月20日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

## （４）【計算期間】

毎年1月27日から翌年1月26日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

## ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

## 信託約款の変更等

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。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

### ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の процедуруを行うことが困難な場合を除きます。）、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、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の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。

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。

### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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。

### 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

### 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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。

### 信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載しま

す。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

##### (2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

##### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成29年1月27日から平成30年1月26日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【eMAXIS 全世界株式インデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 [平成29年 1月26日現在]	第8期 [平成30年 1月26日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	37,891,476	41,989,587
親投資信託受益証券	6,211,913,478	8,006,007,693
未収入金	2,703,378	-
流動資産合計	6,252,508,332	8,047,997,280
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	19,696,794	15,752,436
未払受託者報酬	1,892,281	2,356,314
未払委託者報酬	17,030,490	21,206,737
未払利息	53	62
その他未払費用	97,708	121,681
流動負債合計	38,717,326	39,437,230
負債合計	38,717,326	39,437,230
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,782,311,428	2,919,095,223
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,431,479,578	5,089,464,827
(分配準備積立金)	883,112,925	2,014,785,054
元本等合計	6,213,791,006	8,008,560,050
純資産合計	6,213,791,006	8,008,560,050
負債純資産合計	6,252,508,332	8,047,997,280



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自 至	平成28年 1月27日 平成29年 1月26日	自 至	平成29年 1月27日 平成30年 1月26日
営業収益				
受取利息		444		171
有価証券売買等損益		982,665,966		1,483,431,690
営業収益合計		982,666,410		1,483,431,861
営業費用				
支払利息		8,083		14,061
受託者報酬		3,589,837		4,413,145
委託者報酬		32,308,424		39,718,154
その他費用		185,368		227,895
営業費用合計		36,091,712		44,373,255
営業利益又は営業損失（ ）		946,574,698		1,439,058,606
経常利益又は経常損失（ ）		946,574,698		1,439,058,606
当期純利益又は当期純損失（ ）		946,574,698		1,439,058,606
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（ ）		77,533,763		124,321,822
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,401,904,409		3,431,479,578
剰余金増加額又は欠損金減少額		694,211,329		1,156,481,295
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		694,211,329		1,156,481,295
剰余金減少額又は欠損金増加額		533,677,095		813,232,830
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		533,677,095		813,232,830
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,431,479,578		5,089,464,827

## （ 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 7 期 [ 平成29年1月26日現在 ]	第 8 期 [ 平成30年1月26日現在 ]
1 期首元本額	2,647,132,764円	2,782,311,428円
期中追加設定元本額	721,636,113円	788,170,724円
期中一部解約元本額	586,457,449円	651,386,929円
2 受益権の総数	2,782,311,428口	2,919,095,223口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2333円 (22,333円)	2.7435円 (27,435円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 7 期（自 平成28年1月27日 至 平成29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	122,932,672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	91,577,359円
収益調整金額	C	2,548,366,653円
分配準備積立金額	D	668,602,894円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,431,479,578円
当ファンドの期末残存口数	F	2,782,311,428口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,333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 8 期（自 平成29年1月27日 至 平成30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	139,610,538円
費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額	B	1,175,126,246円
収益調整金額	C	3,074,679,773円
分配準備積立金額	D	700,048,270円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,089,464,827円
当ファンドの期末残存口数	F	2,919,095,223口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	17,435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 7 期 ( 自 平成28年 1月27日 至 平成29年 1月26日 )	第 8 期 ( 自 平成29年 1月27日 至 平成30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 7 期 [ 平成29年1月26日現在 ]	第 8 期 [ 平成30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 7 期 [ 平成29年1月26日現在 ]	第 8 期 [ 平成30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	940,774,757	1,455,342,255
合計	940,774,757	1,455,342,255

## （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	370,081,202	1,056,026,709	
	外国株式インデックスマザーファンド	2,497,567,465	6,949,980,984	
	親投資信託受益証券 小計	2,867,648,667	8,006,007,693	
	合計	2,867,648,667	8,006,007,693	

## 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;

当ファンドの主要投資対象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29年1月26日現在 ]	[ 平成30年1月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,938,472,139	10,056,704,896
コール・ローン	757,207,462	8,556,401,155
株式	331,372,007,156	400,302,402,196
投資証券	8,646,491,644	9,225,372,650
派生商品評価勘定	197,953,037	466,204,620
未収入金	2,503,484	15,468,325
未収配当金	270,353,018	282,152,046
差入委託証拠金	2,396,324,416	2,861,481,122
流動資産合計	362,581,312,356	431,766,187,010
資産合計	362,581,312,356	431,766,187,010
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,270,297	10,886,122
未払金		7,927,105,908
未払解約金	2,775,565,667	1,681,196,505
未払利息	1,074	12,668
流動負債合計	2,816,837,038	9,619,201,203
負債合計	2,816,837,038	9,619,201,203
純資産の部		
元本等		
元本	157,553,049,161	151,705,309,998
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	202,211,426,157	270,441,675,809
元本等合計	359,764,475,318	422,146,985,807
純資産合計	359,764,475,318	422,146,985,807
負債純資産合計	362,581,312,356	431,766,187,010

(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29年1月26日現在 ]	[ 平成30年1月26日現在 ]
1 期首		
期首元本額	平成28年1月27日 107,511,806,135円	平成29年1月27日 157,553,049,161円
期首からの追加設定元本額	144,979,276,843円	114,992,192,850円
期首からの一部解約元本額	94,938,033,817円	120,839,932,013円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	9,085,495,234円	13,242,772,615円
eMAXIS 先進国株式インデックス	15,876,735,618円	13,476,066,942円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,127,906,691円	1,174,650,437円
eMAXIS バランス(波乗り型)	440,942,158円	214,072,155円
コアバランス	334,848円	346,827円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定 拠出年金)	1,083,522円	6,184,600円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定 拠出年金)	540,205円	9,035,119円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定 拠出年金)	1,314,722円	7,935,318円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス		1,633,918,282円
海外株式セレクション(ラップ向け)		838,319,835円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		377,225,633円

つみたて先進国株式		47,018,752円
つみたて8資産均等バランス		5,817,499円
つみたて4資産均等バランス		1,992,672円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		799,373円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		1,041,060円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		1,206,348円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定 拠出年金)		514,574円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定 拠出年金)		740,693円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定 拠出年金)		853,869円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,195,430,610円	9,437,852,800円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,403,154,118円	2,497,567,465円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	3,946,692,552円	2,170,403,033円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	8,010,223,988円	4,120,195,136円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資 型)	172,233,366円	706,820,672円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKU SHIN)	108,700,594円	189,034,146円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	741,556,257円	823,144,617円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	23,857,779円	64,979,318円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	2,124,749円	14,498,258円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	5,078,721円	23,507,561円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィル ダー)	16,949,822円	97,037,087円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	17,424,332円	76,862,219円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	21,533,854円	208,102,339円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資 家限定)	4,914,179,280円	50,413,663円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資 家限定)	14,409,436,185円	11,700,588,317円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投 資家限定)	284,785,571円	194,544,650円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投 資家限定)	2,487,134,519円	2,016,976,191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)	61,047,009,810円	58,365,011,672円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投 資家限定)	241,669,808円	183,566,018円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投 資家限定)	95,336,166円	70,803,953円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資 家限定)	1,806,983,965円	1,495,047,763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)	3,294,610,468円	3,056,328,397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)	7,780,282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)	6,639,978,588円	7,088,023,023円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投 資家限定)	71,333,026円	42,594,477円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投 資家限定)	416,031,045円	206,106,788円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	940,643,556円	2,176,929,646円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制 型)(適格機関投資家転売制限付)	136,674,496円	820,515,984円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適 格機関投資家転売制限付)	99,729,242円	93,345,134円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限 定)	5,552,746円	21,199,007円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格 機関投資家限定)	2,448,789,957円	3,547,775,518円
MUKAM バランス・イノベーション(債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)		404,901円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,899,611,663円	2,293,906,975円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,798,039円	2,382,094円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長 型)VA	13,714,523円	8,970,102円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	29,699,389円	11,907,983円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	23,727,293円	13,223,254円

三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	92,367,343円	74,108,206円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	28,410,060円	19,308,876円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	205,200,405円	130,575,880円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	47,341,709円	23,936,934円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	356,529,046円	189,671,982円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,191,772,490円	4,341,655,916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）	179,840,881円	163,106,015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）	708,931,968円	650,203,398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）	663,866,929円	627,253,721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）	562,264,973円	554,406,306円
（合計）	157,553,049,161円	151,705,309,998円
2 受益権の総数	157,553,049,161口	151,705,309,998口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2834円 （22,834円）	2.7827円 （27,827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28年1月27日 至平成29年1月26日）	（自平成29年1月27日 至平成30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。	同 左
	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成29年1月26日現在]	[平成30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。	同 左
	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。	同 左
	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成29年1月26日現在]	[平成30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	31,009,168,228	44,659,714,225
投資証券	316,841,935	6,710,641
合計	30,692,326,293	44,666,424,866

（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29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	19,569,730,594		19,718,794,974	149,064,380
	合計	19,569,730,594		19,718,794,974	149,064,380

区分	種類	[平成30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	12,435,974,031		12,878,608,879	442,634,848
	合計	12,435,974,031		12,878,608,879	442,634,848

## （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。このような値が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

区分	種類	[平成29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	1,410,252,000		1,402,936,000	7,316,000
	カナダドル	86,466,600		86,650,000	183,400
	オーストラリアドル	60,125,450		60,025,000	100,450
	イギリスポンド	156,714,360		157,278,000	563,640
	スイスフラン	68,180,400		68,034,000	146,400
	香港ドル	29,318,800		29,160,000	158,800
	スウェーデンクローネ	25,680,400		25,700,000	19,600
	デンマーククローネ	16,410,200		16,370,000	40,200
	ユーロ	268,382,400		267,872,000	510,400
	買建				
	アメリカドル	45,253,600		45,252,000	1,600
	オーストラリアドル	42,765,050		42,880,000	114,950
	ユーロ	12,176,600		12,176,000	600
	合計	2,221,725,860		2,214,333,000	7,618,360

区分	種類	[平成30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				
	オーストラリアドル	26,451,300		26,448,000	3,300
	買建				
	アメリカドル	5,649,831,200		5,663,596,000	13,764,800
	カナダドル	323,788,350		323,717,000	71,350
	オーストラリアドル	229,518,700		229,190,000	328,700
	イギリスポンド	623,141,800		621,718,000	1,423,800
	スイスフラン	17,491,200		17,488,500	2,700
	香港ドル	112,080,000		112,240,000	160,000
	シンガポールドル	50,217,000		50,292,000	75,000
	スウェーデンクローネ	96,681,200		97,020,000	338,800
	デンマーククローネ	54,699,000		54,870,000	171,000
	ユーロ	40,853,700		40,851,000	2,700
		合計	7,224,753,450		7,237,430,500

## （注）時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。  
当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。  
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(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	57,132	252.360000	14,417,831.52	
	ABBOTT LABORATORIES	166,294	63.220000	10,513,106.68	
	ABBVIE INC	152,671	108.300000	16,534,269.30	
	ACCENTURE PLC-CL A	59,138	160.790000	9,508,799.02	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	68,710	70.820000	4,866,042.20	
	ACUITY BRANDS INC	3,902	167.070000	651,907.14	
	ADOBE SYSTEMS INC	47,246	197.510000	9,331,557.46	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	6,772	120.920000	818,870.24	
	ADVANCED MICRO DEVICES	79,972	12.410000	992,452.52	
	AERCAP HOLDINGS NV	13,000	54.680000	710,840.00	
	AES CORP	59,786	11.490000	686,941.14	
	AETNA INC	31,742	191.870000	6,090,337.54	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,605	211.000000	1,182,655.00	
	AFLAC INC	37,784	89.420000	3,378,645.28	
	AGCO CORP	5,701	72.690000	414,405.69	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,469	73.860000	2,250,440.34	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,786	174.000000	3,616,764.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,682	66.870000	1,048,655.34	
	ALBEMARLE CORP	10,689	116.900000	1,249,544.10	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,736	124.950000	2,715,913.20	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,355	273.560000	2,012,033.80	
	ALKERMES PLC	15,702	59.850000	939,764.70	
	ALLEGHANY CORP	1,557	629.500000	980,131.50	
	ALLEGION PLC	9,800	85.350000	836,430.00	
	ALLERGAN PLC	32,059	187.120000	5,998,880.08	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,994	252.850000	1,262,732.90	
	ALLIANT ENERGY CORP	23,188	40.390000	936,563.32	
	ALLSTATE CORP	34,610	100.730000	3,486,265.30	
	ALLY FINANCIAL INC	41,530	30.090000	1,249,637.70	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,488	134.290000	1,139,853.52	
	ALPHABET INC-CL A	28,539	1,182.140000	33,737,093.46	
	ALPHABET INC-CL C	29,998	1,170.370000	35,108,759.26	
	ALTRIA GROUP INC	183,758	69.910000	12,846,521.78	
	AMAZON.COM INC	39,125	1,377.950000	53,912,293.75	
	AMERCO	625	378.400000	236,500.00	
	AMEREN CORPORATION	23,630	56.740000	1,340,766.20	
	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,503	53.050000	610,234.15	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	47,249	69.700000	3,293,255.30	
	AMERICAN EXPRESS CO	71,920	99.690000	7,169,704.80	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,629	113.680000	867,264.72	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	86,705	64.800000	5,618,484.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,357	84.530000	1,467,187.21	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,416	173.130000	2,495,842.08	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	15,913	104.370000	1,660,839.81	
	AMETEK INC	22,138	76.980000	1,704,183.24	
	AMGEN INC	69,874	190.080000	13,281,649.92	
	AMPHENOL CORP-CL A	28,630	91.200000	2,611,056.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	54,638	61.490000	3,359,690.62	
	ANALOG DEVICES INC	34,957	91.980000	3,215,344.86	
	ANDEAVOR	14,650	115.120000	1,686,508.00	
	ANSYS INC	7,791	159.930000	1,246,014.63	
	ANTERO RESOURCES CORP	19,804	19.800000	392,119.20	
	ANTHEM INC	25,122	251.350000	6,314,414.70	
	AON PLC	24,906	139.550000	3,475,632.30	
	APACHE CORP	36,500	47.450000	1,731,925.00	



APPLE INC	494,858	171.110000	84,675,152.38
APPLIED MATERIALS INC	102,136	55.760000	5,695,103.36
APTIV PLC	26,071	92.490000	2,411,306.79
ARAMARK	24,355	45.790000	1,115,215.45
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,667	92.370000	1,170,050.79
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,057	42.890000	2,275,614.73
ARCONIC INC	39,566	30.470000	1,205,576.02
ARISTA NETWORKS INC	4,616	276.760000	1,277,524.16
ARROW ELECTRONICS INC	7,923	83.410000	660,857.43
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,725	65.650000	1,163,646.25
ASSURANT INC	4,931	95.030000	468,592.93
AT&T INC	587,899	37.450000	22,016,817.55
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	9,500	51.540000	489,630.00
ATMOS ENERGY CORP	10,791	82.910000	894,681.81
AUTODESK INC	18,741	116.870000	2,190,260.67
AUTOLIV INC	7,938	136.740000	1,085,442.12
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42,587	120.630000	5,137,269.81
AUTONATION INC	5,912	61.250000	362,110.00
AUTOZONE INC	2,706	786.300000	2,127,727.80
AVERY DENNISON CORP	7,989	120.960000	966,349.44
AVNET INC	11,219	42.990000	482,304.81
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,420	31.990000	621,245.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,548	51.270000	386,985.96
BAKER HUGHES A GE CO	38,944	32.310000	1,258,280.64
BALL CORP	32,398	39.210000	1,270,325.58
BANK OF AMERICA CORP	959,964	32.090000	30,805,244.76
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99,131	56.850000	5,635,597.35
BAXTER INTERNATIONAL INC	46,587	71.050000	3,310,006.35
BB&T CORP	77,371	54.690000	4,231,419.99
BECTON DICKINSON AND CO	25,306	242.350000	6,132,909.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	121,315	215.100000	26,094,856.50
BEST BUY CO INC	26,523	76.270000	2,022,909.21
BIOGEN INC	20,249	353.740000	7,162,881.26
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,748	90.560000	1,516,698.88
BLACKROCK INC	11,549	575.500000	6,646,449.50
BOEING CO/THE	53,780	343.110000	18,452,455.80
BORGWARNER INC	21,049	56.260000	1,184,216.74
BOSTON SCIENTIFIC CORP	130,664	28.260000	3,692,564.64
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	7,882	64.890000	511,462.98
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	157,106	63.520000	9,979,373.12
BROADCOM LTD	38,897	247.290000	9,618,839.13
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,637	96.380000	1,025,194.06
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,918	68.650000	1,298,720.70
BUNGE LTD	13,939	80.000000	1,115,120.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,988	96.530000	1,350,261.64
CA INC	31,739	35.130000	1,114,991.07
CABOT OIL & GAS CORP	45,728	27.620000	1,263,007.36
CADENCE DESIGN SYS INC	27,647	44.860000	1,240,244.42
CAMPBELL SOUP CO	18,702	47.460000	887,596.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,866	104.260000	4,781,989.16
CARDINAL HEALTH INC	29,696	73.990000	2,197,207.04
CARMAX INC	18,116	71.540000	1,296,018.64
CARNIVAL CORP	32,680	70.760000	2,312,436.80
CATERPILLAR INC	56,580	169.370000	9,582,954.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,933	137.160000	1,362,410.28
CBRE GROUP INC - A	29,954	45.810000	1,372,192.74
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	32,844	59.270000	1,946,663.88
CDK GLOBAL INC	12,166	74.040000	900,770.64
CDW CORP/DE	15,606	75.370000	1,176,224.22
CELANESE CORP-SERIES A	13,482	112.340000	1,514,567.88
CELGENE CORP	74,962	104.390000	7,825,283.18
CENTENE CORP	16,498	110.660000	1,825,668.68
CENTERPOINT ENERGY INC	40,546	28.380000	1,150,695.48
CENTURYLINK INC	90,262	17.780000	1,604,858.36
CERNER CORP	28,132	68.050000	1,914,382.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,358	40.410000	863,076.78
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18,526	375.140000	6,949,843.64
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12,600	103.970000	1,310,022.00
CHEMOURS CO/THE	17,751	52.790000	937,075.29
CHENIERE ENERGY INC	18,614	58.790000	1,094,317.06

CHEVRON CORP	181,433	130.650000	23,704,221.45
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,644	333.970000	883,016.68
CHUBB LTD	44,562	154.810000	6,898,643.22
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,223	49.340000	1,195,162.82
CIGNA CORP	24,082	221.880000	5,343,314.16
CIMAREX ENERGY CO	8,760	120.250000	1,053,390.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,317	77.220000	1,182,778.74
CINTAS CORP	8,754	166.580000	1,458,241.32
CISCO SYSTEMS INC	478,437	41.900000	20,046,510.30
CIT GROUP INC	12,949	51.350000	664,931.15
CITIGROUP INC	260,895	79.440000	20,725,498.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	48,274	46.670000	2,252,947.58
CITRIX SYSTEMS INC	14,817	94.000000	1,392,798.00
CLOROX COMPANY	12,308	146.130000	1,798,568.04
CME GROUP INC	32,444	154.170000	5,001,891.48
CMS ENERGY CORP	27,601	45.000000	1,242,045.00
COCA-COLA CO/THE	388,096	47.840000	18,566,512.64
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,900	40.770000	852,093.00
COGNEX CORP	16,568	67.440000	1,117,345.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	56,090	77.950000	4,372,215.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	80,297	77.310000	6,207,761.07
COMCAST CORP-CLASS A	450,571	42.140000	18,987,061.94
COMERICA INC	17,257	94.700000	1,634,237.90
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17,665	38.420000	678,689.30
CONAGRA BRANDS INC	41,169	38.040000	1,566,068.76
CONCHO RESOURCES INC	14,089	159.790000	2,251,281.31
CONOCOPHILLIPS	116,946	59.480000	6,955,948.08
CONSOLIDATED EDISON INC	30,117	80.380000	2,420,804.46
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,333	221.310000	3,614,656.23
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,468	57.070000	483,268.76
COOPER COS INC/THE	4,777	243.790000	1,164,584.83
CORNING INC	86,051	33.810000	2,909,384.31
COSTAR GROUP INC	3,312	349.540000	1,157,676.48
COSTCO WHOLESALE CORP	42,054	197.950000	8,324,589.30
COTY INC-CL A	44,566	20.250000	902,461.50
CROWN HOLDINGS INC	12,342	59.260000	731,386.92
CSX CORP	87,821	56.140000	4,930,270.94
CUMMINS INC	15,485	189.400000	2,932,859.00
CVS HEALTH CORP	97,478	81.580000	7,952,255.24
DANAHER CORP	59,821	102.700000	6,143,616.70
DARDEN RESTAURANTS INC	12,238	97.860000	1,197,610.68
DAVITA INC	15,388	78.960000	1,215,036.48
DEERE & CO	26,323	169.130000	4,452,008.99
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	19,553	88.440000	1,729,267.32
DELTA AIR LINES INC	18,823	54.810000	1,031,688.63
DENTSPLY SIRONA INC	22,208	62.810000	1,394,884.48
DEVON ENERGY CORP	47,665	43.910000	2,092,970.15
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,803	126.850000	1,116,660.55
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35,921	80.300000	2,884,456.30
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15,325	25.730000	394,312.25
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,335	24.440000	472,547.40
DISH NETWORK CORP-A	22,311	47.030000	1,049,286.33
DOLLAR GENERAL CORP	25,888	103.750000	2,685,880.00
DOLLAR TREE INC	22,466	115.070000	2,585,162.62
DOMINION ENERGY INC	61,742	76.690000	4,734,993.98
DOMINO'S PIZZA INC	4,822	219.330000	1,057,609.26
DOVER CORP	15,055	104.430000	1,572,193.65
DOWDUPONT INC	223,296	76.650000	17,115,638.40
DR HORTON INC	34,701	50.350000	1,747,195.35
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,569	95.690000	1,681,177.61
DTE ENERGY COMPANY	17,136	105.960000	1,815,730.56
DUKE ENERGY CORP	67,039	78.900000	5,289,377.10
DXC TECHNOLOGY CO	27,717	101.860000	2,823,253.62
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,003	54.210000	1,463,832.63
EAST WEST BANCORP INC	14,565	68.310000	994,935.15
EASTMAN CHEMICAL CO	14,237	100.280000	1,427,686.36
EATON CORP PLC	42,673	85.220000	3,636,593.06
EATON VANCE CORP	12,150	60.170000	731,065.50
EBAY INC	97,470	40.020000	3,900,749.40
ECOLAB INC	24,982	138.320000	3,455,510.24

