

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年9月7日

【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 後藤 俊夫

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【事務連絡者氏名】 井上 靖

連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資信託 M A X I S 海外株式（M S C I コクサイ）上場投信
受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資信託 上限10兆円
受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 株式会社東京証券取引所
（東京都中央区日本橋兜町2番1号）

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で有価証券報告書を提出致しましたので、平成24年3月7日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、提出するものです。

【訂正の内容】

<訂正前> および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

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】

<訂正前>

(略)

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。

(略)

<訂正後>

(略)

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

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

(略)

(3)【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<訂正前>

・資本金

2,000百万円（平成23年12月末現在）

(略)

・大株主の状況（平成23年12月末現在）

(略)

<訂正後>

・資本金

2,000百万円（平成24年6月末現在）

(略)

・大株主の状況（平成24年6月末現在）

(略)

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

ファンドの運用体制等は平成24年3月8日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

(略)

ファンドの運用体制等は平成24年9月8日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

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

信託財産の純資産総額 × 年0.1575% (税抜 年0.15%) 以内の率

(平成24年3月8日現在：年0.1575% (税抜 年0.15%))

信託報酬の配分は以下の通りです。(平成24年3月8日現在)

(略)

<訂正後>

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

信託財産の純資産総額 × 年0.1575% (税抜 年0.15%) 以内の率

(平成24年9月8日現在：年0.1575% (税抜 年0.15%))

信託報酬の配分は以下の通りです。(平成24年9月8日現在)

(略)

(4) 【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

受益権の上場に係る費用(平成24年3月8日現在：追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.007875%(税抜0.0075%)、年間上場料(毎年末の純資産総額に対して最大0.007875%(税抜0.0075%))は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(平成24年3月8日現在：信託財産の純資産総額に年0.05%(上限)を乗じて得た額)は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

(略)

<訂正後>

(略)

受益権の上場に係る費用(平成24年9月8日現在：追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.007875%(税抜0.0075%)、年間上場料(毎年末の純資産総額に対して最大0.007875%(税抜0.0075%))は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(平成24年9月8日現在：信託財産の純資産総額に年0.05%(上限)を乗じて得た額)は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

(略)

(5) 【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は平成23年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

<訂正後>

(略)

上記は平成24年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	1,860,379,210	99.77
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,211,240	0.23
純資産総額		1,864,590,450	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24年6月29日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	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	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)	投資信託 受益証券		1,996,667,422	0.9290 0.9317	1,854,904,035 1,860,295,037		99.77
日本	マネーボールファンド(FOFs 用)(適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券		84,039	1.0016 1.0016	84,173 84,173		0.00

(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24年6月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.77
合計	99.77

(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24年6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口当たりの純資産価額)	東京証券取引所 取引価格
第1計算期間末日 (平成23年6月8日)	1,662,613,235 (分配付) 1,642,613,235 (分配落)	1,039.13 (分配付) 1,026.63 (分配落)	1,056
第2計算期間末日 (平成23年12月8日)	1,920,828,922 (分配付) 1,904,868,922 (分配落)	914.68 (分配付) 907.08 (分配落)	917
第3計算期間末日 (平成24年6月8日)	1,882,024,944 (分配付) 1,859,424,944 (分配落)	941.01 (分配付) 929.71 (分配落)	928
平成23年6月末日	1,762,024,687	1,036.49	1,055
7月末日	1,787,774,021	993.21	999
8月末日	1,789,734,610	894.87	903
9月末日	1,680,279,967	840.14	843
10月末日	2,001,979,192	953.32	956
11月末日	1,834,194,825	873.43	887
12月末日	1,882,194,325	896.28	895
平成24年1月末日	1,944,760,977	926.08	930
2月末日	2,163,990,117	1,030.47	1,030
3月末日	2,214,127,013	1,054.35	1,057

4月末日	2,174,382,789	1,035.42	1,026
5月末日	1,847,346,853	923.67	928
6月末日	1,864,590,450	932.30	955

【分配の推移】

	1口当たりの分配金
第1計算期間	12円50銭
第2計算期間	7円60銭
第3計算期間	11円30銭

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.91
第2計算期間	10.90
第3計算期間	3.74

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ちの額、以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	2,100,000	500,000	1,600,000
第2計算期間	500,000		2,100,000
第3計算期間	300,000	400,000	2,000,000

<参考>

「MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)」

(1)投資状況

平成24年6月29日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,860,163,346	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		88,262	0.00
純資産総額		1,860,251,608	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24年6月29日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	外国株式インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券		1,956,830,787	0.9483 0.9506	1,855,662,636 1,860,163,346		100.00

(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24年6月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(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。

< 参考 >

「外国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成24年6月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	80,135,247,128	56.91
	イギリス	14,261,479,357	10.13
	カナダ	7,328,325,860	5.20
	スイス	5,217,996,174	3.71
	フランス	5,006,943,097	3.56
	オーストラリア	4,958,340,738	3.52
	ドイツ	4,745,469,613	3.37
	スウェーデン	1,863,022,665	1.32
	香港	1,795,774,664	1.28
	スペイン	1,587,119,809	1.13
	オランダ	1,576,164,614	1.12
	イタリア	1,223,248,606	0.87
	シンガポール	1,111,164,802	0.79
	デンマーク	693,339,566	0.49
	ベルギー	674,293,959	0.48
	ノルウェー	551,625,855	0.39
	フィンランド	429,270,930	0.30
	イスラエル	362,102,631	0.26
	ルクセンブルグ	184,187,637	0.13
	アイルランド	180,764,526	0.13
	オーストリア	165,006,137	0.12
	ポルトガル	97,085,239	0.07
	ニュージーランド	69,296,635	0.05
ギリシャ	22,694,302	0.02	
投資証券	アメリカ	2,217,407,391	1.57
	オーストラリア	406,696,200	0.29
	イギリス	165,825,491	0.12
	フランス	164,784,904	0.12
	香港	63,319,543	0.04
	シンガポール	49,085,772	0.03
	カナダ	35,065,541	0.02
	オランダ	17,185,260	0.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,451,876,433	2.45
純資産総額		140,811,211,079	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24年6月29日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	2,815,272,040	2.00

(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24年6月29日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	77,500	44,965.59 45,131.35	3,484,833,814 3,497,680,051		2.48
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	391,900	6,584.31 6,590.66	2,580,393,518 2,582,880,045		1.83
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	627,200	2,464.95 2,372.16	1,546,019,650 1,487,820,069		1.06
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	878,600	1,507.68 1,602.06	1,324,650,371 1,407,571,673		1.00
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	91,400	15,935.75 15,179.93	1,456,528,308 1,387,445,967		0.99
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	493,200	2,664.81 2,806.78	1,314,287,251 1,384,304,339		0.98
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	164,400	8,136.41 8,205.41	1,337,626,280 1,348,969,831		0.96
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	274,521	4,531.41 4,599.64	1,243,968,632 1,262,700,380		0.90
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	227,673	5,091.70 5,309.01	1,159,243,069 1,208,718,552		0.86
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	626,100	1,794.78 1,786.85	1,123,715,076 1,118,749,477		0.79
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	228,600	5,046.49 4,781.59	1,153,628,825 1,093,073,737		0.78
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	416,200	2,635.47 2,575.98	1,096,883,155 1,072,126,538		0.76
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	169,200	6,133.83 6,072.76	1,037,844,949 1,027,512,125		0.73
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,492,584	679.62 687.25	1,014,393,520 1,025,787,069		0.73
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	143,200	6,824.62 6,790.52	977,286,371 972,402,779		0.69
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	21,500	47,928.61 44,755.42	1,030,465,312 962,241,661		0.68
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	4,144,673	210.53 222.60	872,599,558 922,608,188		0.66
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	315,900	2,919.40 2,845.64	922,238,807 898,938,560		0.64
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	414,300	2,185.78 2,048.57	905,570,145 848,725,575		0.60
アメリカ	WAL-MART STORES INC	株式	食品・生活必需品 小売り	156,500	4,728.46 5,416.87	740,004,334 847,740,624		0.60
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	191,234	4,085.83 4,336.57	781,350,952 829,301,061		0.59
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	236,100	3,265.19 3,487.26	770,911,996 823,342,251		0.58
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	252,600	3,015.36 3,226.33	761,681,502 814,971,160		0.58
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,578,353	509.71 507.74	804,513,040 801,403,811		0.57
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	305,787	2,541.19 2,613.83	777,064,945 799,277,558		0.57
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	58,512	12,897.10 13,392.00	754,635,396 783,593,230		0.56
イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	419,148	1,753.22 1,780.31	734,862,345 746,215,555		0.53
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	333,800	2,141.37 2,234.16	714,789,306 745,763,509		0.53
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	130,200	5,301.08 5,519.97	690,200,668 718,700,875		0.51
オーストラリア	BHP BILLITON LTD	株式	素材	269,163	2,725.62 2,447.64	733,636,863 658,815,336		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24年6月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	11.14
	素材	6.53
	資本財	7.08
	商業・専門サービス	0.81
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	1.15
	耐久消費財・アパレル	1.21
	消費者サービス	1.72
	メディア	2.66
	小売	2.97
	食品・生活必需品小売り	2.34
	食品・飲料・タバコ	7.18
	家庭用品・パーソナル用品	1.77
	ヘルスケア機器・サービス	2.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.08
	銀行	7.08
	各種金融	4.28
	保険	3.85
	不動産	0.67
	ソフトウェア・サービス	6.05
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.74
	電気通信サービス	4.11
	公益事業	3.80
半導体・半導体製造装置	1.57	
小計	95.33	
投資証券		2.22
合計		97.55

(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24年6月29日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量 (枚)	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引								
S&P 500 (2012年9月限)	シカゴ商業取引所	買建	66	アメリカ ドル	21,802,313.00	21,819,600.00	1,730,512,476	1.23
FTSE100 (2012年9月限)	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	40	イギリス ポンド	2,194,880.00	2,178,200.00	268,179,984	0.19
SP/TSE60 (2012年9月限)	モントリオール取引所	買建	14	カナダドル	1,852,780.00	1,826,440.00	140,215,798	0.10
SPI 200 (2012年9月限)	シドニー先物取引所	買建	25	オーストラ リアドル	2,528,262.50	2,512,500.00	200,120,625	0.14
EURO ST (2012年9月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	185	ユーロ	4,012,743.75	3,977,500.00	392,738,350	0.28
SWISS IX (2012年9月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	17	スイス フラン	1,019,985.00	1,015,750.00	83,504,807	0.06

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

< 参考 >

「マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)」

(1) 投資状況

平成24年6月29日現在
(単位:円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	113,932	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		286	0.25
純資産総額		114,218	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24年6月29日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数 (口)	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	マネー・マーケット・マザー ファンド	親投資信託 受益証券		112,083	1.0164 1.0165	113,921 113,932		99.75

(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24年6月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

(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。

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」

(1) 投資状況

平成24年6月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	3,049,576,450	85.91
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		500,285,680	14.09
純資産総額		3,549,862,130	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24年6月29日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	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	第283回国庫短期証券	国債証券		700,000	99.97 99.9849	699,826,200 699,894,300	2012/08/27	19.72
日本	第284回国庫短期証券	国債証券		400,000	99.97 99.9830	399,902,400 399,932,000	2012/09/03	11.27
日本	第286回国庫短期証券	国債証券		400,000	99.97 99.9810	399,901,200 399,924,000	2012/09/10	11.27
日本	第277回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9906	299,938,200 299,971,800	2012/08/06	8.45
日本	第279回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9887	299,932,500 299,966,100	2012/08/13	8.45
日本	第288回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9789	299,926,500 299,936,700	2012/09/18	8.45
日本	第269回国庫短期証券	国債証券		200,000	99.98 99.9983	199,978,000 199,996,600	2012/07/02	5.63
日本	第273回国庫短期証券	国債証券		200,000	99.98 99.9961	199,960,000 199,992,200	2012/07/17	5.63
日本	第281回国庫短期証券	国債証券		200,000	99.97 99.9868	199,951,200 199,973,600	2012/08/20	5.63
日本	第222回国庫短期証券	国債証券		50,000	99.96 99.9783	49,983,550 49,989,150	2012/09/20	1.41

(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24年6月29日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	85.91
合計	85.91

(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。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2012年6月29日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は100,000(当初元本100口当たり)を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算

2 分配の推移

2012年6月	1,130円
2011年12月	760円
2011年6月	1,250円
設定来累計	3,140円

・分配金は100口当たり、税引前

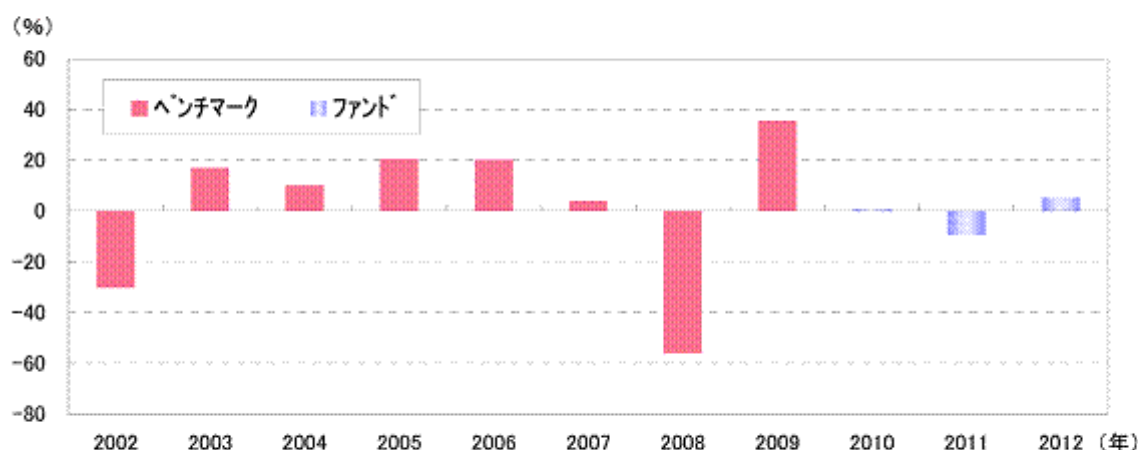
3 主要な資産の状況(2012年6月29日現在)

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	59.7%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.5%
ユーロ	11.7%	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.8%
イギリスポンド	10.4%	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.1%
カナダドル	5.3%	4 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	1.0%
オーストラリアドル	3.9%	5 INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.0%
スイスフラン	3.8%	6 AT&T INC	電気通信サービス	アメリカ	1.0%
香港ドル	1.3%	7 CHEVRON CORP	エネルギー	アメリカ	1.0%
スウェーデンクローネ	1.3%	8 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.9%
その他	2.6%	9 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.9%
合計	100.0%	10 PFIZER INC	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%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	2.0%

