

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年3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）

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信(「ファンド」といいます。)

「MAXIS(マクシス)」は三菱UFJ投信が運用するETF(上場投資信託)シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高(MAX)の品質」と「お客様の投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJ投信の思いが込められています。

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1,000円です。

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

なお、原則、取得申込受付日の前営業日の午後3時までに受け付けた取得申込み(当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの)を当該取得申込受付日の申込みとします。

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

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

なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。

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

(5) 【申込手数料】

販売会社が定める額

消費税および地方消費税に相当する金額(「消費税等相当額」といいます。)がかかります。

申込手数料は販売会社にご確認ください。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

(6) 【申込単位】

10万口の整数倍で販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

(7) 【申込期間】

平成25年3月8日から平成26年3月7日までです。

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（ 8 ）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ投信株式会社

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

（ 9 ）【払込期日】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

払込期日は販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。ファンドの分配金、償還金、解約代金は、社振法および振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

（ 12 ）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数（MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス））を円換算した値の変動率に一致させることを目的として運用を行います。

信託金の限度額は、1兆円です。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

です。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本円換算した対象指数（MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス））の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

< 投資方針 >

日本円換算したMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）に連動する成果をめざして運用を行います。

ファンドの1口当たりの純資産額の変動率をMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）の変動率に一致させることを目的として、実質的に海外の株式に対する投資として運用を行います。

< MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）について >

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されています。

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）は、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

原則として、わが国における計算日の午前10時の対顧客電信売買相場の仲値により円換算

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）の算出要綱

http://www.msribarra.com/products/indices/global_equity_indices/gimi/stdindex/methodology.html

以下を選択してご覧ください。

- ・ MSCI Index Calculation Methodology
- ・ MSCI Global Investable Market Indices Methodology

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）のインデックスデータ

http://www.msribarra.com/products/indices/international_equity_indices/gimi/stdindex/performance.html

データを取得する際には、下記の通り選択してください。

Market : Developed Markets (DM)
Currency : USD
Index Level : Price
Size : Standard (Large+Mid Cap)
Style : None

< 為替対応方針 >

- ・ 原則として、為替ヘッジを行いません。
為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

< ファンドの仕組み >

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



< 上場投信の仕組み >

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は10口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

< 上場される金融商品取引所 >

- ・東京証券取引所（2010年11月25日に新規上場）

< 主な投資制限 >

- ・外貨建資産への直接投資は行いません。
- ・投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

< 分配方針 >

- ・年2回の決算時（6・12月の各8日）に分配を行います。
- ・分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- ・分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

「MAXIS（マクシス）」の由来

「MAXIS（マクシス）」は三菱UFJ投信が運用するETF（上場投資信託）シリーズの統一ブランドです。このブランドには、「最高（MAX）の品質」と「お客様の投資の中心軸（AXIS）」をめざすという三菱UFJ投信の思いが込められています。

「MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス)」の著作権等について

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

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

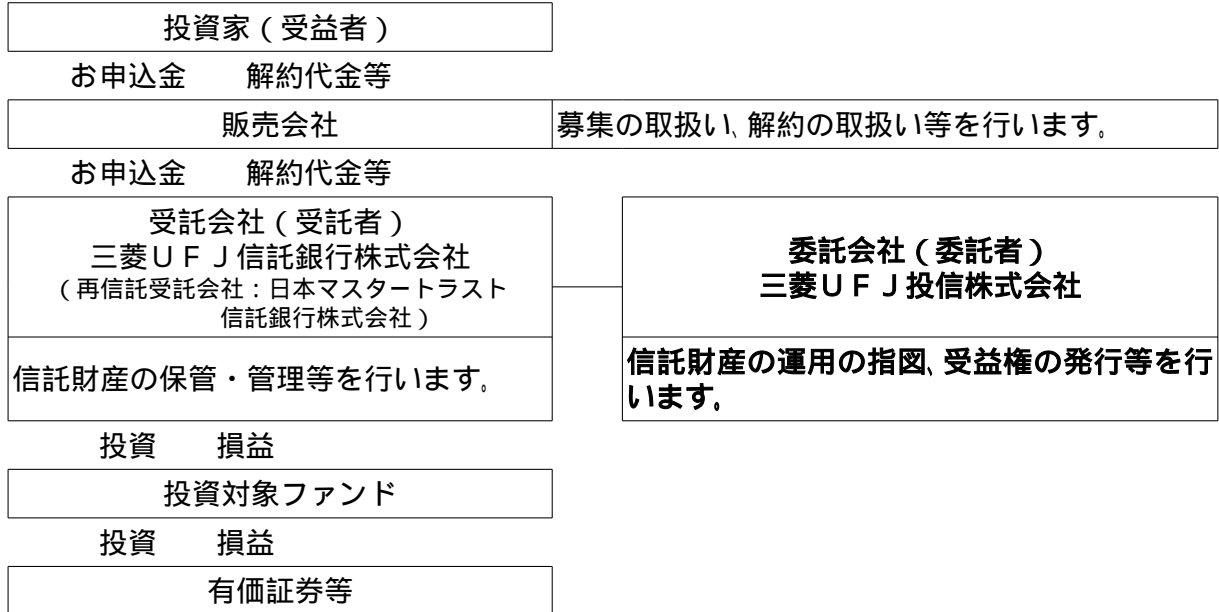
(2) 【ファンドの沿革】

平成22年11月22日 設定日、信託契約締結、運用開始

平成22年11月25日 ファンドの受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況

- ・ 資本金
2,000百万円（平成24年12月末現在）
- ・ 沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
- ・ 大株主の状況（平成24年12月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を、対象指数を円換算した値の変動率に一致させることを目的として、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。））ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に対する投資として運用を行います。

信託財産の成長をめざすため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視し、「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）」を選定しました。

円の余裕資金を効率よく運用するため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視し、「マネーボールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」を選定しました。

別に定める投資信託証券については、見直しを行う場合があります。この際、新たな投資信託証券（ファンド設定以降に新設された投資信託および投資法人にかかる投資信託証券を含みます。）を追加することや、既に指定されていた投資信託証券を除外することがあります。

投資信託証券の合計組入比率は高位を保つことを原則とします。

実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券のほか、次に掲げるものとします。なお、当該有価証券は本邦通貨表示のものに限ります。

１．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

２．コマーシャル・ペーパー

３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、２．の証券の性質を有するもの

４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、１．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

< 投資信託証券の概要 >

ファンド名	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）
形態	証券投資信託
投資対象	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ます。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。

投資態度	<p>外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式に実質的な投資を行い、MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース) に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <p>市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。</p>
投資制限	<p>株式への実質投資割合に制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。</p> <p>有価証券先物取引等を行うことができます。</p> <p>スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。</p> <p>外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。</p>
信託報酬	純資産総額の年0.105% (税込)
申込手数料	申込手数料はかかりません。
信託財産留保額	基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJ投信株式会社
設定日	平成22年11月24日
決算日	原則として毎年5月および11月の25日
分配方針	<p>分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>

ファンド名	外国株式インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資対象	MSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース) に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>投資成果をMSCI Kokusai Index (MSCIコクサイ インデックス) (円換算ベース) の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> 株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <p>なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。</p>