EDISON INTERNATIONAL	32,044	62.410000	1,999,866.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,547	126.240000	2,593,853.28
ELECTRONIC ARTS INC	29,580	114.500000	3,386,910.00
ELI LILLY & CO	94,886	85.010000	8,066,258.86
EMERSON ELECTRIC CO	61,355	72.680000	4,459,281.40
ENTERGY CORP	17,635	78.080000	1,376,940.80
ENVISION HEALTHCARE CORP	12,987	36.130000	469,220.31
EOG RESOURCES INC	55,597	117.450000	6,529,867.65
EQT CORP	24,122	58.480000	1,410,654.56
EQUIFAX INC	11,855	126.750000	1,502,621.25
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20,999	137.170000	2,880,432.83
EVEREST RE GROUP LTD	4,105	230.930000	947,967.65
EVERSOURCE ENERGY	30,287	64.570000	1,955,631.59
EXELON CORP	92,199	38.680000	3,566,257.32
EXPEDIA INC	11,842	131.110000	1,552,604.62
EXPEDITORS INTL WASH INC	18,247	66.710000	1,217,257.37
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	54,690	80.800000	4,418,952.00
EXXON MOBIL CORP	405,840	88.370000	35,864,080.80
F5 NETWORKS INC	5,809	134.940000	783,866.46
FACEBOOK INC-A	227,029	187.480000	42,563,396.92
FASTENAL CO	28,253	57.100000	1,613,246.30
FEDEX CORP	24,432	268.040000	6,548,753.28
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	31,452	101.500000	3,192,378.00
FIFTH THIRD BANCORP	71,088	32.840000	2,334,529.92
FIRST DATA CORP- CLASS A	45,138	18.230000	822,865.74
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,134	90.510000	1,369,778.34
FIRSTENERGY CORP	43,314	32.090000	1,389,946.26
FISERV INC	19,871	140.800000	2,797,836.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,937	212.120000	1,895,716.44
FLEX LTD	53,538	18.810000	1,007,049.78
FLIR SYSTEMS INC	12,291	52.230000	641,958.93
FLOWSERVE CORP	11,755	45.030000	529,327.65
FLUOR CORP	12,821	61.220000	784,901.62
FMC CORP	13,104	91.970000	1,205,174.88
FNF GROUP	23,522	41.490000	975,927.78
FORD MOTOR CO	351,579	11.570000	4,067,769.03
FORTINET INC	13,493	45.410000	612,717.13
FORTIVE CORP	29,437	74.810000	2,202,181.97
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15,300	72.480000	1,108,944.00
FRANKLIN RESOURCES INC	32,456	45.160000	1,465,712.96
FREEMPORT-MCMORAN INC	130,593	19.820000	2,588,353.26
GAP INC/THE	21,353	34.580000	738,386.74
GARMIN LTD	10,947	63.750000	697,871.25
GARTNER INC	8,949	140.120000	1,253,933.88
GENERAL DYNAMICS CORP	24,454	226.530000	5,539,564.62
GENERAL ELECTRIC CO	830,373	16.180000	13,435,435.14
GENERAL MILLS INC	55,081	60.140000	3,312,571.34
GENERAL MOTORS CO	125,868	43.160000	5,432,462.88
GENUINE PARTS CO	14,340	106.310000	1,524,485.40
GILEAD SCIENCES INC	125,080	81.190000	10,155,245.20
GLOBAL PAYMENTS INC	14,718	112.200000	1,651,359.60
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,222	269.030000	9,475,774.66
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,606	35.470000	908,244.82
H&R BLOCK INC	18,609	26.820000	499,093.38
HALLIBURTON CO	84,416	55.200000	4,659,763.20
HANESBRANDS INC	37,085	22.810000	845,908.85
HARLEY-DAVIDSON INC	15,803	54.700000	864,424.10
HARRIS CORP	11,756	144.470000	1,698,389.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,804	58.490000	2,035,685.96
HASBRO INC	11,161	95.550000	1,066,433.55
HCA HEALTHCARE INC	27,700	92.830000	2,571,391.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18,421	39.430000	726,340.03
HELMERICH & PAYNE	9,896	73.690000	729,236.24
HENRY SCHEIN INC	15,435	78.140000	1,206,090.90
HERSHEY CO/THE	13,877	111.230000	1,543,538.71
HESS CORP	28,040	53.590000	1,502,663.60
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	154,385	16.480000	2,544,264.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,200	86.630000	1,663,296.00
HOLLYFRONTIER CORP	15,538	48.500000	753,593.00
HOLOGIC INC	27,922	42.900000	1,197,853.80

HOME DEPOT INC	112,935	205.370000	23,193,460.95
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69,154	161.840000	11,191,883.36
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	120,000	7.170000	860,400.00
HORMEL FOODS CORP	26,342	34.590000	911,169.78
HP INC	161,345	23.320000	3,762,565.40
HUMANA INC	13,766	285.910000	3,935,837.06
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,857	123.990000	1,098,179.43
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,019	16.050000	1,685,554.95
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,590	241.250000	1,107,337.50
IAC/INTERACTIVECORP	7,087	142.910000	1,012,803.17
IDEX CORP	7,629	140.820000	1,074,315.78
IDEXX LABORATORIES INC	8,530	185.730000	1,584,276.90
IHS MARKIT LTD	38,549	48.450000	1,867,699.05
ILLINOIS TOOL WORKS	29,675	174.760000	5,186,003.00
ILLUMINA INC	13,942	243.390000	3,393,343.38
INCYTE CORP	16,393	94.260000	1,545,204.18
INGERSOLL-RAND PLC	23,964	91.570000	2,194,383.48
INGREDION INC	6,495	141.630000	919,886.85
INTEL CORP	449,681	45.300000	20,370,549.30
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	56,355	74.940000	4,223,243.70
INTERNATIONAL PAPER CO	36,963	63.400000	2,343,454.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	40,052	21.360000	855,510.72
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84,815	165.470000	14,034,338.05
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,764	154.850000	1,202,255.40
INTUIT INC	23,295	167.820000	3,909,366.90
INTUITIVE SURGICAL INC	10,723	449.810000	4,823,312.63
INVESCO LTD	39,530	37.590000	1,485,932.70
IPG PHOTONICS CORP	3,597	257.640000	926,731.08
IQVIA HOLDINGS INC	13,636	104.580000	1,426,052.88
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,253	125.550000	910,614.15
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,860	69.860000	758,679.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,400	63.920000	1,303,968.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,000	40.450000	889,900.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,095	153.120000	933,266.40
JM SMUCKER CO/THE	11,343	129.550000	1,469,485.65
JOHNSON & JOHNSON	257,063	144.400000	37,119,897.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89,081	40.790000	3,633,613.99
JONES LANG LASALLE INC	4,112	156.380000	643,034.56
JPMORGAN CHASE & CO	336,998	115.700000	38,990,668.60
JUNIPER NETWORKS INC	37,836	27.670000	1,046,922.12
KANSAS CITY SOUTHERN	10,450	111.420000	1,164,339.00
KELLOGG CO	25,074	67.910000	1,702,775.34
KEYCORP	103,966	21.670000	2,252,943.22
KIMBERLY-CLARK CORP	34,155	123.440000	4,216,093.20
KINDER MORGAN INC	195,488	18.820000	3,679,084.16
KLA-TENCOR CORP	15,078	113.090000	1,705,171.02
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,001	46.310000	555,766.31
KOHL'S CORP	17,043	66.790000	1,138,301.97
KRAFT HEINZ CO/THE	58,381	79.670000	4,651,214.27
KROGER CO	86,796	30.260000	2,626,446.96
L BRANDS INC	24,218	52.350000	1,267,812.30
L3 TECHNOLOGIES INC	7,503	209.200000	1,569,627.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,835	174.710000	1,718,272.85
LAM RESEARCH CORP	15,578	199.250000	3,103,916.50
LAS VEGAS SANDS CORP	37,148	75.360000	2,799,473.28
LEAR CORP	6,785	191.650000	1,300,345.25
LEGGETT & PLATT INC	11,889	47.790000	568,175.31
LEIDOS HOLDINGS INC	14,599	65.920000	962,366.08
LENNAR CORP-A	20,017	68.470000	1,370,563.99
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,479	219.540000	763,779.66
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,367	27.430000	805,536.81
LIBERTY BROADBAND-C	10,649	95.270000	1,014,530.23
LIBERTY GLOBAL PLC- C	55,289	35.950000	1,987,639.55
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,678	37.690000	703,973.82
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	42,342	27.640000	1,170,332.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	19,360	37.530000	726,580.80
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,152	42.870000	392,346.24
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	17,803	42.570000	757,873.71
LINCOLN NATIONAL CORP	21,512	83.400000	1,794,100.80
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,842	45.160000	625,104.72

LKQ CORP	30,462	42.550000	1,296,158.10
LOCKHEED MARTIN CORP	24,835	334.720000	8,312,771.20
LOEWS CORP	27,819	53.150000	1,478,579.85
LOWE'S COS INC	80,209	106.380000	8,532,633.42
LULULEMON ATHLETICA INC	9,233	78.620000	725,898.46
LYONDELLBASELL INDU-CL A	32,605	120.740000	3,936,727.70
M & T BANK CORP	13,078	187.660000	2,454,217.48
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7,087	66.830000	473,624.21
MACY'S INC	31,210	26.640000	831,434.40
MANPOWERGROUP INC	6,038	133.710000	807,340.98
MARATHON OIL CORP	83,648	18.680000	1,562,544.64
MARATHON PETROLEUM CORP	48,617	71.080000	3,455,696.36
MARKEL CORP	1,349	1,121.850000	1,513,375.65
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	29,880	145.500000	4,347,540.00
MARSH & MCLENNAN COS	49,143	83.570000	4,106,880.51
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,101	238.140000	1,452,892.14
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	40,621	23.010000	934,689.21
MASCO CORP	31,472	45.430000	1,429,772.96
MASTERCARD INC - A	90,394	168.590000	15,239,524.46
MATTEL INC	30,802	16.640000	512,545.28
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,436	55.120000	1,512,272.32
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,127	105.090000	1,169,336.43
MCDONALD'S CORP	77,537	175.660000	13,620,149.42
MCKESSON CORP	20,157	175.200000	3,531,506.40
MEDTRONIC PLC	130,072	86.820000	11,292,851.04
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	26,000	28.690000	745,940.00
MERCADOLIBRE INC	4,150	360.060000	1,494,249.00
MERCK & CO. INC.	261,296	61.300000	16,017,444.80
METLIFE INC	86,936	54.000000	4,694,544.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,475	678.050000	1,678,173.75
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,372	36.810000	1,633,333.32
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,995	67.040000	938,224.80
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,693	92.480000	2,006,168.64
MICRON TECHNOLOGY INC	102,035	43.010000	4,388,525.35
MICROSOFT CORP	700,990	92.330000	64,722,406.70
MIDDLEBY CORP	5,993	134.490000	805,998.57
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,087	276.770000	1,684,698.99
MOLSON COORS BREWING CO -B	18,094	83.790000	1,516,096.26
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	144,541	44.470000	6,427,738.27
MONSANTO CO	42,063	122.390000	5,148,090.57
MONSTER BEVERAGE CORP	37,480	67.800000	2,541,144.00
MOODY'S CORP	16,237	162.790000	2,643,221.23
MORGAN STANLEY	131,980	56.810000	7,497,783.80
MOSAIC CO/THE	30,291	26.690000	808,466.79
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,891	97.680000	1,552,232.88
MSCI INC	9,015	137.860000	1,242,807.90
MYLAN NV	44,026	45.990000	2,024,755.74
NASDAQ INC	11,759	81.180000	954,595.62
NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,990	37.600000	1,390,824.00
NETAPP INC	26,505	62.490000	1,656,297.45
NETFLIX INC	41,365	269.700000	11,156,140.50
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	44,196	13.950000	616,534.20
NEWELL BRANDS INC	48,657	24.810000	1,207,180.17
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,967	33.810000	607,464.27
NEWMONT MINING CORP	50,566	40.770000	2,061,575.82
NEWS CORP - CLASS A	34,402	17.040000	586,210.08
NEXTERA ENERGY INC	44,863	153.090000	6,868,076.67
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,576	37.200000	1,286,227.20
NIKE INC -CL B	125,676	67.710000	8,509,521.96
NISOURCE INC	33,979	24.420000	829,767.18
NOBLE ENERGY INC	45,693	32.620000	1,490,505.66
NORDSTROM INC	11,209	49.500000	554,845.50
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,639	148.230000	4,096,928.97
NORTHERN TRUST CORP	20,688	105.010000	2,172,446.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,833	325.000000	5,145,725.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	18,132	59.610000	1,080,848.52
NUCOR CORP	30,361	68.240000	2,071,834.64
NVIDIA CORP	57,452	236.350000	13,578,780.20
NVR INC	354	3,350.000000	1,185,900.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	33,165	120.200000	3,986,433.00

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,291	76.740000	5,624,351.34	
OGE ENERGY CORP	18,186	32.300000	587,407.80	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,961	148.660000	886,162.26	
OMNICOM GROUP	22,390	76.680000	1,716,865.20	
ONEOK INC	35,928	60.580000	2,176,518.24	
ORACLE CORP	297,101	51.600000	15,330,411.60	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,641	272.880000	2,357,956.08	
OWENS CORNING	10,752	95.760000	1,029,611.52	
P G & E CORP	48,947	43.490000	2,128,705.03	
PACCAR INC	32,993	77.220000	2,547,719.46	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,301	125.630000	1,168,484.63	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,933	157.280000	1,404,982.24	
PARKER HANNIFIN CORP	12,534	207.510000	2,600,930.34	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,264	28.900000	585,629.60	
PAYCHEX INC	30,673	68.630000	2,105,087.99	
PAYPAL HOLDINGS INC	109,346	84.340000	9,222,241.64	
PENTAIR PLC	17,280	73.350000	1,267,488.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	30,850	19.910000	614,223.50	
PEPSICO INC	136,537	120.900000	16,507,323.30	
PERRIGO CO PLC	12,830	94.590000	1,213,589.70	
PFIZER INC	569,308	37.230000	21,195,336.84	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,833	107.490000	15,998,059.17	
PHILLIPS 66	41,668	104.170000	4,340,555.56	
PINNACLE WEST CAPITAL	11,336	81.050000	918,782.80	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,612	188.500000	3,131,362.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45,842	157.800000	7,233,867.60	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,389	135.340000	729,347.26	
PPG INDUSTRIES INC	24,894	120.210000	2,992,507.74	
PPL CORP	67,162	32.270000	2,167,317.74	
PRAXAIR INC	27,380	163.350000	4,472,523.00	
PRICELINE GROUP INC/THE	4,702	1,949.670000	9,167,348.34	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,470	74.260000	2,039,922.20	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	244,200	88.340000	21,572,628.00	
PROGRESSIVE CORP	56,258	55.760000	3,136,946.08	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,908	124.400000	5,088,955.20	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,931	51.120000	2,450,232.72	
PULTEGROUP INC	25,803	34.260000	884,010.78	
PVH CORP	7,798	152.710000	1,190,832.58	
QORVO INC	12,738	66.060000	841,472.28	
QUALCOMM INC	141,297	67.420000	9,526,243.74	
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,303	105.150000	1,398,810.45	
RALPH LAUREN CORP	4,951	117.370000	581,098.87	
RANGE RESOURCES CORP	22,261	15.320000	341,038.52	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,021	95.850000	1,248,062.85	
RAYTHEON COMPANY	27,777	202.840000	5,634,286.68	
RED HAT INC	16,940	130.900000	2,217,446.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,592	391.840000	2,974,849.28	
REGIONS FINANCIAL CORP	114,690	19.140000	2,195,166.60	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,825	162.020000	943,766.50	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,620	131.080000	474,509.60	
REPUBLIC SERVICES INC	22,704	68.500000	1,555,224.00	
RESMED INC	13,930	101.620000	1,415,566.60	
ROBERT HALF INTL INC	11,431	57.340000	655,453.54	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,165	199.710000	2,429,472.15	
ROCKWELL COLLINS INC	15,308	138.560000	2,121,076.48	
ROLLINS INC	8,805	50.490000	444,564.45	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,989	279.080000	2,787,730.12	
ROSS STORES INC	36,726	84.390000	3,099,307.14	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,272	131.930000	2,146,764.96	
S&P GLOBAL INC	24,456	181.890000	4,448,301.84	
SABRE CORP	18,948	20.740000	392,981.52	
SALESFORCE.COM INC	65,393	111.960000	7,321,400.28	
SBA COMMUNICATIONS CORP	11,539	170.290000	1,964,976.31	
SCANA CORP	12,154	42.000000	510,468.00	
SCHLUMBERGER LTD	133,184	77.330000	10,299,118.72	
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,468	54.180000	6,256,056.24	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	8,909	88.320000	786,842.88	
SEAGATE TECHNOLOGY	27,074	53.170000	1,439,524.58	
SEALED AIR CORP	17,712	49.080000	869,304.96	
SEATTLE GENETICS INC	9,002	55.590000	500,421.18	