・各比率は実質的な投資を行う投資信託の純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2010年は設定日から年末までの、2012年は6月29日までの収益率を表示
- ・2009年以前は対象指数を円換算した値(ベンチマーク)の年間収益率(委託会社の計算日基準)を表示

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

第2【管理及び運営】

2【換金(解約)手続等】

<訂正前>

(略)

その他	(略) 当該マザーファンドの純資産総額(平成23年12月30日現在:約1,408億円)の10%程度を大口の解約請求の制限の目安とします。 (略)
-----	--

(略)

<訂正後>

(略)

その他	(略) 当該マザーファンドの純資産総額(平成24年6月29日現在:約1,408億円)の10%程度を大口の解約請求の制限の目安とします。 (略)
-----	---

(略)

3【資産管理等の概要】

(5)【その他】

<訂正前>

(略)

公告	委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。
----	---------------------------------

<訂正後>

(略)

公告	委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。 ただし、平成25年6月21日以降は、以下の通り変更される予定です。 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。 http://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。
----	--

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- 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 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成23年12月9日から平成24年6月8日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第 2 期 [平成23年12月8日現在]	第 3 期 [平成24年6月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,461,233	5,909,169
投資信託受益証券	1,901,054,160	1,854,988,208
未収入金	16,130,071	23,266,236
未収利息	12	13
流動資産合計	1,922,645,476	1,884,163,626
資産合計	1,922,645,476	1,884,163,626
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,960,000	22,600,000
未払受託者報酬	368,984	426,457
未払委託者報酬	1,014,652	1,172,701
その他未払費用	432,918	539,524
流動負債合計	17,776,554	24,738,682
負債合計	17,776,554	24,738,682
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,100,000,000	1 2,000,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 195,131,078	2 140,575,056
(分配準備積立金)	200,899	68,154
元本等合計	1,904,868,922	1,859,424,944
純資産合計	1,904,868,922	1,859,424,944
負債純資産合計	1,922,645,476	1,884,163,626

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 2 期		第 3 期	
	自 平成23年 6月 9日 至 平成23年12月 8日		自 平成23年12月 9日 至 平成24年 6月 8日	
営業収益				
受取配当金	18,013,906		24,745,851	
受取利息	2,775		2,749	
有価証券売買等損益	203,989,516		43,455,767	
営業収益合計	185,972,835		68,204,367	
営業費用				
受託者報酬	368,984		426,457	
委託者報酬	1,014,652		1,172,701	
その他費用	¹ 521,842		¹ 682,187	
営業費用合計	1,905,478		2,281,345	
営業利益	187,878,313		65,923,022	
経常利益	187,878,313		65,923,022	
当期純利益	187,878,313		65,923,022	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	-		-	
期首剰余金又は期首欠損金 ()	42,613,235		195,131,078	
剰余金増加額又は欠損金減少額	-		32,170,000	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		32,170,000	
剰余金減少額又は欠損金増加額	33,906,000		20,937,000	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,906,000		20,937,000	
分配金	² 15,960,000		² 22,600,000	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	195,131,078		140,575,056	

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 2 期 [平成23年12月8日現在]	第 3 期 [平成24年6月8日現在]
1 期首元本額	1,600,000,000円	2,100,000,000円
期中追加設定元本額	500,000,000円	300,000,000円
期中一部解約元本額		400,000,000円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	195,131,078円	140,575,056円
3 受益権の総数	2,100,000口	2,000,000口
4 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	907.08円 (90,708円)	929.71円 (92,971円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 (自 平成23年6月9日 至 平成23年12月8日)

- 1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	18,016,681円
分配準備積立金額	B	49,696円
配当等収益合計額	C=A+B	18,066,377円
経費	D	1,905,478円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	16,160,899円
収益分配金金額	F	15,960,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	200,899円
当ファンドの期末残存口数	H	2,100,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	760円

第 3 期 (自 平成23年12月9日 至 平成24年6月8日)

- 1 その他費用
上場費用および商標使用料等を含んでおります。

2 分配金の計算過程

当期配当等収益額	A	24,748,600円
分配準備積立金額	B	200,899円
配当等収益合計額	C=A+B	24,949,499円
経費	D	2,281,345円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	22,668,154円
収益分配金金額	F	22,600,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	68,154円
当ファンドの期末残存口数	H	2,000,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,130円

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第2期 (自平成23年6月9日 至平成23年12月8日)	第3期 (自平成23年12月9日 至平成24年6月8日)
	1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する投資信託受益証券の詳細は「(4)附属明細表」に記載しております。投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 (1) 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、株価の変動による価格変動リスクを有しております。 (2) 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、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	また、投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [平成23年12月8日現在]	第3期 [平成24年6月8日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 [平成23年12月8日現在]	第3期 [平成24年6月8日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	200,873,949	38,150,367
合計	200,873,949	38,150,367

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数(口)	評価額	備考
投資信託受益証券	M S C Iコクサイインデックスファンド(F O F s用)(適格機関投資家限定)	1,996,667,422	1,854,904,035	
	マネーブルファンド(F O F s用)(適格機関投資家限定)	84,039	84,173	
	投資信託受益証券 小計	1,996,751,461	1,854,988,208	
	合計	1,996,751,461	1,854,988,208	

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。

[次へ](#)

<参考>

当ファンドは「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）」および「マネーパブルファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、これら投資信託の受益証券です。

なお、これら投資信託の状況は次の通りです。

「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）」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

	第2期	第3期
	[平成23年11月25日現在]	[平成24年5月25日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,057,013	1,149,475
親投資信託受益証券	1,728,776,199	1,853,846,584
未収入金	17,971,885	120,546,541
未収利息	2	2
流動資産合計	1,747,805,099	1,975,542,602
資産合計	1,747,805,099	1,975,542,602
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	18,013,909	24,745,849
未払解約金	13,645	94,572,958
未払受託者報酬	266,767	306,932
未払委託者報酬	653,071	751,405
流動負債合計	18,947,392	120,377,144
負債合計	18,947,392	120,377,144
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,094,640,590	1,995,633,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 365,782,883	140,467,599
(分配準備積立金)	88,271,566	73,996,736
元本等合計	1,728,857,707	1,855,165,458
純資産合計	1,728,857,707	1,855,165,458
負債純資産合計	1,747,805,099	1,975,542,602

(2) 損益及び剰余金計算書

	第2期	第3期
	自平成23年5月26日 至平成23年11月25日	自平成23年11月26日 至平成24年5月25日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	139	177
有価証券売買等損益	401,819,243	241,114,218
営業収益合計	401,819,104	241,114,395
営業費用		
受託者報酬	266,767	306,932
委託者報酬	653,071	751,405
営業費用合計	919,838	1,058,337
営業利益	402,738,942	240,056,058
経常利益	402,738,942	240,056,058
当期純利益	402,738,942	240,056,058
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,083,012	37,881,195
期首剰余金又は期首欠損金()	88,407,128	365,782,883
剰余金増加額又は欠損金減少額		72,013,284
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		72,013,284
剰余金減少額又は欠損金増加額	35,520,172	24,127,014
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,560,580	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,959,592	24,127,014
分配金	1 18,013,909	24,745,849
期末剰余金又は期末欠損金()	365,782,883	140,467,599

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第 2 期 [平成23年11月25日現在]	第 3 期 [平成24年5月25日現在]
1 期首元本額	1,594,465,881円	2,094,640,590円
期中追加設定元本額	532,308,316円	322,342,631円
期中一部解約元本額	32,133,607円	421,350,164円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	365,782,883円	140,467,599円
3 受益権の総数	2,094,640,590口	1,995,633,057口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8254円 (8,254円)	0.9296円 (9,296円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 (自 平成23年5月26日 至 平成23年11月25日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	19,547,636円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	30,273,361円
分配準備積立金額	D	86,737,839円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	136,558,836円
当ファンドの期末残存口数	F	2,094,640,590口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	651円
1万口当たり分配金額	H	86円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	18,013,909円

第 3 期 (自 平成23年11月26日 至 平成24年5月25日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	27,323,000円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	41,899,677円
分配準備積立金額	D	71,419,585円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	140,642,262円
当ファンドの期末残存口数	F	1,995,633,057口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	704円
1万口当たり分配金額	H	124円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	24,745,849円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第 2 期 (自平成23年 5月26日 至平成23年11月25日)	第 3 期 (自平成23年11月26日 至平成24年 5月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 (1) 親投資信託受益証券は、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、株価の変動による価格変動リスクを有しております。 (2) 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、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	また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 2 期 [平成23年11月25日現在]	第 3 期 [平成24年5月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 2 期 [平成23年11月25日現在]	第 3 期 [平成24年5月25日現在]
	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	392,127,904	200,553,204
合計	392,127,904	200,553,204

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数（口）	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	1,954,709,600	1,853,846,584	
	親投資信託受益証券 小計	1,954,709,600	1,853,846,584	
合計		1,954,709,600	1,853,846,584	

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドは「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。
なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「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23年11月25日現在]		[平成24年5月25日現在]	
		金額（円）		金額（円）
資産の部				
流動資産				
預金		1,994,349,497		4,341,879,222
コール・ローン		789,218,102		269,731,487
株式		121,530,885,900		131,065,796,101
投資証券		2,230,662,737		2,805,968,411
派生商品評価勘定		1,567,673		20,093,498
未収入金		1,641,170		6,089
未収配当金		319,423,781		359,162,191
未収利息		1,741		617
差入委託証拠金		1,042,276,409		1,258,308,305
流動資産合計		127,910,027,010		140,120,945,921
資産合計		127,910,027,010		140,120,945,921
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		214,910,044		61,347,071
未払金				2,135,585,869
未払解約金		46,695,328		139,700,185
流動負債合計		261,605,372		2,336,633,125
負債合計		261,605,372		2,336,633,125
純資産の部				
元本等				
元本	1	153,686,812,742		145,277,856,586
剰余金				
剰余金又は欠損金（ ）	2	26,038,391,104		7,493,543,790
元本等合計		127,648,421,638		137,784,312,796
純資産合計		127,648,421,638		137,784,312,796
負債純資産合計		127,910,027,010		140,120,945,921

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場(外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	[平成23年11月25日現在]	[平成24年5月25日現在]
1 期首	平成23年5月26日	平成23年11月26日
期首元本額	133,607,472,877円	153,686,812,742円
期首からの追加設定元本額	39,118,799,122円	11,207,910,449円
期首からの一部解約元本額	19,039,459,257円	19,616,866,605円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	428,559,781円	334,517,697円
eMAXIS 先進国株式インデックス	6,558,455,526円	7,129,121,559円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	2,737,252円	29,709,228円
eMAXIS バランス（波乗り型）	3,624,953円	6,886,924円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,272,273,989円	1,387,401,503円
eMAXIS 全世界株式インデックス	862,790,552円	934,411,972円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	52,944,197,531円	49,768,705,232円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	40,615,563,434円	37,375,848,460円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,169,263,633円	1,074,001,693円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	7,619,864,779円	7,065,669,670円
MUAM 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,636,322,497円	7,283,077,435円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	957,032,559円	887,275,390円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	638,963,027円	602,897,304円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,575,625,885円	5,156,302,223円
MSCIコクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,081,358,295円	1,954,709,600円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	24,590,175円	17,529,648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）	6,102,904,187円	6,022,197,705円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,653,435,392円	2,509,162,570円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	75,611,648円	66,442,682円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	190,613,321円	168,505,044円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	268,662,019円	247,337,560円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	345,668,651円	284,557,958円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	3,000,940,796円	2,778,901,317円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	345,397,805円	321,741,206円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,608,024,158円	2,402,903,061円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	659,479,960円	608,637,397円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	2,995,316,311円	2,791,372,793円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	2,774,851,499円	2,875,372,977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）	365,241,887円	356,270,070円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	1,269,473,413円	1,258,004,427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）	966,140,105円	925,526,758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）	673,827,722円	652,857,523円
（合計）	153,686,812,742円	145,277,856,586円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	26,038,391,104円	7,493,543,790円
3 受益権の総数	153,686,812,742口	145,277,856,586口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8306円 （8,306円）	0.9484円 （9,484円）

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成23年5月26日 至平成23年11月25日）	（自平成23年11月26日 至平成24年5月25日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	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23年11月25日現在]	[平成24年5月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成23年11月25日現在]	[平成24年5月25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	21,035,275,935	4,018,346,395
投資証券	322,727,312	88,609,587
合計	21,358,003,247	4,106,955,982

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	[平成23年11月25日現在]		
		契約額等(円) うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,006,350,902	3,791,746,731	214,604,171
	合計	4,006,350,902	3,791,746,731	214,604,171

区分	種類	[平成24年5月25日現在]		
		契約額等(円) うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,787,397,611	3,746,140,758	41,256,853
	合計	3,787,397,611	3,746,140,758	41,256,853

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

区分	種類	[平成23年11月25日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	428,114,350		429,292,500	1,178,150
	カナダドル	44,172,600		44,250,000	77,400
	オーストラリアドル	11,251,350		11,250,000	1,350
	イギリスポンド	77,825,150		77,753,000	72,150
	スイスフラン	29,368,850		29,389,500	20,650
	ユーロ	108,122,400		108,181,500	59,100
	合計	698,854,700		700,116,500	1,261,800

区分	種類	[平成24年5月25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	31,875,280		31,872,000	3,280
	合計	31,875,280		31,872,000	3,280