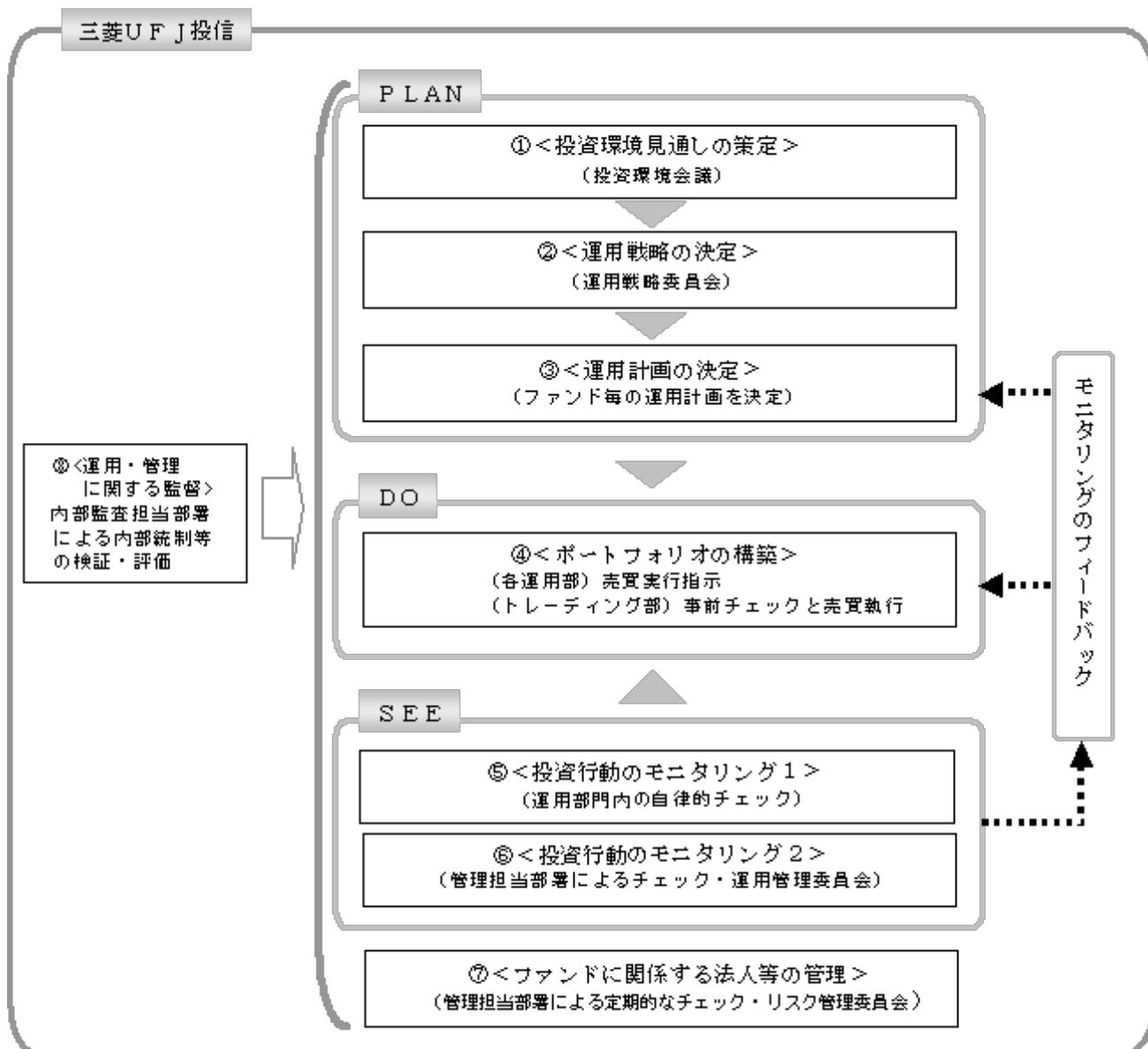
投資制限	株式への投資割合に制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 有価証券先物取引等を行うことができます。 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
信託報酬	信託報酬はかかりません。
申込手数料	申込手数料はかかりません。
信託財産留保額	基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJ投信株式会社
設定日	平成13年12月5日
決算日	原則として毎年5月12日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	マネープールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）
形態	証券投資信託
投資対象	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ます。 なお、わが国の公社債等に直接投資することがあります。
投資態度	マネー・マーケット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債等に実質的な投資を行い、利子等収益の確保を図ります。なお、わが国の公社債等に直接投資することがあります。 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
投資制限	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 有価証券先物取引等を行うことができます。 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
信託報酬	純資産総額の年0.0315%（税込）
申込手数料	申込手数料はかかりません。
信託財産留保額	信託財産留保額はかかりません。
投資運用会社	三菱UFJ投信株式会社
設定日	平成22年11月24日
決算日	原則として毎年5月および11月の20日

分配方針	分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
------	--

ファンド名	マネー・マーケット・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資対象	わが国の公社債等を主要投資対象とします。
投資態度	わが国の短期公社債等を中心に投資し、利子等収益の確保を図ります。 なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
投資制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 有価証券先物取引等を行うことができます。 スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 金利先渡取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
信託報酬	信託報酬はかかりません。
申込手数料	申込手数料はかかりません。
信託財産留保額	信託財産留保額はかかりません。
投資運用会社	三菱UFJ投信株式会社
設定日	平成17年3月4日
決算日	原則として毎年5月および11月の20日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

(3) 【運用体制】

**投資環境見通しの策定**

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部

署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(5名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成25年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。

(4) 【分配方針】

毎決算時に、経費等控除後の配当等収益(利子およびこれに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。)の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

売買益(評価益を含みます。)からの分配は行いません。

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

(5) 【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は行いません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

信用取引

信用取引の指図は行いません。

公社債の借入れ

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

資金の借入れ

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

3 【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

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

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

市場リスク

（価格変動リスク）

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

（為替変動リスク）

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・当ファンドが実質的な投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、換金時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・当ファンドは、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行いますが、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数における各銘柄の構成比率と当ファンドにおける各銘柄の組入比率が完全に一致しないこと、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・当ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格は当ファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、当ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

（2）投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

市場リスク

（価格変動リスク・為替変動リスク）

市場リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、市場リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、市場リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

販売会社が定める額

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）がかかります。

申込手数料は販売会社にご確認ください。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJ投信株式会社

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

（2）【換金（解約）手数料】

解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1%）が差し引かれます。

また、販売会社は、受益者が解約請求を行うときは、当該受益者から販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を徴収することができるものとします。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

（3）【信託報酬等】

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

信託財産の純資産総額 × 年0.1575%（税抜 年0.15%）以内の率

（平成25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25年3月8日現在）

委託会社	受託会社
年0.1155% （税抜 年0.11%）	年0.042% （税抜 年0.04%）

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率（上限値）は、次の通りとなります。

年0.2625%（税込）

（注）上記上限値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです。各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることから、実質的な信託報酬率は変動します。したがって事前に固定の料率、上限額等を表示することはできません。

<ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬率>

投資信託証券の名称	信託報酬率(税込)
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)	年0.105%
マネーブルファンド(F O F s 用) (適格機関投資家限定)	年0.0315%

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。申込手数料はかかりません。

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、投資信託証券の売却に伴う信託財産留保額、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および借入れに係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が含まれます。

受益権の上場に係る費用(平成25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25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。

(*) 上記 から の「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

売却価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得として課税されます。

10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率 による申告分離課税が適用されます。

特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率 で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、10.147%(所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率 で源泉徴収(申告不要)されます。

なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除は適用されません。)・申告分離課税を選択することもできます。

3. 受益権の解約時および償還時

上記1.と同様の取扱いとなります。

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

平成26年1月1日以降の税率は、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)となる予定です。

法人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

2. 収益分配金の受取り時

7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

3. 受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記1.と同様の取扱いとなります。

平成26年1月1日以降の税率は、15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となる予定です。

上記は平成25年1月1日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

日本以外の国・地域にお住まいの方が取得された場合、いわゆる租税条約および関連規定により、日本国外の税当局に対してファンド受益者に関する報告義務が発生することとなる可能性があります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成24年12月28日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	2,049,419,222	99.82
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,613,658	0.18
純資産総額		2,053,032,880	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12月28日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	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		1,797,662,287	1.0728 1.1400	1,928,532,101 2,049,335,007		99.82
日本	マネーブルファンド(FOFs 用)(適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券		84,039	1.0021 1.0021	84,215 84,215		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12月28日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

(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12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
第4計算期間末日 (平成24年12月8日)	1,948,672,999 (分配付) 1,932,472,999 (分配落)	1,082.60 (分配付) 1,073.60 (分配落)	1,075
平成23年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
7月末日	1,934,123,395	967.06	971
8月末日	1,976,530,890	988.27	995

9月末日	1,934,127,416	1,017.96	1,024
10月末日	1,858,391,377	1,032.44	1,042
11月末日	1,934,621,236	1,074.79	1,072
12月末日	2,053,032,880	1,140.57	1,139

【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
第4計算期間	9円00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
第4計算期間	16.44

(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
第4計算期間		200,000	1,800,000

< 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12月28日現在
（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,049,282,106	100.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		95,597	0.00
純資産総額		2,049,377,703	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12月28日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	外国株式インデックスマ ザーファンド	親投資信託 受益証券		1,743,476,354	1.0959 1.1754	1,910,675,737 2,049,282,106		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12月28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12月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	85,802,734,329	54.40
	イギリス	16,109,372,342	10.21
	カナダ	8,201,278,298	5.20
	フランス	6,432,216,830	4.08
	ドイツ	6,369,475,393	4.04
	スイス	6,327,194,270	4.01
	オーストラリア	5,952,188,229	3.77
	スウェーデン	2,282,536,264	1.45
	スペイン	2,216,536,815	1.41
	香港	2,193,579,582	1.39
	オランダ	2,007,019,119	1.27
	イタリア	1,585,480,701	1.01
	シンガポール	1,272,427,978	0.81
	ベルギー	854,101,673	0.54
	デンマーク	844,586,025	0.54
	ノルウェー	674,374,704	0.43
	フィンランド	583,589,077	0.37
	イスラエル	388,893,706	0.25
	ルクセンブルグ	229,574,406	0.15
	オーストリア	218,689,185	0.14
	アイルランド	188,280,431	0.12
	ポルトガル	125,337,575	0.08
	ニュージーランド	89,859,069	0.06
ギリシャ	32,573,940	0.02	
投資証券	アメリカ	2,454,503,084	1.56
	オーストラリア	471,199,510	0.30
	フランス	220,602,137	0.14
	イギリス	199,362,894	0.13
	香港	76,528,462	0.05
	シンガポール	75,158,096	0.05
	カナダ	35,887,842	0.02
	オランダ	20,697,611	0.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,198,354,231	1.99
純資産総額		157,734,193,808	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12月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	2,350,354,881	1.49