SEI INVESTMENTS COMPANY	12,209	76.750000	937,040.75
SEMPRA ENERGY	23,353	106.400000	2,484,759.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	17,449	55.630000	970,687.87
SERVICENOW INC	16,115	145.540000	2,345,377.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,997	424.660000	3,396,006.02
SIGNATURE BANK	4,963	155.410000	771,299.83
SIRIUS XM HOLDINGS INC	146,504	5.770000	845,328.08
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,545	95.050000	1,667,652.25
SMITH (A.O.) CORP	14,799	67.400000	997,452.60
SNAP-ON INC	5,257	181.030000	951,674.71
SOUTHERN CO/THE	95,782	44.620000	4,273,792.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,078	60.190000	847,354.82
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,399	123.720000	296,804.28
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	11,403	100.520000	1,146,229.56
SPLUNK INC	12,712	91.850000	1,167,597.20
SPRINT CORP	71,605	5.340000	382,370.70
SQUARE INC - A	24,040	45.120000	1,084,684.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,813	50.510000	899,734.63
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,397	169.160000	2,435,396.52
STARBUCKS CORP	138,361	60.550000	8,377,758.55
STATE STREET CORP	35,829	110.330000	3,953,013.57
STEEL DYNAMICS INC	24,504	46.350000	1,135,760.40
STERICYCLE INC	7,624	70.480000	537,339.52
STRYKER CORP	32,195	165.550000	5,329,882.25
SUNTRUST BANKS INC	46,594	70.600000	3,289,536.40
SVB FINANCIAL GROUP	5,246	261.130000	1,369,887.98
SYMANTEC CORP	57,384	27.150000	1,557,975.60
SYNCHRONY FINANCIAL	76,519	39.580000	3,028,622.02
SYNOPSIS INC	14,659	91.910000	1,347,308.69
SYSCO CORP	47,529	63.990000	3,041,380.71
T ROWE PRICE GROUP INC	22,934	117.350000	2,691,304.90
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,072	117.200000	1,180,438.40
TAPESTRY INC	27,688	47.430000	1,313,241.84
TARGA RESOURCES CORP	21,552	50.000000	1,077,600.00
TARGET CORP	49,825	76.300000	3,801,647.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,728	54.450000	1,291,989.60
TE CONNECTIVITY LTD	33,929	102.640000	3,482,472.56
TECHNIPFMC PLC	43,400	33.990000	1,475,166.00
TELEFLEX INC	4,431	278.150000	1,232,482.65
TESARO INC	3,392	71.020000	240,899.84
TESLA INC	12,843	337.640000	4,336,310.52
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	87,900	21.160000	1,859,964.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	94,561	110.150000	10,415,894.15
TEXTRON INC	25,896	60.530000	1,567,484.88
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,333	217.880000	8,351,994.04
TIFFANY & CO	12,266	109.130000	1,338,588.58
TIME WARNER INC	74,472	94.080000	7,006,325.76
TJX COMPANIES INC	61,274	79.260000	4,856,577.24
T-MOBILE US INC	27,617	64.390000	1,778,258.63
TOLL BROTHERS INC	13,859	49.710000	688,930.89
TORCHMARK CORP	10,035	92.710000	930,344.85
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,395	88.280000	1,447,350.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,482	78.150000	897,318.30
TRANSDIGM GROUP INC	5,056	306.850000	1,551,433.60
TRANSUNION	14,919	60.480000	902,301.12
TRAVELERS COS INC/THE	26,572	148.470000	3,945,144.84
TRIMBLE INC	25,293	45.070000	1,139,955.51
TRIPADVISOR INC	10,389	36.490000	379,094.61
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	40,643	37.730000	1,533,460.39
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	102,117	38.180000	3,898,827.06
TWITTER INC	61,988	22.160000	1,373,654.08
TYSON FOODS INC-CL A	27,357	79.800000	2,183,088.60
UGI CORP	15,746	47.550000	748,722.30
ULTA BEAUTY INC	5,712	227.290000	1,298,280.48
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	16,507	14.570000	240,506.99
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,041	13.310000	226,815.71
UNION PACIFIC CORP	76,668	133.600000	10,242,844.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	7,192	66.080000	475,247.36
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,061	131.290000	8,673,148.69
UNITED RENTALS INC	8,305	181.910000	1,510,762.55

UNITED TECHNOLOGIES CORP	72,706	137.750000	10,015,251.50	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,067	138.420000	562,954.14	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,559	245.180000	22,693,615.62	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,008	119.130000	953,993.04	
UNUM GROUP	22,548	55.030000	1,240,816.44	
US BANCORP	160,103	57.980000	9,282,771.94	
VAIL RESORTS INC	3,609	233.620000	843,134.58	
VALERO ENERGY CORP	42,684	97.180000	4,148,031.12	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,192	127.010000	1,167,475.92	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,740	58.910000	573,783.40	
VERISIGN INC	8,292	115.990000	961,789.08	
VERISK ANALYTICS INC	15,321	98.590000	1,510,497.39	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	390,687	54.290000	21,210,397.23	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,450	166.240000	4,064,568.00	
VF CORP	32,144	80.940000	2,601,735.36	
VIACOM INC-CLASS B	35,076	33.610000	1,178,904.36	
VISA INC-CLASS A SHARES	175,141	125.220000	21,931,156.02	
VISTRA ENERGY CORP	24,359	19.720000	480,359.48	
VMWARE INC-CLASS A	6,365	137.630000	876,014.95	
VOYA FINANCIAL INC	16,758	53.870000	902,753.46	
VULCAN MATERIALS CO	12,700	138.540000	1,759,458.00	
WABCO HOLDINGS INC	4,624	156.750000	724,812.00	
WABTEC CORP	7,807	82.320000	642,672.24	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	87,262	78.270000	6,829,996.74	
WAL-MART STORES INC	143,080	106.600000	15,252,328.00	
WALT DISNEY CO/THE	147,839	110.550000	16,343,601.45	
WASTE CONNECTIONS INC	25,082	72.470000	1,817,692.54	
WASTE MANAGEMENT INC	42,205	88.560000	3,737,674.80	
WATERS CORP	7,706	217.210000	1,673,820.26	
WEC ENERGY GROUP INC	30,060	64.140000	1,928,048.40	
WELLS FARGO & CO	451,782	65.650000	29,659,488.30	
WESTAR ENERGY INC	13,089	51.620000	675,654.18	
WESTERN DIGITAL CORP	28,506	87.990000	2,508,242.94	
WESTERN UNION CO	42,386	20.800000	881,628.80	
WESTROCK CO	24,233	69.090000	1,674,257.97	
WHIRLPOOL CORP	7,211	183.090000	1,320,261.99	
WILLIAMS COS INC	81,096	32.400000	2,627,510.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,175	160.170000	1,950,069.75	
WORKDAY INC-CLASS A	12,697	115.320000	1,464,218.04	
WORLDPAY INC-CLASS A	27,854	80.730000	2,248,653.42	
WR BERKLEY CORP	8,757	72.320000	633,306.24	
WR GRACE & CO	6,231	74.720000	465,580.32	
WW GRAINGER INC	5,043	286.440000	1,444,516.92	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,256	125.090000	1,282,923.04	
WYNN RESORTS LTD	8,006	200.600000	1,606,003.60	
XCEL ENERGY INC	47,986	46.000000	2,207,356.00	
XEROX CORP	22,536	32.380000	729,715.68	
XILINX INC	23,676	69.740000	1,651,164.24	
XL GROUP LTD	25,881	36.880000	954,491.28	
XYLEM INC	17,945	73.240000	1,314,291.80	
YUM! BRANDS INC	31,090	85.660000	2,663,169.40	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,621	36.450000	605,835.45	
ZILLOW GROUP INC - C	9,384	44.200000	414,772.80	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,938	124.740000	2,362,326.12	
ZIONS BANCORPORATION	20,220	53.020000	1,072,064.40	
ZOETIS INC	46,893	79.250000	3,716,270.25	
アメリカドル 小計	29,306,140		2,386,074,163.27 (261,943,221,643)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	22,900	60.370000	1,382,473.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,900	67.070000	2,676,093.00	
ALTAGAS LTD	15,500	28.600000	443,300.00	
ARC RESOURCES LTD	31,600	13.970000	441,452.00	
ATCO LTD -CLASS I	7,200	43.540000	313,488.00	
BANK OF MONTREAL	62,300	103.560000	6,451,788.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	114,400	81.840000	9,362,496.00	
BARRICK GOLD CORP	110,400	18.270000	2,017,008.00	
BCE INC	15,800	57.900000	914,820.00	
BLACKBERRY LTD	46,000	16.160000	743,360.00	
BOMBARDIER INC-B	174,700	3.070000	536,329.00	



BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	81,800	51.690000	4,228,242.00	
CAE INC	23,900	22.930000	548,027.00	
CAMECO CORP	35,700	11.720000	418,404.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,000	121.930000	4,999,130.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,200	97.020000	7,004,844.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,200	44.310000	4,705,722.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,800	230.440000	3,180,072.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	172.570000	1,018,163.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	11,800	36.100000	425,980.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,600	58.870000	859,502.00	
CENOVUS ENERGY INC	103,800	12.890000	1,337,982.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	20,800	68.200000	1,418,560.00	
CI FINANCIAL CORP	23,700	30.080000	712,896.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,000	788.870000	1,577,740.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	49,000	10.920000	535,080.00	
DOLLARAMA INC	10,600	165.940000	1,758,964.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	35,200	8.740000	307,648.00	
EMERA INC	5,400	46.390000	250,506.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,600	25.330000	395,148.00	
ENBRIDGE INC	157,900	47.560000	7,509,724.00	
ENCANA CORP	96,500	16.660000	1,607,690.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,700	672.680000	1,816,236.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	33.760000	513,152.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	20.910000	288,558.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63,300	19.010000	1,203,333.00	
FORTIS INC	40,400	43.590000	1,761,036.00	
FRANCO-NEVADA CORP	17,400	96.010000	1,670,574.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,100	41.230000	828,723.00	
GOLDCORP INC	85,100	18.190000	1,547,969.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	30,400	35.320000	1,073,728.00	
HUSKY ENERGY INC	31,878	18.300000	583,367.40	
HYDRO ONE LTD	33,200	22.110000	734,052.00	
IGM FINANCIAL INC	7,700	43.790000	337,183.00	
IMPERIAL OIL LTD	29,900	39.090000	1,168,791.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,500	60.280000	572,660.00	
INTACT FINANCIAL CORP	12,900	102.740000	1,325,346.00	
INTER PIPELINE LTD	35,100	25.370000	890,487.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,300	24.390000	178,047.00	
KEYERA CORP	20,700	35.930000	743,751.00	
KINROSS GOLD CORP	112,100	5.510000	617,671.00	
LINAMAR CORP	4,400	73.770000	324,588.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	69.090000	1,485,435.00	
LUNDIN MINING CORP	62,100	8.930000	554,553.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,500	72.300000	2,494,350.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	191,400	26.740000	5,118,036.00	
METHANEX CORP	8,000	73.570000	588,560.00	
METRO INC	23,400	41.030000	960,102.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	32,500	64.780000	2,105,350.00	
NUTRIEN LTD	62,059	65.450000	4,061,761.55	
ONEX CORPORATION	7,500	91.930000	689,475.00	
OPEN TEXT CORP	26,700	41.870000	1,117,929.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	48,232	42.460000	2,047,930.72	
POWER CORP OF CANADA	35,800	31.820000	1,139,156.00	
POWER FINANCIAL CORP	22,700	34.510000	783,377.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	19,188	31.190000	598,473.72	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,610	76.620000	1,655,758.20	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	34,400	60.340000	2,075,696.00	
ROYAL BANK OF CANADA	139,400	105.520000	14,709,488.00	
SAPUTO INC	21,800	42.310000	922,358.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,100	18.200000	402,220.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,100	27.120000	1,141,752.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	8,000	154.300000	1,234,400.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,800	54.910000	977,398.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,700	53.880000	3,108,876.00	
SUNCOR ENERGY INC	159,600	45.780000	7,306,488.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	55,600	36.040000	2,003,824.00	
TELUS CORP	11,600	46.130000	535,108.00	
THOMSON REUTERS CORP	27,900	53.680000	1,497,672.00	
TORONTO-DOMINION BANK	176,200	74.430000	13,114,566.00	
TOURMALINE OIL CORP	20,400	21.250000	433,500.00	

TRANSCANADA CORP	83,900	57.720000	4,842,708.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	90,900	3.980000	361,782.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	29,800	24.360000	725,928.00
VERMILION ENERGY INC	10,100	49.060000	495,506.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	84.530000	515,633.00
WESTON (GEORGE) LTD	4,600	109.960000	505,816.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	44,100	27.200000	1,199,520.00
カナダドル 小計	3,842,467		171,772,369.59 (15,236,209,182)
オーストラリアドル			
AGL ENERGY LTD	64,974	23.470000	1,524,939.78
ALUMINA LTD	220,517	2.430000	535,856.31
AMCOR LIMITED	112,709	14.460000	1,629,772.14
AMP LTD	290,105	5.170000	1,499,842.85
ARISTOCRAT LEISURE LTD	50,407	24.140000	1,216,824.98
ASX LTD	18,041	54.690000	986,662.29
AURIZON HOLDINGS LTD	214,288	4.600000	985,724.80
AUSNET SERVICES	184,070	1.675000	308,317.25
AUST AND NZ BANKING GROUP	281,840	28.650000	8,074,716.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	36,107	12.280000	443,393.96
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,263	11.410000	493,630.83
BHP BILLITON LIMITED	308,042	30.850000	9,503,095.70
BLUESCOPE STEEL LTD	51,047	14.790000	754,985.13
BORAL LTD	124,498	7.900000	983,534.20
BRAMBLES LTD	157,555	9.920000	1,562,945.60
CALTEX AUSTRALIA LTD	24,027	34.900000	838,542.30
CHALLENGER LTD	53,120	13.900000	738,368.00
CIMIC GROUP LTD	8,873	48.150000	427,234.95
COCA-COLA AMATIL LTD	52,552	8.290000	435,656.08
COCHLEAR LTD	5,273	169.410000	893,298.93
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	166,119	78.650000	13,065,259.35
COMPUTERSHARE LTD	42,496	16.900000	718,182.40
CROWN RESORTS LTD	35,622	13.070000	465,579.54
CSL LTD	43,430	147.560000	6,408,530.80
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	47.430000	276,754.05
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,138	50.670000	260,342.46
FORTESCUE METALS GROUP LTD	140,882	5.100000	718,498.20
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	4.390000	229,118.49
HEALTHSCOPE LTD	161,984	1.940000	314,248.96
INCITEC PIVOT LTD	153,458	3.760000	577,002.08
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	234,237	7.110000	1,665,425.07
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	40,661	21.260000	864,452.86
LENLEASE GROUP	57,156	15.930000	910,495.08
MACQUARIE GROUP LTD	30,710	104.960000	3,223,321.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	292,503	3.310000	968,184.93
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	258,232	29.060000	7,504,221.92
NEWCREST MINING LTD	74,529	23.360000	1,740,997.44
OIL SEARCH LTD	125,885	7.880000	991,973.80
ORICA LTD	34,168	19.080000	651,925.44
ORIGIN ENERGY LTD	174,771	9.290000	1,623,622.59
QBE INSURANCE GROUP LTD	135,829	10.940000	1,485,969.26
RAMSAY HEALTH CARE LTD	13,281	69.030000	916,787.43
REA GROUP LTD	4,869	74.500000	362,740.50
RIO TINTO LTD	40,136	78.810000	3,163,118.16
SANTOS LTD	171,653	5.200000	892,595.60
SEEK LTD	30,420	19.740000	600,490.80
SONIC HEALTHCARE LTD	42,490	23.040000	978,969.60
SOUTH32 LTD	511,684	3.830000	1,959,749.72
SUNCORP GROUP LTD	127,178	13.560000	1,724,533.68
SYDNEY AIRPORT	102,875	6.950000	714,981.25
TABCORP HOLDINGS LTD	199,743	5.120000	1,022,684.16
TELSTRA CORP LTD	410,084	3.560000	1,459,899.04
TPG TELECOM LTD	34,153	6.280000	214,480.84
TRANSURBAN GROUP	215,167	12.060000	2,594,914.02
TREASURY WINE ESTATES LTD	76,045	16.910000	1,285,920.95
WESFARMERS LTD	108,999	43.820000	4,776,336.18
WESTPAC BANKING CORP	325,678	30.930000	10,073,220.54
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,845	34.040000	2,717,923.80
WOOLWORTHS GROUP LTD	126,986	27.090000	3,440,050.74

オーストラリアドル 小 計	7,188,430		117,400,845.41 (10,352,406,548)
イギリス債券			
3I GROUP PLC	94,618	9.086000	859,699.14
ADMIRAL GROUP PLC	17,849	18.785000	335,293.46
ANGLO AMERICAN PLC	129,862	17.332000	2,250,768.18
ANTOFAGASTA PLC	35,355	9.480000	335,165.40
ASHTREAD GROUP PLC	48,894	20.720000	1,013,083.68
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,225	28.610000	979,177.25
ASTRAZENECA PLC	121,273	49.985000	6,061,830.90
AUTO TRADER GROUP PLC	87,980	3.500000	307,930.00
AVIVA PLC	379,778	5.198000	1,974,086.04
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	7.378000	168,004.43
BAE SYSTEMS PLC	310,235	5.658000	1,755,309.63
BARCLAYS PLC	1,633,472	2.103000	3,435,191.61
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,248	6.130000	632,910.24
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	11,651	41.100000	478,856.10
BHP BILLITON PLC	202,451	15.688000	3,176,051.28
BP PLC	1,890,731	5.167000	9,769,407.07
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	219,664	48.700000	10,697,636.80
BT GROUP PLC	810,109	2.605500	2,110,738.99
BUNZL PLC	33,394	20.090000	670,885.46
BURBERRY GROUP PLC	39,262	16.025000	629,173.55
CAPITA PLC	60,112	3.654000	219,649.24
CARNIVAL PLC	18,291	48.790000	892,417.89
CENTRICA PLC	534,930	1.349000	721,620.57
COBHAM PLC	215,766	1.314500	283,624.40
COCA-COLA HBC AG-DI	16,463	23.710000	390,337.73
COMPASS GROUP PLC	150,650	14.965000	2,254,477.25
CONVATEC GROUP PLC	123,135	2.025000	249,348.37
CRODA INTERNATIONAL PLC	11,925	44.220000	527,323.50
DCC PLC	9,033	74.750000	675,216.75
DIAGEO PLC	241,075	25.370000	6,116,072.75
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	123,007	3.750000	461,276.25
EASYJET PLC	15,270	16.510000	252,107.70
EXPERIAN PLC	89,627	16.180000	1,450,164.86
FERGUSON PLC	24,232	54.960000	1,331,790.72
FRESNILLO PLC	19,964	13.705000	273,606.62
G4S PLC	140,955	2.860000	403,131.30
GKN PLC	175,545	4.329000	759,934.30
GLAXOSMITHKLINE PLC	471,537	13.350000	6,295,018.95
GLENCORE PLC	1,171,658	4.000000	4,686,632.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	23,412	19.060000	446,232.72
HSBC HOLDINGS PLC	1,924,669	7.684000	14,789,156.59
IMI PLC	24,418	13.290000	324,515.22
IMPERIAL BRANDS PLC	92,934	28.640000	2,661,629.76
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	18,106	47.550000	860,940.30
INTERTEK GROUP PLC	15,986	50.300000	804,095.80
INVESTEC PLC	59,244	5.556000	329,159.66
ITV PLC	367,957	1.706500	627,918.62
JOHNSON MATTHEY PLC	19,499	32.250000	628,842.75
KINGFISHER PLC	198,771	3.479000	691,524.30
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	563,705	2.720000	1,533,277.60
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,895,247	0.712500	4,912,863.48
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,985	39.320000	1,179,010.20
MARKS & SPENCER GROUP PLC	144,127	3.103000	447,226.08
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,328	6.292000	209,699.77
MEGGITT PLC	69,419	4.716000	327,380.00
MERLIN ENTERTAINMENT	63,785	3.357000	214,126.24
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	43,031	21.820000	938,936.42
MONDI PLC	36,476	18.765000	684,472.14
NATIONAL GRID PLC	330,263	7.956000	2,627,572.42
NEXT PLC	14,749	50.640000	746,889.36
OLD MUTUAL PLC	479,781	2.404000	1,153,393.52
PEARSON PLC	74,172	6.854000	508,374.88
PERSIMMON PLC	30,482	26.020000	793,141.64
PRUDENTIAL PLC	247,858	19.160000	4,748,959.28
RANDGOLD RESOURCES LTD	9,424	71.980000	678,339.52
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	64,061	68.280000	4,374,085.08
RELX PLC	100,828	15.570000	1,569,891.96