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル					
	3M CO	54,300	84.980000	4,614,414.00	
	ABBOTT LABORATORIES	126,800	62.420000	7,914,856.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,900	35.290000	243,501.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	51,800	57.990000	3,003,882.00	
	ACE LTD	27,200	73.240000	1,992,128.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	42,500	12.100000	514,250.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,600	31.540000	1,248,984.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	5,600	72.930000	408,408.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	46,700	6.020000	281,134.00	
	AES CORP	52,600	12.380000	651,188.00	
	AETNA INC	29,800	41.130000	1,225,674.00	
	AFLAC INC	38,400	39.680000	1,523,712.00	
	AGCO CORP	7,900	40.880000	322,952.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,400	41.020000	1,164,968.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,700	80.450000	1,343,515.00	
	AIRGAS INC	6,300	88.730000	558,999.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	14,700	29.400000	432,180.00	
	ALCOA INC	88,500	8.630000	763,755.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	15,200	93.100000	1,415,120.00	
	ALLEGHANY CORP	1,000	333.000000	333,000.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	9,500	34.780000	330,410.00	
	ALLERGAN INC	24,400	90.490000	2,207,956.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,300	126.080000	542,144.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	9,100	43.930000	399,763.00	
	ALLSTATE CORP	41,800	33.430000	1,397,374.00	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	20,700	11.170000	231,219.00	
	ALTERA CORP	27,200	33.760000	918,272.00	
	ALTRIA GROUP INC	167,800	32.260000	5,413,228.00	
	AMAZON.COM INC	29,700	215.240000	6,392,628.00	
	AMEREN CORPORATION	19,000	32.040000	608,760.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,800	37.980000	1,511,604.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	86,200	56.340000	4,856,508.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	48,600	29.410000	1,429,326.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,000	34.240000	547,840.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,400	47.900000	881,360.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	22,100	36.460000	805,766.00	
	AMETEK INC	13,300	49.660000	660,478.00	
	AMGEN INC	64,500	69.100000	4,456,950.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	13,100	53.260000	697,706.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	40,600	63.650000	2,584,190.00	
	ANALOG DEVICES INC	25,000	36.000000	900,000.00	
	AON PLC	24,400	47.350000	1,155,340.00	
	APACHE CORP	31,300	82.090000	2,569,417.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	8,900	32.510000	289,339.00	
	APPLE INC	75,800	565.320000	42,851,256.00	
	APPLIED MATERIALS INC	109,400	10.380000	1,135,572.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,900	38.620000	420,958.00	
	ARCH COAL INC	16,900	7.300000	123,370.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,700	32.100000	1,755,870.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	9,800	34.320000	336,336.00	
	ASSURANT INC	6,600	33.860000	223,476.00	
	AT&T INC	484,100	33.640000	16,285,124.00	
	AUTODESK INC	19,300	31.860000	614,898.00	
	AUTOLIV INC	7,400	57.410000	424,834.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	39,600	53.150000	2,104,740.00	
	AUTOZONE INC	2,000	369.400000	738,800.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	17,500	32.510000	568,925.00	
	AVERY DENNISON CORP	8,000	29.330000	234,640.00	
	AVNET INC	12,300	30.660000	377,118.00	
	AVON PRODUCTS INC	35,800	16.720000	598,576.00	

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,700	33.620000	326,114.00
BAKER HUGHES INC	35,700	41.250000	1,472,625.00
BALL CORP	11,900	39.860000	474,334.00
BANK OF AMERICA CORP	823,600	7.140000	5,880,504.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	98,300	20.730000	2,037,759.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	46,100	52.250000	2,408,725.00
BB&T CORP	56,300	30.260000	1,703,638.00
BEAM INC	11,600	57.540000	667,464.00
BECTON DICKINSON AND CO	17,800	74.720000	1,330,016.00
BED BATH & BEYOND INC	19,900	72.470000	1,442,153.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	73,600	79.800000	5,873,280.00
BEST BUY CO INC	24,800	18.820000	466,736.00
BIOGEN IDEC INC	18,800	131.650000	2,475,020.00
BLACKROCK INC	10,600	170.440000	1,806,664.00
BMC SOFTWARE INC	13,500	42.970000	580,095.00
BOEING CO/THE	57,300	71.390000	4,090,647.00
BORGWARNER INC	9,300	75.780000	704,754.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	122,100	5.910000	721,611.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	138,700	32.990000	4,575,713.00
BROADCOM CORP-CL A	40,100	31.150000	1,249,115.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,900	87.370000	602,853.00
BUNGE LTD	11,700	60.490000	707,733.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,000	59.820000	837,480.00
CA INC	30,600	25.160000	769,896.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	18,300	11.660000	213,378.00
CABOT OIL & GAS CORP	17,200	35.070000	603,204.00
CALPINE CORP	27,900	16.920000	472,068.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	19,900	47.730000	949,827.00
CAMPBELL SOUP CO	14,300	32.560000	465,608.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,900	51.720000	2,115,348.00
CARDINAL HEALTH INC	28,900	41.470000	1,198,483.00
CAREFUSION CORP	18,900	24.760000	467,964.00
CARMAX INC	18,400	29.020000	533,968.00
CARNIVAL CORP	37,000	32.160000	1,189,920.00
CATERPILLAR INC	52,500	91.420000	4,799,550.00
CBRE GROUP INC - A	22,500	16.390000	368,775.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	50,600	31.630000	1,600,478.00
CELANESE CORP-SERIES A	13,200	40.810000	538,692.00
CELGENE CORP	36,100	69.910000	2,523,751.00
CENTERPOINT ENERGY INC	35,500	20.030000	711,065.00
CENTURYLINK INC	51,000	38.700000	1,973,700.00
CERNER CORP	12,200	79.370000	968,314.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,200	168.080000	874,016.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	53,800	15.580000	838,204.00
CHEVRON CORP	162,400	100.060000	16,249,744.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,600	401.610000	1,044,186.00
CHUBB CORP	22,600	72.100000	1,629,460.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,500	53.750000	618,125.00
CIGNA CORP	23,400	44.090000	1,031,706.00
CIMAREX ENERGY CO	7,000	54.210000	379,470.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,700	35.640000	416,988.00
CINTAS CORP	9,100	37.720000	343,252.00
CISCO SYSTEMS INC	436,700	16.390000	7,157,513.00
CIT GROUP INC	16,100	35.160000	566,076.00
CITIGROUP INC	237,700	26.660000	6,337,082.00
CITRIX SYSTEMS INC	15,400	75.690000	1,165,626.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	12,000	49.750000	597,000.00
CLOROX COMPANY	10,900	69.190000	754,171.00
CME GROUP INC	5,300	256.160000	1,357,648.00
COACH INC	24,200	69.270000	1,676,334.00
COCA-COLA CO/THE	166,600	75.560000	12,588,296.00
COCA-COLA ENTERPRISES	27,300	27.480000	750,204.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,300	60.110000	1,460,673.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	39,300	99.130000	3,895,809.00
COMCAST CORP-CLASS A	168,900	28.930000	4,886,277.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	53,400	28.640000	1,529,376.00
COMERICA INC	17,600	30.230000	532,048.00
COMPUTER SCIENCES CORP	13,400	26.450000	354,430.00
CONAGRA FOODS INC	33,100	25.260000	836,106.00

CONCHO RESOURCES INC	8,300	88.850000	737,455.00
CONOCOPHILLIPS	103,100	52.140000	5,375,634.00
CONSOL ENERGY INC	18,100	29.570000	535,217.00
CONSOLIDATED EDISON INC	24,100	59.590000	1,436,119.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,300	19.150000	292,995.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	4,000	74.420000	297,680.00
COOPER INDUSTRIES PLC	12,600	71.530000	901,278.00
CORNING INC	128,900	12.810000	1,651,209.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,700	84.480000	3,015,936.00
COVANCE INC	4,900	46.100000	225,890.00
COVENTRY HEALTH CARE INC	12,200	29.980000	365,756.00
COVIDIEN PLC	39,600	53.460000	2,117,016.00
CR BARD INC	6,900	99.990000	689,931.00
CREE INC	8,900	25.910000	230,599.00
CROWN CASTLE INTL CORP	24,200	54.310000	1,314,302.00
CROWN HOLDINGS INC	13,100	34.400000	450,640.00
CSX CORP	87,100	21.350000	1,859,585.00
CUMMINS INC	14,800	100.260000	1,483,848.00
CVS CAREMARK CORP	105,600	45.170000	4,769,952.00
DANAHER CORP	48,100	52.830000	2,541,123.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,600	53.240000	564,344.00
DAVITA INC	7,500	82.020000	615,150.00
DEERE & CO	32,600	75.670000	2,466,842.00
DELL INC	127,600	12.450000	1,588,620.00
DELTA AIR LINES INC	17,300	11.270000	194,971.00
DENBURY RESOURCES INC	31,800	15.210000	483,678.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	12,200	38.110000	464,942.00
DEVON ENERGY CORPORATION	31,400	60.430000	1,897,502.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,400	60.070000	324,378.00
DIRECTV-CLASS A	56,400	46.370000	2,615,268.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	44,300	32.620000	1,445,066.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,300	50.320000	518,296.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	10,600	46.380000	491,628.00
DISH NETWORK CORP-A	17,000	28.510000	484,670.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,200	44.000000	228,800.00
DOLLAR GENERAL CORP	14,400	47.650000	686,160.00
DOLLAR TREE INC	9,600	101.710000	976,416.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	45,400	52.500000	2,383,500.00
DOVER CORP	15,200	58.250000	885,400.00
DOW CHEMICAL CO/THE	97,200	31.550000	3,066,660.00
DR HORTON INC	24,800	17.150000	425,320.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	18,000	40.760000	733,680.00
DTE ENERGY COMPANY	13,600	56.450000	767,720.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	74,500	48.660000	3,625,170.00
DUKE ENERGY CORP	106,900	21.800000	2,330,420.00
DUN & BRADSTREET CORP	4,200	66.800000	280,560.00
EASTMAN CHEMICAL CO	10,900	47.000000	512,300.00
EATON CORP	26,400	43.500000	1,148,400.00
EATON VANCE CORP	8,900	24.180000	215,202.00
EBAY INC	94,900	39.670000	3,764,683.00
ECOLAB INC	24,300	65.090000	1,581,687.00
EDISON INTERNATIONAL	25,900	44.850000	1,161,615.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,300	87.330000	812,169.00
ELECTRONIC ARTS INC	27,100	14.220000	385,362.00
ELI LILLY & CO	84,100	41.160000	3,461,556.00
EMC CORP/MA	165,700	24.230000	4,014,911.00
EMERSON ELECTRIC CO	59,500	47.700000	2,838,150.00
ENERGEN CORP	6,900	44.040000	303,876.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,800	71.860000	416,788.00
ENTERGY CORP	14,500	64.350000	933,075.00
EOG RESOURCES INC	21,800	100.790000	2,197,222.00
EQT CORP	11,700	46.580000	544,986.00
EQUIFAX INC	10,200	45.470000	463,794.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,300	55.090000	1,063,237.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,300	101.690000	437,267.00
EXELON CORP	69,200	36.860000	2,550,712.00
EXPEDIA INC	8,100	45.250000	366,525.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	17,500	38.740000	677,950.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	65,100	51.670000	3,363,717.00

EXXON MOBIL CORP	391,000	82.610000	32,300,510.00
F5 NETWORKS INC	6,600	108.560000	716,496.00
FAMILY DOLLAR STORES	8,600	67.560000	581,016.00
FASTENAL CO	23,800	44.360000	1,055,768.00
FEDEX CORP	24,700	90.020000	2,223,494.00
FIDELITY NATIONAL FINL-A	18,700	19.020000	355,674.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	20,000	32.960000	659,200.00
FIFTH THIRD BANCORP	77,800	13.570000	1,055,746.00
FIRST SOLAR INC	4,700	14.220000	66,834.00
FIRSTENERGY CORP	33,700	47.170000	1,589,629.00
FISERV INC	10,700	66.960000	716,472.00
FLEXTRONICS INTL LTD	58,200	6.380000	371,316.00
FLIR SYSTEMS INC	12,900	21.320000	275,028.00
FLOWSERVE CORP	5,000	108.000000	540,000.00
FLUOR CORP	13,500	50.050000	675,675.00
FMC CORP	6,000	103.960000	623,760.00
FMC TECHNOLOGIES INC	20,300	41.990000	852,397.00
FORD MOTOR CO	285,500	10.590000	3,023,445.00
FOREST LABORATORIES INC	22,600	33.330000	753,258.00
FOSSIL INC	4,200	71.060000	298,452.00
FRANKLIN RESOURCES INC	12,600	108.000000	1,360,800.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER	78,100	32.570000	2,543,717.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	89,600	3.430000	307,328.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,600	19.170000	222,372.00
GAP INC/THE	25,100	26.990000	677,449.00
GARMIN LTD	9,500	43.720000	415,340.00
GENERAL DYNAMICS CORP	23,800	63.340000	1,507,492.00
GENERAL ELECTRIC CO	859,200	19.250000	16,539,600.00
GENERAL MILLS INC	52,500	38.980000	2,046,450.00
GENERAL MOTORS CO	63,300	22.040000	1,395,132.00
GENUINE PARTS CO	13,000	61.960000	805,480.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	38,700	5.250000	203,175.00
GILEAD SCIENCES INC	60,900	50.620000	3,082,758.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	37,800	96.860000	3,661,308.00
GOODRICH CORP	10,200	125.710000	1,282,242.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	20,100	10.420000	209,442.00
GOOGLE INC-CL A	20,800	603.660000	12,556,128.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	11,000	25.090000	275,990.00
H&R BLOCK INC	25,100	14.990000	376,249.00
HALLIBURTON CO	73,500	31.410000	2,308,635.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,200	47.390000	909,888.00
HARRIS CORP	9,100	39.180000	356,538.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,100	17.240000	605,124.00
HASBRO INC	9,900	34.590000	342,441.00
HCA HOLDINGS INC	13,600	26.100000	354,960.00
HELMERICH & PAYNE	8,900	45.830000	407,887.00
HENRY SCHEIN INC	7,300	75.050000	547,865.00
HERBALIFE LTD	9,900	45.430000	449,757.00
HERSHEY CO/THE	14,000	68.000000	952,000.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,000	13.100000	275,100.00
HESS CORP	25,000	46.510000	1,162,750.00
HEWLETT-PACKARD CO	160,900	21.770000	3,502,793.00
HJ HEINZ CO	26,600	53.550000	1,424,430.00
HOLLYFRONTIER CORP	18,600	30.200000	561,720.00
HOLOGIC INC	23,100	16.970000	392,007.00
HOME DEPOT INC	125,000	49.710000	6,213,750.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,700	57.270000	3,419,019.00
HORMEL FOODS CORP	12,900	29.690000	383,001.00
HOSPIRA INC	12,900	31.980000	412,542.00
HUDSON CITY BANCORP INC	39,100	6.270000	245,157.00
HUMANA INC	13,600	77.310000	1,051,416.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,600	56.680000	487,448.00
IHS INC-CLASS A	4,000	102.930000	411,720.00
ILLINOIS TOOL WORKS	34,600	55.750000	1,928,950.00
ILLUMINA INC	10,500	43.460000	456,330.00
INGERSOLL-RAND PLC	26,500	42.650000	1,130,225.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	6,500	54.760000	355,940.00
INTEL CORP	414,400	25.650000	10,629,360.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	6,000	123.950000	743,700.00