(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12月28日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	71,500	49,087.39 44,593.89	3,509,748,871 3,188,463,478		2.02
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	352,300	7,187.87 7,520.33	2,532,287,164 2,649,415,359		1.68
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	805,300	1,645.88 1,791.34	1,325,431,834 1,442,566,263		0.91
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	149,900	8,882.24 9,395.66	1,331,448,105 1,408,409,673		0.89
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	245,850	5,230.88 5,679.76	1,286,013,814 1,396,370,225		0.89
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	82,800	17,396.51 16,684.83	1,440,431,806 1,381,504,073		0.88
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	575,700	2,690.90 2,334.19	1,549,154,814 1,343,797,097		0.85
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	439,800	2,909.08 2,914.28	1,279,416,902 1,281,701,575		0.81
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	210,200	5,558.43 6,068.39	1,168,383,247 1,275,576,040		0.81
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,395,300	770.15 909.67	1,074,590,853 1,269,263,109		0.80
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	569,600	1,959.30 2,176.62	1,116,020,355 1,239,803,435		0.79
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	210,100	5,509.95 5,884.84	1,157,640,747 1,236,405,430		0.78
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	20,000	52,360.98 61,150.58	1,047,219,732 1,223,011,764		0.78
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	382,600	2,877.05 2,959.30	1,100,760,630 1,132,229,863		0.72
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	289,400	3,187.00 3,777.48	922,320,636 1,093,204,274		0.69
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	309,500	3,348.04 3,153.24	1,036,221,041 975,928,894		0.62
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	175,450	4,716.53 5,475.73	827,515,188 960,716,828		0.61
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	53,650	14,887.91 17,622.93	798,736,478 945,470,194		0.60
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	128,500	7,450.20 7,252.80	957,351,856 931,985,648		0.59
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,454,800	577.61 597.77	840,311,101 869,640,800		0.55
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	297,800	2,337.66 2,880.51	696,155,148 857,817,843		0.54
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	283,300	2,879.69 2,994.09	815,816,970 848,228,303		0.54
アメリカ	WAL-MART STORES INC	株式	食品・生活必需品 小売り	142,134	5,161.89 5,903.89	733,681,437 839,143,529		0.53
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	232,200	3,291.77 3,567.09	764,349,365 828,279,691		0.53
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	3,757,528	238.57 217.72	896,468,024 818,092,602		0.52
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	217,100	3,564.49 3,764.49	773,852,646 817,272,602		0.52
オーストラリア	BHP BILLITON LTD	株式	素材	246,000	3,072.95 3,321.70	755,947,176 817,138,692		0.52
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	各種金融	822,000	651.94 993.07	535,900,762 816,305,677		0.52
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	223,700	2,531.59 3,398.26	566,318,741 760,191,880		0.48
フランス	SANOFI	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	91,186	6,418.02 8,276.32	585,233,982 754,685,108		0.48

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成24年12月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	10.89
	素材	6.86
	資本財	7.26
	商業・専門サービス	0.92
	運輸	1.73
	自動車・自動車部品	1.43
	耐久消費財・アパレル	1.43
	消費者サービス	1.62
	メディア	2.70
	小売	2.88
	食品・生活必需品小売り	2.28
	食品・飲料・タバコ	6.73
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	2.62
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.09
	銀行	7.85
	各種金融	4.83
	保険	4.26
	不動産	0.74
	ソフトウェア・サービス	6.01
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.24
	電気通信サービス	3.72
	公益事業	3.45
半導体・半導体製造装置	1.37	
小計	95.72	
投資証券		2.25
合計		97.97

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成24年12月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引								
S&P 500 (2013年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	45	アメリカドル	16,160,985.00	15,870,375.00	1,374,057,067	0.87
FTSE100 (2013年3月限)	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	29	イギリスポンド	1,712,022.50	1,715,930.00	239,406,553	0.15
SP/TSE60 (2013年3月限)	モントリオール取引所	買建	10	カナダドル	1,412,137.50	1,414,000.00	123,088,700	0.08
SPI 200 (2013年3月限)	シドニー先物取引所	買建	15	オーストラリアドル	1,712,560.00	1,735,500.00	155,847,900	0.10
EURO ST (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	125	ユーロ	3,301,343.75	3,317,500.00	380,550,425	0.24
SWISS IX (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	12	スイスフラン	821,895.00	815,640.00	77,404,236	0.05

(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12月28日現在
(単位:円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	118,466	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		297	0.25
純資産総額		118,763	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12月28日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	マネー・マーケット・マザー ファンド	親投資信託 受益証券		116,475	1.0169 1.0171	118,443 118,466		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12月28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12月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	2,399,674,100	86.49
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		374,990,871	13.51
純資産総額		2,774,664,971	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12月28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327回国庫短期証券	国債証券		600,000	99.97 99.9846	599,843,400 599,907,600	2013/03/04	21.62
日本	第324回国庫短期証券	国債証券		500,000	99.97 99.9865	499,869,500 499,932,500	2013/02/25	18.02
日本	第321回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9901	299,932,500 299,970,300	2013/02/12	10.81
日本	第330回国庫短期証券	国債証券		300,000	99.97 99.9808	299,924,400 299,942,400	2013/03/18	10.81
日本	第328回国庫短期証券	国債証券		200,000	99.97 99.9827	199,948,200 199,965,400	2013/03/11	7.21
日本	第313回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9983	99,986,500 99,998,300	2013/01/10	3.60
日本	第317回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9961	99,983,500 99,996,100	2013/01/21	3.60
日本	第319回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.98 99.9942	99,981,600 99,994,200	2013/01/28	3.60
日本	第323回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9884	99,975,800 99,988,400	2013/02/18	3.60
日本	第332回国庫短期証券	国債証券		100,000	99.97 99.9789	99,975,000 99,978,900	2013/03/25	3.60

(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12月28日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	86.49
合計	86.49

(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。

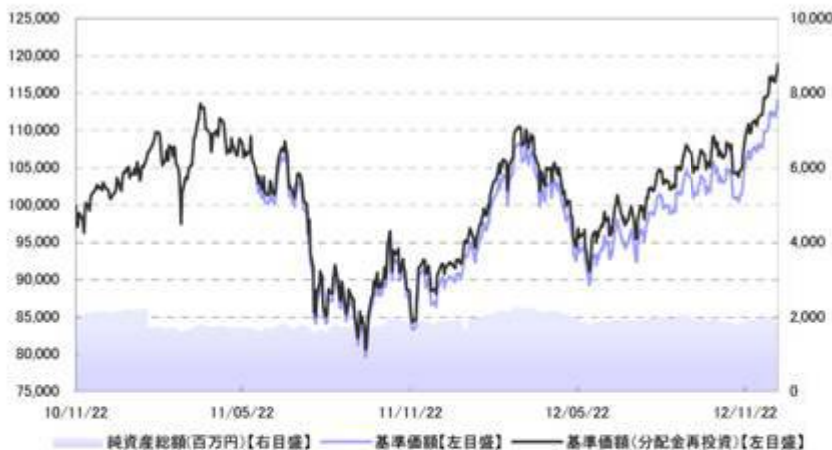
その他投資資産の主要なもの

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12月28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)を再投資したもとして計算

2 分配の推移

2012年12月	900円
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	4,040円

・分配金は100口当たり、税引前

3 主要な資産の状況(2012年12月28日現在)

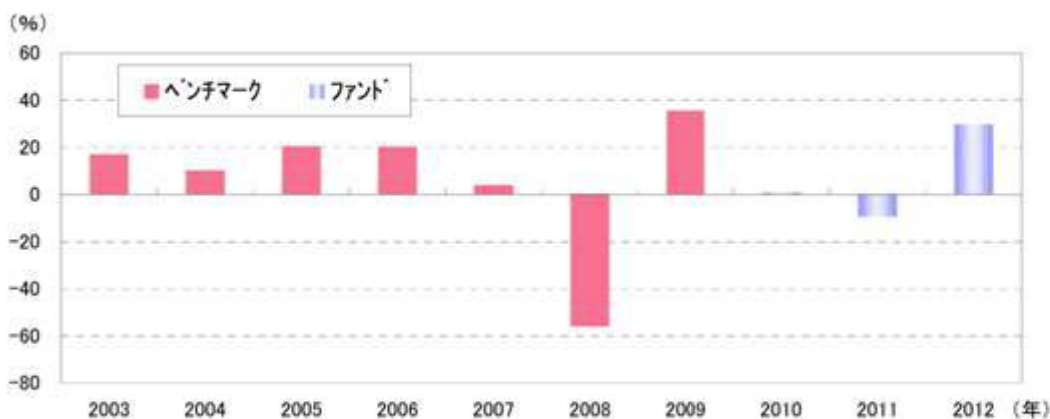
通貨別構成	比率
アメリカドル	56.8%
ユーロ	13.6%
イギリスポンド	10.5%
カナダドル	5.3%
オーストラリアドル	4.1%
スイスフラン	4.1%
スウェーデンクローネ	1.5%
香港ドル	1.4%
その他	2.7%
合計	100.0%

	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.0%
2	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.7%
3	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	0.9%
4	CHEVRON CORP	エネルギー	アメリカ	0.9%
5	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.9%
6	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
7	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
8	AT&T INC	電気通信サービス	アメリカ	0.8%
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	0.8%
10	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	イギリス	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	1.5%