RIO TINTO PLC	118,119	39.375000	4,650,935.62	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	157,182	8.440000	1,326,616.08	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	349,611	2.991000	1,045,686.50	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	431,782	25.110000	10,842,046.02	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	358,777	25.620000	9,191,866.74	
ROYAL MAIL PLC	80,182	4.690000	376,053.58	
RSA INSURANCE GROUP PLC	104,624	6.202000	648,878.04	
SAGE GROUP PLC/THE	107,162	7.506000	804,357.97	
SAINSBURY (J) PLC	146,652	2.586000	379,242.07	
SCHRODERS PLC	13,248	36.710000	486,334.08	
SEVERN TRENT PLC	22,827	20.100000	458,822.70	
SHIRE PLC	87,071	33.640000	2,929,068.44	
SKY PLC	100,562	10.360000	1,041,822.32	
SMITH & NEPHEW PLC	83,779	12.935000	1,083,681.36	
SMITHS GROUP PLC	36,608	16.160000	591,585.28	
SSE PLC	96,657	12.625000	1,220,294.62	
ST JAMES'S PLACE PLC	53,880	12.210000	657,874.80	
STANDARD CHARTERED PLC	314,169	8.330000	2,617,027.77	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	259,900	4.307000	1,119,389.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	294,631	1.969000	580,128.43	
TESCO PLC	775,096	2.097000	1,625,376.31	
TRAVIS PERKINS PLC	22,414	14.820000	332,175.48	
TUI AG-DI	44,533	16.135000	718,539.95	
UNILEVER PLC	120,954	39.960000	4,833,321.84	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	72,694	7.402000	538,080.98	
VODAFONE GROUP PLC	2,549,803	2.244000	5,721,757.93	
WEIR GROUP PLC/THE	19,948	22.200000	442,845.60	
WHITBREAD PLC	18,349	39.000000	715,611.00	
WM MORRISON SUPERMARKETS	233,602	2.257000	527,239.71	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	63,450	6.892000	437,297.40	
WPP PLC	119,240	13.015000	1,551,908.60	
イギリスポンド 小計	29,073,220		185,192,472.19 (28,786,317,877)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	177,105	26.490000	4,691,511.45	
ADECCO GROUP AG-REG	15,950	77.960000	1,243,462.00	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,469	156.100000	697,610.90	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	200	1,927.000000	385,400.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	93	5,810.000000	540,330.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	69,400.000000	694,000.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	49,978	88.020000	4,399,063.56	
CLARIANT AG-REG	22,478	26.070000	586,001.46	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	231,030	18.400000	4,250,952.00	
DUFREY AG-REG	3,168	151.600000	480,268.80	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	742	685.500000	508,641.00	
GEBERIT AG-REG	3,557	449.900000	1,600,294.30	
GIVAUDAN-REG	883	2,250.000000	1,986,750.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	21,909	63.440000	1,389,906.96	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5,439	172.800000	939,859.20	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	44,310	58.700000	2,600,997.00	
LONZA GROUP AG-REG	7,076	267.500000	1,892,830.00	
NESTLE SA-REG	298,011	80.860000	24,097,169.46	
NOVARTIS AG-REG	212,956	87.240000	18,578,281.44	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,491	86.350000	301,447.85	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	720.500000	1,224,850.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	67,296	231.300000	15,565,564.80	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,922	228.800000	439,753.60	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,989	235.400000	939,010.60	
SGS SA-REG	536	2,529.000000	1,355,544.00	
SIKA AG-BR	207	8,170.000000	1,691,190.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	5,256	151.950000	798,649.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,049	710.000000	744,790.00	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,003	398.200000	1,195,794.60	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,171	76.050000	393,254.55	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,190	357.100000	1,139,149.00	
SWISS PRIME SITE-REG	7,662	89.650000	686,898.30	
SWISS RE AG	29,793	94.160000	2,805,308.88	
SWISSCOM AG-REG	2,522	515.200000	1,299,334.40	
UBS GROUP AG-REG	350,853	19.270000	6,760,937.31	
VIFOR PHARMA AG	4,430	136.800000	606,024.00	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,482	314.200000	4,550,244.40	
	スイスフラン 小計	1,605,916		114,061,075.02 (13,298,380,736)	
香港ドル					
	AIA GROUP LTD	1,158,400	66.350000	76,859,840.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,900	111.100000	2,655,290.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	110,420	34.300000	3,787,406.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	352,500	41.650000	14,681,625.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	246,368	74.000000	18,231,232.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	258,868	106.400000	27,543,555.20	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	61,000	69.650000	4,248,650.00	
	CLP HOLDINGS LTD	161,500	79.100000	12,774,650.00	
	FIRST PACIFIC CO	200,000	5.660000	1,132,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	226,000	65.700000	14,848,200.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	80,000	30.900000	2,472,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,000	21.100000	3,840,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	73,100	186.500000	13,633,150.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	122,589	52.950000	6,491,087.55	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	345,000	9.750000	3,363,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	819,168	15.440000	12,647,953.92	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,500	293.000000	32,669,500.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	56,000	45.450000	2,545,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	59,500	34.750000	2,067,625.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	400,000	8.780000	3,512,000.00	
	LI & FUNG LTD	534,000	4.040000	2,157,360.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	86,800	23.250000	2,018,100.00	
	MINTH GROUP LTD	72,000	45.350000	3,265,200.00	
	MTR CORP	152,500	45.000000	6,862,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	545,000	12.700000	6,921,500.00	
	NWS HOLDINGS LTD	141,500	15.240000	2,156,460.00	
	PCCW LTD	404,000	4.540000	1,834,160.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	137,000	66.950000	9,172,150.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	47.350000	11,269,300.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	19.040000	2,208,640.00	
	SINO LAND CO	343,400	14.700000	5,047,980.00	
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	8.360000	1,463,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	143,000	136.200000	19,476,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	56,000	79.150000	4,432,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	105,600	27.100000	2,861,760.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	126,000	49.250000	6,205,500.00	
	WH GROUP LTD	855,000	9.240000	7,900,200.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	119,000	31.600000	3,760,400.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	53.800000	6,402,200.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	74,000	61.600000	4,558,400.00	
	WYNN MACAU LTD	141,600	29.350000	4,155,960.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	67,500	35.500000	2,396,250.00	
	香港ドル 小計	9,799,713		376,530,934.67 (5,286,494,322)	
シンガポールドル					
	CAPITALAND LTD	270,200	3.840000	1,037,568.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,200	13.200000	491,040.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	197,100	2.090000	411,939.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	173,600	26.770000	4,647,272.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	549,100	1.360000	746,776.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.385000	246,230.60	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,000	40.830000	367,470.00	
	KEPPEL CORP LTD	134,200	8.580000	1,151,436.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	308,100	13.110000	4,039,191.00	
	SATS LTD	62,600	5.670000	354,942.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	92,600	3.450000	319,470.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	55,040	11.490000	632,409.60	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	75,500	8.170000	616,835.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,550	2.700000	395,685.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	143,900	3.420000	492,138.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	810,560	3.620000	2,934,227.20	
	STARHUB LTD	58,200	2.970000	172,854.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	130,200	27.980000	3,642,996.00	
	UOL GROUP LTD	43,800	9.280000	406,464.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,100	3.210000	468,981.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	208,500	1.590000	331,515.00	

シンガポールドル 小計	4,291,610		23,907,439.40 (2,004,160,644)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,732	6.720000	582,839.04	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	55,727	13.100000	730,023.70	
FLETCHER BUILDING LTD	62,019	7.500000	465,142.50	
MERCURY NZ LTD	64,309	3.430000	220,579.87	
MERIDIAN ENERGY LTD	126,539	2.870000	363,166.93	
RYMAN HEALTHCARE LTD	35,654	10.940000	390,054.76	
SPARK NEW ZEALAND LTD	161,174	3.560000	573,779.44	
ニュージーランドドル 小計	592,154		3,325,586.24 (267,244,110)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	30,572	205.300000	6,276,431.60	
ASSA ABLOY AB-B	99,062	175.450000	17,380,427.90	
ATLAS COPCO AB-A SHS	63,222	370.600000	23,430,073.20	
ATLAS COPCO AB-B SHS	37,514	327.200000	12,274,580.80	
BOLIDEN AB	27,383	286.700000	7,850,706.10	
ELECTROLUX AB-SER B	24,544	261.100000	6,408,438.40	
ERICSSON LM-B SHS	293,825	54.600000	16,042,845.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,860	236.700000	13,695,462.00	
GETINGE AB-B SHS	22,021	115.600000	2,545,627.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	93,044	157.300000	14,635,821.20	
HEXAGON AB-B SHS	25,251	462.800000	11,686,162.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	37,258	79.800000	2,973,188.40	
ICA GRUPPEN AB	7,186	307.200000	2,207,539.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,468	214.800000	3,107,726.40	
INVESTOR AB-B SHS	42,640	388.400000	16,561,376.00	
KINNEVIK AB - B	23,937	289.900000	6,939,336.30	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,319	639.500000	2,122,500.50	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,956	204.500000	3,467,502.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,988	590.500000	3,535,914.00	
NORDEA BANK AB	290,278	96.560000	28,029,243.68	
SANDVIK AB	108,140	157.650000	17,048,271.00	
SECURITAS AB-B SHS	28,100	147.800000	4,153,180.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,496	98.660000	14,255,975.36	
SKANSKA AB-B SHS	34,698	160.200000	5,558,619.60	
SKF AB-B SHARES	38,397	195.450000	7,504,693.65	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	143,421	114.800000	16,464,730.80	
SWEDBANK AB - A SHARES	89,147	200.000000	17,829,400.00	
SWEDISH MATCH AB	16,479	326.200000	5,375,449.80	
TELE2 AB-B SHS	32,211	96.660000	3,113,515.26	
TELIA CO AB	252,914	37.110000	9,385,638.54	
VOLVO AB-B SHS	148,313	162.250000	24,063,784.25	
スウェーデンクローネ 小計	2,252,644		325,924,161.34 (4,517,308,876)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	93,134	157.550000	14,673,261.70	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,992	159.700000	2,873,322.40	
MARINE HARVEST	37,053	135.050000	5,004,007.65	
NORSK HYDRO ASA	133,726	57.500000	7,689,245.00	
ORKLA ASA	83,447	80.600000	6,725,828.20	
SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	236.500000	1,908,318.50	
STATOIL ASA	108,667	187.100000	20,331,595.70	
TELENOR ASA	71,990	181.100000	13,037,389.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	18,322	376.400000	6,896,400.80	
ノルウェークローネ 小計	572,400		79,139,368.95 (1,122,196,251)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	356	10,900.000000	3,880,400.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	627	11,400.000000	7,147,800.00	
CARLSBERG AS-B	10,482	753.000000	7,892,946.00	
CHR HANSEN HOLDING A/S	10,210	535.000000	5,462,350.00	
COLOPLAST-B	11,843	534.000000	6,324,162.00	
DANSKE BANK A/S	72,757	238.600000	17,359,820.20	
DSV A/S	18,414	487.400000	8,974,983.60	
GENMAB A/S	5,624	1,099.000000	6,180,776.00	
H LUNDBECK A/S	6,220	315.000000	1,959,300.00	
ISS A/S	15,182	238.300000	3,617,870.60	
NOVO NORDISK A/S-B	178,503	343.750000	61,360,406.25	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,218	330.000000	7,331,940.00	

ORSTED A/S	18,913	348.500000	6,591,180.50
PANDORA A/S	10,770	582.200000	6,270,294.00
TDC A/S	72,933	39.650000	2,891,793.45
TRYG A/S	10,139	149.100000	1,511,724.90
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	20,352	406.000000	8,262,912.00
WILLIAM DEMANT HOLDING	10,386	185.300000	1,924,525.80
デンマーククローネ 小計	495,929		164,945,185.30 (3,016,847,439)
イスラエルシェケル			
AZRIELI GROUP LTD	3,746	183.000000	685,518.00
BANK HAPOALIM BM	111,304	25.700000	2,860,512.80
BANK LEUMI LE-ISRAEL	149,187	21.370000	3,188,126.19
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	5.600000	1,044,461.60
ELBIT SYSTEMS LTD	2,101	474.700000	997,344.70
FRUTAROM	3,477	330.100000	1,147,757.70
ISRAEL CHEMICALS LTD	46,853	15.220000	713,102.66
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	65.800000	825,066.20
NICE LTD	5,540	312.700000	1,732,358.00
イスラエルシェケル 小計	521,258		13,194,247.85 (426,833,917)
ユーロ			
1&1 DRILLISCH AG	5,142	67.750000	348,370.50
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	67,282	19.120000	1,286,431.84
ABN AMRO GROUP NV-CVA	40,478	27.290000	1,104,644.62
ACCOR SA	17,207	45.400000	781,197.80
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	24,911	32.900000	819,571.90
ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS	22,193	0.433600	9,622.88
ADIDAS AG	18,240	183.100000	3,339,744.00
ADP	2,719	162.700000	442,381.30
AEGON NV	176,201	5.628000	991,659.22
AENA SME SA	6,629	178.600000	1,183,939.40
AGEAS	19,001	43.000000	817,043.00
AIB GROUP PLC	79,880	5.575000	445,331.00
AIR LIQUIDE SA	41,000	108.550000	4,450,550.00
AIRBUS SE	55,677	88.000000	4,899,576.00
AKZO NOBEL	24,816	74.820000	1,856,733.12
ALLIANZ SE-REG	43,072	203.900000	8,782,380.80
ALSTOM	16,182	36.250000	586,597.50
ALTICE NV - A	47,736	9.042000	431,628.91
AMADEUS IT GROUP SA	41,681	62.340000	2,598,393.54
AMUNDI SA	5,763	72.960000	420,468.48
ANDRITZ AG	6,583	48.780000	321,118.74
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,206	91.510000	6,699,081.06
ARCELORMITTAL	63,150	29.700000	1,875,555.00
ARKEMA	6,944	105.800000	734,675.20
ASML HOLDING NV	37,111	163.750000	6,076,926.25
ASSICURAZIONI GENERALI	117,333	16.200000	1,900,794.60
ATLANTIA SPA	43,897	26.540000	1,165,026.38
ATOS SE	9,102	126.500000	1,151,403.00
AXA SA	185,761	26.980000	5,011,831.78
AXEL SPRINGER SE	4,257	68.700000	292,455.90
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	638,719	7.601000	4,854,903.11
BANCO DE SABADELL SA	524,455	1.924500	1,009,313.64
BANCO SANTANDER SA	1,547,454	6.076000	9,402,330.50
BANK OF IRELAND GROUP PLC	95,816	8.145000	780,421.32
BANKIA SA	90,363	4.340000	392,175.42
BANKINTER SA	60,287	9.132000	550,540.88
BASF SE	87,969	95.350000	8,387,844.15
BAYER AG-REG	79,279	106.640000	8,454,312.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,740	93.250000	2,959,755.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,933	78.750000	388,473.75
BEIERSDORF AG	9,871	95.040000	938,139.84
BIOMERIEUX	4,050	74.500000	301,725.00
BNP PARIBAS	107,602	68.000000	7,316,936.00
BOLLORE	79,699	4.706000	375,063.49
BOSKALIS WESTMINSTER	8,202	32.230000	264,350.46
BOUYGUES SA	21,577	45.260000	976,575.02
BRENNTAG AG	14,409	53.300000	767,999.70
BUREAU VERITAS SA	24,364	23.600000	574,990.40
CAIXABANK S.A	340,654	4.440000	1,512,503.76
CAPGEMINI SE	15,258	105.700000	1,612,770.60

CARREFOUR SA	55,836	19.355000	1,080,705.78
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,022	48.420000	243,165.24
CNH INDUSTRIAL NV	100,275	12.070000	1,210,319.25
CNP ASSURANCES	15,727	20.200000	317,685.40
COLRUYT SA	5,266	44.550000	234,600.30
COMMERZBANK AG	103,317	13.668000	1,412,136.75
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	48,235	47.560000	2,294,056.60
CONTINENTAL AG	10,657	243.900000	2,599,242.30
COVESTRO AG	15,203	94.000000	1,429,082.00
CREDIT AGRICOLE SA	107,867	15.455000	1,667,084.48
CRH PLC	82,085	30.590000	2,510,980.15
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	92,206	74.390000	6,859,204.34
DANONE	57,991	69.500000	4,030,374.50
DASSAULT AVIATION SA	222	1,330.000000	295,260.00
DASSAULT SYSTEMES SA	12,562	93.100000	1,169,522.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	54,194	6.325000	342,777.05
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	198,364	15.800000	3,134,151.20
DEUTSCHE BOERSE AG	18,131	103.400000	1,874,745.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,780	28.590000	622,690.20
DEUTSCHE POST AG-REG	92,233	38.830000	3,581,407.39
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	320,607	14.580000	4,674,450.06
DEUTSCHE WOHNEN SE	34,052	35.210000	1,198,970.92
E.ON SE	207,934	8.662000	1,801,124.30
EDENRED	20,231	25.870000	523,375.97
EDF	58,355	11.115000	648,615.82
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,604	2.889000	697,993.95
EIFFAGE	7,638	96.320000	735,692.16
ELISA OYJ	15,323	32.440000	497,078.12
ENAGAS SA	20,481	23.180000	474,749.58
ENDESA SA	33,244	18.615000	618,837.06
ENEL SPA	779,559	5.160000	4,022,524.44
ENGIE	175,391	14.070000	2,467,751.37
ENI SPA	246,111	14.930000	3,674,437.23
ERSTE GROUP BANK AG	29,458	40.850000	1,203,359.30
ESSILOR INTERNATIONAL	20,265	113.500000	2,300,077.50
EURAZEO SA	3,949	84.350000	333,098.15
EUROFINS SCIENTIFIC	1,150	530.000000	609,500.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,700	18.820000	295,474.00
EVONIK INDUSTRIES AG	14,769	32.100000	474,084.90
EXOR NV	11,267	63.000000	709,821.00
FAURECIA	7,308	72.480000	529,683.84
FERRARI NV	11,929	94.900000	1,132,062.10
FERROVIAL SA	47,623	18.500000	881,025.50
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	102,020	19.420000	1,981,228.40
FORTUM OYJ	40,592	17.895000	726,393.84
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,775	95.740000	361,418.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	20,301	90.680000	1,840,894.68
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,971	69.000000	2,757,999.00
FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,184	42.660000	263,809.44
GALP ENERGIA SGPS SA	50,873	16.355000	832,027.91
GAS NATURAL SDG SA	35,824	19.550000	700,359.20
GEA GROUP AG	16,513	40.550000	669,602.15
GETLINK SE	43,040	11.180000	481,187.20
GRIFOLS SA	26,932	26.150000	704,271.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,204	95.240000	781,348.96
HANNOVER RUECK SE	6,202	110.400000	684,700.80
HEIDELBERGCEMENT AG	14,308	89.260000	1,277,132.08
HEINEKEN HOLDING NV	11,136	83.900000	934,310.40
HEINEKEN NV	24,519	89.380000	2,191,508.22
HENKEL AG & CO KGAA	10,448	100.200000	1,046,889.60
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,776	110.250000	1,849,554.00
HERMES INTERNATIONAL	3,040	439.700000	1,336,688.00
HOCHTIEF AG	1,738	147.200000	255,833.60
HUGO BOSS AG -ORD	5,624	74.760000	420,450.24
IBERDROLA SA	556,321	6.724000	3,740,702.40
IBERDROLA SA-RTS	532,075	0.147300	78,374.64
ILIAD SA	2,782	212.100000	590,062.20
IMERYS SA	3,211	82.100000	263,623.10
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	103,675	28.960000	3,002,428.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	109,946	23.710000	2,606,819.66



ING GROEP NV	372,332	16.258000	6,053,373.65	
INGENICO GROUP	5,304	89.660000	475,556.64	
INNOGY SE	12,762	31.990000	408,256.38	
INTESA SANPAOLO	1,295,713	3.122000	4,045,215.98	
INTESA SANPAOLO-RSP	82,627	3.028000	250,194.55	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	58,425	7.282000	425,450.85	
IPSEN	3,371	114.400000	385,642.40	
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248			
JCDECAUX SA	6,778	35.760000	242,381.28	
JERONIMO MARTINS	22,605	17.375000	392,761.87	
K+S AG-REG	17,191	22.800000	391,954.80	
KBC GROEP NV	23,721	77.200000	1,831,261.20	
KERING	7,223	401.500000	2,900,034.50	
KERRY GROUP PLC-A	15,725	86.100000	1,353,922.50	
KION GROUP AG	6,359	74.900000	476,289.10	
KONE OYJ-B	32,044	45.240000	1,449,670.56	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	120,724	18.368000	2,217,458.43	
KONINKLIJKE DSM NV	17,462	83.680000	1,461,220.16	
KONINKLIJKE KPN NV	335,213	2.859000	958,373.96	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,094	33.400000	3,042,539.60	
LAGARDERE SCA	10,504	25.230000	265,015.92	
LANXESS AG	8,305	71.580000	594,471.90	
LEGRAND SA	25,725	65.920000	1,695,792.00	
LEONARDO SPA	41,903	10.880000	455,904.64	
LINDE AG - TENDER	17,808	200.800000	3,575,846.40	
L'OREAL	24,139	181.800000	4,388,470.20	
LUXOTTICA GROUP SPA	17,124	51.500000	881,886.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	26,680	240.150000	6,407,202.00	
MAN SE	3,133	95.600000	299,514.80	
MAPFRE SA	94,896	2.933000	278,329.96	
MEDIOBANCA SPA	51,879	9.905000	513,861.49	
MERCK KGAA	12,442	89.540000	1,114,056.68	
METRO AG	16,244	16.980000	275,823.12	
METSO OYJ	10,175	28.310000	288,054.25	
MICHELIN (CGDE)	16,239	126.650000	2,056,669.35	
MTU AERO ENGINES AG	5,117	145.700000	745,546.90	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,796	191.500000	2,833,434.00	
NATIXIS	84,670	7.404000	626,896.68	
NESTE OYJ	11,624	55.800000	648,619.20	
NN GROUP NV	27,944	38.400000	1,073,049.60	
NOKIA OYJ	558,266	3.896000	2,175,004.33	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,377	39.840000	413,419.68	
OMV AG	15,123	54.500000	824,203.50	
ORANGE	191,435	14.725000	2,818,880.37	
ORION OYJ-CLASS B	9,317	32.330000	301,218.61	
OSRAM LICHT AG	9,181	71.160000	653,319.96	
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,509	91.500000	687,073.50	
PERNOD RICARD SA	20,372	128.150000	2,610,671.80	
PEUGEOT SA	56,498	18.450000	1,042,388.10	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	15,119	75.500000	1,141,484.50	
POSTE ITALIANE SPA	46,876	6.675000	312,897.30	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	23,886	29.670000	708,697.62	
PROXIMUS	13,567	27.820000	377,433.94	
PRYSMIAN SPA	18,585	28.800000	535,248.00	
PUBLICIS GROUPE	19,667	56.200000	1,105,285.40	
QIAGEN N.V.	22,300	26.910000	600,093.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	13,370	34.310000	458,724.70	
RANDSTAD HOLDING NV	12,347	58.000000	716,126.00	
RECORDATI SPA	9,371	37.740000	353,661.54	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40,110	17.675000	708,944.25	
RELX NV	91,570	17.700000	1,620,789.00	
REMY COINTREAU	2,005	103.800000	208,119.00	
RENAULT SA	17,959	89.140000	1,600,865.26	
REPSOL SA	121,770	15.720000	1,914,224.40	
REXEL SA	27,249	14.825000	403,966.42	
RTL GROUP	3,426	68.650000	235,194.90	
RWE AG	51,261	16.790000	860,672.19	
SAFRAN SA	32,121	89.500000	2,874,829.50	
SAMPO OYJ-A SHS	42,025	47.500000	1,996,187.50	
SANOFI	108,865	72.250000	7,865,496.25	