INTERNATIONAL PAPER CO	33,800	29.620000	1,001,156.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,200	10.790000	422,968.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96,000	196.090000	18,824,640.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,100	57.340000	407,114.00
INTL GAME TECHNOLOGY	25,300	14.120000	357,236.00
INTUIT INC	23,200	56.390000	1,308,248.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,200	531.500000	1,700,800.00
INVESCO LTD	38,000	21.600000	820,800.00
IRON MOUNTAIN INC	14,000	29.170000	408,380.00
J.C. PENNEY CO INC	12,900	27.310000	352,299.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,200	37.030000	377,706.00
JM SMUCKER CO/THE	9,600	77.440000	743,424.00
JOHNSON & JOHNSON	222,400	63.100000	14,033,440.00
JOHNSON CONTROLS INC	55,900	30.830000	1,723,397.00
JOY GLOBAL INC	8,500	59.740000	507,790.00
JPMORGAN CHASE & CO	310,700	33.970000	10,554,479.00
JUNIPER NETWORKS INC	44,200	17.000000	751,400.00
KANSAS CITY SOUTHERN	8,900	67.190000	597,991.00
KBR INC	12,400	26.450000	327,980.00
KELLOGG CO	20,400	50.200000	1,024,080.00
KEYCORP	75,600	7.540000	570,024.00
KIMBERLY-CLARK CORP	31,600	79.210000	2,503,036.00
KINDER MORGAN INC	33,500	32.110000	1,075,685.00
KLA-TENCOR CORPORATION	14,000	45.740000	640,360.00
KOHL'S CORP	19,700	50.040000	985,788.00
KRAFT FOODS INC-CLASS A	136,600	38.690000	5,285,054.00
KROGER CO	44,200	22.150000	979,030.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,200	67.680000	554,976.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,600	84.860000	644,936.00
LAM RESEARCH CORP	10,100	37.630000	380,063.00
LAS VEGAS SANDS CORP	30,400	47.920000	1,456,768.00
LEGG MASON INC	11,100	25.170000	279,387.00
LEGGETT & PLATT INC	11,100	20.780000	230,658.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,500	20.940000	345,510.00
LIBERTY GLOBAL INC-A	11,300	47.430000	535,959.00
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	9,500	45.550000	432,725.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	46,400	17.110000	793,904.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	8,900	84.020000	747,778.00
LIFE TECHNOLOGIES CORP	15,600	42.010000	655,356.00
LIMITED BRANDS INC	21,300	45.940000	978,522.00
LINCOLN NATIONAL CORP	25,800	21.310000	549,798.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	19,300	29.140000	562,402.00
LOCKHEED MARTIN CORP	22,200	83.370000	1,850,814.00
LOEWS CORP	26,300	39.370000	1,035,431.00
LORILLARD INC	11,100	128.180000	1,422,798.00
LOWE'S COS INC	103,500	27.100000	2,804,850.00
LSI CORP	44,500	6.850000	304,825.00
LULULEMON ATHLETICA INC	7,900	72.670000	574,093.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,700	38.970000	884,619.00
M & T BANK CORP	9,600	81.250000	780,000.00
MACY'S INC	34,700	38.020000	1,319,294.00
MANPOWER INC	6,400	36.230000	231,872.00
MARATHON OIL CORP	58,600	24.880000	1,457,968.00
MARATHON PETROLEUM CORP	29,500	35.800000	1,056,100.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	21,700	38.390000	833,063.00
MARSH & MCLENNAN COS	44,200	32.470000	1,435,174.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,700	69.120000	255,744.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	41,200	12.860000	529,832.00
MASCO CORP	29,200	12.690000	370,548.00
MASTERCARD INC-CLASS A	8,900	419.830000	3,736,487.00
MATTEL INC	27,400	31.040000	850,496.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,800	25.230000	600,474.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,800	56.820000	556,836.00
MCDONALD'S CORP	83,100	91.530000	7,606,143.00
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	23,100	44.760000	1,033,956.00
MCKESSON CORP	19,500	86.990000	1,696,305.00
MDU RESOURCES GROUP INC	15,800	22.430000	354,394.00
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	17,100	82.190000	1,405,449.00
MEADWESTVACO CORP	15,300	27.970000	427,941.00

MEDTRONIC INC	85,800	37.070000	3,180,606.00
MERCK & CO. INC.	247,700	37.600000	9,313,520.00
METLIFE INC	84,800	30.650000	2,599,120.00
METROPCS COMMUNICATIONS INC	27,500	6.440000	177,100.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	26,400	10.840000	286,176.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16,900	30.860000	521,534.00
MICRON TECHNOLOGY INC	71,000	5.740000	407,540.00
MICROSOFT CORP	616,300	29.070000	17,915,841.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,300	70.040000	371,212.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	13,600	39.510000	537,336.00
MONSANTO CO	43,400	73.940000	3,208,996.00
MONSTER BEVERAGE CORP	12,400	72.950000	904,580.00
MOODY'S CORP	17,200	37.250000	640,700.00
MORGAN STANLEY	114,600	13.310000	1,525,326.00
MOSAIC CO/THE	24,800	48.740000	1,208,752.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	23,300	47.720000	1,111,876.00
MURPHY OIL CORP	15,100	47.300000	714,230.00
MYLAN INC	35,700	21.280000	759,696.00
NABORS INDUSTRIES LTD	24,000	13.850000	332,400.00
NASDAQ OMX GROUP/THE	10,800	21.800000	235,440.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	34,100	67.850000	2,313,685.00
NETAPP INC	30,900	28.810000	890,229.00
NETFLIX INC	4,200	70.270000	295,134.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	37,100	12.680000	470,428.00
NEWELL RUBBERMAID INC	22,700	18.390000	417,453.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	10,900	29.720000	323,948.00
NEWMONT MINING CORP	40,700	48.630000	1,979,241.00
NEWS CORP-B	36,600	19.580000	716,628.00
NEWS CORP-CL A	139,500	19.380000	2,703,510.00
NEXTERA ENERGY INC	33,100	65.030000	2,152,493.00
NII HOLDINGS INC	15,900	10.940000	173,946.00
NIKE INC -CL B	28,600	107.480000	3,073,928.00
NISOURCE INC	25,400	24.960000	633,984.00
NOBLE CORP	21,500	34.050000	732,075.00
NOBLE ENERGY INC	14,600	84.350000	1,231,510.00
NORDSTROM INC	14,300	50.450000	721,435.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	29,100	67.440000	1,962,504.00
NORTHEAST UTILITIES	24,658	36.320000	895,578.56
NORTHERN TRUST CORP	16,700	43.660000	729,122.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,700	58.810000	1,158,557.00
NRG ENERGY INC	20,500	15.690000	321,645.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	18,900	20.830000	393,687.00
NUCOR CORP	25,200	35.730000	900,396.00
NVIDIA CORP	48,000	12.110000	581,280.00
NYSE EURONEXT	21,400	24.500000	524,300.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	66,300	81.380000	5,395,494.00
OMNICARE INC	9,200	31.870000	293,204.00
OMNICOM GROUP	22,000	50.100000	1,102,200.00
ONEOK INC	8,300	83.660000	694,378.00
ORACLE CORP	327,800	26.120000	8,562,136.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10,700	96.280000	1,030,196.00
OWENS-ILLINOIS INC	13,000	19.760000	256,880.00
P G & E CORP	32,600	43.860000	1,429,836.00
PACCAR INC	25,700	38.500000	989,450.00
PALL CORP	9,100	58.360000	531,076.00
PARKER HANNIFIN CORP	12,000	84.460000	1,013,520.00
PARTNERRE LTD	4,900	72.010000	352,849.00
PATTERSON COS INC	7,500	33.450000	250,875.00
PAYCHEX INC	25,500	30.420000	775,710.00
PEABODY ENERGY CORP	23,600	23.860000	563,096.00
PENTAIR INC	9,000	42.600000	383,400.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,100	11.930000	323,303.00
PEPCO HOLDINGS INC	19,000	18.650000	354,350.00
PEPSICO INC	127,300	68.810000	8,759,513.00
PERRIGO CO	7,100	102.920000	730,732.00
PETSMART INC	8,600	63.920000	549,712.00
PFIZER INC	625,800	22.140000	13,855,212.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	141,700	85.340000	12,092,678.00
PHILLIPS 66	52,800	31.130000	1,643,664.00

PINNACLE WEST CAPITAL	8,800	48.880000	430,144.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,300	98.030000	911,679.00
PITNEY BOWES INC	15,700	13.820000	216,974.00
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	11,800	36.020000	425,036.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	43,400	62.200000	2,699,480.00
PPG INDUSTRIES INC	12,800	104.200000	1,333,760.00
PPL CORPORATION	46,000	27.410000	1,260,860.00
PRAXAIR INC	24,200	108.780000	2,632,476.00
PRECISION CASTPARTS CORP	11,700	168.270000	1,968,759.00
PRICELINE.COM INC	4,100	668.970000	2,742,777.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,700	24.410000	627,337.00
PROCTER & GAMBLE CO/THE	224,100	62.570000	14,021,937.00
PROGRESS ENERGY INC	24,700	54.580000	1,348,126.00
PROGRESSIVE CORP	46,000	21.510000	989,460.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,900	47.330000	1,793,807.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,600	30.670000	1,214,532.00
QEP RESOURCES INC	15,100	26.250000	396,375.00
QUALCOMM INC	136,600	57.150000	7,806,690.00
QUANTA SERVICES INC	15,000	22.910000	343,650.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,400	57.410000	769,294.00
RALCORP HOLDINGS INC	4,600	65.690000	302,174.00
RALPH LAUREN CORP	4,900	148.680000	728,532.00
RANGE RESOURCES CORP	13,000	62.170000	808,210.00
RAYTHEON COMPANY	27,700	49.920000	1,382,784.00
RED HAT INC	16,100	52.620000	847,182.00
REGIONS FINANCIAL CORP	115,800	6.330000	733,014.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,400	78.400000	344,960.00
REPUBLIC SERVICES INC	25,500	26.660000	679,830.00
REYNOLDS AMERICAN INC	28,500	41.890000	1,193,865.00

[前](#) [次](#)

(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	ROBERT HALF INTL INC	12,300	28.730000	353,379.00	
	ROCK-TENN COMPANY -CL A	6,300	52.910000	333,333.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	11,400	75.960000	865,944.00	
	ROCKWELL COLLINS INC	12,800	50.620000	647,936.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	8,400	100.360000	843,024.00	
	ROSS STORES INC	19,200	62.420000	1,198,464.00	
	ROWAN COMPANIES PLC	10,700	31.480000	336,836.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,100	24.310000	294,151.00	
	SAFEWAY INC	27,800	18.830000	523,474.00	
	SAIC INC	24,400	10.530000	256,932.00	
	SALESFORCE.COM INC	10,400	146.210000	1,520,584.00	
	SANDISK CORP	19,900	32.250000	641,775.00	
	SARA LEE CORP	45,100	20.830000	939,433.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	10,200	52.320000	533,664.00	
	SCANA CORP	10,800	46.400000	501,120.00	
	SCHLUMBERGER LTD	108,500	65.850000	7,144,725.00	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	90,300	12.630000	1,140,489.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,400	53.650000	397,010.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	34,600	26.390000	913,094.00	
	SEALED AIR CORP	12,700	16.080000	204,216.00	
	SEARS HOLDINGS CORP	3,100	56.590000	175,429.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	13,000	18.140000	235,820.00	
	SEMPRA ENERGY	18,700	64.050000	1,197,735.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,400	125.330000	927,442.00	
	SIGMA-ALDRICH	9,900	71.600000	708,840.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	317,400	1.990000	631,626.00	
	SLM CORP	42,800	13.560000	580,368.00	
	SOUTHERN CO/THE	70,600	45.600000	3,219,360.00	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	15,400	8.740000	134,596.00	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,900	28.840000	862,316.00	
	SPECTRA ENERGY CORP	54,300	28.840000	1,566,012.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	244,900	2.530000	619,597.00	
	SPX CORP	4,000	74.200000	296,800.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	26,600	39.290000	1,045,114.00	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	12,900	68.850000	888,165.00	
	STAPLES INC	56,700	13.490000	764,883.00	
	STARBUCKS CORP	60,700	54.760000	3,323,932.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	16,500	53.530000	883,245.00	
	STATE STREET CORP	40,700	41.730000	1,698,411.00	
	STERICYCLE INC	6,600	86.800000	572,880.00	
	STRYKER CORP	23,900	51.720000	1,236,108.00	
	SUNOCO INC	8,600	47.350000	407,210.00	
	SUNTRUST BANKS INC	44,900	22.670000	1,017,883.00	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	12,800	21.710000	277,888.00	
	SYMANTEC CORP	61,400	14.950000	917,930.00	
	SYNOPSIS INC	11,500	29.850000	343,275.00	
	SYSCO CORP	48,500	27.800000	1,348,300.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	20,400	58.070000	1,184,628.00	
	TARGET CORP	51,200	57.250000	2,931,200.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,400	17.050000	347,820.00	
TE CONNECTIVITY LTD	35,700	31.190000	1,113,483.00		
TERADATA CORP	13,900	69.970000	972,583.00		
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,800	28.890000	2,680,992.00		
TEXTRON INC	22,700	23.780000	539,806.00		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,500	52.210000	1,644,615.00		
TIFFANY & CO	9,400	57.590000	541,346.00		
TIME WARNER CABLE	26,600	76.900000	2,045,540.00		
TIME WARNER INC	82,000	34.580000	2,835,560.00		
TJX COMPANIES INC	61,400	40.900000	2,511,260.00		
TOLL BROTHERS INC	11,700	27.960000	327,132.00		
TORCHMARK CORP	9,000	47.070000	423,630.00		
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	15,100	23.350000	352,585.00		
TRAVELERS COS INC/THE	33,000	63.190000	2,085,270.00		
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	9,100	39.000000	354,900.00		
TYCO INTERNATIONAL LTD	37,800	54.960000	2,077,488.00		