・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】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	<p>原則、取得申込受付日の前営業日の午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該取得申込受付日の申込みとします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。</p> <p>ただし、以下の日は申込みができません。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ニューヨーク証券取引所の休業日、ニューヨークの銀行の休業日、ロンドン証券取引所の休業日、ロンドンの銀行の休業日 2. 毎月の最初の営業日から起算して3営業日以内 3. 毎月の最終営業日の4営業日前から起算して5営業日以内 4. 計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内） 5. ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間 6. 委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき <p>なお、委託会社は、2. から6. に定める日の申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における申込みについては、申込みの受付を行うことができます。</p>
申込単位	10万口の整数倍で販売会社が定める単位
申込価額	取得申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	<p>申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。</p> <p>また、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</p> <p>なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>
申込手数料	<p>販売会社が定める額</p> <p>消費税等相当額がかかります。</p> <p>申込手数料は販売会社にご確認ください。</p> <p>販売会社は、下記にてご確認ください。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</p>
申込方法	<p>取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。</p> <p>取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。</p> <p>取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。</p>
その他	<p>金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。</p> <p>ファンドの規模等を勘案し、1日当たり100億円に相当する口数を超える取得申込みを受け付けられない場合があります。なお、上限については、ファンドの規模等により、委託会社の判断で変更することがありますので、販売会社にご確認ください。</p>

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	<p>解約請求の翌営業日を受付日として、受益者は自己に帰属する受益権につき解約の請求ができます。原則、解約請求受付日の前営業日の午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該解約請求受付日の請求とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。</p> <p>ただし、以下の日は解約の請求ができません。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. ニューヨーク証券取引所の休業日、ニューヨークの銀行の休業日、ロンドン証券取引所の休業日、ロンドンの銀行の休業日 2. 毎月の最初の営業日から起算して3営業日以内 3. 毎月の最終営業日の2営業日前から起算して3営業日以内 4. 計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内） 5. ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間 6. 委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき <p>なお、委託会社は、2. から6. に定める日の解約請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における解約請求については、解約請求の受付を行うことができます。</p>
解約単位	10万口の整数倍で販売会社が定める単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.1%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	<p>解約価額は、販売会社にてご確認ください。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
その他	<p>委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。</p> <p>ファンドが実質的な運用を行う「外国株式インデックスマザーファンド」における運用状況・運用規模等を勘案し、委託会社の判断により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。</p> <p>当該マザーファンドの純資産総額の10%程度を大口の解約請求の制限の目安とします。受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。</p>

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数</p> <p>なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。</p> <p>(注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。</p> <p>(主な評価方法)</p> <table border="1"> <tr> <td colspan="2">投資信託証券</td> </tr> <tr> <td>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)</td> <td>原則として、計算日における基準価額で評価します。</td> </tr> <tr> <td>マネーパールファンド (F O F s 用) (適格機関投資家限定)</td> <td>原則として、計算日における前営業日の基準価額で評価します。</td> </tr> </table>	投資信託証券		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)	原則として、計算日における基準価額で評価します。	マネーパールファンド (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	原則として、計算日における前営業日の基準価額で評価します。
投資信託証券							
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)	原則として、計算日における基準価額で評価します。						
マネーパールファンド (F O F s 用) (適格機関投資家限定)	原則として、計算日における前営業日の基準価額で評価します。						
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。						
基準価額の照会方法	<p>基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。</p> <p>なお、下記においてもご照会いただけます。</p> <p>三菱UFJ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>						

(2)【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

(3)【信託期間】

信託期間	<p>平成22年11月22日から無期限</p> <p>ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。</p>
------	---

(4)【計算期間】

計算期間	<p>原則として、毎年6月9日から12月8日まで、および12月9日から翌年6月8日まで</p> <p>ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。</p>
------	---

(5)【その他】

ファンドの償還条件等	<p>委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還)</p> <ul style="list-style-type: none"> ・受益権の口数が10万口を下回ることとなったとき ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき <p>このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のとき、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止された場合、対象指数が廃止された場合、対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた当ファンドの信託約款の変更が書面決議により否決された場合は、原則として、ファンドを償還させます。</p> <p>なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止された場合によりファンドを償還するときには、その廃止された日にファンドを償還するための手続きを開始するものとします。</p> <p>委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。</p>
------------	---

信託約款の変更等	<p>委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。</p> <p>委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。</p>
ファンドの償還等に関する開示方法	<p>委託会社は、ファンドの任意償還、信託約款の変更のうち重大な内容の変更または併合について、書面による決議(「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発送します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。</p> <p>併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。</p>
金融商品取引所への上場	<p>委託会社は、ファンドの受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとなります。</p> <p>平成22年11月25日 東京証券取引所に上場</p> <p>委託会社は、ファンドの受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとし、</p>
反対者の買取請求権	<p>委託会社がファンドの任意償還、信託約款について重大な内容の変更または併合を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。</p>
関係法人との契約の更改	<p>委託会社と販売会社との間で締結された「上場投資信託の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。</p>
運用報告書の作成	<p>投資信託及び投資法人に関する法律により、当ファンドの運用報告書の作成・交付は行いません。</p>
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	<p>委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。</p>
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	<p>受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。</p>
信託事務処理の再信託	<p>受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。</p>

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

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

<p>収益分配金に対する請求権および名義登録</p>	<p>受益者（計算期間終了日において受益者名簿に名義登録^{（注）}されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式等により支払われます。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 <p>（注）受託会社は、ファンドに係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称および住所その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を、振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権に係る受益者として、その氏名または名称および住所その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。</p> <p>受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限ります。）を経由して受益者名簿に名義登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社（受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。</p> <p>名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。</p>
<p>償還金に対する請求権</p>	<p>受益者（信託終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・償還金は、原則として信託終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該償還金を振り込む方式により支払われます。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
<p>換金（解約）請求権</p>	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 <p>（「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）</p>

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの計算期間は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4期計算期間(平成24年6月9日から平成24年12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3期 [平成24年6月8日現在]	第4期 [平成24年12月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,909,169	5,737,425
投資信託受益証券	1,854,988,208	1,944,969,196
未収入金	23,266,236	-
未収利息	13	24
流動資産合計	1,884,163,626	1,950,706,645
資産合計	1,884,163,626	1,950,706,645
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,600,000	16,200,000
未払受託者報酬	426,457	407,022
未払委託者報酬	1,172,701	1,119,252
その他未払費用	539,524	507,372
流動負債合計	24,738,682	18,233,646
負債合計	24,738,682	18,233,646
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,000,000,000	1 1,800,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 140,575,056	2 132,472,999
(分配準備積立金)	68,154	165,623
元本等合計	1,859,424,944	1,932,472,999
純資産合計	1,859,424,944	1,932,472,999
負債純資産合計	1,884,163,626	1,950,706,645

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 3 期 自 平成23年12月 9日 至 平成24年 6月 8日	第 4 期 自 平成24年 6月 9日 至 平成24年12月 8日
営業収益		
受取配当金	24,745,851	18,496,887
受取利息	2,749	3,118
有価証券売買等損益	43,455,767	281,514,586
営業収益合計	68,204,367	300,014,591
営業費用		
受託者報酬	426,457	407,022
委託者報酬	1,172,701	1,119,252
その他費用	682,187	676,262
営業費用合計	2,281,345	2,202,536
営業利益	65,923,022	297,812,055
経常利益	65,923,022	297,812,055
当期純利益	65,923,022	297,812,055
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（ ）	195,131,078	140,575,056
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	20,937,000	8,564,000
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,564,000
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,937,000	-
分配金	22,600,000	16,200,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	140,575,056	132,472,999

(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。</p> <p>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>金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認め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)

	第 3 期 [平成24年6月8日現在]	第 4 期 [平成24年12月8日現在]
1 期首元本額	2,100,000,000円	2,000,000,000円
期中追加設定元本額	300,000,000円	
期中一部解約元本額	400,000,000円	200,000,000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。	140,575,056円	
3 受益権の総数	2,000,000口	1,800,000口
4 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	929.71円 (92,971円)	1,073.60円 (107,360円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第 4 期 (自 平成24年6月9日 至 平成24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	18,500,005円
分配準備積立金額	B	68,154円
配当等収益合計額	C=A+B	18,568,159円
経費	D	2,202,536円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	16,365,623円
収益分配金金額	F	16,200,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	165,623円
当ファンドの期末残存口数	H	1,800,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	900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3期 (自平成23年12月9日 至平成24年6月8日)	第4期 (自平成24年6月9日 至平成24年12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。	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、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、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 (2) 投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	また、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3期 [平成24年6月8日現在]	第4期 [平成24年12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。	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
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 [平成24年6月8日現在]	第4期 [平成24年12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	38,150,367	258,600,454
合計	38,150,367	258,600,454

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	口数	評価額	備考
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）	1,812,905,464	1,944,884,981	
	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	84,215	
	投資信託受益証券 小計	1,812,989,503	1,944,969,196	
	合計	1,812,989,503	1,944,969,196	