SAP SE	94,216	90.800000	8,554,812.80	
SCHAEFFLER AG	15,276	16.085000	245,714.46	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,829	74.780000	4,025,332.62	
SCOR SE	17,890	35.750000	639,567.50	
SEB SA	2,038	164.700000	335,658.60	
SES	37,565	12.925000	485,527.62	
SIEMENS AG-REG	73,362	122.060000	8,954,565.72	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,231	12.400000	263,264.40	
SNAM SPA	225,214	3.954000	890,496.15	
SOCIETE BIC SA	2,546	94.500000	240,597.00	
SOCIETE GENERALE SA	74,514	46.465000	3,462,293.01	
SODEXO SA	9,118	104.800000	955,566.40	
SOLVAY SA	7,331	118.850000	871,289.35	
STMICROELECTRONICS NV	62,441	18.925000	1,181,695.92	
STORA ENSO OYJ-R SHS	50,057	13.845000	693,039.16	
SUEZ	33,681	11.865000	399,625.06	
SYMRISE AG	12,492	67.720000	845,958.24	
TELECOM ITALIA SPA	1,127,378	0.726000	818,476.42	
TELECOM ITALIA-RSP	535,180	0.616000	329,670.88	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,777	4.000000	267,108.00	
TELEFONICA SA	434,557	8.409000	3,654,189.81	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,843	60.850000	294,696.55	
TELEPERFORMANCE	5,602	121.300000	679,522.60	
TENARIS SA	42,968	14.460000	621,317.28	
TERNA SPA	128,643	4.846000	623,403.97	
THALES SA	10,379	87.680000	910,030.72	
THYSSENKRUPP AG	41,537	25.740000	1,069,162.38	
TOTAL SA	227,494	47.540000	10,815,064.76	
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,026	67.560000	407,116.56	
UCB SA	11,488	70.180000	806,227.84	
UMICORE	17,197	43.695000	751,422.91	
UNICREDIT SPA	193,653	18.080000	3,501,246.24	
UNILEVER NV-CVA	156,155	46.420000	7,248,715.10	
UNIPER SE	19,009	24.400000	463,819.60	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	88,023	2.088000	183,792.02	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,633	57.700000	728,924.10	
UPM-KYMMENE OYJ	51,397	26.760000	1,375,383.72	
VALEO SA	22,865	64.020000	1,463,817.30	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	47,608	20.480000	975,011.84	
VINCI SA	48,480	87.200000	4,227,456.00	
VIVENDI	100,184	23.220000	2,326,272.48	
VOESTALPINE AG	10,577	53.560000	566,504.12	
VOLKSWAGEN AG	3,139	182.000000	571,298.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,728	181.380000	3,215,504.64	
VONOVIA SE	46,989	39.630000	1,862,174.07	
VOPAK	6,422	37.300000	239,540.60	
WARTSILA OYJ ABP	15,019	54.100000	812,527.90	
WENDEL	2,624	150.000000	393,600.00	
WIRECARD AG	11,261	99.160000	1,116,640.76	
WOLTERS KLUWER	29,591	42.120000	1,246,372.92	
ZALANDO SE	10,117	46.870000	474,183.79	
ZODIAC AEROSPACE	18,512	25.000000	462,800.00	
ユーロ 小計	19,378,657		396,891,978.05 (54,044,780,651)	
合計	108,920,538		400,302,402,196 (400,302,402,196)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカドル				
投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	35,704.00	699,798.40	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,974.00	1,139,428.78	
	AMERICAN TOWER CORP	41,073.00	5,871,796.08	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	113,044.00	1,245,744.88	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,964.00	2,206,213.52	
	BOSTON PROPERTIES INC	14,624.00	1,794,072.32	

	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	27,436.00	465,863.28	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,381.00	729,566.05	
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	46,657.00	461,904.30	
	CROWN CASTLE INTL CORP	39,058.00	4,242,089.38	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	19,214.00	2,140,631.74	
	DUKE REALTY CORP	32,395.00	842,593.95	
	EQUINIX INC	7,400.00	3,249,858.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	34,636.00	2,120,069.56	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,254.00	1,446,300.04	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,620.00	1,072,700.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,651.00	819,137.16	
	GGP INC	60,077.00	1,417,817.20	
	HCP INC	45,369.00	1,106,096.22	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	71,542.00	1,514,544.14	
	INVITATION HOMES INC	29,720.00	671,077.60	
	IRON MOUNTAIN INC	25,269.00	905,135.58	
	KIMCO REALTY CORP	39,433.00	638,420.27	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	13,238.00	553,348.40	
	MACERICH CO/THE	11,029.00	717,436.45	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,056.00	1,044,792.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,428.00	555,382.08	
	PROLOGIS INC	50,371.00	3,234,825.62	
	PUBLIC STORAGE	14,867.00	2,862,938.19	
	REALTY INCOME CORP	26,102.00	1,420,992.88	
	REGENCY CENTERS CORP	15,388.00	986,678.56	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,795.00	4,892,339.00	
	SL GREEN REALTY CORP	9,188.00	886,550.12	
	UDR INC	26,436.00	970,994.28	
	VENTAS INC	33,547.00	1,892,386.27	
	VEREIT INC	98,677.00	736,130.42	
	VORNADO REALTY TRUST	16,646.00	1,202,340.58	
	WELLTOWER INC	35,841.00	2,180,566.44	
	WEYERHAEUSER CO	73,538.00	2,774,588.74	
	投資証券 小計	1,217,642.00	63,713,148.48 (6,994,429,440)	
	アメリカドル 小計	1,217,642.00	63,713,148.48 (6,994,429,440)	
	カナダドル			
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200.00	258,762.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700.00	336,472.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700.00	177,954.00	
	投資証券 小計	31,600.00	773,188.00 (68,581,775)	
	カナダドル 小計	31,600.00	773,188.00 (68,581,775)	
	オーストラリアドル			
投資証券	DEXUS	107,134.00	1,025,272.38	
	GOODMAN GROUP	177,470.00	1,442,831.10	
	GPT GROUP	186,909.00	940,152.27	
	MIRVAC GROUP	336,014.00	739,230.80	
	SCENTRE GROUP	518,897.00	2,132,666.67	
	STOCKLAND	225,746.00	961,677.96	
	VICINITY CENTRES	356,298.00	947,752.68	
	WESTFIELD CORP	194,292.00	1,775,828.88	
	投資証券 小計	2,102,760.00	9,965,412.74 (878,750,095)	
	オーストラリアドル 小計	2,102,760.00	9,965,412.74 (878,750,095)	
	イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	87,749.00	596,693.20	
	HAMMERSON PLC	70,806.00	347,586.65	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	73,108.00	727,059.06	
	SEGRO PLC	89,418.00	508,430.74	
	投資証券 小計	321,081.00	2,179,769.65 (338,823,394)	
	イギリスポンド 小計	321,081.00	2,179,769.65 (338,823,394)	
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	212,500.00	14,970,625.00	
	投資証券 小計	212,500.00	14,970,625.00 (210,187,575)	

香港ドル 小計		212,500.00	14,970,625.00 (210,187,575)
シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	275,700.00	758,175.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	276,100.00	524,590.00
	CAPITALAND MALL TRUST	225,900.00	474,390.00
	SUNTEC REIT	231,600.00	495,624.00
投資証券 小計		1,009,300.00	2,252,779.00 (188,850,463)
シンガポールドル 小計		1,009,300.00	2,252,779.00 (188,850,463)
ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	3,052.00	272,391.00
	GECINA SA	4,793.00	752,021.70
	ICADE	3,002.00	258,172.00
	KLEPIERRE	22,095.00	785,035.35
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,497.00	1,940,237.10
投資証券 小計		42,439.00	4,007,857.15 (545,749,908)
ユーロ 小計		42,439.00	4,007,857.15 (545,749,908)
合計			9,225,372,650 (9,225,372,650)

(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 601銘柄	97.40%		63.96%
	投資証券 39銘柄		2.60%	1.71%
カナダドル	株式 88銘柄	99.55%		3.72%
	投資証券 3銘柄		0.45%	0.02%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	92.18%		2.53%
	投資証券 8銘柄		7.82%	0.21%
イギリスポンド	株式 98銘柄	98.84%		7.03%
	投資証券 4銘柄		1.16%	0.08%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.00%		3.25%
香港ドル	株式 42銘柄	96.18%		1.29%
	投資証券 1銘柄		3.82%	0.05%
シンガポールドル	株式 21銘柄	91.39%		0.49%
	投資証券 4銘柄		8.61%	0.05%
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 31銘柄	100.00%		1.10%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%		0.27%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.00%		0.74%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.00%		0.10%
ユーロ	株式 242銘柄	99.00%		13.20%
	投資証券 5銘柄		1.00%	0.13%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「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29年1月26日現在 ]	[ 平成30年1月26日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,592,965,929	1,885,580,036
コール・ローン	196,309,444	470,495,376
株式	40,947,746,543	70,478,128,712
投資証券	178,423,566	311,561,253
派生商品評価勘定	81,981,282	89,363,328
未収配当金	58,451,437	104,540,543

差入委託証拠金	197,462,184	703,325,120
流動資産合計	43,253,340,385	74,042,994,368
資産合計	43,253,340,385	74,042,994,368
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	203,161	408,722
未払金	7,385	460,296,874
未払解約金	76,247,436	50,151,691
未払利息	278	696
流動負債合計	76,458,260	510,857,983
負債合計	76,458,260	510,857,983
純資産の部		
元本等		
元本	20,724,821,460	25,769,515,964
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	22,452,060,665	47,762,620,421
元本等合計	43,176,882,125	73,532,136,385
純資産合計	43,176,882,125	73,532,136,385
負債純資産合計	43,253,340,385	74,042,994,368

(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29年1月26日現在]	[平成30年1月26日現在]
1 期首	平成28年1月27日	平成29年1月27日
期首元本額	18,949,314,185円	20,724,821,460円
期首からの追加設定元本額	6,013,448,770円	8,383,607,511円
期首からの一部解約元本額	4,237,941,495円	3,338,913,007円
元本の内訳*		
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,837,117,156円	13,468,749,086円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,242,235,603円	1,181,900,612円
eMAXIS バランス(波乗り型)	204,265,975円	227,203,977円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	160,296,031円	166,436,084円
コアバランス	108,371円	87,504円
海外株式セレクション(ラップ向け)		27,153,951円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)		370,708,403円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス		1,302,604,401円
つみたて新興国株式		50,991,825円
つみたて8資産均等バランス		5,718,427円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		382,685円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		675,490円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		1,323,893円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	4,481,077,922円	6,269,412,372円
新興国株式インデックスオープン	267,471,144円	282,670,436円
eMAXIS 全世界株式インデックス	347,790,220円	370,081,202円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	144,599,424円	652,503,161円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)	6,428,307円	7,677,244円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	2,020,076円	7,720,511円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	9,269,583円	44,977,832円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	10,906,768円	41,213,915円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	26,327,391円	227,207,892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)	2,859,869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)	961,438,197円	1,050,249,568円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,508,926円	2,102,106円

アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	15,842,516円	5,484,552円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	1,257,981円	4,278,835円
（合計）	20,724,821,460円	25,769,515,964円
2 受益権の総数	20,724,821,460口	25,769,515,964口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0833円 （20,833円）	2.8535円 （28,535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28年1月27日 至平成29年1月26日）	（自平成29年1月27日 至平成30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。	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29年1月26日現在]	[平成30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29年1月26日現在]	[平成30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	4,389,713,732	11,539,327,099
投資証券	7,958,031	1,618,897
合計	4,381,755,701	11,540,945,996

（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29年1月26日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,916,480,388	1,998,243,709	81,763,321
	合計	1,916,480,388	1,998,243,709	81,763,321

区分	種類	[平成30年1月26日現在]		
		契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引			

買建	2,834,466,906	2,920,685,922	86,219,016
合 計	2,834,466,906	2,920,685,922	86,219,016

## (注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成29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	29,318,800		29,160,000	158,800
	メキシコペソ	21,480,400		21,440,000	40,400
	南アフリカランド	42,486,000		42,700,000	214,000
	合 計	93,285,200		93,300,000	14,800

区 分	種 類	[ 平成30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	280,560,000		280,600,000	40,000
	ブラジルリアル	147,763,910		149,855,000	2,091,090
	韓国ウォン	103,000,000		103,300,000	300,000
	ニュー台湾ドル	94,195,500		94,500,000	304,500
合 計	625,519,410		628,255,000	2,735,590	

## (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	58.COM INC-ADR	9,681	84.370000	816,785.97	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	125,610	198.330000	24,912,231.30	
	ALROSA PJSC	264,200	1.475817	389,910.93	
	AUTOHOME INC-ADR	5,473	84.950000	464,931.35	
	BAIDU INC - SPON ADR	29,896	254.140000	7,597,769.44	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	20,697	15.860000	328,254.42	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	142,542	4.545000	647,853.39	
	CREDICORP LTD	7,470	234.420000	1,751,117.40	
	CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	42,809	45.590000	1,951,662.31	
	DP WORLD LTD	17,357	26.990000	468,465.43	
	GAZPROM PAO -SPON ADR	572,037	5.314000	3,039,804.61	
	INTER RAO UES PJSC	3,193,000	0.066438	212,137.49	
	JD.COM INC-ADR	71,359	47.380000	3,380,989.42	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	46,760	68.300000	3,193,708.00	

MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,510	25.650000	1,013,431.50	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	17,700	10.420000	184,434.00	
MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,053	204.399817	1,441,631.91	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	54,750	11.830000	647,692.50	
MOMO INC-SPON ADR	10,871	29.760000	323,520.96	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	159,120	2.061538	328,031.89	
NETEASE INC-ADR	8,678	329.590000	2,860,182.02	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	14,842	92.000000	1,365,464.00	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,866	135.400000	1,335,856.40	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	128,760	2.728402	351,309.01	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	14,167	16.500000	233,755.50	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	5,400	40.700000	219,780.00	
ROSNEFT OIL CO PJSC	124,300	6.227489	774,076.82	
RUSHYDRO PJSC	10,464,000	0.013727	143,639.32	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	269,050	19.290000	5,189,974.50	
SEVERSTAL PJSC	22,700	16.831050	382,064.83	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	105,800	1.516000	160,392.80	
SINA CORP	6,454	118.470000	764,605.38	
SOUTHERN COPPER CORP	10,046	50.050000	502,802.30	
SURGUTNEFTEGAS OJSC	870,900	0.545680	475,232.97	
SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	723,400	0.560385	405,382.72	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	30,129	33.560000	1,011,129.24	
TATNEFT PJSC	170,810	10.165954	1,736,446.65	
TRANSNEFT PJSC	62	3,242.191781	201,015.89	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	45,216	16.830000	760,985.28	
VTB BANK PJSC	558,190,000	0.000884	493,439.96	
WEIBO CORP-SPON ADR	5,111	130.520000	667,087.72	
YUM CHINA HOLDINGS INC	41,946	47.500000	1,992,435.00	
YY INC-ADR	4,807	140.390000	674,854.73	
アメリカドル 小計	576,104,339		75,796,277.26 (8,320,915,317)	
香港ドル				
3SBIO INC	94,000	15.360000	1,443,840.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	79,500	133.300000	10,597,350.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	168,000	13.980000	2,348,640.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,802,000	4.710000	13,197,420.00	
AIR CHINA LTD-H	214,000	11.060000	2,366,840.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	418,000	4.220000	1,763,960.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,410,000	1.130000	1,593,300.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	422,000	5.780000	2,439,160.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	133,500	42.200000	5,633,700.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	38.400000	4,646,400.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	188,000	4.410000	829,080.00	
BANK OF CHINA LTD-H	8,625,000	4.590000	39,588,750.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	906,900	6.710000	6,085,299.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	164,000	12.100000	1,984,400.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	53,500	49.250000	2,634,875.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	484,000	5.980000	2,894,320.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	340,000	18.840000	6,405,600.00	
BYD CO LTD-H	71,500	74.150000	5,301,725.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	73,500	17.260000	1,268,610.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,111,000	2.240000	2,488,640.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	895,000	3.290000	2,944,550.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	938,000	6.300000	5,909,400.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	467,000	9.590000	4,478,530.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	304,000	5.040000	1,532,160.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	172,000	21.050000	3,620,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,161,550	8.570000	78,514,483.50	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	288,000	4.410000	1,270,080.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	255,000	12.040000	3,070,200.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	106,000	19.580000	2,075,480.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	351,000	28.050000	9,845,550.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	346,500	6.760000	2,342,340.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	193,000	23.800000	4,593,400.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,116,000	3.990000	4,452,840.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	0.420000	156,240.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	446,000	5.000000	2,230,000.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	811,000	26.300000	21,329,300.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	347,000	5.500000	1,908,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	139,000	17.840000	2,479,760.00	



CHINA MENGNIU DAIRY CO	291,000	25.750000	7,493,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	426,550	37.550000	16,016,952.50
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	134,000	21.450000	2,874,300.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	614,600	8.460000	5,199,516.00
CHINA MOBILE LTD	668,500	82.550000	55,184,675.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	390,000	6.080000	2,371,200.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	322,000	8.200000	2,640,400.00
CHINA OILFIELD SERVICES-H	218,000	10.180000	2,219,240.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	424,000	30.350000	12,868,400.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	290,400	40.650000	11,804,760.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,764,000	6.980000	19,292,720.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	208,000	9.690000	2,015,520.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	408,000	6.130000	2,501,040.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	176,000	30.500000	5,368,000.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	90,000	25.950000	2,335,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	298,000	31.300000	9,327,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	228,500	10.440000	2,385,540.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	226,000	14.600000	3,299,600.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	365,500	23.500000	8,589,250.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	170,000	9.140000	1,553,800.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	230,000	11.660000	2,681,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	173,000	33.300000	5,760,900.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,558,000	3.920000	6,107,360.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	676,000	11.720000	7,922,720.00
CHINA VANKE CO LTD-H	128,451	40.000000	5,138,040.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	302,000	6.750000	2,038,500.00
CITIC LTD	616,000	12.720000	7,835,520.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	251,500	21.600000	5,432,400.00
CNOOC LTD	1,940,000	12.900000	25,026,000.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	8.370000	1,523,340.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	572,232	16.460000	9,418,938.72
CRRC CORP LTD - H	420,550	8.080000	3,398,044.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	516,000	17.660000	9,112,560.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	278,000	10.040000	2,791,120.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	85,000	58.300000	4,955,500.00
FAR EAST HORIZON LTD	226,000	8.410000	1,900,660.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	287,000	19.080000	5,475,960.00
FULLSHARE HOLDINGS LTD	740,000	4.150000	3,071,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	59,600	33.800000	2,014,480.00
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,507,000	1.330000	2,004,310.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	527,000	25.400000	13,385,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	145,400	17.640000	2,564,856.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,128,000	1.010000	1,139,280.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	310,500	9.410000	2,921,805.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	332,000	11.520000	3,824,640.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	230,675	16.940000	3,907,634.50
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	110,800	22.500000	2,493,000.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	129,000	28.600000	3,689,400.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	79,000	25.650000	2,026,350.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	13.020000	4,650,744.00
HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.910000	3,753,600.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	76,500	76.250000	5,833,125.00
HUANENG POWER INTL INC-H	438,000	5.150000	2,255,700.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	512,000	2.730000	1,397,760.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	169,200	18.680000	3,160,656.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	8,025,350	7.060000	56,658,971.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	140,000	12.580000	1,761,200.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	149,000	13.320000	1,984,680.00
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	68,000	44.150000	3,002,200.00
KINGSOFT CORP LTD	90,000	27.800000	2,502,000.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	334,000	7.990000	2,668,660.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	174,000	9.140000	1,590,360.00
LENOVO GROUP LTD	826,000	4.720000	3,898,720.00
LONGFOR PROPERTIES	168,500	24.750000	4,170,375.00
MEITU INC	138,000	11.540000	1,592,520.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	85,100	51.550000	4,386,905.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	99,000	17.300000	1,712,700.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	187,000	12.180000	2,277,660.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	718,000	4.570000	3,281,260.00
PETROCHINA CO LTD-H	2,241,000	6.350000	14,230,350.00