TYSON FOODS INC-CL A	24,900	19.040000	474,096.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	14,400	18.980000	273,312.00	
UNION PACIFIC CORP	39,400	112.890000	4,447,866.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,016	23.530000	141,556.48	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,300	75.180000	4,458,174.00	
UNITED STATES STEEL CORP	11,800	21.720000	256,296.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,200	73.500000	5,159,700.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	86,300	56.220000	4,851,786.00	
UNUM GROUP	24,200	20.190000	488,598.00	
URBAN OUTFITTERS INC	9,900	28.030000	277,497.00	
URS CORP	6,100	36.940000	225,334.00	
US BANCORP	154,200	31.130000	4,800,246.00	
VALERO ENERGY CORP	44,800	22.120000	990,976.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,000	61.150000	550,350.00	
VERISIGN INC	12,900	39.240000	506,196.00	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	12,200	47.980000	585,356.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	231,700	41.390000	9,590,063.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,400	64.090000	1,115,166.00	
VF CORP	7,100	141.610000	1,005,431.00	
VIACOM INC-CLASS B	41,300	48.400000	1,998,920.00	
VIRGIN MEDIA INC	24,000	21.820000	523,680.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	42,700	119.770000	5,114,179.00	
VMWARE INC-CLASS A	7,000	95.430000	668,010.00	
VULCAN MATERIALS CO	10,800	35.030000	378,324.00	
WALGREEN CO	71,100	31.260000	2,222,586.00	
WAL-MART STORES INC	154,500	65.070000	10,053,315.00	
WALT DISNEY CO/THE	138,300	44.440000	6,146,052.00	
WALTER ENERGY INC	5,500	49.710000	273,405.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	11,700	20.120000	235,404.00	
WASHINGTON POST-CLASS B	500	339.350000	169,675.00	
WASTE MANAGEMENT INC	34,700	33.090000	1,148,223.00	
WATERS CORP	7,700	82.250000	633,325.00	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	10,800	72.760000	785,808.00	
WEATHERFORD INTL LTD	64,400	12.760000	821,744.00	
WELLPOINT INC	28,500	67.820000	1,932,870.00	
WELLS FARGO & CO	407,500	31.810000	12,962,575.00	
WESTERN DIGITAL CORP	18,600	33.830000	629,238.00	
WESTERN UNION CO	51,100	17.030000	870,233.00	
WHIRLPOOL CORP	6,500	58.530000	380,445.00	
WHITING PETROLEUM CORP	10,700	44.270000	473,689.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	12,200	86.420000	1,054,324.00	
WILLIAMS COS INC	49,300	31.050000	1,530,765.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	14,400	35.330000	508,752.00	
WINDSTREAM CORP	47,600	9.440000	449,344.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	19,500	37.300000	727,350.00	
WR BERKLEY CORP	10,500	39.000000	409,500.00	
WW GRAINGER INC	5,000	194.840000	974,200.00	
WYNN RESORTS LTD	6,800	103.230000	701,964.00	
XCEL ENERGY INC	40,400	27.780000	1,122,312.00	
XEROX CORP	113,600	6.940000	788,384.00	
XILINX INC	20,900	31.610000	660,649.00	
XL GROUP PLC	25,500	20.440000	521,220.00	
XYLEM INC	14,800	26.140000	386,872.00	
YAHOO! INC	95,300	15.350000	1,462,855.00	
YUM! BRANDS INC	37,500	70.490000	2,643,375.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	14,800	61.900000	916,120.00	
アメリカドル 小計	24,458,074		981,887,788.04 (78,246,637,828)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES LTD	14,600	40.670000	593,782.00	
AGRIUM INC	13,100	82.770000	1,084,287.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	10,800	40.240000	434,592.00	
ARC RESOURCES LTD	24,300	21.280000	517,104.00	
ATHABASCA OIL CORP	27,000	10.750000	290,250.00	
BANK OF MONTREAL	52,200	55.080000	2,875,176.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	89,400	51.400000	4,595,160.00	
BARRICK GOLD CORP	81,000	40.500000	3,280,500.00	
BAYTEX ENERGY CORP	10,700	47.340000	506,538.00	
BCE INC	21,300	40.370000	859,881.00	
BOMBARDIER INC-B	124,600	3.740000	466,004.00	

BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	46,700	32.440000	1,514,948.00
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	20,800	17.550000	365,040.00
CAE INC	26,500	10.130000	268,445.00
CAMECO CORP	33,600	19.820000	665,952.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,700	70.660000	2,310,582.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,500	84.120000	3,070,380.00
CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,700	31.410000	2,817,477.00
CANADIAN OIL SANDS LTD	39,300	20.740000	815,082.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	14,200	77.250000	1,096,950.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6,500	67.540000	439,010.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,000	68.020000	544,160.00
CENOVUS ENERGY INC	61,100	32.480000	1,984,528.00
CENTERRA GOLD INC	15,400	10.070000	155,078.00
CGI GROUP INC - CLASS A	20,300	20.730000	420,819.00
CI FINANCIAL CORP	12,900	22.080000	284,832.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	24,600	40.340000	992,364.00
ELDORADO GOLD CORP	53,600	11.960000	641,056.00
ENBRIDGE INC	61,600	40.960000	2,523,136.00
ENCANA CORP	59,300	20.800000	1,233,440.00
ENERPLUS CORP	16,700	14.090000	235,303.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,700	408.160000	693,872.00
FINNING INTERNATIONAL INC	14,500	24.630000	357,135.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,500	18.600000	753,300.00
FORTIS INC	17,000	33.430000	568,310.00
FRANCO-NEVADA CORP	11,400	42.480000	484,272.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,000	25.630000	281,930.00
GOLDCORP INC	66,500	38.380000	2,552,270.00
GREAT-WEST LIFECO INC	25,000	21.270000	531,750.00
HUSKY ENERGY INC	28,700	23.460000	673,302.00
IAMGOLD CORP	32,500	11.000000	357,500.00
IGM FINANCIAL INC	9,900	40.040000	396,396.00
IMPERIAL OIL LTD	25,100	41.620000	1,044,662.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,800	25.440000	223,872.00
INMET MINING CORPORATION	4,500	43.620000	196,290.00
INTACT FINANCIAL CORP	11,300	63.910000	722,183.00
IVANHOE MINES LTD	22,800	9.920000	226,176.00
KINROSS GOLD CORP	95,200	8.650000	823,480.00
LOBLAW COMPANIES LTD	10,400	32.010000	332,904.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,900	42.830000	723,827.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	141,000	11.370000	1,603,170.00
MEG ENERGY CORP	11,500	38.150000	438,725.00
METRO INC	8,900	51.490000	458,261.00
NATIONAL BANK OF CANADA	13,700	72.630000	995,031.00
NEW GOLD INC	34,900	8.910000	310,959.00
NEXEN INC	43,700	16.440000	718,428.00
NIKO RESOURCES LTD	3,700	32.320000	119,584.00
ONEX CORPORATION	8,800	38.960000	342,848.00
OPEN TEXT CORP	4,300	50.250000	216,075.00
OSISKO MINING CORP	26,300	6.960000	183,048.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	21,900	26.380000	577,722.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,600	17.290000	217,854.00
PEMBINA PIPELINE CORP	23,400	29.430000	688,662.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	38,000	14.190000	539,220.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	69,700	41.230000	2,873,731.00
POWER CORP OF CANADA	29,200	23.650000	690,580.00
POWER FINANCIAL CORP	21,300	25.780000	549,114.00
PRECISION DRILLING CORP	21,300	7.910000	168,483.00
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	18,600	11.280000	209,808.00
RESEARCH IN MOTION	41,500	10.980000	455,670.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,600	20.360000	195,456.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	32,800	36.150000	1,185,720.00
ROYAL BANK OF CANADA	117,000	51.380000	6,011,460.00
SAPUTO INC	11,600	43.050000	499,380.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,900	19.480000	601,932.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	17,800	41.130000	732,114.00
SILVER WHEATON CORP	28,100	27.020000	759,262.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,500	39.840000	498,000.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,600	21.590000	1,027,684.00
SUNCOR ENERGY INC	128,600	28.490000	3,663,814.00

TALISMAN ENERGY INC	83,800	10.360000	868,168.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	48,400	31.160000	1,508,144.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	12,400	57.140000	708,536.00	
THOMSON REUTERS CORP	30,900	29.440000	909,696.00	
TIM HORTONS INC	13,600	55.000000	748,000.00	
TMX GROUP INC	6,000	46.130000	276,780.00	
TORONTO-DOMINION BANK	73,500	78.990000	5,805,765.00	
TOURMALINE OIL CORP	11,600	25.240000	292,784.00	
TRANSALTA CORP	17,300	17.270000	298,771.00	
TRANSCANADA CORP	58,000	42.200000	2,447,600.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	22,900	49.340000	1,129,886.00	
VERMILION ENERGY INC	8,500	43.230000	367,455.00	
VITERRA INC	30,900	16.030000	495,327.00	
WESTON (GEORGE) LTD	4,500	58.700000	264,150.00	
YAMANA GOLD INC	57,100	14.830000	846,793.00	
カナダドル 小計	3,112,900		94,324,937.00 (7,323,388,108)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	37,010	14.930000	552,559.30	
ALUMINA LTD	211,345	0.895000	189,153.77	
AMCOR LIMITED	100,021	7.500000	750,157.50	
AMP LTD	247,008	3.830000	946,040.64	
ASCIANO LTD	80,533	4.480000	360,787.84	
ASX LTD	14,158	29.420000	416,528.36	
AUST AND NZ BANKING GROUP	216,750	20.470000	4,436,872.50	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,612	6.910000	218,438.92	
BHP BILLITON LTD	260,822	31.990000	8,343,695.78	
BORAL LTD	58,154	3.400000	197,723.60	
BRAMBLES LTD	129,002	6.720000	866,893.44	
CALTEX AUSTRALIA LTD	12,898	12.700000	163,804.60	
CAMPBELL BROTHERS LTD	5,472	56.680000	310,152.96	
COCA-COLA AMATIL LTD	47,686	12.720000	606,565.92	
COCHLEAR LTD	4,643	61.770000	286,798.11	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	129,072	49.310000	6,364,540.32	
COMPUTERSHARE LTD	38,258	7.710000	294,969.18	
CROWN LTD	37,709	8.560000	322,789.04	
CSL LTD	42,895	37.800000	1,621,431.00	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	52,860	4.340000	229,412.40	
FAIRFAX MEDIA LTD	152,684	0.640000	97,717.76	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	98,627	4.480000	441,848.96	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	44,167	1.930000	85,242.31	
ILUKA RESOURCES LTD	33,792	12.560000	424,427.52	
INCITEC PIVOT LTD	137,980	2.730000	376,685.40	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	167,598	3.290000	551,397.42	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	35,024	7.510000	263,030.24	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,861	17.860000	211,837.46	
LEND LEASE GROUP	42,089	7.330000	308,512.37	
LYNAS CORP LTD	130,000	0.880000	114,400.00	
MACQUARIE GROUP LTD	27,865	26.140000	728,391.10	
METCASH LTD	58,721	3.950000	231,947.95	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	179,372	23.480000	4,211,654.56	
NEWCREST MINING LTD	62,102	24.900000	1,546,339.80	
ORICA LTD	30,097	25.350000	762,958.95	
ORIGIN ENERGY LTD	92,036	12.910000	1,188,184.76	
OZ MINERALS LTD	26,401	8.130000	214,640.13	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.470000	124,447.26	
QBE INSURANCE GROUP LTD	90,470	12.380000	1,120,018.60	
QR NATIONAL LTD	141,692	3.330000	471,834.36	
RIO TINTO LTD	35,908	56.360000	2,023,774.88	
SANTOS LTD	77,882	11.920000	928,353.44	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	12,576	12.250000	154,056.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	34,125	12.660000	432,022.50	
SUNCORP GROUP LTD	108,392	7.590000	822,695.28	
TABCORP HOLDINGS LTD	76,696	2.910000	223,185.36	
TATTS GROUP LTD	107,000	2.600000	278,200.00	
TELSTRA CORP LTD	368,876	3.530000	1,302,132.28	
TOLL HOLDINGS LTD	57,066	4.390000	250,519.74	
TRANSURBAN GROUP	110,181	5.770000	635,744.37	
WESFARMERS LTD	82,411	29.660000	2,444,310.26	
WESTPAC BANKING CORP	247,165	20.390000	5,039,694.35	

WHITEHAVEN COAL LTD	38,500	3.960000	152,460.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	53,235	31.110000	1,656,140.85	
WOOLWORTHS LTD	101,620	26.900000	2,733,578.00	
WORLEYPARSONS LTD	17,093	25.110000	429,205.23	
オーストラリアドル 小計	4,933,870		60,460,904.63 (4,709,904,470)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	85,351	1.688000	144,072.48	
ADMIRAL GROUP PLC	15,622	10.840000	169,342.48	
AGGREKO PLC	21,510	21.070000	453,215.70	
AMEC PLC	29,263	10.000000	292,630.00	
ANGLO AMERICAN PLC	107,595	20.260000	2,179,874.70	
ANTOFAGASTA PLC	33,525	10.270000	344,301.75	
ARM HOLDINGS PLC	115,446	4.952000	571,688.59	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,635	11.740000	336,174.90	
ASTRAZENECA PLC	105,017	26.220000	2,753,545.74	
AVIVA PLC	230,022	2.680000	616,458.96	
BABCOCK INTL GROUP PLC	28,798	8.395000	241,759.21	
BAE SYSTEMS PLC	269,452	2.732000	736,142.86	
BALFOUR BEATTY PLC	53,446	2.757000	147,350.62	
BARCLAYS PLC	947,817	1.853000	1,756,304.90	
BG GROUP PLC	277,078	12.690000	3,516,119.82	
BHP BILLITON PLC	171,492	17.185000	2,947,090.02	
BP PLC	1,547,855	4.070000	6,299,769.85	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	160,619	30.425000	4,886,833.07	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	93,724	6.995000	655,599.38	
BT GROUP PLC	647,182	2.062000	1,334,489.28	
BUNZL PLC	27,504	10.020000	275,590.08	
BURBERRY GROUP PLC	35,037	13.650000	478,255.05	
CAPITA PLC	46,862	6.095000	285,623.89	
CARNIVAL PLC	15,012	20.610000	309,397.32	
CENTRICA PLC	422,052	3.139000	1,324,821.22	
COBHAM PLC	92,292	2.216000	204,519.07	
COMPASS GROUP PLC	154,970	6.315000	978,635.55	
DIAGEO PLC	204,571	14.980000	3,064,473.58	
ESSAR ENERGY PLC	29,117	1.121000	32,640.15	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	23,840	4.606000	109,807.04	
EXPERIAN PLC	84,293	8.995000	758,215.53	
FRESNILLO PLC	13,551	13.470000	182,531.97	
G4S PLC	116,629	2.735000	318,980.31	
GKN PLC	127,117	1.832000	232,878.34	
GLAXOSMITHKLINE PLC	411,146	14.095000	5,795,102.87	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	110,478	3.460000	382,253.88	
HSBC HOLDINGS PLC	1,452,944	5.148000	7,479,755.71	
ICAP PLC	41,055	3.390000	139,176.45	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	81,751	23.910000	1,954,666.41	
INMARSAT PLC	35,299	3.970000	140,137.03	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	25,065	14.060000	352,413.90	
INTERNATIONAL POWER PLC	126,004	4.136000	521,152.54	
INTERTEK GROUP PLC	12,257	25.510000	312,676.07	
INVENSYS PLC	62,894	2.127000	133,775.53	
INVESTEC PLC	37,700	3.259000	122,864.30	
ITV PLC	325,271	0.775000	252,085.02	
JOHNSON MATTHEY PLC	17,272	21.550000	372,211.60	
KAZAKHMYS PLC	18,604	6.895000	128,274.58	
KINGFISHER PLC	198,422	2.802000	555,978.44	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	493,572	1.109000	547,371.34	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,331,148	0.269100	896,411.92	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,437	9.615000	138,811.75	
LONMIN PLC	12,600	7.410000	93,366.00	
MAN GROUP PLC	138,891	0.727000	100,973.75	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	131,398	3.432000	450,957.93	
MEGGITT PLC	69,119	3.793000	262,168.36	
NATIONAL GRID PLC	291,565	6.720000	1,959,316.80	
NEXT PLC	13,453	29.760000	400,361.28	
OLD MUTUAL PLC	394,621	1.432000	565,097.27	
PEARSON PLC	66,616	11.370000	757,423.92	
PETROFAC LTD	20,162	15.520000	312,914.24	
PRUDENTIAL PLC	208,372	6.860000	1,429,431.92	
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,299	51.700000	377,358.30	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,742	33.800000	1,715,079.60	
REED ELSEVIER PLC	100,701	4.904000	493,837.70	
RESOLUTION LTD	116,321	2.045000	237,876.44	
REXAM PLC	76,364	3.939000	300,797.79	
RIO TINTO PLC	111,267	28.385000	3,158,313.79	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	153,175	8.105000	1,241,483.37	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C ENT S	15,683,654	0.001000	15,683.65	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,466,953	0.214400	314,514.72	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	297,990	20.130000	5,998,538.70	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	217,325	20.750000	4,509,493.75	
RSA INSURANCE GROUP PLC	305,788	1.004000	307,011.15	
SABMILLER PLC	77,646	23.910000	1,856,515.86	
SAGE GROUP PLC/THE	104,276	2.546000	265,486.69	
SAINSBURY (J) PLC	99,565	2.940000	292,721.10	
SCHRODERS PLC	8,259	11.920000	98,447.28	
SERCO GROUP PLC	40,290	5.175000	208,500.75	
SEVERN TRENT PLC	18,872	16.850000	317,993.20	
SHIRE PLC	45,309	18.770000	850,449.93	
SMITH & NEPHEW PLC	71,316	6.000000	427,896.00	
SMITHS GROUP PLC	32,971	10.190000	335,974.49	
SSE PLC	73,902	13.400000	990,286.80	
STANDARD CHARTERED PLC	195,957	13.370000	2,619,945.09	
STANDARD LIFE PLC	199,724	2.059000	411,231.71	
TATE & LYLE PLC	37,539	6.680000	250,760.52	
TESCO PLC	645,836	3.082500	1,990,789.47	
TUI TRAVEL PLC	48,761	1.660000	80,943.26	
TULLOW OIL PLC	74,864	13.630000	1,020,396.32	
UNILEVER PLC	103,994	20.270000	2,107,958.38	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	56,530	6.370000	360,096.10	
VEDANTA RESOURCES PLC	11,069	9.995000	110,634.65	
VODAFONE GROUP PLC	4,105,012	1.717000	7,048,305.60	
WEIR GROUP PLC/THE	17,581	15.590000	274,087.79	
WHITBREAD PLC	14,119	18.210000	257,106.99	
WM MORRISON SUPERMARKETS	171,644	2.708000	464,811.95	
WOLSELEY PLC	22,523	22.720000	511,722.56	
WPP PLC	103,120	7.895000	814,132.40	
XSTRATA PLC	165,558	9.350000	1,547,967.30	
イギリスポンド 小計	39,638,228		109,681,415.37 (13,692,627,894)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	178,274	15.590000	2,779,291.66	
ACTELION LTD-REG	8,929	37.210000	332,248.09	
ADECCO SA-REG	11,687	38.150000	445,859.05	
ARYZTA AG	7,350	44.350000	325,972.50	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,043	62.500000	252,687.50	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	43,379	55.400000	2,403,196.60	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	94,435	19.360000	1,828,261.60	
GAM HOLDING AG	20,607	10.200000	210,191.40	
GEBERIT AG-REG	3,274	188.200000	616,166.80	
GIVAUDAN-REG	716	876.500000	627,574.00	
HOLCIM LTD-REG	19,677	53.750000	1,057,638.75	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,368	31.080000	570,877.44	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,647	104.900000	487,470.30	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	10	33,745.000000	337,450.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,916	34.830000	136,394.28	
NESTLE SA-REG	269,538	54.650000	14,730,251.70	
NOVARTIS AG-REG	190,070	49.480000	9,404,663.60	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,257	54.150000	122,216.55	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	57,291	152.000000	8,708,232.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,123	108.500000	230,345.50	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,785	108.200000	409,537.00	
SGS SA-REG	452	1,749.000000	790,548.00	