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「マネーパールファンド（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3期	第4期
	[平成24年5月25日現在]	[平成24年11月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,149,475	1,076,425
親投資信託受益証券	1,853,846,584	1,909,368,576
未収入金	120,546,541	18,580,886
未収利息	2	2
流動資産合計	1,975,542,602	1,929,025,889
資産合計	1,975,542,602	1,929,025,889
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	24,745,849	18,496,885
未払解約金	94,572,958	
未払受託者報酬	306,932	296,691
未払委託者報酬	751,405	726,323
流動負債合計	120,377,144	19,519,899
負債合計	120,377,144	19,519,899
純資産の部		
元本等		
元本	1,995,633,057	1,795,814,163
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	140,467,599	113,691,827
(分配準備積立金)	73,996,736	159,674,125
元本等合計	1,855,165,458	1,909,505,990
純資産合計	1,855,165,458	1,909,505,990
負債純資産合計	1,975,542,602	1,929,025,889

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自平成23年11月26日 至平成24年5月25日	自平成24年5月26日 至平成24年11月26日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	177	181
有価証券売買等損益	241,114,218	282,236,103
営業収益合計	241,114,395	282,236,284
営業費用		
受託者報酬	306,932	296,691
委託者報酬	751,405	726,323
営業費用合計	1,058,337	1,023,014
営業利益	240,056,058	281,213,270
経常利益	240,056,058	281,213,270
当期純利益	240,056,058	281,213,270
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	37,881,195	22,631,688
期首剰余金又は期首欠損金()	365,782,883	140,467,599
剰余金増加額又は欠損金減少額	72,013,284	15,990,299
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	15,990,299
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,127,014	1,915,570
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,127,014	1,915,570
分配金	1, 24,745,849	18,496,885
期末剰余金又は期末欠損金()	140,467,599	113,691,827

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月25日および11月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年5月26日から平成24年11月26日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 [平成24年5月25日現在]	第4期 [平成24年11月26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	2,094,640,590円 322,342,631円 421,350,164円	1,995,633,057円 26,312,761円 226,131,655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。	140,467,599円	
3 受益権の総数	1,995,633,057口	1,795,814,163口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9296円 (9,296円)	1.0633円 (10,633円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第4期(自平成24年5月26日至平成24年11月26日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	20,474,424円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	91,908,383円
収益調整金額	C	38,585,748円
分配準備積立金額	D	65,788,203円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	216,756,758円
当ファンドの期末残存口数	F	1,795,814,163口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,206円
1万口当たり分配金額	H	103円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	18,496,885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 3 期 （自平成23年11月26日 至平成24年 5月25日）	第 4 期 （自平成24年 5月26日 至平成24年11月26日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスク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、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 （2）親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 3 期 [平成24年5月25日現在]	第 4 期 [平成24年11月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 3 期 [平成24年5月25日現在]	第 4 期 [平成24年11月26日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	200,553,204	257,613,219
合計	200,553,204	257,613,219

(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	1,741,806,766	1,909,368,576	
	親投資信託受益証券 小計	1,741,806,766	1,909,368,576	
	合計	1,741,806,766	1,909,368,576	

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24年5月25日現在]	[平成24年11月26日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,341,879,222	1,562,932,066
コール・ローン	269,731,487	197,537,062
株式	131,065,796,101	145,319,666,872
投資証券	2,805,968,411	3,360,912,048
派生商品評価勘定	20,093,498	25,826,663
未収入金	6,089	353,975
未収配当金	359,162,191	329,338,058
未収利息	617	452
差入委託証拠金	1,258,308,305	633,066,243
流動資産合計	140,120,945,921	151,429,633,439
資産合計	140,120,945,921	151,429,633,439
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	61,347,071	9,488,236
未払金	2,135,585,869	
未払解約金	139,700,185	228,094,179
流動負債合計	2,336,633,125	237,582,415
負債合計	2,336,633,125	237,582,415
純資産の部		
元本等		
元本	1	145,277,856,586
剰余金		137,927,382,939
剰余金又は欠損金()	2	7,493,543,790
元本等合計		137,784,312,796
純資産合計		151,192,051,024
負債純資産合計		140,120,945,921
		151,429,633,439

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年5月25日現在]	[平成24年11月26日現在]
1 期首		
期首元本額	平成23年11月26日 153,686,812,742円	平成24年5月26日 145,277,856,586円
期首からの追加設定元本額	11,207,910,449円	7,436,950,761円
期首からの一部解約元本額	19,616,866,605円	14,787,424,408円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	334,517,697円	82,294,692円
eMAXIS 先進国株式インデックス	7,129,121,559円	7,558,844,083円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	29,709,228円	54,661,868円
eMAXIS バランス（波乗り型）	6,886,924円	9,332,479円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	1,387,401,503円	1,497,985,698円
eMAXIS 全世界株式インデックス	934,411,972円	1,062,903,893円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	49,768,705,232円	47,885,562,868円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	37,375,848,460円	34,101,688,997円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	1,074,001,693円	973,270,223円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	7,065,669,670円	6,487,168,626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）	7,283,077,435円	7,072,320,107円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	887,275,390円	824,866,779円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	602,897,304円	534,941,890円
三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	5,156,302,223円	4,711,394,337円
MSCIコクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	1,954,709,600円	1,741,806,766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）	17,529,648円	16,495,815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）	6,022,197,705円	5,796,187,157円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,509,162,570円	2,446,938,582円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	66,442,682円	56,094,661円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	168,505,044円	147,854,930円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	247,337,560円	223,394,505円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	284,557,958円	247,754,114円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	2,778,901,317円	2,556,436,717円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	321,741,206円	291,051,854円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	2,402,903,061円	2,201,384,980円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	608,637,397円	570,638,002円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	2,791,372,793円	2,620,581,100円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	2,875,372,977円	3,105,615,339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）	356,270,070円	327,824,502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）	1,258,004,427円	1,179,383,550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）	925,526,758円	902,836,256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）	652,857,523円	637,867,569円
（合計）	145,277,856,586円	137,927,382,939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。	7,493,543,790円	
3 受益権の総数	145,277,856,586口	137,927,382,939口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9484円 (9,484円)	1.0962円 (10,962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11月26日 至平成24年5月25日）	（自平成24年5月26日 至平成24年11月26日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年5月25日現在]	[平成24年11月26日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同左 同左 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成24年5月25日現在]	[平成24年11月26日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,018,346,395	7,674,910,832
投資証券	88,609,587	112,824,912
合計	4,106,955,982	7,787,735,744

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種類	[平成24年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	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

区分	種類	[平成24年11月26日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,367,417,143	2,384,209,036	16,791,893
	合計	2,367,417,143	2,384,209,036	16,791,893

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

区分	種類	[平成24年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

区分	種類	[平成24年11月26日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル カナダドル オーストラリアドル イギリスポンド ユーロ	63,485,884 14,069,540 10,266,000 13,244,650 13,777,660		63,617,400 14,142,300 10,369,200 13,244,000 13,924,300	131,516 72,760 103,200 650 146,640
	合計	114,843,734		115,297,200	453,466

(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	51,600	90.280000	4,658,448.00	
	ABBOTT LABORATORIES	123,200	64.470000	7,942,704.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,900	44.400000	306,360.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	50,700	68.180000	3,456,726.00	
	ACE LTD	26,800	79.800000	2,138,640.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	36,500	11.240000	410,260.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	39,900	33.400000	1,332,660.00	
	ADT CORP/THE	18,400	42.860000	788,624.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	5,700	79.040000	450,528.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	46,700	1.950000	91,065.00	
	AES CORP	52,600	10.100000	531,260.00	
	AETNA INC	26,800	42.990000	1,152,132.00	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,100	128.220000	525,702.00	
	AFLAC INC	37,000	51.890000	1,919,930.00	
	AGCO CORP	7,900	45.610000	360,319.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	27,500	36.880000	1,014,200.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,900	83.040000	1,403,376.00	
	AIRGAS INC	5,300	90.000000	477,000.00	
	AKAMA TECHNOLOGIES INC	14,300	35.970000	514,371.00	
	ALBEMARLE CORP	7,000	57.540000	402,780.00	
	ALCOA INC	83,400	8.350000	696,390.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	15,200	94.710000	1,439,592.00	
	ALLEGHANY CORP	1,000	334.810000	334,810.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,800	26.860000	209,508.00	
	ALLERGAN INC	24,100	91.990000	2,216,959.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,000	140.830000	563,320.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	9,100	43.720000	397,852.00	
	ALLSTATE CORP	38,700	40.740000	1,576,638.00	
	ALTERA CORP	25,700	31.860000	818,802.00	
	ALTRIA GROUP INC	160,200	33.480000	5,363,496.00	
	AMAZON.COM INC	28,300	239.880000	6,788,604.00	
	AMEREN CORPORATION	19,400	28.550000	553,870.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	37,700	41.030000	1,546,831.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	81,500	56.510000	4,605,565.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	86,800	32.830000	2,849,644.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,700	37.140000	508,818.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,400	61.000000	1,061,400.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	19,500	41.380000	806,910.00	
	AMETEK INC	18,600	37.260000	693,036.00	
	AMGEN INC	61,200	87.600000	5,361,120.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	12,400	61.520000	762,848.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,400	74.550000	2,937,270.00	
	ANALOG DEVICES INC	23,400	40.740000	953,316.00	
	ANSYS INC	7,200	67.220000	483,984.00	
	AON PLC	24,200	57.740000	1,397,308.00	
	APACHE CORP	30,600	77.140000	2,360,484.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	8,900	18.860000	167,854.00	
	APPLE INC	73,450	571.750000	41,995,037.50	
	APPLIED MATERIALS INC	101,600	10.400000	1,056,640.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,900	44.070000	480,363.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,600	26.740000	1,406,524.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	8,800	37.360000	328,768.00	
	ASSURANT INC	6,600	34.350000	226,710.00	
	AT&T INC	460,100	34.360000	15,809,036.00	
	AUTODESK INC	17,700	31.800000	562,860.00	
	AUTOLIV INC	7,400	59.620000	441,188.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	38,900	56.120000	2,183,068.00	
	AUTOZONE INC	2,700	383.120000	1,034,424.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,300	33.550000	613,965.00	
	AVERY DENNISON CORP	8,000	33.790000	270,320.00	