PICC PROPERTY & CASUALTY-H	490,000	16.700000	8,183,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	567,500	91.700000	52,039,750.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	323,400	11.760000	3,803,184.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	172,000	6.040000	1,038,880.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	254,000	3.290000	835,660.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	53,000	51.450000	2,726,850.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	60,000	23.550000	1,413,000.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	81,700	20.750000	1,695,275.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	82,000	79.050000	6,482,100.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	133,500	24.000000	3,204,000.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	340,000	3.100000	1,054,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	477,000	15.280000	7,288,560.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	346,000	6.510000	2,252,460.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	385,000	4.970000	1,913,450.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	130,800	33.600000	4,394,880.00	
SOHO CHINA LTD	193,000	4.730000	912,890.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	265,000	10.320000	2,734,800.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	268,000	35.200000	9,433,600.00	
SUNNY OPTICAL TECH	76,000	112.500000	8,550,000.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	621,100	458.000000	284,463,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	212,000	16.560000	3,510,720.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	98,000	25.100000	2,459,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	42,000	44.850000	1,883,700.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	576,000	7.140000	4,112,640.00	
WEICHA I POWER CO LTD-H	227,800	10.320000	2,350,896.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	212,000	13.340000	2,828,080.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	132,000	9.730000	1,284,360.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	58,000	45.500000	2,639,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	666,000	3.770000	2,510,820.00	
ZTE CORP-H	81,131	30.450000	2,470,438.95	
香港ドル 小計	80,620,989		1,150,409,044.17 (16,151,742,980)	
マレーシアリングgit				
AIRASIA BHD	140,000	4.210000	589,400.00	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	146,200	4.260000	622,812.00	
AMMB HOLDINGS BHD	165,700	4.800000	795,360.00	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	217,200	2.600000	564,720.00	
AXIATA GROUP BERHAD	272,300	5.610000	1,527,603.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	17,300	33.340000	576,782.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	480,800	7.020000	3,375,216.00	
DIALOG GROUP BHD	386,580	2.660000	1,028,302.80	
DIGI.COM BHD	363,600	4.950000	1,799,820.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	244,600	2.000000	489,200.00	
GAMUDA BHD	205,700	5.250000	1,079,925.00	
GENTING BHD	251,900	9.590000	2,415,721.00	
GENTING MALAYSIA BHD	302,700	5.560000	1,683,012.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.340000	405,328.00	
HAP SENG CONSOLIDATED	70,300	9.700000	681,910.00	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	60,100	11.680000	701,968.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	84,800	18.140000	1,538,272.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	18.080000	602,064.00	
IHH HEALTHCARE BHD	232,200	6.020000	1,397,844.00	
IJM CORP BHD	311,300	3.170000	986,821.00	
IOI CORP BHD	241,900	4.670000	1,129,673.00	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	172,800	2.040000	352,512.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	46,700	25.240000	1,178,708.00	
MALAYAN BANKING BHD	432,000	10.000000	4,320,000.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	91,500	9.020000	825,330.00	
MAXIS BHD	237,400	6.060000	1,438,644.00	
MISC BHD	173,000	7.520000	1,300,960.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	5,000	107.500000	537,500.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	246,100	8.000000	1,968,800.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	26,100	24.820000	647,802.00	
PETRONAS GAS BHD	73,500	17.800000	1,308,300.00	
PPB GROUP BERHAD	55,700	17.380000	968,066.00	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	117,000	5.700000	666,900.00	
PUBLIC BANK BERHAD	312,300	21.200000	6,620,760.00	
RHB BANK BHD	114,349	5.400000	617,484.60	
SAPURA ENERGY BHD	357,800	0.810000	289,818.00	
SIME DARBY BERHAD	248,500	2.890000	718,165.00	

SIME DARBY PLANTATION BHD	248,500	5.510000	1,369,235.00	
SIME DARBY PROPERTY BHD	248,500	1.580000	392,630.00	
SP SETIA BHD	158,000	3.290000	519,820.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	135,500	6.000000	813,000.00	
TENAGA NASIONAL BHD	342,300	15.860000	5,428,878.00	
UMW HOLDINGS BHD	49,000	6.820000	334,180.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.540000	525,336.00	
YTL CORP BHD	545,663	1.550000	845,777.65	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	194,820	1.310000	255,214.20	
マレーシアリングット 小計	9,048,112		58,235,574.25 (1,644,572,616)	
タイバーツ				
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	109,800	193.000000	21,191,400.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	473,100	70.000000	33,117,000.00	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	30,300	211.000000	6,393,300.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	422,000	21.000000	8,862,000.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	862,300	7.700000	6,639,710.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	270,600	21.000000	5,682,600.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	132,900	58.250000	7,741,425.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	722,800	8.050000	5,818,540.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,900	193.000000	7,700,700.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	143,600	85.000000	12,206,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	298,500	23.600000	7,044,600.00	
CP ALL PCL-NVDR	542,500	80.000000	43,400,000.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	60,600	76.750000	4,651,050.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	12,700	219.000000	2,781,300.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	133,000	66.000000	8,778,000.00	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	66,900	85.250000	5,703,225.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	500,701	14.500000	7,260,164.50	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	159,900	56.500000	9,034,350.00	
IRPC PCL - NVDR	1,161,700	7.400000	8,596,580.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	194,000	226.000000	43,844,000.00	
KCE ELECTRONICS - NVDR	26,000	79.000000	2,054,000.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	408,600	20.000000	8,172,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,700	43.250000	10,237,275.00	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	158,200	117.500000	18,588,500.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	240,861	94.250000	22,701,149.25	
PTT PCL-NVDR	111,800	486.000000	54,334,800.00	
ROBINSON PCL-NVDR	45,900	73.750000	3,385,125.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	39,550	494.000000	19,537,700.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	196,700	156.000000	30,685,200.00	
THAI OIL PCL-NVDR	117,100	101.500000	11,885,650.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	262,200	20.900000	5,479,980.00	
TMB BANK PCL-NVDR	1,726,300	2.960000	5,109,848.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	1,227,076	6.600000	8,098,701.60	
タイバーツ 小計	11,134,788		456,715,873.35 (1,598,505,556)	
フィリピンペソ				
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	209,710	78.500000	16,462,235.00	
ABOITIZ POWER CORP	195,300	41.400000	8,085,420.00	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	559,300	15.800000	8,836,940.00	
AYALA CORPORATION	27,335	1,034.000000	28,264,390.00	
AYALA LAND INC	767,100	47.000000	36,053,700.00	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	87,830	117.900000	10,355,157.00	
BDO UNIBANK INC	216,670	157.000000	34,017,190.00	
DMCI HOLDINGS INC	571,900	14.660000	8,384,054.00	
GLOBE TELECOM INC	4,210	1,735.000000	7,304,350.00	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	10,115	1,344.000000	13,594,560.00	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	45,000	113.500000	5,107,500.00	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	320,650	79.000000	25,331,350.00	
JOLLIBEE FOODS CORP	48,550	293.000000	14,225,150.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	24,800	337.600000	8,372,480.00	
MEGAWORLD CORP	999,000	5.080000	5,074,920.00	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,538,500	6.700000	10,307,950.00	
METROPOLITAN BANK & TRUST	83,040	103.700000	8,611,248.00	
PLDT INC	8,830	1,508.000000	13,315,640.00	
ROBINSONS LAND CO	145,000	21.600000	3,132,000.00	
SECURITY BANK CORP	21,400	251.800000	5,388,520.00	
SM INVESTMENTS CORP	24,590	1,100.000000	27,049,000.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	923,300	38.500000	35,547,050.00	

UNIVERSAL ROBINA CORP	90,220	169.700000	15,310,334.00	
フィリピンペソ 小計	6,922,350		348,131,138.00 (751,963,258)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	1,586,200	2,450.000000	3,886,190,000.00	
AKR CORPORINDO TBK PT	154,300	6,275.000000	968,232,500.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,223,700	8,725.000000	19,401,782,500.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,090,400	22,575.000000	24,615,780,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	401,400	7,050.000000	2,829,870,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,048,100	8,150.000000	16,692,015,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	829,600	9,600.000000	7,964,160,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,024,300	3,770.000000	22,711,611,000.00	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	580,600	3,630.000000	2,107,578,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	701,700	1,725.000000	1,210,432,500.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	877,400	3,630.000000	3,184,962,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	49,100	84,500.000000	4,148,950,000.00	
HM SAMPOERNA TBK PT	1,006,600	5,175.000000	5,209,155,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	201,300	21,150.000000	4,257,495,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	283,800	8,825.000000	2,504,535,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	446,600	8,000.000000	3,572,800,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	281,200	5,700.000000	1,602,840,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	2,187,900	1,725.000000	3,774,127,500.00	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	276,200	11,225.000000	3,100,345,000.00	
PAKUWON JATI TBK PT	1,900,000	695.000000	1,320,500,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	1,314,400	2,650.000000	3,483,160,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	318,000	11,100.000000	3,529,800,000.00	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	500,000	2,520.000000	1,260,000,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	5,518,800	3,970.000000	21,909,636,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	212,600	6,350.000000	1,350,010,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	162,900	55,025.000000	8,963,572,500.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	195,100	39,975.000000	7,799,122,500.00	
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	436,500	2,840.000000	1,239,660,000.00	
XL AXIATA TBK PT	320,000	3,010.000000	963,200,000.00	
インドネシアルピア 小計	32,128,700		185,561,522,000.00 (1,540,160,632)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B.-A	352,900	24.070000	8,494,303.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	3,674,600	17.610000	64,709,706.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,466	136.680000	6,077,612.88	
CEMEX SAB-CPO	1,573,368	15.430000	24,277,068.24	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	52,200	145.200000	7,579,440.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	16,500	136.450000	2,251,425.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,000	185.110000	38,317,770.00	
GENTERA SAB DE CV	90,100	16.510000	1,487,551.00	
GRUMA S.A.B.-B	22,680	228.690000	5,186,689.20	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	41,900	201.050000	8,423,995.00	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	23,965	366.270000	8,777,660.55	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	190,500	46.070000	8,776,335.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	50,300	67.360000	3,388,208.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	183,300	29.930000	5,486,169.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	266,900	115.530000	30,834,957.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	270,700	34.840000	9,431,188.00	
GRUPO LALA SAB DE CV	55,200	30.490000	1,683,048.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	428,370	66.410000	28,448,051.70	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	261,300	78.000000	20,381,400.00	
INDUSTRIAS PENOLAS SAB DE CV	15,420	445.780000	6,873,927.60	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	59,700	97.000000	5,790,900.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	172,300	34.960000	6,023,608.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	121,598	53.680000	6,527,380.64	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	24,200	190.450000	4,608,890.00	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	561,800	46.120000	25,910,216.00	
メキシコペソ 小計	8,761,267		339,747,499.81 (2,004,510,248)	
ブラジルリアル				
AMBEV SA	514,300	21.890000	11,258,027.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	42,800	15.520000	664,256.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	221,375	25.870000	5,726,971.25	
BANCO BRADESCO S.A.	112,998	38.190000	4,315,393.62	
BANCO BRADESCO SA-PREF	320,099	39.800000	12,739,940.20	
BANCO DO BRASIL S.A.	91,900	37.990000	3,491,281.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	48,500	35.150000	1,704,775.00	

BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	79,400	31.810000	2,525,714.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	82,954	12.530000	1,039,413.62	
BRASKEM SA-PREF A	19,100	50.860000	971,426.00	
BRF SA	48,300	36.410000	1,758,603.00	
CCR SA	126,400	15.950000	2,016,080.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	29,400	19.550000	574,770.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	20,100	22.650000	455,265.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	16,100	76.000000	1,223,600.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	101,173	6.750000	682,917.75	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	35,000	35.890000	1,256,150.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	73,800	10.860000	801,468.00	
CIELO SA	134,121	27.000000	3,621,267.00	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	19,200	44.200000	848,640.00	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	40,100	13.680000	548,568.00	
EMBRAER SA	67,900	19.800000	1,344,420.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	19,800	36.700000	726,660.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	20,100	67.790000	1,362,579.00	
FIBRIA CELULOSE SA	26,600	53.230000	1,415,918.00	
GERDAU SA-PREF	113,100	14.140000	1,599,234.00	
HYPERMARCAS SA	36,200	36.480000	1,320,576.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	352,387	50.370000	17,749,733.19	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	422,207	12.910000	5,450,692.37	
JBS SA	93,400	9.890000	923,726.00	
KLABIN SA - UNIT	61,600	17.920000	1,103,872.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	153,992	16.570000	2,551,647.44	
LOCALIZA RENT A CAR	54,375	24.170000	1,314,243.75	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	74,161	16.500000	1,223,656.50	
LOJAS RENNEN S.A.	78,200	37.250000	2,912,950.00	
M DIAS BRANCO SA	12,800	54.740000	700,672.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	9,900	72.600000	718,740.00	
NATURA COSMETICOS SA	15,700	37.100000	582,470.00	
ODONTOPREV S.A.	24,500	16.780000	411,110.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	334,200	20.630000	6,894,546.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	425,700	19.340000	8,233,038.00	
PORTO SEGURO SA	15,200	43.380000	659,376.00	
QUALICORP SA	26,400	33.500000	884,400.00	
RAIA DROGASIL SA	24,900	84.490000	2,103,801.00	
RUMO SA	125,300	13.230000	1,657,719.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	27,358	21.000000	574,518.00	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	53,200	20.890000	1,111,348.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	50,275	52.300000	2,629,382.50	
TIM PARTICIPACOES SA	89,277	12.950000	1,156,137.15	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	17,000	20.580000	349,860.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	38,900	81.010000	3,151,289.00	
VALE SA	346,530	41.780000	14,478,023.40	
WEG SA	65,880	24.900000	1,640,412.00	
ブラジルリアル 小計	5,454,162		147,161,276.74 (5,128,570,494)	
チリペソ				
AES GENER SA	260,100	190.330000	49,504,833.00	
AGUAS ANDINAS SA-A	239,300	401.180000	96,002,374.00	
BANCO DE CHILE	2,561,915	103.130000	264,210,293.00	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,119	44,894.000000	229,812,386.00	
BANCO SANTANDER CHILE	7,467,266	51.800000	386,804,378.00	
CENCOSUD SA	145,440	1,892.100000	275,187,024.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	17,584	8,774.600000	154,292,566.00	
COLBUN SA	958,889	143.910000	137,993,715.00	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	22,000	2,938.900000	64,655,800.00	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	17,574	7,184.300000	126,256,888.00	
EMPRESAS CMPC SA	130,245	2,317.500000	301,842,787.00	
EMPRESAS COPEC SA	47,919	9,950.300000	476,808,425.00	
ENEL AMERICAS SA	3,137,061	144.730000	454,026,838.00	
ENEL CHILE SA	2,251,641	78.090000	175,830,645.00	
ENEL GENERACION CHILE SA	372,759	568.550000	211,932,129.00	
ITAU CORPBANCA	14,192,300	6.133000	87,041,375.00	
LATAM AIRLINES GROUP SA	31,400	10,207.000000	320,499,800.00	
S.A.C.I. FALABELLA	78,067	6,385.900000	498,528,055.00	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,805	34,402.000000	371,713,610.00	
チリペソ 小計	31,947,384		4,682,943,921.00 (858,383,620)	

韓国ウォン				
AMOREPACIFIC CORP	3,434	310,000.000000	1,064,540,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	161,500.000000	197,353,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	2,995	149,000.000000	446,255,000.00	
BGF RETAIL CO LTD	933	218,500.000000	203,860,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	27,737	10,400.000000	288,464,800.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,700	116,800.000000	432,160,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW	74	116,800.000000	8,643,200.00	
CELLTRION INC	8,684	289,700.000000	2,515,754,800.00	
CELLTRION INC-NEW	163	289,700.000000	47,221,100.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	9,543	20,250.000000	193,245,750.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	843	362,000.000000	305,166,000.00	
CJ CORP	1,568	183,500.000000	287,728,000.00	
CJ E&M CORP	1,720	90,800.000000	156,176,000.00	
CJ LOGISTICS	730	134,000.000000	97,820,000.00	
COWAY CO LTD	5,978	97,700.000000	584,050,600.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,208	89,400.000000	286,795,200.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	11,700	6,070.000000	71,019,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	5,115	71,400.000000	365,211,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	20,041	12,000.000000	240,492,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	4,963	29,250.000000	145,167,750.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,200	35,750.000000	114,400,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	4,900	16,100.000000	78,890,000.00	
E-MART INC	2,319	256,000.000000	593,664,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,600	31,600.000000	145,360,000.00	
GS HOLDINGS	5,214	67,600.000000	352,466,400.00	
GS RETAIL CO LTD	2,340	41,500.000000	97,110,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	32,259	51,900.000000	1,674,242,100.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	8,476	56,100.000000	475,503,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	686	585,000.000000	401,310,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	1,704	104,500.000000	178,068,000.00	
HANON SYSTEMS	23,021	13,350.000000	307,330,350.00	
HANSSEM CO LTD	1,257	170,500.000000	214,318,500.00	
HANWHA CHEMICAL CORP	11,326	35,550.000000	402,639,300.00	
HANWHA CORPORATION	5,451	46,950.000000	255,924,450.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,553	7,160.000000	197,279,480.00	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,400	33,150.000000	112,710,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,680	94,600.000000	348,128,000.00	
HYOSUNG CORPORATION	2,186	129,500.000000	283,087,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,360	104,000.000000	141,440,000.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	6,991	43,700.000000	305,506,700.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	8,030	42,150.000000	338,464,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,125	139,500.000000	296,437,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,634	141,500.000000	514,211,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	6,778	45,650.000000	309,415,700.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	7,515	268,000.000000	2,014,020,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	16,968	158,500.000000	2,689,428,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	3,775	105,500.000000	398,262,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,671	94,000.000000	251,074,000.00	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	1,097	462,000.000000	506,814,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	8,945	60,400.000000	540,278,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	1,390	66,200.000000	92,018,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	25,548	16,650.000000	425,374,200.00	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,300	53,300.000000	175,890,000.00	
KAKAO CORP	3,488	135,000.000000	470,880,000.00	
KANGWON LAND INC	13,902	32,850.000000	456,680,700.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	43,259	66,600.000000	2,881,049,400.00	
KCC CORP	654	404,000.000000	264,216,000.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	2,040	40,950.000000	83,538,000.00	
KIA MOTORS CORP	28,331	33,900.000000	960,420,900.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,500	54,600.000000	409,500,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,829	35,550.000000	953,770,950.00	
KOREA GAS CORPORATION	2,550	51,100.000000	130,305,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,218	87,800.000000	370,340,400.00	
KOREA ZINC CO LTD	986	522,000.000000	514,692,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,796	38,000.000000	220,248,000.00	
KT CORP	2,250	29,900.000000	67,275,000.00	
KT&G CORP	12,362	109,500.000000	1,353,639,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,157	104,500.000000	225,406,500.00	
LG CHEM LTD	4,947	436,500.000000	2,159,365,500.00	