前へ 次へ

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スイスフラン	SIKA AG-BR	182	1,797.000000	327,054.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,848	86.800000	334,006.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	635	158.100000	100,393.50	
	SULZER AG-REG	2,320	116.900000	271,208.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,407	370.700000	892,274.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,882	63.400000	246,118.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,956	82.900000	245,052.40	
	SWISS RE AG	27,836	54.800000	1,525,412.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,943	351.700000	683,353.10	
	SYNGENTA AG-REG	7,677	305.900000	2,348,394.30	
	SYNTHES INC-144A/REGS	5,576	156.900000	874,874.40	
	TRANSOCEAN LTD	28,684	41.150000	1,180,346.60	
	UBS AG-REG	295,408	11.250000	3,323,340.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,005	202.300000	2,428,611.50	
	スイスフラン 小計	1,340,187		61,587,515.02 (5,121,001,873)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	696,000	24.900000	17,330,400.00	
	BANK OF EAST ASIA	143,820	26.400000	3,796,848.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	309,000	22.050000	6,813,450.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	105,000	11.980000	1,257,900.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	112,000	91.150000	10,208,800.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	38,000	45.300000	1,721,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	163,500	64.150000	10,488,525.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	159,000	3.300000	524,700.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	75,000	45.000000	3,375,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	212,000	24.500000	5,194,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	67,500	100.700000	6,797,250.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	78,000	37.850000	2,952,300.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	385,893	18.320000	7,069,559.76	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	85,500	109.000000	9,319,500.00	
	HOPEWELL HOLDINGS LTD	55,500	20.250000	1,123,875.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	177,000	66.000000	11,682,000.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	51,000	30.900000	1,575,900.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	57,000	31.350000	1,786,950.00	
	LI & FUNG LTD	468,000	14.700000	6,879,600.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	68,000	15.740000	1,070,320.00	
	MTR CORP	125,500	25.200000	3,162,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	336,000	7.980000	2,681,280.00	
	NWS HOLDINGS LTD	106,500	11.620000	1,237,530.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	25,000	41.850000	1,046,250.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	120,500	57.750000	6,958,875.00	
	SANDS CHINA LTD	199,200	25.600000	5,099,520.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	15.440000	1,791,040.00	
	SINO LAND CO	257,400	10.680000	2,749,032.00	
	SJM HOLDINGS LTD	133,000	13.420000	1,784,860.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	119,000	87.550000	10,418,450.00	
	SWIRE PACIFIC LTD-A	62,000	82.100000	5,090,200.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	124,000	39.750000	4,929,000.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	83,000	23.350000	1,938,050.00	
WING HANG BANK LTD	15,500	73.750000	1,143,125.00		
WYNN MACAU LTD	135,200	18.500000	2,501,200.00		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	60,000	25.400000	1,524,000.00		
香港ドル 小計	5,524,513		165,023,289.76 (1,693,138,952)		
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	232,000	2.460000	570,720.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	43,000	9.930000	426,990.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	187,000	1.460000	273,020.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	86,000	0.895000	76,970.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,000	13.220000	1,969,780.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	88,000	6.400000	563,200.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	512,000	1.500000	768,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	152,000	1.975000	300,200.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	534,360	0.645000	344,662.20	

JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,000	44.100000	441,000.00	
KEPPEL CORP LTD	119,000	9.990000	1,188,810.00	
KEPPEL LAND LTD	84,000	2.850000	239,400.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.030000	100,940.00	
NOBLE GROUP LTD	304,090	1.060000	322,335.40	
OLAM INTERNATIONAL LTD	117,000	1.685000	197,145.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	217,000	8.530000	1,851,010.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	82,000	4.830000	396,060.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	48,340	10.200000	493,068.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	77,000	6.240000	480,480.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,250	3.850000	563,062.50	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	151,000	2.980000	449,980.00	
SINGAPORE TELECOM LTD	677,260	3.100000	2,099,506.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,000	17.360000	1,770,720.00	
UOL GROUP LTD	49,000	4.210000	206,290.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	162,000	3.750000	607,500.00	
シンガポールドル 小計	4,427,300		16,700,849.10 (1,042,968,026)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81,688	2.550000	208,304.40	
CONTACT ENERGY LTD	15,339	4.800000	73,627.20	
FLETCHER BUILDING LTD	42,857	6.160000	263,999.12	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	49,774	3.540000	176,199.96	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	172,680	2.580000	445,514.40	
ニュージーランドドル 小計	362,338		1,167,645.08 (70,222,175)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	27,920	122.100000	3,409,032.00	
ASSA ABLOY AB-B	25,670	187.000000	4,800,290.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	56,870	149.800000	8,519,126.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	31,597	132.500000	4,186,602.50	
BOLIDEN AB	20,204	94.100000	1,901,196.40	
ELECTROLUX AB-SER B	18,238	137.600000	2,509,548.80	
ERICSSON LM-B SHS	242,509	62.300000	15,108,310.70	
GETINGE AB-B SHS	17,017	179.700000	3,057,954.90	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	81,514	216.700000	17,664,083.80	
HEXAGON AB-B SHS	21,156	130.400000	2,758,742.40	
HOLMEN AB-B SHARES	4,448	184.200000	819,321.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	29,317	33.130000	971,272.21	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	18,842	123.600000	2,328,871.20	
INVESTOR AB-B SHS	38,756	127.400000	4,937,514.40	
LUNDIN PETROLEUM AB	18,976	132.600000	2,516,217.60	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,287	630.500000	3,963,953.50	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,572	293.900000	1,049,810.80	
NORDEA BANK AB	211,653	54.600000	11,556,253.80	
RATOS AB-B SHS	15,854	67.450000	1,069,352.30	
SANDVIK AB	81,446	94.750000	7,717,008.50	
SCANIA AB-B SHS	27,357	116.300000	3,181,619.10	
SECURITAS AB-B SHS	26,395	52.250000	1,379,138.75	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	118,838	41.240000	4,900,879.12	
SKANSKA AB-B SHS	32,359	97.250000	3,146,912.75	
SKF AB-B SHARES	32,473	144.200000	4,682,606.60	
SSAB AB-A SHARES	12,259	59.000000	723,281.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,824	102.900000	4,818,189.60	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	41,443	205.400000	8,512,392.20	
SWEDBANK AB - A SHARES	68,988	104.600000	7,216,144.80	
SWEDISH MATCH AB	17,894	271.300000	4,854,642.20	
TELE2 AB-B SHS	29,554	109.900000	3,247,984.60	
TELIASONERA AB	176,637	44.280000	7,821,486.36	
VOLVO AB-B SHS	115,639	81.250000	9,395,668.75	
スウェーデンクローネ 小計	1,718,506		164,725,409.24 (1,828,452,042)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	15,085	82.700000	1,247,529.50	
DNB ASA	81,235	56.500000	4,589,777.50	
NORSK HYDRO ASA	80,019	25.960000	2,077,293.24	
ORKLA ASA	61,733	41.000000	2,531,053.00	
SEADRILL LTD	28,236	210.400000	5,940,854.40	
STATOIL ASA	92,231	138.900000	12,810,885.90	
SUBSEA 7 SA	24,521	127.000000	3,114,167.00	

TELENOR ASA	59,796	94.000000	5,620,824.00
YARA INTERNATIONAL ASA	15,375	235.500000	3,620,812.50
ノルウェークローネ 小計	458,231		41,553,197.04 (548,917,732)
デンマーククローネ			
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	46	35,140.000000	1,616,440.00
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	105	37,120.000000	3,897,600.00
CARLSBERG AS-B	8,712	449.600000	3,916,915.20
COLOPLAST-B	2,027	1,020.000000	2,067,540.00
DANSKE BANK A/S	53,139	82.050000	4,360,054.95
DSV A/S	14,575	122.800000	1,789,810.00
NOVO NORDISK A/S-B	34,611	824.000000	28,519,464.00
NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,190	160.400000	3,078,076.00
TDC A/S	40,164	38.750000	1,556,355.00
TRYG A/S	2,468	331.000000	816,908.00
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,414	37.620000	692,734.68
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,242	522.000000	1,170,324.00
デンマーククローネ 小計	195,693		53,482,221.83 (719,335,883)
イスラエルシェケル			
BANK HAPOLIM BM	103,230	12.630000	1,303,794.90
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114,273	9.919000	1,133,473.88
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	174,078	4.240000	738,090.72
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	132.600000	397,800.00
ISRAEL CHEMICALS LTD	35,743	40.650000	1,452,952.95
ISRAEL CORP LIMITED/THE	227	2,119.000000	481,013.00
NICE SYSTEMS LTD	5,776	145.000000	837,520.00
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	77,294	151.800000	11,733,229.20
イスラエルシェケル 小計	513,621		18,077,874.65 (373,850,447)
ユーロ			
A2A SPA	101,437	0.567500	57,565.49
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	32,279	10.910000	352,163.89
ACCIONA SA	2,042	45.510000	92,931.42
ACCOR SA	12,412	25.355000	314,706.26
ACERINOX SA	7,250	8.423000	61,066.75
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,624	13.505000	156,982.12
ADIDAS AG	17,189	58.900000	1,012,432.10
ADP	3,469	58.750000	203,803.75
AEGON NV	143,678	3.448000	495,401.74
AGEAS	166,647	1.332000	221,973.80
AIR LIQUIDE SA	23,232	94.460000	2,194,494.72
AKZO NOBEL	19,493	37.460000	730,207.78
ALCATEL-LUCENT	185,432	1.263000	234,200.61
ALLIANZ SE-REG	37,006	75.460000	2,792,472.76
ALSTOM	16,380	23.710000	388,369.80
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	24,875	15.180000	377,602.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	65,764	54.450000	3,580,849.80
ARCELORMITTAL	68,450	11.425000	782,041.25
ARKEMA	4,273	54.820000	234,245.86
ASML HOLDING NV	36,095	36.930000	1,332,988.35
ASSICURAZIONI GENERALI	98,891	8.575000	847,990.32
ATLANTIA SPA	26,976	10.170000	274,345.92
ATOS	4,454	42.990000	191,477.46
AUTOGRILL SPA	6,219	6.840000	42,537.96
AXA SA	137,865	9.362000	1,290,692.13
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	432,224	0.214500	92,712.04
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	370,873	4.929000	1,828,033.01
BANCO DE SABADELL SA	161,620	1.483000	239,682.46
BANCO POPOLARE SCARL	130,709	0.945500	123,585.35
BANCO POPULAR ESPANOL	87,695	1.894000	166,094.33
BANCO SANTANDER SA	705,583	4.543000	3,205,463.56
BASF SE	74,866	57.080000	4,273,351.28
BAYER AG-REG	68,056	50.450000	3,433,425.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,177	61.980000	1,684,430.46
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,500	41.595000	145,582.50
BEIERSDORF AG	8,500	50.840000	432,140.00
BEKAERT NV	2,836	21.340000	60,520.24
BELGACOM SA	13,508	21.385000	288,868.58
BNP PARIBAS	79,128	26.670000	2,110,343.76