AVNET INC	10,700	28.970000	309,979.00
AVON PRODUCTS INC	32,900	14.260000	469,154.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,700	35.080000	340,276.00
BAKER HUGHES INC	33,900	41.830000	1,418,037.00
BALL CORP	11,900	45.070000	536,333.00
BANK OF AMERICA CORP	846,800	9.900000	8,383,320.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	94,000	24.430000	2,296,420.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,800	68.810000	3,013,878.00
BB&T CORP	54,400	28.810000	1,567,264.00
BEAM INC	10,800	55.510000	599,508.00
BECTON DICKINSON AND CO	16,200	77.730000	1,259,226.00
BED BATH & BEYOND INC	18,400	60.160000	1,106,944.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	72,100	88.500000	6,380,850.00
BEST BUY CO INC	22,800	11.700000	266,760.00
BIOGEN IDEC INC	17,900	149.870000	2,682,673.00
BLACKROCK INC	10,400	195.540000	2,033,616.00
BMC SOFTWARE INC	12,600	40.190000	506,394.00
BOEING CO/THE	56,100	73.740000	4,136,814.00
BORGWARNER INC	8,600	65.300000	561,580.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	110,400	5.590000	617,136.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,800	32.620000	4,331,936.00
BROADCOM CORP-CL A	39,500	31.580000	1,247,410.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,600	68.420000	656,832.00
BUNGE LTD	11,700	73.050000	854,685.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,000	60.980000	792,740.00
CA INC	25,900	22.100000	572,390.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	14,800	13.980000	206,904.00
CABOT OIL & GAS CORP	16,400	49.880000	818,032.00
CALPINE CORP	24,100	16.930000	408,013.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	19,100	54.470000	1,040,377.00
CAMPBELL SOUP CO	15,200	36.700000	557,840.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,300	58.970000	2,671,341.00
CARDINAL HEALTH INC	27,500	39.990000	1,099,725.00
CAREFUSION CORP	17,500	28.040000	490,700.00
CARMAX INC	18,400	35.140000	646,576.00
CARNIVAL CORP	35,100	39.080000	1,371,708.00
CATERPILLAR INC	51,200	84.160000	4,308,992.00
CBRE GROUP INC - A	24,400	17.870000	436,028.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	47,400	35.850000	1,699,290.00
CELANESE CORP-SERIES A	12,300	39.700000	488,310.00
CELGENE CORP	34,300	78.510000	2,692,893.00
CENTERPOINT ENERGY INC	32,500	19.260000	625,950.00
CENTURYLINK INC	48,900	38.520000	1,883,628.00
CERNER CORP	11,300	78.060000	882,078.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,100	210.120000	1,071,612.00
CHARTER COMMUNICATION-A	3,000	70.000000	210,000.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	51,400	17.830000	916,462.00
CHEVRON CORP	155,000	105.470000	16,347,850.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,500	274.340000	685,850.00
CHUBB CORP	21,300	77.230000	1,644,999.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,500	53.900000	619,850.00
CIGNA CORP	22,400	52.760000	1,181,824.00
CIMAREX ENERGY CO	7,000	63.000000	441,000.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,200	40.320000	491,904.00
CINTAS CORP	9,100	40.860000	371,826.00
CISCO SYSTEMS INC	420,500	18.840000	7,922,220.00
CIT GROUP INC	15,000	37.200000	558,000.00
CITIGROUP INC	230,400	36.030000	8,301,312.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,600	61.770000	901,842.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,900	31.230000	340,407.00
CLOROX COMPANY	9,900	74.650000	739,035.00
CME GROUP INC	24,700	54.640000	1,349,608.00
CMS ENERGY CORP	20,000	23.520000	470,400.00
COACH INC	22,400	59.660000	1,336,384.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,900	21.860000	325,714.00
COCA-COLA CO/THE	318,500	37.930000	12,080,705.00
COCA-COLA ENTERPRISES	23,300	30.560000	712,048.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,600	66.480000	1,568,928.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	37,500	108.000000	4,050,000.00

COMCAST CORP-CLASS A	165,600	36.910000	6,112,296.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	45,700	35.810000	1,636,517.00
COMERICA INC	15,000	29.190000	437,850.00
COMPUTER SCIENCES CORP	11,700	37.900000	443,430.00
CONAGRA FOODS INC	33,100	28.410000	940,371.00
CONCHO RESOURCES INC	7,900	81.240000	641,796.00
CONOCOPHILLIPS	94,400	56.670000	5,349,648.00
CONSOL ENERGY INC	18,300	32.690000	598,227.00
CONSOLIDATED EDISON INC	23,200	54.100000	1,255,120.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,500	35.110000	473,985.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,500	71.030000	248,605.00
COOPER INDUSTRIES PLC	12,700	78.770000	1,000,379.00
CORE LABORATORIES N.V.	3,800	102.450000	389,310.00
CORNING INC	119,800	11.290000	1,352,542.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,100	97.920000	3,339,072.00
COVENTRY HEALTH CARE INC	11,300	43.400000	490,420.00
COVIDIEN PLC	38,300	57.420000	2,199,186.00
CR BARD INC	6,300	98.540000	620,802.00
CREE INC	8,900	31.370000	279,193.00
CROWN CASTLE INTL CORP	23,200	67.550000	1,567,160.00
CROWN HOLDINGS INC	11,900	37.350000	444,465.00
CSX CORP	81,400	19.710000	1,604,394.00
CUMMINS INC	14,500	99.640000	1,444,780.00
CVS CAREMARK CORP	100,800	45.830000	4,619,664.00
DANAHER CORP	46,500	53.490000	2,487,285.00
DARDEN RESTAURANTS INC	10,600	53.530000	567,418.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	7,500	111.430000	835,725.00
DEERE & CO	29,600	83.970000	2,485,512.00
DELL INC	117,400	9.550000	1,121,170.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	24,900	34.050000	847,845.00
DELTA AIR LINES INC	17,300	9.840000	170,232.00
DENBURY RESOURCES INC	31,800	15.740000	500,532.00
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	11,000	39.300000	432,300.00
DEVON ENERGY CORPORATION	30,500	53.230000	1,623,515.00
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,400	67.360000	363,744.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,500	51.970000	389,775.00
DIRECTV	51,100	49.490000	2,528,939.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41,400	41.460000	1,716,444.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	11,900	58.200000	692,580.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	8,200	54.190000	444,358.00
DISH NETWORK CORP-A	17,000	35.750000	607,750.00
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,500	32.620000	114,170.00
DOLLAR GENERAL CORP	20,700	49.410000	1,022,787.00
DOLLAR TREE INC	18,400	42.030000	773,352.00
DOMINION RESOURCES INC/VA	44,700	50.120000	2,240,364.00
DOVER CORP	14,500	63.880000	926,260.00
DOW CHEMICAL CO/THE	94,200	29.380000	2,767,596.00
DR HORTON INC	21,800	19.530000	425,754.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,800	44.810000	752,808.00
DTE ENERGY COMPANY	13,600	58.880000	800,768.00
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	73,700	43.120000	3,177,944.00
DUKE ENERGY CORP	55,000	60.450000	3,324,750.00
DUN & BRADSTREET CORP	3,600	78.060000	281,016.00
EASTMAN CHEMICAL CO	12,200	60.050000	732,610.00
EATON CORP	25,200	51.580000	1,299,816.00
EATON VANCE CORP	8,900	32.000000	284,800.00
EBAY INC	91,100	49.010000	4,464,811.00
ECOLAB INC	22,800	70.350000	1,603,980.00
EDISON INTERNATIONAL	24,500	43.490000	1,065,505.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,900	85.600000	761,840.00
ELECTRONIC ARTS INC	23,600	14.370000	339,132.00
ELI LILLY & CO	81,700	47.740000	3,900,358.00
EMC CORP/MA	165,600	24.810000	4,108,536.00
EMERSON ELECTRIC CO	57,600	49.120000	2,829,312.00
ENERGEN CORP	5,700	44.440000	253,308.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,000	77.440000	387,200.00
ENSCO PLC-CL A	17,800	57.260000	1,019,228.00
ENTERGY CORP	13,700	62.040000	849,948.00
EOG RESOURCES INC	21,100	118.990000	2,510,689.00