LG CHEM LTD-PREFERENCE	961	253,000.000000	243,133,000.00	
LG CORP	10,561	94,900.000000	1,002,238,900.00	
LG DISPLAY CO LTD	26,276	32,950.000000	865,794,200.00	
LG ELECTRONICS INC	11,450	103,500.000000	1,185,075,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,052	1,174,000.000000	1,235,048,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	190	668,000.000000	126,920,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,685	126,500.000000	213,152,500.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	1,708	415,000.000000	708,820,000.00	
LOTTE CORP	2,834	67,800.000000	192,145,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,167	227,000.000000	264,909,000.00	
MEDY-TOX INC	506	617,400.000000	312,404,400.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	42,663	10,650.000000	454,360,950.00	
NAVER CORP	3,054	913,000.000000	2,788,302,000.00	
NCSOFT CORP	1,830	425,500.000000	778,665,000.00	
NETMARBLE GAMES CORP	1,869	165,500.000000	309,319,500.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	15,720	16,850.000000	264,882,000.00	
OCI CO LTD	1,883	159,500.000000	300,338,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,149	112,500.000000	241,762,500.00	
OTTOGI CORPORATION	105	785,000.000000	82,425,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	19,000	5,940.000000	112,860,000.00	
POSCO	8,066	392,000.000000	3,161,872,000.00	
POSCO DAEWOO CORP	4,198	24,000.000000	100,752,000.00	
S-1 CORPORATION	1,650	100,500.000000	165,825,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,868	405,000.000000	756,540,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,409	136,500.000000	1,147,828,500.00	
SAMSUNG CARD CO	3,090	40,400.000000	124,836,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,001	103,000.000000	618,103,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,606	2,513,000.000000	26,652,878,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,909	2,048,000.000000	3,909,632,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,386	285,000.000000	965,010,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,644	9,670.000000	267,317,480.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	7,636	129,500.000000	988,862,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	6,057	210,000.000000	1,271,970,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,724	258,500.000000	962,654,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	7,484	42,950.000000	321,437,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	46,407	51,900.000000	2,408,523,300.00	
SHINSEGAE INC	882	310,000.000000	273,420,000.00	
SILLAJEN INC	6,052	111,500.000000	674,798,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	3,408	319,500.000000	1,088,856,000.00	
SK HYNIX INC	63,132	75,800.000000	4,785,405,600.00	
SK INNOVATION CO LTD	6,994	200,000.000000	1,398,800,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	12,100	6,450.000000	78,045,000.00	
SK TELECOM	2,189	266,500.000000	583,368,500.00	
S-OIL CORP	5,104	116,500.000000	594,616,000.00	
WOORI BANK	40,958	16,900.000000	692,190,200.00	
YUHAN CORP	967	219,000.000000	211,773,000.00	
韓国ウォン 小計	955,903		100,577,385,360.00 (10,389,643,907)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	331,168	27.950000	9,256,145.60	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	694,589	41.200000	28,617,066.80	
ADVANTECH CO LTD	36,676	235.500000	8,637,198.00	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	457.000000	5,941,000.00	
ASIA CEMENT CORP	259,281	30.200000	7,830,286.20	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	381,000	10.050000	3,829,050.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	73,774	281.000000	20,730,494.00	
AU OPTRONICS CORP	868,000	14.050000	12,195,400.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	71,000	324.500000	23,039,500.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	891,366	55.600000	49,559,949.60	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	136,464	100.500000	13,714,632.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	655,377	17.300000	11,338,022.10	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	221,413	51.900000	11,491,334.70	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	69,419	77.000000	5,345,263.00	
CHINA AIRLINES LTD	373,000	12.500000	4,662,500.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,530,255	10.800000	16,526,754.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	272,016	30.550000	8,310,088.80	
CHINA STEEL CORP	1,365,947	25.100000	34,285,269.70	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	401,000	108.500000	43,508,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	448,775	21.800000	9,783,295.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,878,955	21.300000	40,021,741.50	

DELTA ELECTRONICS INC	213,220	147.500000	31,449,950.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,056,603	19.500000	20,603,758.50
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	16,728	307.500000	5,143,860.00
EVA AIRWAYS CORP	179,142	15.600000	2,794,615.20
EVERGREEN MARINE CORP LTD	251,318	17.400000	4,372,933.20
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	337,138	26.400000	8,900,443.20
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	183,000	75.700000	13,853,100.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,926	148.000000	6,501,048.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,044,886	20.100000	21,002,208.60
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,430	109.000000	34,272,870.00
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	143,150	123.000000	17,607,450.00
FORMOSA PLASTICS CORP	449,600	101.500000	45,634,400.00
FORMOSA TAFFETA CO.	111,000	32.800000	3,640,800.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	97,042	86.700000	8,413,541.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	722,087	53.400000	38,559,445.80
GENERAL INTERFACE SOLUTION	17,000	202.500000	3,442,500.00
GIANT MANUFACTURING	35,000	167.500000	5,862,500.00
GLOBALWAFERS CO LTD	25,000	452.500000	11,312,500.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	75,000	45.400000	3,405,000.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	24,755	360.000000	8,911,800.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,696,840	95.400000	161,878,536.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	33,000	388.000000	12,804,000.00
HTC CORP	84,744	68.600000	5,813,438.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	857,255	17.400000	14,916,237.00
INNOLUX CORP	1,004,112	14.250000	14,308,596.00
INVENTEC CORP	281,429	24.250000	6,824,653.25
LARGAN PRECISION CO LTD	10,820	3,790.000000	41,007,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	213,160	43.100000	9,187,196.00
MACRONIX INTERNATIONAL	186,000	43.200000	8,035,200.00
MEDIATEK INC	161,236	305.500000	49,257,598.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,213,754	25.600000	31,072,102.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	81,000	93.400000	7,565,400.00
NAN YA PLASTICS CORP	512,557	81.800000	41,927,162.60
NANYA TECHNOLOGY CORP	64,000	78.500000	5,024,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	19,000	307.000000	5,833,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	63,000	123.000000	7,749,000.00
PEGATRON CORP	219,976	79.000000	17,378,104.00
PHISON ELECTRONICS CORP	14,000	310.000000	4,340,000.00
POU CHEN	228,500	39.650000	9,060,025.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	84,300	91.000000	7,671,300.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	62,000	291.000000	18,042,000.00
QUANTA COMPUTER INC	281,150	64.900000	18,246,635.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	41,703	123.000000	5,129,469.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	91,200	33.950000	3,096,240.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,000	52.800000	2,481,600.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	906,281	10.800000	9,787,834.80
SILICONWARE PRECISION INDS	217,000	50.400000	10,936,800.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,258,842	10.100000	12,714,304.20
STANDARD FOODS CORP	79,023	75.000000	5,926,725.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	170,193	41.850000	7,122,577.05
TAIMED BIOLOGICS INC	15,000	204.000000	3,060,000.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,056,267	14.800000	15,632,751.60
TAIWAN BUSINESS BANK	573,578	8.780000	5,036,014.84
TAIWAN CEMENT	413,706	37.600000	15,555,345.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	878,311	17.400000	15,282,611.40
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	228,000	23.850000	5,437,800.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	173,400	110.000000	19,074,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,677,000	258.000000	690,666,000.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	238,000	29.150000	6,937,700.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	528,624	68.700000	36,316,468.80
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,250,000	14.500000	18,125,000.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	110,000	64.800000	7,128,000.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	35,000	240.000000	8,400,000.00
WINBOND ELECTRONICS CORP	303,000	23.400000	7,090,200.00
WISTRON CORP	281,141	24.600000	6,916,068.60
WPG HOLDINGS LTD	171,400	39.850000	6,830,290.00
YAGEO CORPORATION	21,000	395.500000	8,305,500.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,149,321	14.200000	16,320,358.20
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	40,000	67.700000	2,708,000.00



ニュー台湾ドル 小 計	36,638,323		2,114,267,857.64 (7,991,932,501)
インドルビー			
ACC LTD	5,580	1,726.400000	9,633,312.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	82,476	436.500000	36,000,774.00
AMBUJA CEMENTS LTD	63,614	263.000000	16,730,482.00
ASHOK LEYLAND LTD	130,037	122.300000	15,903,525.10
ASIAN PAINTS LTD	31,197	1,150.450000	35,890,588.65
AUROBINDO PHARMA LTD	27,351	639.700000	17,496,434.70
AXIS BANK LTD	197,190	616.100000	121,488,759.00
BAJAJ AUTO LTD	9,613	3,311.700000	31,835,372.10
BAJAJ FINANCE LTD	16,823	1,710.300000	28,772,376.90
BAJAJ FINSERV LTD	4,020	4,933.050000	19,830,861.00
BHARAT FORGE LTD	23,964	721.150000	17,281,638.60
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	121,084	103.000000	12,471,652.00
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	78,728	480.650000	37,840,613.20
BHARTI AIRTEL LTD	129,153	452.700000	58,467,563.10
BHARTI INFRAEL LTD	68,727	343.450000	23,604,288.15
BOSCH LTD	793	19,642.500000	15,576,502.50
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,000	4,625.600000	13,876,800.00
CADILA HEALTHCARE LTD	27,181	418.150000	11,365,735.15
CIPLA LTD	35,859	621.400000	22,282,782.60
COAL INDIA LTD	72,972	299.400000	21,847,816.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,787	1,440.400000	5,454,794.80
DABUR INDIA LTD	57,083	353.750000	20,193,111.25
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,764	2,507.750000	32,008,921.00
EICHER MOTORS LTD	1,401	26,519.400000	37,153,679.40
GAIL INDIA LTD	53,768	493.750000	26,547,950.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,600	634.250000	7,991,550.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	24,662	1,075.000000	26,511,650.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	37,029	1,193.000000	44,175,597.00
HAVELLS INDIA LTD	28,929	580.550000	16,794,730.95
HCL TECHNOLOGIES LTD	60,423	1,009.550000	61,000,039.65
HERO MOTOCORP LTD	5,182	3,571.200000	18,505,958.40
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,360	258.950000	31,426,172.00
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	62,316	384.150000	23,938,691.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	71,650	1,372.750000	98,357,537.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	165,204	1,908.300000	315,258,793.20
ICICI BANK LTD	253,955	360.800000	91,626,964.00
IDEA CELLULAR LTD	163,526	95.100000	15,551,322.60
IDFC BANK LTD	120,000	58.200000	6,984,000.00
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	34,003	1,394.000000	47,400,182.00
INDIAN OIL CORP LTD	59,408	392.300000	23,305,758.40
INFOSYS LTD	195,065	1,175.400000	229,279,401.00
ITC LTD	377,864	281.250000	106,274,250.00
JSW STEEL LTD	89,367	290.800000	25,987,923.60
LARSEN & TOUBRO LTD	52,669	1,416.500000	74,605,638.50
LIC HOUSING FINANCE LTD	31,322	555.850000	17,410,333.70
LUPIN LTD	26,667	949.650000	25,324,316.55
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	33,735	481.800000	16,253,523.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	79,759	757.800000	60,441,370.20
MARICO LTD	53,035	307.450000	16,305,610.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,403	9,278.200000	105,799,314.60
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	65,010	370.150000	24,063,451.50
NESTLE INDIA LTD	2,499	7,490.750000	18,719,384.25
NTPC LTD	183,584	171.950000	31,567,268.80
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	151,258	208.500000	31,537,293.00
PETRONET LNG LTD	46,400	244.000000	11,321,600.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	8,151	2,771.200000	22,588,051.20
POWER FINANCE CORPORATION	89,431	118.750000	10,619,931.25
RELIANCE INDUSTRIES LTD	284,277	965.900000	274,583,154.30
RURAL ELECTRIFICATION CORP	87,685	157.850000	13,841,077.25
SHREE CEMENT LTD	895	18,161.850000	16,254,855.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	16,355	1,446.200000	23,652,601.00
SIEMENS LTD	8,272	1,296.100000	10,721,339.20
STATE BANK OF INDIA	185,208	313.150000	57,997,885.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	102,917	579.850000	59,676,422.45
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	50,461	3,121.050000	157,491,304.05
TATA MOTORS LTD	181,263	400.300000	72,559,578.90
TATA MOTORS LTD-A-DVR	35,000	227.250000	7,953,750.00

TATA POWER CO LTD	144,584	89.950000	13,005,330.80	
TATA STEEL LTD	32,661	769.150000	25,121,208.15	
TECH MAHINDRA LTD	49,066	598.450000	29,363,547.70	
TITAN CO LTD	33,047	884.100000	29,216,852.70	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,165	4,359.950000	44,318,891.75	
UNITED SPIRITS LTD	6,812	3,367.550000	22,939,750.60	
UPL LTD	40,466	768.950000	31,116,330.70	
VAKRANGEE LTD	41,800	505.000000	21,109,000.00	
VEDANTA LTD	165,274	345.600000	57,118,694.40	
WIPRO LTD	129,679	311.950000	40,453,364.05	
YES BANK LTD	181,130	361.600000	65,496,608.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	57,513	595.850000	34,269,121.05	
インドルビー 小計	5,820,161		3,454,744,611.00 (6,011,255,623)	
チェココルナ				
CEZ AS	16,855	522.000000	8,798,310.00	
KOMERCNI BANKA AS	8,864	917.000000	8,128,288.00	
MONETA MONEY BANK AS	57,129	83.700000	4,781,697.30	
O2 CZECH REPUBLIC AS	9,494	288.000000	2,734,272.00	
チェココルナ 小計	92,342		24,442,567.30 (131,256,586)	
コロンビアペソ				
BANCOLOMBIA SA	33,198	31,840.000000	1,057,024,320.00	
BANCOLOMBIA SA-PREF	44,628	32,240.000000	1,438,806,720.00	
CEMENTOS ARGOS SA	50,956	11,800.000000	601,280,800.00	
ECOPETROL SA	538,294	2,745.000000	1,477,617,030.00	
GRUPO ARGOS SA	32,301	21,200.000000	684,781,200.00	
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	400,277	1,315.000000	526,364,255.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	31,873	41,100.000000	1,309,980,300.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	5,983	39,000.000000	233,337,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	45,615	14,480.000000	660,505,200.00	
コロンビアペソ 小計	1,183,125		7,989,696,825.00 (313,995,085)	
ハンガリーフォリント				
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	42,150	3,112.000000	131,170,800.00	
OTP BANK PLC	25,561	11,330.000000	289,606,130.00	
RICHTER GEDEON NYRT	16,549	6,645.000000	109,968,105.00	
ハンガリーフォリント 小計	84,260		530,745,035.00 (233,740,113)	
ディルハム				
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	220,831	7.500000	1,656,232.50	
ALDAR PROPERTIES PJSC	353,653	2.320000	820,474.96	
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	160,000	3.320000	531,200.00	
DUBAI INVESTMENTS PJSC	153,000	2.480000	379,440.00	
DUBAI ISLAMIC BANK	138,060	6.490000	896,009.40	
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	260,000	0.652000	169,520.00	
EMAAR MALLS PJSC	256,775	2.380000	611,124.50	
EMAAR PROPERTIES PJSC	366,395	6.870000	2,517,133.65	
EMIRATES TELECOM GROUP CO	182,353	18.000000	3,282,354.00	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	153,829	11.250000	1,730,576.25	
ディルハム 小計	2,244,896		12,594,065.26 (377,192,254)	
ポーランドズロチ				
ALIOR BANK SA	10,598	86.300000	914,607.40	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	5,658	83.500000	472,443.00	
BANK MILLENNIUM SA	76,012	9.700000	737,316.40	
BANK PEKAO SA	16,845	140.750000	2,370,933.75	
BANK ZACHODNI WBK SA	4,028	429.000000	1,728,012.00	
CCC SA	3,290	289.000000	950,810.00	
CD PROJEKT SA	6,700	112.000000	750,400.00	
CYFROWY POLSAT SA	26,995	24.780000	668,936.10	
DINO POLSKA SA	4,500	80.200000	360,900.00	
GRUPA AZOTY SA	6,391	70.600000	451,204.60	
GRUPA LOTOS SA	8,600	59.260000	509,636.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,700	99.120000	465,864.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,870	112.350000	1,782,994.50	
LPP SA	139	9,895.000000	1,375,405.00	
MBANK SA	1,716	522.000000	895,752.00	
ORANGE POLSKA SA	57,240	6.120000	350,308.80	
PGE SA	87,510	12.120000	1,060,621.20	
PKO BANK POLSKI SA	103,404	46.430000	4,801,047.72	

PLAY COMMUNICATIONS SA	14,900	32.220000	480,078.00	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	33,416	105.450000	3,523,717.20	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	181,261	6.830000	1,238,012.63	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	65,857	46.600000	3,068,936.20	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	95,940	3.110000	298,373.40	
ポーランドズロチ 小計	831,570		29,256,309.90 (961,362,343)	
南アフリカランド				
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,900	366.000000	1,793,400.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,703	140.050000	5,700,455.15	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	41,510	257.000000	10,668,070.00	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	71,709	185.410000	13,295,565.69	
BID CORP LTD	36,142	273.100000	9,870,380.20	
BIDVEST GROUP LTD	37,152	241.070000	8,956,232.64	
BRAIT SE	33,120	40.000000	1,324,800.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,393	1,069.300000	4,697,434.90	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	30,502	80.800000	2,464,561.60	
DISCOVERY LTD	40,296	183.500000	7,394,316.00	
EXXARO RESOURCES LTD	25,153	148.000000	3,722,644.00	
FIRSTRAND LTD	366,528	71.430000	26,181,095.04	
GOLD FIELDS LTD	85,465	53.850000	4,602,290.25	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,915	282.000000	4,770,030.00	
INVESTEC LTD	30,241	94.570000	2,859,891.37	
KUMBA IRON ORE LTD	6,900	375.070000	2,587,983.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	17,401	136.000000	2,366,536.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	142,938	28.000000	4,002,264.00	
MMI HOLDINGS LTD	128,397	23.660000	3,037,873.02	
MONDI LTD	12,149	316.080000	3,840,055.92	
MR PRICE GROUP LTD	27,874	281.000000	7,832,594.00	
MTN GROUP LTD	185,364	135.560000	25,127,943.84	
NASPERS LTD-N SHS	47,781	3,648.000000	174,305,088.00	
NEDBANK GROUP LTD	25,687	280.000000	7,192,360.00	
NEPI ROCKCASTLE PLC	39,514	168.990000	6,677,470.86	
NETCARE LTD	120,289	25.200000	3,031,282.80	
PICK N PAY STORES LTD	42,191	73.180000	3,087,537.38	
PIONEER FOODS GROUP LTD	17,184	140.170000	2,408,681.28	
PSG GROUP LTD	11,156	282.500000	3,151,570.00	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	78,513	47.160000	3,702,673.08	
REMGRO LTD	56,307	244.600000	13,772,692.20	
RMB HOLDINGS LTD	82,310	83.570000	6,878,646.70	
SANLAM LTD	153,877	91.790000	14,124,369.83	
SAPPI LIMITED	56,542	86.360000	4,882,967.12	
SASOL LTD	60,437	460.680000	27,842,117.16	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	47,922	249.240000	11,944,079.28	
SIBANYE GOLD LTD	192,319	15.230000	2,929,018.37	
SPAR GROUP LIMITED/THE	21,107	211.530000	4,464,763.71	
STANDARD BANK GROUP LTD	141,258	207.900000	29,367,538.20	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	308,060	7.440000	2,291,966.40	
TELKOM SA SOC LTD	24,490	51.700000	1,266,133.00	
THE FOSCHINI GROUP LTD	22,531	200.570000	4,519,042.67	
TIGER BRANDS LTD	17,695	474.500000	8,396,277.50	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,220	99.250000	4,686,585.00	
VODACOM GROUP LTD	64,693	157.520000	10,190,441.36	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	109,873	64.270000	7,061,537.71	
南アフリカランド 小計	3,174,708		515,271,256.23 (4,745,648,269)	
トルコリラ				
AKBANK T.A.S.	227,815	10.650000	2,426,229.75	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	27,231	28.000000	762,468.00	
ARCELIK AS	29,629	19.840000	587,839.36	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	18,000	32.880000	591,840.00	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,976	76.000000	1,822,176.00	
COCA-COLA ICECEK AS	6,400	37.100000	237,440.00	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	143,073	9.970000	1,426,437.81	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,460	63.150000	407,949.00	
HACI OMER SABANCI HOLDING	94,696	11.260000	1,066,276.96	
KOC HOLDING AS	78,940	18.210000	1,437,497.40	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	62,700	7.940000	497,838.00	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	14,000	22.300000	312,200.00	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	16,554	31.580000	522,775.32	

	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	13,031	115.000000	1,498,565.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	61,133	15.190000	928,610.27	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	112,856	5.020000	566,537.12	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	76,648	6.560000	502,810.88	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	129,733	16.340000	2,119,837.22	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	241,254	11.690000	2,820,259.26	
	TURKIYE HALK BANKASI	56,840	10.420000	592,272.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	168,876	7.910000	1,335,809.16	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	65,670	7.270000	477,420.90	
	ULKER BISKUVI SANAYI	23,160	23.140000	535,922.40	
	YAPI VE KREDI BANKASI	74,500	4.620000	344,190.00	
	トルコリラ 小計	1,773,175		23,821,202.61 (695,817,328)	
ユーロ					
	ALPHA BANK AE	158,150	2.026000	320,411.90	
	EUROBANK ERGASIAS SA	203,876	0.880000	179,410.88	
	FF GROUP	5,889	19.400000	114,246.60	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,539	12.600000	321,791.40	
	JUMBO SA	12,381	15.560000	192,648.36	
	NATIONAL BANK OF GREECE	572,412	0.348000	199,199.37	
	OPAP SA	23,143	11.000000	254,573.00	
	PIRAEUS BANK S.A	29,079	3.648000	106,080.19	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,850	24.750000	95,287.50	
	ユーロ 小計	1,034,319		1,783,649.20 (242,879,511)	
カタールリアル					
	BARWA REAL ESTATE CO	8,300	38.500000	319,550.00	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,639	28.590000	618,659.01	
	DOHA BANK QPSC	12,420	33.030000	410,232.60	
	EZDAN HOLDING GROUP	84,250	11.650000	981,512.50	
	INDUSTRIES QATAR	16,223	113.500000	1,841,310.50	
	MASRAF AL RAYAN	38,797	41.940000	1,627,146.18	
	OOREDOO QPSC	8,931	100.000000	893,100.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,479	200.000000	695,800.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	23,470	18.100000	424,807.00	
	QATAR INSURANCE CO	14,092	53.500000	753,922.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	7,135	101.900000	727,056.50	
	QATAR NATIONAL BANK	24,452	139.890000	3,420,590.28	
	カタールリアル 小計	263,188		12,713,686.57 (384,080,471)	
合計		816,218,061		70,478,128,712 (70,478,128,712)	