BOSKALIS WESTMINSTER	5,800	24.020000	139,316.00
BOUYGUES SA	14,344	20.545000	294,697.48
BRENTAG AG	4,100	90.750000	372,075.00
BUREAU VERITAS SA	4,989	66.910000	333,813.99
CAIXABANK	64,431	2.290000	147,546.99
CAP GEMINI	12,392	28.295000	350,631.64
CARREFOUR SA	48,967	14.195000	695,086.56
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,810	67.760000	325,925.60
CELESIO AG	6,516	11.715000	76,334.94
CHRISTIAN DIOR	4,643	105.350000	489,140.05
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	12,695	18.255000	231,747.22
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	23,315	5.350000	124,735.25
CNP ASSURANCES	11,531	9.276000	106,961.55
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	16,655	12.200000	203,191.00
COLRUYT SA	5,864	31.420000	184,246.88
COMMERZBANK AG	290,419	1.408000	408,909.95
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	33,474	30.065000	1,006,395.81
CONTINENTAL AG	6,897	67.680000	466,788.96
CREDIT AGRICOLE SA	82,083	3.014000	247,398.16
CRH PLC	57,483	14.120000	811,659.96
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	73,939	38.095000	2,816,706.20
DANONE	48,189	51.690000	2,490,889.41
DASSAULT SYSTEMES SA	5,100	73.610000	375,411.00
DELHAIZE GROUP	9,243	30.990000	286,440.57
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	75,194	29.080000	2,186,641.52
DEUTSCHE BOERSE AG	16,095	38.995000	627,624.52
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	20,804	8.471000	176,230.68
DEUTSCHE POST AG-REG	70,091	13.235000	927,654.38
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	228,476	8.875000	2,027,724.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,659	3.670000	167,568.53
E.ON AG	147,953	15.310000	2,265,160.43
EADS NV	33,171	27.985000	928,290.43
EDENRED	12,975	21.840000	283,374.00
EDF	19,286	15.690000	302,597.34
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	165,382	1.737000	287,268.53
EIFFAGE	2,991	25.245000	75,507.79
ELAN CORP PLC	42,186	10.490000	442,531.14
ELISA OYJ	14,717	16.170000	237,973.89
ENAGAS SA	13,875	13.185000	182,941.87
ENEL GREEN POWER SPA	136,769	1.186000	162,208.03
ENEL SPA	525,488	2.384000	1,252,763.39
ENI SPA	197,933	15.720000	3,111,506.76
ERSTE GROUP BANK AG	15,734	14.565000	229,165.71
ESSILOR INTERNATIONAL	16,326	68.320000	1,115,392.32
EURAZEO	2,642	30.560000	80,739.52
EURAZEO-NEW	132	30.560000	4,033.92
EUTELSAT COMMUNICATIONS	10,840	22.000000	238,480.00
EXOR SPA	5,660	16.580000	93,842.80
FERROVIAL SA	34,016	7.979000	271,413.66
FIAT INDUSTRIAL	64,579	7.735000	499,518.56
FIAT SPA	57,788	4.048000	233,925.82
FINMECCANICA SPA	31,249	2.706000	84,559.79
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	3,253	10.730000	34,904.69
FORTUM OYJ	34,690	15.540000	539,082.60
FRANCE TELECOM SA	149,736	10.365000	1,552,013.64
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	16,996	52.870000	898,578.52
FRESENIUS SE & CO KGAA	10,364	75.560000	783,103.84
FUGRO NV-CVA	6,062	46.000000	278,852.00
GALP ENERGIA SGPS SA	20,637	9.850000	203,274.45
GAS NATURAL SDG SA	31,954	9.711000	310,305.29
GDF SUEZ	101,897	16.430000	1,674,167.71
GEA GROUP AG	14,472	20.560000	297,544.32
GRIFOLS SA	10,838	18.550000	201,044.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,173	50.870000	314,020.51
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	48,434	6.340000	307,071.56
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	5,200	44.045000	229,034.00
HEIDELBERGCEMENT AG	11,630	35.920000	417,749.60
HEINEKEN HOLDING NV	9,660	32.585000	314,771.10
HEINEKEN NV	21,192	38.660000	819,282.72

HENKEL AG & CO KGAA	11,849	44.070000	522,185.43	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,496	52.350000	706,515.60	
HOCHTIEF AG	3,135	37.075000	116,230.12	
IBERDROLA SA	319,893	3.388000	1,083,797.48	
ILIAD SA	2,132	105.350000	224,606.20	
IMERYS SA	2,595	39.075000	101,399.62	
IMMOFINANZ AG	84,750	2.442000	206,959.50	
INDITEX	17,579	68.800000	1,209,435.20	
INDRA SISTEMAS SA	7,291	7.779000	56,716.68	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	88,747	6.250000	554,668.75	
ING GROEP NV-CVA	316,406	4.810000	1,521,912.86	
INTESA SANPAOLO	818,144	1.025000	838,597.60	
INTESA SANPAOLO-RSP	65,939	0.873500	57,597.71	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	69,461	1.794000	124,613.03	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248			
JERONIMO MARTINS	20,759	13.600000	282,322.40	
K+S AG-REG	14,526	33.300000	483,715.80	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	8,295	47.890000	397,247.55	
KBC GROEP NV	14,084	12.490000	175,909.16	
KERRY GROUP PLC-A	11,366	32.700000	371,668.20	
KESKO OYJ-B SHS	5,314	19.880000	105,642.32	
KONE OYJ-B	12,856	45.450000	584,305.20	
KONINKLIJKE AHOLD NV	91,752	9.460000	867,973.92	
KONINKLIJKE DSM NV	11,670	39.310000	458,747.70	
KONINKLIJKE KPN NV	119,039	7.670000	913,029.13	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	83,171	14.300000	1,189,345.30	
LAFARGE SA	16,831	29.515000	496,766.96	
LAGARDERE S.C.A.	9,629	19.995000	192,531.85	
LANXESS AG	6,956	53.450000	371,798.20	
LEGRAND SA	18,278	25.480000	465,723.44	
LINDE AG	13,985	122.600000	1,714,561.00	
L'OREAL	19,478	90.170000	1,756,331.26	
LUXOTTICA GROUP SPA	9,901	25.540000	252,871.54	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	20,629	117.300000	2,419,781.70	
MAN SE	5,419	78.090000	423,169.71	
MAPFRE SA	76,775	1.802000	138,348.55	
MEDIASET SPA	58,500	1.312000	76,752.00	
MEDIOBANCA SPA	47,627	2.952000	140,594.90	
MERCK KGAA	5,442	74.830000	407,224.86	
METRO AG	11,047	22.480000	248,336.56	
METSO OYJ	10,105	27.620000	279,100.10	
MICHELIN (CGDE)	14,977	48.550000	727,133.35	
MOBISTAR SA	2,475	26.350000	65,216.25	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,923	102.350000	1,527,369.05	
NATIXIS	79,227	1.962000	155,443.37	
NEOPOST SA	2,514	41.460000	104,230.44	
NESTE OIL OYJ	13,107	7.660000	100,399.62	
NOKIA OYJ	303,468	2.136000	648,207.64	
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,978	31.600000	283,704.80	
OMV AG	13,370	22.715000	303,699.55	
OPAP SA	23,661	3.800000	89,911.80	
ORION OYJ-CLASS B	7,072	14.430000	102,048.96	
PERNOD-RICARD SA	16,178	76.750000	1,241,661.50	
PEUGEOT SA	15,762	8.309000	130,966.45	
PIRELLI & C.	17,226	8.105000	139,616.73	
POHJOLA BANK PLC-A SHS	11,086	8.585000	95,173.31	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12,981	39.605000	514,112.50	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	62,476	3.400000	212,418.40	
PPR	6,328	117.950000	746,387.60	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PRF	8,549	16.915000	144,606.33	
PRYSMIAN SPA	16,699	11.320000	189,032.68	
PUBLICIS GROUPE	11,833	36.935000	437,051.85	
QIAGEN N.V.	19,850	13.075000	259,538.75	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,565	23.680000	84,419.20	
RANDSTAD HOLDING NV	9,474	22.395000	212,170.23	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,508	29.695000	282,340.06	
REED ELSEVIER NV	55,490	8.581000	476,159.69	
RENAULT SA	16,074	33.220000	533,978.28	
REPSOL YPF SA	64,763	13.795000	893,405.58	

RWE AG	39,978	29.985000	1,198,740.33	
RWE AG-NON VTG PFD	3,847	26.980000	103,792.06	
SAFRAN SA	13,834	26.820000	371,027.88	
SAIPEM SPA	20,568	31.540000	648,714.72	
SALZGITTER AG	3,128	36.065000	112,811.32	
SAMPO OYJ-A SHS	32,903	18.990000	624,827.97	
SANOFI	92,300	54.570000	5,036,811.00	
SANOMA OYJ	6,963	6.910000	48,114.33	
SAP AG	75,153	46.170000	3,469,814.01	
SBM OFFSHORE NV	16,553	11.185000	185,145.30	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	40,255	43.450000	1,749,079.75	
SCOR SE	14,050	17.790000	249,949.50	
SES	25,479	17.965000	457,730.23	
SIEMENS AG-REG	67,052	67.070000	4,497,177.64	
SNAM SPA	136,195	3.190000	434,462.05	
SOCIETE BIC SA	2,250	76.620000	172,395.00	
SOCIETE GENERALE	55,342	16.285000	901,244.47	
SODEXO	7,660	58.210000	445,888.60	
SOLVAY SA	4,644	85.100000	395,204.40	
STMICROELECTRONICS NV	48,058	4.095000	196,797.51	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,501	4.564000	193,974.56	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	23,106	9.887000	228,449.02	
TECHNIP SA	7,842	74.820000	586,738.44	
TELECOM ITALIA SPA	761,530	0.708500	539,544.00	
TELECOM ITALIA-RSP	515,529	0.584500	301,326.70	
TELEFONICA SA	336,896	9.677000	3,260,142.59	
TELEFONICA SA-RTS	330,979	0.254000	84,068.66	
TELEKOM AUSTRIA AG	29,788	7.770000	231,452.76	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	9,519	6.020000	57,304.38	
TENARIS SA	37,781	13.110000	495,308.91	
TERNA SPA	104,532	2.752000	287,672.06	
THALES SA	7,336	24.350000	178,631.60	
THYSSENKRUPP AG	32,362	14.530000	470,219.86	
TNT EXPRESS NV	28,487	8.880000	252,964.56	
TOTAL SA	173,494	35.000000	6,072,290.00	
UBI BANCA SCPA	65,520	2.270000	148,730.40	
UCB SA	7,813	38.380000	299,862.94	
UMICORE	10,173	38.080000	387,387.84	
UNICREDIT SPA	340,762	2.518000	858,038.71	
UNILEVER NV-CVA	133,188	25.315000	3,371,654.22	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,645	13.635000	158,779.57	
UPM-KYMMENE OYJ	40,187	8.630000	346,813.81	
VALLOUREC	9,110	31.500000	286,965.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	32,405	9.599000	311,055.59	
VERBUND AG	6,128	18.650000	114,287.20	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	3,950	28.995000	114,530.25	
VINCI SA	35,663	32.605000	1,162,792.11	
VIVENDI	107,323	13.070000	1,402,711.61	
VOESTALPINE AG	8,689	21.145000	183,728.90	
VOLKSWAGEN AG	2,309	120.200000	277,541.80	
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,882	128.250000	1,523,866.50	
VOPAK	5,604	46.390000	259,969.56	
WACKER CHEMIE AG	1,300	55.840000	72,592.00	
WARTSILA OYJ ABP	13,374	27.150000	363,104.10	
WENDEL	2,600	54.460000	141,596.00	
WOLTERS KLUWER	24,628	11.880000	292,580.64	
ZARDOYA OTIS SA	17,350	8.830000	153,200.50	
ユーロ小計	14,251,995		157,016,313.24 (15,695,350,671)	
合計	100,935,456		131,065,796,101 (131,065,796,101)	

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨		口数(口)	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN TOWER CORP	31,800.00	2,094,030.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	75,500.00	1,253,300.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,600.00	1,072,664.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,200.00	1,269,410.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000.00	641,070.00	
	DUKE REALTY CORP	19,400.00	267,526.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	24,600.00	1,527,168.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,300.00	525,707.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	33,100.00	562,038.00	
	HCP INC	32,700.00	1,350,510.00	
	HEALTH CARE REIT INC	17,100.00	951,273.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	59,200.00	893,328.00	
	KIMCO REALTY CORP	34,700.00	630,846.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,900.00	312,390.00	
	MACERICH CO/THE	10,800.00	629,640.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,300.00	492,366.00	
	PROLOGIS INC	36,700.00	1,166,326.00	
	PUBLIC STORAGE	11,800.00	1,568,338.00	
	RAYONIER INC	10,650.00	457,204.50	
	REGENCY CENTERS CORP	7,700.00	340,263.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,900.00	3,561,817.00	
VENTAS INC	22,500.00	1,310,175.00		
VORNADO REALTY TRUST	12,900.00	1,073,796.00		
WEYERHAEUSER CO	43,700.00	870,067.00		
投資証券 小計		565,050.00	24,821,252.50 (1,978,005,611)	
アメリカドル 小計		565,050.00	24,821,252.50 (1,978,005,611)	
オーストラリアドル				
投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	174,816.00	328,654.08	
	DEXUS PROPERTY GROUP	452,999.00	423,554.06	
	GOODMAN GROUP	125,866.00	429,203.06	
	GPT GROUP	144,101.00	461,123.20	
	MIRVAC GROUP	271,719.00	338,290.15	
	STOCKLAND	189,465.00	596,814.75	
	WESTFIELD GROUP	178,065.00	1,615,049.55	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	250,831.00	669,718.77	
投資証券 小計		1,787,862.00	4,862,407.62 (378,781,553)	
オーストラリアドル 小計		1,787,862.00	4,862,407.62 (378,781,553)	
イギリスポンド				
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	69,938.00	347,451.98	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	50,078.00	160,349.75	
	HAMMERSON PLC	57,875.00	244,464.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	64,190.00	457,995.65	
	SEGRO PLC	57,308.00	127,281.06	
投資証券 小計		299,389.00	1,337,542.44 (166,978,798)	
イギリスポンド 小計		299,389.00	1,337,542.44 (166,978,798)	
香港ドル				
投資証券	LINK REIT	197,000.00	5,890,300.00	
	投資証券 小計	197,000.00	5,890,300.00 (60,434,478)	
香港ドル 小計		197,000.00	5,890,300.00 (60,434,478)	
シンガポールドル				
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	195,000.00	389,025.00	
	CAPITAMALL TRUST	201,000.00	355,770.00	
投資証券 小計		396,000.00	744,795.00 (46,512,447)	
シンガポールドル 小計		396,000.00	744,795.00 (46,512,447)	
ユーロ				