EQT CORP	11,700	62.740000	734,058.00
EQUIFAX INC	9,200	51.030000	469,476.00
EQUINIX INC	3,800	186.760000	709,688.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,700	59.620000	1,114,894.00
EVEREST RE GROUP LTD	4,300	105.110000	451,973.00
EXELON CORP	66,700	28.570000	1,905,619.00
EXPEDIA INC	6,900	60.590000	418,071.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	17,500	37.180000	650,650.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	63,500	52.240000	3,317,240.00
EXXON MOBIL CORP	367,400	89.090000	32,731,666.00
F5 NETWORKS INC	6,200	92.160000	571,392.00
FACEBOOK INC-A	34,900	24.000000	837,600.00
FAMILY DOLLAR STORES	7,600	70.100000	532,760.00
FASTENAL CO	22,000	41.140000	905,080.00
FEDEX CORP	23,700	87.730000	2,079,201.00
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,100	23.660000	357,266.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	18,300	35.780000	654,774.00
FIFTH THIRD BANCORP	72,800	14.890000	1,083,992.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	34.200000	242,820.00
FIRSTENERGY CORP	33,000	41.070000	1,355,310.00
FISERV INC	11,000	75.430000	829,730.00
FLEXTRONICS INTL LTD	52,500	5.830000	306,075.00
FLIR SYSTEMS INC	12,900	20.030000	258,387.00
FLOWSERVE CORP	4,100	139.450000	571,745.00
FLUOR CORP	13,100	53.810000	704,911.00
FMC CORP	10,800	54.800000	591,840.00
FMC TECHNOLOGIES INC	19,000	41.750000	793,250.00
FORD MOTOR CO	278,400	11.100000	3,090,240.00
FOREST LABORATORIES INC	21,000	33.320000	699,720.00
FOSSIL INC	4,200	86.200000	362,040.00
FRANKLIN RESOURCES INC	11,800	133.180000	1,571,524.00
FREEPORT-MCMORAN COPPER	74,800	38.880000	2,908,224.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,600	4.500000	335,700.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	11,600	27.070000	314,012.00
GAP INC/THE	25,500	35.500000	905,250.00
GARMIN LTD	9,500	38.610000	366,795.00
GENERAL DYNAMICS CORP	24,100	65.410000	1,576,381.00
GENERAL ELECTRIC CO	831,600	21.040000	17,496,864.00
GENERAL MILLS INC	51,300	40.770000	2,091,501.00
GENERAL MOTORS CO	61,800	25.210000	1,557,978.00
GENUINE PARTS CO	12,400	62.940000	780,456.00
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	38,700	5.650000	218,655.00
GILEAD SCIENCES INC	59,400	76.120000	4,521,528.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36,800	120.310000	4,427,408.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	20,100	11.830000	237,783.00
GOOGLE INC-CL A	20,400	667.970000	13,626,588.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	11,000	28.130000	309,430.00
H&R BLOCK INC	22,900	18.230000	417,467.00
HALLIBURTON CO	73,300	32.080000	2,351,464.00
HARLEY-DAVIDSON INC	18,400	48.260000	887,984.00
HARRIS CORP	9,100	46.830000	426,153.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	33,200	21.310000	707,492.00
HASBRO INC	8,700	38.250000	332,775.00
HCA HOLDINGS INC	13,600	31.460000	427,856.00
HELMERICH & PAYNE	8,900	51.590000	459,151.00
HENRY SCHEIN INC	7,300	80.750000	589,475.00
HERBALIFE LTD	9,200	48.490000	446,108.00
HERSHEY CO/THE	12,100	72.400000	876,040.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,000	15.000000	315,000.00
HESS CORP	24,500	51.120000	1,252,440.00
HEWLETT-PACKARD CO	154,900	12.440000	1,926,956.00
HJ HEINZ CO	25,500	58.430000	1,489,965.00
HOLLYFRONTIER CORP	16,500	45.480000	750,420.00
HOLOGIC INC	20,300	19.480000	395,444.00
HOME DEPOT INC	120,300	64.820000	7,797,846.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,200	61.260000	3,565,332.00
HORMEL FOODS CORP	11,300	30.640000	346,232.00
HOSPIRA INC	12,900	29.420000	379,518.00
HUDSON CITY BANCORP INC	39,100	8.160000	319,056.00

HUMANA INC	12,800	66.690000	853,632.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,300	59.630000	435,299.00
IHS INC-CLASS A	4,500	90.360000	406,620.00
ILLINOIS TOOL WORKS	34,100	60.620000	2,067,142.00
ILLUMINA INC	9,700	52.930000	513,421.00
INGERSOLL-RAND PLC	23,700	48.230000	1,143,051.00
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	6,500	52.600000	341,900.00
INTEL CORP	394,400	19.710000	7,773,624.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,600	131.190000	734,664.00
INTERNATIONAL PAPER CO	32,600	36.260000	1,182,076.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,300	10.320000	343,656.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	86,000	193.490000	16,640,140.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,100	64.330000	392,413.00
INTL GAME TECHNOLOGY	25,300	13.130000	332,189.00
INTUIT INC	22,100	59.160000	1,307,436.00
INTUITIVE SURGICAL INC	3,100	537.500000	1,666,250.00
INVESCO LTD	35,700	24.830000	886,431.00
IRON MOUNTAIN INC	9,600	32.600000	312,960.00
J.C. PENNEY CO INC	12,900	17.290000	223,041.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,200	40.380000	411,876.00
JM SMUCKER CO/THE	8,900	86.050000	765,845.00
JOHNSON & JOHNSON	215,400	69.560000	14,983,224.00
JOHNSON CONTROLS INC	54,000	27.220000	1,469,880.00
JOY GLOBAL INC	8,500	57.130000	485,605.00
JPMORGAN CHASE & CO	299,000	41.090000	12,285,910.00
JUNIPER NETWORKS INC	41,200	16.700000	688,040.00
KANSAS CITY SOUTHERN	8,900	77.610000	690,729.00
KBR INC	12,400	27.840000	345,216.00
KELLOGG CO	19,500	55.260000	1,077,570.00
KEYCORP	75,600	8.450000	638,820.00
KIMBERLY-CLARK CORP	30,600	87.340000	2,672,604.00
KINDER MORGAN INC	51,100	33.720000	1,723,092.00
KLA-TENCOR CORPORATION	12,700	45.170000	573,659.00
KOHL'S CORP	17,600	52.250000	919,600.00
KRAFT FOODS GROUP INC	44,233	45.280000	2,002,870.24
KROGER CO	41,700	24.980000	1,041,666.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,600	76.330000	580,108.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,600	83.750000	636,500.00
LAM RESEARCH CORP	16,600	35.340000	586,644.00
LAS VEGAS SANDS CORP	32,100	44.180000	1,418,178.00
LEGG MASON INC	11,100	26.030000	288,933.00
LEGGETT & PLATT INC	11,100	27.430000	304,473.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,500	21.100000	348,150.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	11,300	18.510000	209,163.00
LIBERTY GLOBAL INC-A	10,500	57.030000	598,815.00
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	9,500	53.940000	512,430.00
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	40,800	19.220000	784,176.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	8,400	109.040000	915,936.00
LIFE TECHNOLOGIES CORP	14,000	50.080000	701,120.00
LIMITED BRANDS INC	20,000	48.740000	974,800.00
LINCOLN NATIONAL CORP	22,500	24.610000	553,725.00
LINEAR TECHNOLOGY CORP	17,900	32.450000	580,855.00
LINKEDIN CORP - A	4,900	107.620000	527,338.00
LOCKHEED MARTIN CORP	21,700	91.830000	1,992,711.00
LOEWS CORP	25,400	41.300000	1,049,020.00
LORILLARD INC	10,300	123.270000	1,269,681.00
LOWE'S COS INC	92,300	35.150000	3,244,345.00
LSI CORP	44,500	6.710000	298,595.00
LULULEMON ATHLETICA INC	7,900	70.670000	558,293.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,300	48.620000	1,181,466.00
M & T BANK CORP	9,200	99.670000	916,964.00
MACY'S INC	32,100	41.730000	1,339,533.00
MANPOWER INC	6,400	38.140000	244,096.00
MARATHON OIL CORP	56,000	31.930000	1,788,080.00
MARATHON PETROLEUM CORP	27,100	58.980000	1,598,358.00
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	20,900	35.240000	736,516.00
MARSH & MCLENNAN COS	42,400	35.780000	1,517,072.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,700	86.000000	318,200.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	37,600	8.070000	303,432.00