(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	328,300.00	9,684,850.00	
	投資証券 小計	328,300.00	9,684,850.00 (57,140,615)	
メキシコペソ 小計		328,300.00	9,684,850.00 (57,140,615)	
南アフリカランド				
投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	93,800.00	1,682,772.00	
	FORTRESS REIT LTD-B	89,509.00	3,007,502.40	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	242,610.00	6,916,811.10	
	HYPROP INVESTMENTS LTD	28,577.00	3,444,100.04	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	568,113.00	6,391,271.25	
	RESILIENT REIT LTD	30,408.00	3,873,979.20	
	投資証券 小計	1,053,017.00	25,316,435.99 (233,164,375)	
南アフリカランド 小計		1,053,017.00	25,316,435.99 (233,164,375)	
トルコリラ				
投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	264,620.00	727,705.00	
	投資証券 小計	264,620.00	727,705.00 (21,256,263)	

トルコリラ 小計	264,620.00	727,705.00 (21,256,263)	
合計		311,561,253 (311,561,253)	

(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 43銘柄	100.00%		11.75%
香港ドル	株式 138銘柄	100.00%		22.82%
マレーシアリングgit	株式 46銘柄	100.00%		2.32%
タイバーツ	株式 33銘柄	100.00%		2.26%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.00%		1.06%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.00%		2.18%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.23%		2.83%
	投資証券 1銘柄		2.77%	0.08%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	100.00%		7.24%
チリペソ	株式 19銘柄	100.00%		1.21%
韓国ウォン	株式 115銘柄	100.00%		14.68%
ニュー台湾ドル	株式 90銘柄	100.00%		11.29%
インドルピー	株式 79銘柄	100.00%		8.49%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.00%		0.19%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.00%		0.44%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.33%
ディルハム	株式 10銘柄	100.00%		0.53%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	100.00%		1.36%
南アフリカランド	株式 46銘柄	95.32%		6.70%
	投資証券 6銘柄		4.68%	0.33%
トルコリラ	株式 24銘柄	97.04%		0.98%
	投資証券 1銘柄		2.96%	0.03%
ユーロ	株式 9銘柄	100.00%		0.34%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.00%		0.54%

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】

## 【eMAXIS 全世界株式インデックス】

## 【純資産額計算書】

平成30年1月31日現在  
(単位：円)

資産総額	7,924,595,080
負債総額	15,504,084
純資産総額( - )	7,909,090,996
発行済口数	2,926,920,289 口
1口当たり純資産価額( / )	2.7022 ( 1万口当たり 27,022 )

(参考)

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年1月31日現在  
(単位：円)

資産総額	417,848,572,906
負債総額	8,931,296,857
純資産総額( - )	408,917,276,049
発行済口数	149,069,875,501 口
1口当たり純資産価額( / )	2.7431 ( 1万口当たり 27,431 )

## 新興国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成30年1月31日現在  
(単位：円)

資産総額	73,130,307,935
負債総額	38,060,677
純資産総額( - )	73,092,247,258
発行済口数	26,135,704,590 口
1口当たり純資産価額( / )	2.7966 ( 1万口当たり 27,966 )

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定められ、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

( 2 ) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

( 3 ) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

( 4 ) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。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 ) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

平成30年1月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

###### 運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

###### 運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

###### ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

###### 投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

###### 投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信



託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

平成30年1月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	842	12,086,050
追加型公社債投資信託	16	1,443,011
単位型株式投資信託	54	324,608
単位型公社債投資信託	1	6,323
合計	913	13,859,992

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	80,707,781	2	69,212,680
有価証券		2,728,127		36,210
前払費用		402,267		337,699
未収入金		14,286		35,896

未収委託者報酬		11,275,577		10,076,022
未収収益	2	564,923	2	659,405
繰延税金資産		491,700		446,374
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		438,012		113,754
流動資産合計		96,652,678		80,948,042
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	846,844	1	806,798
器具備品	1	768,584	1	759,446
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,971,428		2,922,245
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,813,951		1,844,549
ソフトウェア仮勘定		341,815		608,066
その他		71		10
無形固定資産合計		2,171,661		2,468,448
投資その他の資産				
投資有価証券		24,223,272		24,327,081
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		686,446		654,402
前払年金費用		499,178		463,105
繰延税金資産		786,810		711,230
その他		51,090		50,235
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,543,335		26,502,592
固定資産合計		31,686,425		31,893,286
資産合計		128,339,103		112,841,328

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	199,091	166,493
未払金		
未払収益分配金	101,046	108,024
未払償還金	821,178	547,707
未払手数料	2 4,866,423	2 4,225,009
その他未払金	2 2,521,849	2 2,355,815
未払費用	2 3,419,978	2 3,061,479
未払消費税等	370,110	351,670
未払法人税等	947,540	756,668

賞与引当金	882,523	843,729
役員賞与引当金		100,680
その他	670,983	711,633
流動負債合計	14,800,725	13,228,909
固定負債		
退職給付引当金	508,142	590,154
役員退職慰労引当金	166,789	166,458
時効後支払損引当金	257,105	253,070
固定負債合計	932,038	1,009,684
負債合計	15,732,763	14,238,594
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	57,079,782	43,034,713
利益剰余金合計	64,420,372	50,375,303
株主資本合計	111,153,216	97,108,147

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,446,576	1,494,586
繰延ヘッジ損益	6,546	
評価・換算差額等合計	1,453,123	1,494,586
純資産合計	112,606,339	98,602,734
負債純資産合計	128,339,103	112,841,328

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,096,942	81,709,776

投資顧問料		2,226,322		2,396,020
その他営業収益		35,063		25,763
営業収益合計		84,358,328		84,131,560
営業費用				
支払手数料	2	34,821,751	2	33,975,255
広告宣伝費		742,632		731,771
公告費				482
調査費				
調査費		1,642,352		1,713,892
委託調査費		14,530,744		13,961,993
事務委託費		751,410		984,749
営業雑経費				
通信費		122,574		158,915
印刷費		704,639		699,940
協会費		51,201		51,995
諸会費		7,730		9,887
事務機器関連費		1,674,745		1,611,608
その他営業雑経費		30,382		11,925
営業費用合計		55,080,164		53,912,419
一般管理費				
給料				
役員報酬		280,681		331,997
給料・手当		5,948,603		6,496,165
賞与引当金繰入		882,523		843,729
役員賞与引当金繰入				100,680
福利厚生費		1,091,897		1,196,210
交際費		17,062		14,843
旅費交通費		212,578		233,159
租税公課		264,376		422,030
不動産賃借料		795,415		706,571
退職給付費用		341,073		441,736
役員退職慰労引当金繰入		34,369		48,393
固定資産減価償却費		1,068,796		1,030,040
諸経費		426,547		474,521
一般管理費合計		11,363,925		12,340,079
営業利益		17,914,238		17,879,061

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	235,697	243,048
有価証券利息	523	0
受取利息	2 15,142	2 4,601
投資有価証券償還益	9,315	260,190
収益分配金等時効完成分	71,619	278,148

その他		17,393		4,383
営業外収益合計		349,691		790,372
営業外費用				
投資有価証券償還損		152,298		11,552
時効後支払損引当金繰入		98,891		
事務過誤費		421		218
その他		5,862		4,357
営業外費用合計		257,473		16,128
経常利益		18,006,455		18,653,304
特別利益				
投資有価証券売却益		424,605		259,137
ゴルフ会員権売却益		1,300		
特別利益合計		425,905		259,137
特別損失				
投資有価証券売却損		52,623		42,248
デリバティブ解約損				126,228
有価証券評価損		67,284		
投資有価証券評価損		18,539		157,482
固定資産除却損	1	1,305	1	13,540
減損損失	3	42,073	3	48,575
合併関連費用		829,181		
特別損失合計		1,011,007		388,075
税引前当期純利益		17,421,353		18,524,367
法人税、住民税及び事業税	2	5,796,941	2	5,658,953
法人税等調整額		1,035,591		103,169
法人税等合計		4,761,350		5,762,122
当期純利益		12,660,003		12,762,244

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096		222,096	342,589	6,998,000	48,527,422	55,868,012	58,090,240
当期変動額									
剰余金の配当							4,107,643	4,107,643	4,107,643
当期純利益							12,660,003	12,660,003	12,660,003
合併による増加		3,350,000	41,160,616	44,510,616					44,510,616
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計		3,350,000	41,160,616	44,510,616			8,552,359	8,552,359	53,062,976

当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
-------	-----------	-----------	------------	------------	---------	-----------	------------	------------	-------------

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,300,727		2,300,727	60,390,967
当期変動額				
剰余金の配当				4,107,643
当期純利益				12,660,003
合併による増加	903,495	148,745	754,749	45,265,365
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,757,645	155,292	1,602,353	1,602,353
当期変動額合計	854,150	6,546	847,604	52,215,371
当期末残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339

## 第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

## （追加情報）

当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一

時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行しております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準委員会 平成14年1月31日 企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（企業会計基準委員会 平成19年2月7日 実務対応報告第2号）を適用しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ開始から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして判断しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	467,206千円	539,649千円
器具備品	897,207千円	1,029,950千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。



	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
預金	43,128,360千円	47,798,472千円
未収収益	52,753千円	46,963千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	2,612,168千円	1,993,055千円
その他未払金	2,296,632千円	2,071,256千円
未払費用	442,340千円	456,748千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	254千円	2,392千円
器具備品	1,051千円	7,791千円
ソフトウェア	-	3,356千円
計	1,305千円	13,540千円

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
支払手数料	15,120,269千円	13,862,465千円
受取利息	12,609千円	4,375千円
法人税、住民税及び事業税	3,980,844千円	4,204,969千円

## 3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
静岡県裾野市	遊休資産（不動産）	土地	35,031千円
東京都千代田区（本社）	遊休資産（美術品）	器具備品	7,041千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア （遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループ

ングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式（注）	124,098	87,483	-	211,581
合計	124,098	87,483	-	211,581

（注）普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,107,643千円
1株当たり配当額	33,100円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月30日

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

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,651,815千円	1,973,699千円
合計	3,329,932千円	2,651,815千円

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1)現金及び預金	80,707,781	80,707,781	-
(2)有価証券	2,728,127	2,728,127	-
(3)未収委託者報酬	11,275,577	11,275,577	-
(4)投資有価証券	24,054,542	24,054,542	-
資産計	118,766,029	118,766,029	-
(1)未払手数料	4,866,423	4,866,423	-
負債計	4,866,423	4,866,423	-

デリバティブ取引( )	(3,459)	(3,459)	-
-------------	---------	---------	---

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については( )で表示しております。

第32期(平成29年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

(2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	168,730	137,160
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	80,707,781	-	-	-
未収委託者報酬	11,275,577	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				

その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,728,127	9,234,321	9,756,778	5,050
合計	94,711,487	9,234,321	9,756,778	5,050

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	113,875	30,541	83,333
	債券	-	-	-
	その他	19,085,937	16,697,402	2,388,535
	小計	19,199,812	16,727,944	2,471,868
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,582,857	7,969,134	386,277
	小計	7,582,857	7,969,134	386,277
合計		26,782,669	24,697,079	2,085,590

第32期(平成29年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

## 3. 売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,649,814	424,605	52,623
合計	5,649,814	424,605	52,623

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	945,410	-	3,459
合計			945,410	-	3,459

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けておりません。

## 2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	263,476 千円	2,997,931 千円
勤務費用	135,457	199,166
利息費用	19,818	22,711
数理計算上の差異の発生額	113,714	40,934
退職給付の支払額	159,115	183,403
過去勤務費用の発生額	-	653,618
合併による増加	2,624,579	-
退職給付債務の期末残高	2,997,931	3,649,089

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	196,439 千円	2,678,827 千円
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の発生額	111,449	7,066
事業主からの拠出額	210,960	107,823
退職給付の支払額	139,379	142,532
合併による増加	2,486,329	-
年金資産の期末残高	2,678,827	2,698,738

## (3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,422,447 千円	3,471,120 千円
年金資産	2,678,827	2,698,738
	256,380	772,381
非積立型制度の退職給付債務	575,484	177,969
未積立退職給付債務	319,103	950,350
未認識数理計算上の差異	310,139	207,810
未認識過去勤務費用	-	615,490
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049
退職給付引当金	508,142	590,154
前払年金費用	499,178	463,105
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	8,964	127,049

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	135,457 千円	199,166 千円

利息費用	19,818	22,711
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の費用処理額	13,847	54,327
過去勤務費用の費用処理額	-	38,127
その他	65,395	28,533
確定給付制度に係る退職給付費用	198,592	295,314

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

#### (5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
債券	58.1 %	62.9 %
株式	35.5	33.3
その他	6.3	3.7
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.077～0.71%	0.061～0.90%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

### 3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円であります。

（税効果会計関係）

#### 1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	475,116 千円	455,165 千円
投資有価証券評価損	238,391	242,551
ゴルフ会員権評価損	295	295
未払事業税	185,473	124,367
賞与引当金	272,346	260,374
役員賞与引当金	-	11,509
役員退職慰労引当金	51,071	50,969
退職給付引当金	155,593	180,726
減価償却超過額	29,059	19,277
委託者報酬	204,395	217,902
長期差入保証金	6,344	14,803
時効後支払損引当金	78,725	77,490



連結納税適用による時価評価	309,675	236,450
その他	69,525	68,614
繰延税金資産 小計	2,076,013	1,960,499
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,076,013	1,960,499
繰延税金負債		
未収配当金	1,228	-
前払年金費用	152,848	141,802
連結納税適用による時価評価	1,516	1,447
その他有価証券評価差額金	639,013	659,638
繰延ヘッジ損益	2,889	-
その他	6	3
繰延税金負債 合計	797,502	802,893
繰延税金資産の純額	1,278,511	1,157,605

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
法定実効税率	33.06 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
(調整)		
評価性引当額の減少	6.34	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.59	
その他	0.02	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.33	

(セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### (関連当事者情報)

#### 1. 関連当事者との取引

##### (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	3,980,844 千円	その他未払金	2,296,632 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借	投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料	5,895,622 千円 223,695 千円	未払手数料	805,721 千円
主要株	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入	9,224,647 千円 35,000,000 千円	未払手数料 現金及び預金	1,806,446 千円 35,000,000 千円

主						コーラブル預金 に係る受取利息	9,263 千円	未収収益	2,372 千円
---	--	--	--	--	--	--------------------	-------------	------	-------------

## 第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税  役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969 千円	その他未払 金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言  役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

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

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,398,782 千円	未払手数料	898,096 千円

## 第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

## （注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
1株当たり純資産額	532,213.85円	466,028.30円
1株当たり当期純利益金額	66,691.34円	60,318.47円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株式の期中平均株式数 (株)	189,829	211,581

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)	
(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	46,287,102
有価証券	78,897
前払費用	496,625
未収入金	87,286
未収委託者報酬	9,160,402
未収収益	681,527
繰延税金資産	471,973
金銭の信託	30,000
その他	95,228
流動資産合計	57,389,043
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 780,721
器具備品	1 764,182
土地	1,356,000
有形固定資産合計	2,900,904
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,938,735
ソフトウェア仮勘定	1,212,251
無形固定資産合計	3,166,809
投資その他の資産	
投資有価証券	28,266,735
関係会社株式	320,136
長期差入保証金	640,950
前払年金費用	448,902
繰延税金資産	451,891
その他	45,230
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	30,150,247
固定資産合計	36,217,960
資産合計	93,607,004

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		196,841
未払金		
未払収益分配金		174,797
未払償還金		514,622
未払手数料		3,754,874
その他未払金		2,503,473
未払費用		4,229,858
未払消費税等	2	305,160
未払法人税等		792,896
賞与引当金		863,522
役員賞与引当金		66,649
その他		776,417
流動負債合計		14,179,114

## 固定負債

退職給付引当金		651,492
役員退職慰労引当金		163,557
時効後支払損引当金		252,546
固定負債合計		1,067,596

## 負債合計

15,246,710

## (純資産の部)

## 株主資本

資本金		2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712

## 利益剰余金

利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		22,251,535
利益剰余金合計		29,592,124

## 株主資本合計

76,324,968

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## 評価・換算差額等

その他有価証券		2,035,325
評価差額金		

評価・換算差額等合計		2,035,325
------------	--	-----------

## 純資産合計

78,360,294

## 負債純資産合計

93,607,004

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自平成29年4月1日

至平成29年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		38,184,632
投資顧問料		1,346,730
その他営業収益		26,405
営業収益合計		39,557,767
営業費用		
支払手数料		15,720,488
広告宣伝費		318,084
公告費		500
調査費		
調査費		861,247
委託調査費		6,711,776
事務委託費		436,601
営業雑経費		
通信費		85,593
印刷費		251,837
協会費		24,207
諸会費		7,746
事務機器関連費		821,139
その他営業雑経費		13,599
営業費用合計		25,252,824
一般管理費		
給料		
役員報酬		178,839
給料・手当		2,821,754
賞与引当金繰入		863,522
役員賞与引当金繰入		66,649
福利厚生費		619,913
交際費		6,009
旅費交通費		93,328
租税公課		222,435
不動産賃借料		341,770
退職給付費用		210,625
役員退職慰労引当金繰入		23,884
固定資産減価償却費	1	512,328
諸経費		199,624
一般管理費合計		6,160,685
営業利益		8,144,257

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自平成29年4月1日

至平成29年9月30日)

営業外収益		
受取配当金		134,154
受取利息		277
投資有価証券償還益		29,656

収益分配金等時効完成分	34,222
その他	9,043
営業外収益合計	207,354
営業外費用	
投資有価証券償還損	20,261
時効後支払損引当金繰入	26,116
その他	5,612
営業外費用合計	51,990
経常利益	8,299,622
特別利益	
投資有価証券売却益	196,888
ゴルフ会員権売却益	2,495
特別利益合計	199,383
特別損失	
投資有価証券売却損	60,319
固定資産除却損	0
特別損失合計	60,319
税引前中間純利益	8,438,686
法人税、住民税及び事業税	2,631,045
法人税等調整額	4,911
法人税等合計	2,626,133
中間純利益	5,812,552

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
中間純利益							5,812,552	5,812,552	5,812,552
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							20,783,178	20,783,178	20,783,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	22,251,535	29,592,124	76,324,968

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当中間期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
中間純利益			5,812,552



株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	540,738	540,738	540,738
当中間期変動額合計	540,738	540,738	20,242,440
当中間期末残高	2,035,325	2,035,325	78,360,294

## [重要な会計方針]

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

#### (5) 役員退職慰労引当金

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

#### (6) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

**[注記事項]**

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
建物	571,713千円
器具備品	1,115,446千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
有形固定資産	114,767千円
無形固定資産	397,560千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

## 第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 借主側

## オペレーティング・リース取引

## オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	678,116千円
1年超	1,634,641千円
合 計	2,312,757千円

## (金融商品関係)

## 第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	46,287,102	46,287,102	-
(2) 有価証券	78,897	78,897	-
(3) 未収委託者報酬	9,160,402	9,160,402	-
(4) 投資有価証券	28,129,575	28,129,575	-
資産計	83,655,978	83,655,978	-
(1) 未払手数料	3,754,874	3,754,874	-
負債計	3,754,874	3,754,874	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## 負 債

## (1)未払手数料

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

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## (有価証券関係)

## 第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	21,493,708	18,316,441	3,177,266
	小計	21,493,708	18,316,441	3,177,266
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,714,765	6,958,415	243,650
	小計	6,714,765	6,958,415	243,650
合計		28,208,473	25,274,857	2,933,616

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 （平成29年9月30日現在）
1株当たり純資産額	370,356.00円
（算定上の基礎）	

純資産の部の合計額（千円）	78,360,294
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	78,360,294
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	27,471.99円
中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社  
 （再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）  
 資本金の額：324,279百万円（平成29年9月末現在）  
 事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名称	資本金の額 （平成29年9月末現在）	事業の内容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社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	12,500 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500 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。
株式会社三重銀行	15,295 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社百十四銀行	37,322 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	48,323 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	2,500 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。
GMOクリック証券株式会社	4,346 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。
高木証券株式会社	11,069 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。
株式会社証券ジャパン	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種 金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種 金融商品取引業を営んでいます。
浜銀 T T 証券株式会社	3,307 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。
ひろぎん証券株式会社	5,000 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。
フィデリティ証券株式会社	8,157 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	3,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種 金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945 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30年4月2日現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

## 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

- ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
- ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
- ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。(請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。)
- ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

- ( 3 ) 投資信託説明書(請求目論見書)に信託約款を掲載します。
- ( 4 ) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- ( 5 ) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- ( 6 ) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- ( 7 ) 目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。



# 独立監査人の監査報告書

平成29年6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年2月28日

三菱UFJ国際投信株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているeMAXIS全世界株式インデックスの平成29年1月27日から平成30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30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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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