投資証券	CORIO NV	5,100.00	172,533.00	
	FONCIERE DES REGIONS	2,779.00	149,649.15	
	GECINA SA	2,212.00	154,087.92	
	ICADE	1,941.00	122,865.30	
	KLEPIERRE	7,368.00	181,510.68	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,170.00	972,610.50	
投資証券 小計		26,570.00	1,753,256.55 (175,255,524)	
ユーロ 小計		26,570.00	1,753,256.55 (175,255,524)	
合 計			2,805,968,411 (2,805,968,411)	

(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 555銘柄	97.53%		58.45%
	投資証券 24銘柄		2.47%	1.48%
カナダドル	株式 95銘柄	100.00%		5.47%
	投資証券 8銘柄		7.44%	0.28%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	92.56%		3.52%
	投資証券 8銘柄		7.44%	0.28%
イギリスポンド	株式 100銘柄	98.80%		10.23%
	投資証券 5銘柄		1.20%	0.12%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.00%		3.83%
香港ドル	株式 36銘柄	96.55%		1.26%
	投資証券 1銘柄		3.45%	0.05%
シンガポールドル	株式 25銘柄	95.73%		0.78%
	投資証券 2銘柄		4.27%	0.03%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%		0.05%
スウェーデンクローネ	株式 33銘柄	100.00%		1.37%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%		0.41%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.00%		0.54%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%		0.28%
ユーロ	株式 234銘柄	98.90%		11.72%
	投資証券 6銘柄		1.10%	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

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「マネー・プールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」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

	第 2 期	第 3 期
	[平成23年11月21日現在]	[平成24年5月21日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	211	286
親投資信託受益証券	83,917	113,921
流動資産合計	84,128	114,207
資産合計	84,128	114,207
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	84,039	114,039
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	89	168
(分配準備積立金)	89	129
元本等合計	84,128	114,207
純資産合計	84,128	114,207
負債純資産合計	84,128	114,207

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 2 期	第 3 期
	自 平成23年 5月21日 至 平成23年11月21日	自 平成23年11月22日 至 平成24年 5月21日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益	41	40
営業収益合計	41	40
営業費用		
営業費用合計		
営業利益	41	40
経常利益	41	40
当期純利益	41	40
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		
期首剰余金又は期首欠損金()	48	89
剰余金増加額又は欠損金減少額		39
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		39
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()	89	168

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月20日および11月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成23年11月22日から平成24年5月21日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第 2 期 [平成23年11月21日現在]	第 3 期 [平成24年5月21日現在]
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	84,039円	84,039円 30,000円
2 受益権の総数	84,039口	114,039口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0011円 (10,011円)	1.0015円 (10,015円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 2 期 (自 平成23年5月21日 至 平成23年11月21日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	23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	18円
収益調整金額	C	
分配準備積立金額	D	48円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	89円
当ファンドの期末残存口数	F	84,039口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	10円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第 3 期 (自 平成23年11月22日 至 平成24年5月21日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	30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	10円
収益調整金額	C	39円
分配準備積立金額	D	89円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	168円
当ファンドの期末残存口数	F	114,039口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	14円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第2期 （自平成23年5月21日 至平成23年11月21日）	第3期 （自平成23年11月22日 至平成24年5月21日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 [平成23年11月21日現在]	第3期 [平成24年5月21日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第2期 [平成23年11月21日現在]	第3期 [平成24年5月21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	40	44
合計	40	44

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数(口)	評価額	備考
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	112,083	113,921	
	親投資信託受益証券 小計	112,083	113,921	
	合計	112,083	113,921	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

<参考>

当ファンドは「マネー・マーケット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。
なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「マネー・マーケット・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23年11月21日現在]	[平成24年5月21日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,204,819,256	647,903,487
国債証券	4,049,434,400	3,049,637,250
未収利息	2,711	1,492
流動資産合計	5,254,256,367	3,697,542,229
資産合計	5,254,256,367	3,697,542,229
負債の部		
流動負債		
未払金	199,948,400	
未払解約金	49,502,386	1,183,211
流動負債合計	249,450,786	1,183,211
負債合計	249,450,786	1,183,211
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,926,216,651	3,636,601,179
剰余金		
剰余金又は欠損金()	78,588,930	59,757,839
元本等合計	5,004,805,581	3,696,359,018
純資産合計	5,004,805,581	3,696,359,018
負債純資産合計	5,254,256,367	3,697,542,229

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月21日から11月20日まで、および11月21日から翌年5月20日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成23年11月21日現在]	[平成24年5月21日現在]
1 期首	平成23年5月21日	平成23年11月22日
期首元本額	1,680,677,409円	4,926,216,651円
期首からの追加設定元本額	5,881,072,414円	1,892,504,577円
期首からの一部解約元本額	2,635,533,172円	3,182,120,049円
元本の内訳*		
三菱UFJ DC金利連動アロケーション型バランス ファンド	110,695,445円	120,912,458円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド（毎月決算 型）	24,866,713円	24,866,713円
ファンド・マネジャー（新興国株式）	32,418円	32,418円
ファンド・マネジャー（新興国債券）	308,759円	308,759円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<円 コース>（毎月分配型）	34,487,026円	38,059,510円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米 ドルコース>（毎月分配型）	1,056,774円	997,724円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ< ユーロコース>（毎月分配型）	711,530円	170,286円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪 ドルコース>（毎月分配型）	96,804,041円	126,013,765円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブ ラジルリアルコース>（毎月分配型）	585,321,107円	584,396,001円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<南 アフリカランドコース>（毎月分配型）	1,649,246円	724,288円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<ト ルコリラコース>（毎月分配型）	1,371,762円	1,480,020円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーブルファンド>	3,854,335,030円	2,286,763,308円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<中 国元コース>（毎月分配型）	414,126円	197,649円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<イ ンドネシアルピアコース>（毎月分配型）	2,830,885円	2,712,786円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーブル・ ファンド	14,048,270円	12,374,921円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円 コース>（毎月分配型）	1,083,960円	641,165円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪 ドルコース>（毎月分配型）	2,659,524円	2,807,148円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブ ラジルリアルコース>（毎月分配型）	2,689,118円	2,571,019円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<新 興国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	1,862,156円	1,694,849円
米国ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーブルファンド>	19,083,430円	18,332,232円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<資 源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	1,853,418円	1,784,527円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド	39,552,564円	68,417,834円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド	1,583,306円	1,081,386円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドル コース>（毎月分配型）	30,925,208円	55,440,512円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<ブラジ ルリアルコース>（毎月分配型）	2,471,651円	2,363,393円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択 シリーズ<円コース>（毎月分配型）	1,306,820円	929,681円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択 シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	9,968,866円	6,098,505円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択 シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	24,453,129円	12,197,893円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択 シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配 型）	10,657,509円	5,416,358円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択 シリーズ<マネーブルファンド>	21,108,002円	3,505,646円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シ リーズ<円コース>（毎月分配型）	1,732,625円	19,365,265円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シ リーズ<米ドルコース>（毎月分配型）	39,378円	501,843円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シ リーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	88,601円	3,276,715円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シ リーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	68,912円	4,929,750円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シ リーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	118,134円	560,929円

三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<アジアバスケット通貨コース>（毎月分配型）	206,735円	1,613,828円
三菱UFJ 新興国高利回り社債ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	981,965円	3,250,307円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>（毎月分配型）	1,850,576円	2,221,253円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ユーロコース>（毎月分配型）	19,687円	42,187円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>（毎月分配型）	19,687円	31,180円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>（毎月分配型）	19,687円	35,726円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<資源国バスケット通貨コース>（毎月分配型）	59,111円	67,305円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネープールファンド>	981,885円	981,935円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<円コース>		19,109,690円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<米ドルコース>		1,879,348円
通貨選択型CTAマルチ・マネジャー・ファンド<豪ドルコース>		7,812,992円
N a v i o インド債券ファンド		885,566円
N a v i o マネープールファンド		1,005,262円
マネープールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	82,596円	112,083円
MUAMトピックスリスクコントロール（5%）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）		162,554,068円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Aコース（為替ヘッジなし）	17,602,869円	16,982,851円
ピムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース（為替ヘッジあり）	2,152,410円	6,088,342円
（合計）	4,926,216,651円	3,636,601,179円
2 受益権の総数	4,926,216,651口	3,636,601,179口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0160円 （10,160円）	1.0164円 （10,164円）

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	（自平成23年5月21日 至平成23年11月21日）	（自平成23年11月22日 至平成24年5月21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、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	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23年11月21日現在]	[平成24年5月21日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種 類	[平成23年11月21日現在]	[平成24年5月21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)
国債証券	55,250	14,291
合計	55,250	14,291

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項
 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。

（3）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	券面総額	評 価 額	備 考
国債証券	第222回国庫短期証券	50,000,000	49,983,550	
	第261回国庫短期証券	400,000,000	399,993,200	
	第262回国庫短期証券	400,000,000	399,986,800	
	第264回国庫短期証券	400,000,000	399,978,800	
	第265回国庫短期証券	200,000,000	199,985,600	
	第269回国庫短期証券	200,000,000	199,978,000	
	第273回国庫短期証券	600,000,000	599,909,400	
	第277回国庫短期証券	300,000,000	299,938,200	
	第279回国庫短期証券	300,000,000	299,932,500	
	第281回国庫短期証券	200,000,000	199,951,200	
	国債証券 小計	3,050,000,000	3,049,637,250	
	合計	3,050,000,000	3,049,637,250	

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。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産総額	1,887,417,082
負債総額	22,826,632
純資産総額(-)	1,864,590,450
発行済口数	2,000,000 口
1口当たり純資産価額(/)	932.30 (100口当たり 93,230)

<参考>

「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)」の現況
純資産額計算書

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産総額	1,860,438,621
負債総額	187,013
純資産総額(-)	1,860,251,608
発行済口数	1,996,667,422 口
1口当たり純資産価額(/)	0.9317 (1万口当たり 9,317)

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産総額	140,932,215,510
負債総額	121,004,431
純資産総額(-)	140,811,211,079
発行済口数	148,123,135,907 口
1口当たり純資産価額(/)	0.9506 (1万口当たり 9,506)

<参考>

「マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)」の現況
純資産額計算書

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産総額	114,218
負債総額	
純資産総額(-)	114,218
発行済口数	114,039 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0016 (1万口当たり 10,016)

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成24年6月29日現在
(単位：円)

資産総額	3,549,862,160
負債総額	30
純資産総額(-)	3,549,862,130
発行済口数	3,492,099,946 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0165 (1万口当たり 10,165)

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

<訂正前>

平成23年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

<訂正後>

平成24年6月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

<訂正前>

(略)

ファンドの運用体制等は平成23年12月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

(略)

ファンドの運用体制等は平成24年6月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年6月29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	385	5,532,015
追加型公社債投資信託	18	455,151
単位型株式投資信託	8	29,822
単位型公社債投資信託	6	101,364
合計	417	6,118,352

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】

<更新後>

(1) 財務諸表の作成方法について

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

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

(2) 監査証明について

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

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,528	79,079
未払金		
未払収益分配金	245,085	185,817
未払償還金	1,328,820	1,159,445
未払手数料	2 1,768,519	2 1,557,726
その他未払金	104,042	50,899
未払費用	2 1,240,586	2 1,174,572
未払消費税等	184,873	63,602
未払法人税等	2,228,870	1,532,874
賞与引当金	550,000	520,000
その他	227,518	278,521
流動負債合計	7,925,844	6,602,539
固定負債		
退職給付引当金	105,461	119,902
役員退職慰労引当金	76,024	49,735
時効後支払損引当金	196,123	195,228
固定負債合計	377,609	364,866
負債合計	8,303,454	6,967,405
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計	42,243,903	44,203,921
株主資本合計	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券	391,537	723,054
評価差額金		
評価・換算差額等合計	391,537	723,054
純資産合計	44,857,668	47,149,203
負債純資産合計	53,161,123	54,116,609

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計		
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	31,383,254	34,903,313
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計		
当期首残高	38,723,843	42,243,903
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	42,243,903	44,203,921
株主資本合計		
当期首残高	40,946,071	44,466,131
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,277,237	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	885,699	331,516
当期変動額合計	885,699	331,516
当期末残高	391,537	723,054
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	62,258	

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

(4) 時効後支払損引当金

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

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

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

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

2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,841,844千円
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1日

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

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

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

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第26期(平成23年3月31日現在)

(単位:千円)

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

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

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

(4) 長期性預金

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

(5) 投資有価証券

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

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
非上場株式	264,257	38,900
子会社株式	431,812	160,600
関連会社株式	-	159,536

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

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

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

第27期（平成24年3月31日現在）

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式431,812千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	4,026,733	3,476,499	550,234
	小計	4,026,733	3,476,499	550,234
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,114,022	5,236,164	122,142
	小計	5,114,022	5,236,164	122,142
	合計	9,140,755	8,712,663	428,091

第27期（平成24年3月31日現在）

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

3. 売却したその他有価証券

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,283,999	392,809	127,114
合計	4,283,999	392,809	127,114

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

(デリバティブ取引関係)
重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注)「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

(2) 割引率

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

(3) 期待運用収益率

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

(4) 数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）及び第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）
当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高	
主要株主	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業 銀行業	被所有 直接 30.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円	
							事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
							投資の助言	投資助言料	189,915 千円	未払費用	88,454 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円	
							取引銀行	譲渡性預金の預入	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
								譲渡性預金に係る受取利息	8,718 千円	未収利息	675 千円
								マルチコーラブル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
								マルチコーラブル預金に係る受取利息	18,499 千円	未収利息	3,069 千円
								長期性預金	7,000,000 千円		

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	------	----	------

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円
						事務所の賃借	事務所賃借 料	667,780 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却	98,112 千円		
主要株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円
						取引銀行	譲渡性預金 の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金 に係る受取 利息	6,532 千円	未収利息	544 千円
							マルチコー ラブル預金 の預入	7,000,000 千円	現金及び 預金	5,500,000 千円
							マルチコー ラブル預金 に係る受取 利息	24,415 千円	長期性預金	8,500,000 千円
			未収利息	2,886 千円						

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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

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

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	3,000 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,447,569 千円	未払手数料	408,084 千円

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

(1株当たり情報)

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

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

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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	6,361,903	5,149,336
期中平均株式数(株)	124,098	124,098

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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

< 訂正前 >

(略)

資本金の額：324,279百万円（平成23年9月末現在）

(略)

< 訂正後 >

(略)

資本金の額：324,279百万円（平成24年3月末現在）

(略)

(2) 販売会社

< 更新後 >

名称	資本金の額 (平成24年3月末現在)	事業の内容
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 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。
クレディ・スイス証券株式会社	78,100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社	62,100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3【資本関係】

< 訂正前 >

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23年12月末現在）

(略)

< 訂正後 >

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24年6月末現在）

(略)

独立監査人の監査報告書

平成24年7月11日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成23年12月9日から平成24年6月8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、MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成24年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月26日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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