MASCO CORP	29,200	16.900000	493,480.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	8,600	481.240000	4,138,664.00	
MATTEL INC	26,200	36.870000	965,994.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,100	28.180000	622,778.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,800	66.370000	650,426.00	
MCDONALD'S CORP	79,800	87.050000	6,946,590.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	19,700	51.940000	1,023,218.00	
MCKESSON CORP	18,700	94.110000	1,759,857.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	13,700	20.410000	279,617.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,800	67.400000	1,064,920.00	
MEADWESTVACO CORP	14,100	29.420000	414,822.00	
MEDTRONIC INC	81,000	43.270000	3,504,870.00	
MERCK & CO. INC.	238,500	44.280000	10,560,780.00	
METLIFE INC	66,400	33.230000	2,206,472.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	24,000	10.670000	256,080.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,200	9.990000	281,718.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,300	29.990000	458,847.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,400	5.680000	433,952.00	
MICROSOFT CORP	593,300	27.700000	16,434,410.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,600	87.100000	400,660.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,800	40.510000	478,018.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	132,700	25.620000	3,399,774.00	
MONSANTO CO	42,100	90.580000	3,813,418.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,700	45.940000	537,498.00	
MOODY'S CORP	15,800	47.320000	747,656.00	
MORGAN STANLEY	115,700	16.430000	1,900,951.00	
MOSAIC CO/THE	22,900	52.650000	1,205,685.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,600	54.760000	1,128,056.00	
MURPHY OIL CORP	14,400	58.410000	841,104.00	
MYLAN INC	34,100	27.110000	924,451.00	
NABORS INDUSTRIES LTD	24,000	14.020000	336,480.00	

[前へ](#) [次へ](#)

(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					
	NASDAQ OMX GROUP/THE	10,800	23.780000	256,824.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,400	72.600000	2,424,840.00	
	NETAPP INC	28,700	31.150000	894,005.00	
	NETFLIX INC	4,200	82.950000	348,390.00	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,400	12.900000	430,860.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	22,700	21.350000	484,645.00	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	10,900	24.140000	263,126.00	
	NEWMONT MINING CORP	38,400	47.690000	1,831,296.00	
	NEWS CORP-B	34,300	24.825000	851,497.50	
	NEWS CORP-CL A	128,400	24.300000	3,120,120.00	
	NEXTERA ENERGY INC	31,300	67.200000	2,103,360.00	
	NIELSEN HOLDINGS NV	9,300	28.260000	262,818.00	
	NIKE INC -CL B	28,800	96.750000	2,786,400.00	
	NISOURCE INC	22,400	24.020000	538,048.00	
	NOBLE CORP	19,800	34.440000	681,912.00	
	NOBLE ENERGY INC	14,200	96.550000	1,371,010.00	
	NORDSTROM INC	13,100	56.550000	740,805.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	25,800	57.760000	1,490,208.00	
	NORTHEAST UTILITIES	24,000	37.730000	905,520.00	
	NORTHERN TRUST CORP	17,300	48.290000	835,417.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	18,800	65.360000	1,228,768.00	
	NRG ENERGY INC	17,900	19.950000	357,105.00	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	18,900	20.650000	390,285.00	
	NUCOR CORP	24,800	41.140000	1,020,272.00	
	NVIDIA CORP	48,800	11.900000	580,720.00	
	NYSE EURONEXT	19,200	22.880000	439,296.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,700	76.170000	4,852,029.00	
	OMNICARE INC	9,200	34.480000	317,216.00	
	OMNICOM GROUP	21,300	47.460000	1,010,898.00	
	ONEOK INC	15,800	45.980000	726,484.00	
	ORACLE CORP	312,100	30.920000	9,650,132.00	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10,100	92.630000	935,563.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	13,000	19.790000	257,270.00	
	P G & E CORP	33,100	40.170000	1,329,627.00	
	PACCAR INC	26,600	43.050000	1,145,130.00	
	PALL CORP	9,200	61.560000	566,352.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	12,100	81.430000	985,303.00	
	PARTNERRE LTD	5,000	81.500000	407,500.00	
	PATTERSON COS INC	7,500	33.830000	253,725.00	
	PAYCHEX INC	26,200	32.440000	849,928.00	
	PEABODY ENERGY CORP	22,100	25.150000	555,815.00	
	PENTAIR LTD-REGISTERED	16,529	47.660000	787,772.14	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,300	11.890000	324,597.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	19,000	19.110000	363,090.00	
	PEPSICO INC	122,600	70.190000	8,605,294.00	
	PERRIGO CO	7,200	103.300000	743,760.00	
	PETSMART INC	8,800	69.090000	607,992.00	
	PFIZER INC	587,500	24.530000	14,411,375.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,800	90.410000	12,096,858.00	
	PHILLIPS 66	47,000	49.820000	2,341,540.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,800	49.280000	433,664.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,000	107.990000	971,910.00	
	PITNEY BOWES INC	15,700	11.170000	175,369.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,900	35.910000	355,509.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,900	55.750000	2,335,925.00	
	PPG INDUSTRIES INC	11,800	123.370000	1,455,766.00	
	PPL CORPORATION	45,000	28.080000	1,263,600.00	
	PRAXAIR INC	23,700	106.930000	2,534,241.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	11,500	179.340000	2,062,410.00	
	PRICELINE.COM INC	3,900	641.910000	2,503,449.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,400	27.330000	639,522.00	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	215,000	69.590000	14,961,850.00	
	PROGRESSIVE CORP	46,400	21.820000	1,012,448.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,200	52.020000	1,935,144.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	40,300	29.240000	1,178,372.00	

PVH CORP	5,500	110.970000	610,335.00
QEP RESOURCES INC	14,000	28.690000	401,660.00
QUALCOMM INC	134,400	63.130000	8,484,672.00
QUANTA SERVICES INC	15,900	25.470000	404,973.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,500	57.980000	724,750.00
RACKSPACE HOSTING INC	8,200	66.390000	544,398.00
RALCORP HOLDINGS INC	4,600	71.420000	328,532.00
RALPH LAUREN CORP	4,900	159.900000	783,510.00
RANGE RESOURCES CORP	13,000	69.730000	906,490.00
RAYTHEON COMPANY	26,500	56.200000	1,489,300.00
RED HAT INC	15,000	49.740000	746,100.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,700	176.080000	1,003,656.00
REGIONS FINANCIAL CORP	109,400	6.690000	731,886.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,400	81.320000	357,808.00
REPUBLIC SERVICES INC	25,500	27.930000	712,215.00
REYNOLDS AMERICAN INC	27,100	43.080000	1,167,468.00
ROBERT HALF INTL INC	10,900	27.460000	299,314.00
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,500	65.360000	359,480.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,500	78.390000	901,485.00
ROCKWELL COLLINS INC	11,200	56.570000	633,584.00
ROPER INDUSTRIES INC	7,800	113.140000	882,492.00
ROSS STORES INC	17,700	55.910000	989,607.00
ROWAN COMPANIES PLC-A	10,700	32.910000	352,137.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	34.930000	373,751.00
SAFEWAY INC	17,700	16.960000	300,192.00
SAIC INC	20,200	11.620000	234,724.00
SALESFORCE.COM INC	10,200	159.450000	1,626,390.00
SANDISK CORP	18,900	40.130000	758,457.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,000	67.750000	609,750.00
SCANA CORP	9,600	45.130000	433,248.00
SCHLUMBERGER LTD	104,400	71.180000	7,431,192.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	85,500	13.230000	1,131,165.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,800	60.400000	410,720.00
SEAGATE TECHNOLOGY	30,100	27.290000	821,429.00
SEALED AIR CORP	13,300	17.160000	228,228.00
SEARS HOLDINGS CORP	3,100	47.520000	147,312.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,000	22.500000	225,000.00
SEMPRA ENERGY	18,000	66.050000	1,188,900.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	29.320000	222,832.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,700	158.590000	1,062,553.00
SIGMA-ALDRICH	9,900	72.200000	714,780.00
SIRIUS XM RADIO INC	295,500	2.780000	821,490.00
SLM CORP	38,800	17.050000	661,540.00
SOUTHERN CO/THE	67,700	42.030000	2,845,431.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,400	9.370000	144,298.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	27,800	36.600000	1,017,480.00
SPECTRA ENERGY CORP	51,100	28.080000	1,434,888.00
SPRINT NEXTEL CORP	235,200	5.640000	1,326,528.00
SPX CORP	4,000	67.840000	271,360.00
ST JUDE MEDICAL INC	24,900	32.030000	797,547.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,000	71.390000	928,070.00
STAPLES INC	52,600	11.900000	625,940.00
STARBUCKS CORP	59,300	51.190000	3,035,567.00
STARWOOD HOTELS & RESORTS	15,500	53.470000	828,785.00
STATE STREET CORP	38,400	45.780000	1,757,952.00
STERICYCLE INC	6,700	92.160000	617,472.00
STRYKER CORP	24,400	54.520000	1,330,288.00
SUNTRUST BANKS INC	42,700	27.480000	1,173,396.00
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	12,800	19.050000	243,840.00
SYMANTEC CORP	55,700	18.480000	1,029,336.00
SYNOPSYS INC	11,500	32.760000	376,740.00
SYSCO CORP	46,700	31.000000	1,447,700.00
T ROWE PRICE GROUP INC	19,900	65.700000	1,307,430.00
TARGET CORP	49,300	64.480000	3,178,864.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,100	15.900000	271,890.00
TE CONNECTIVITY LTD	32,700	35.500000	1,160,850.00
TERADATA CORP	13,400	62.280000	834,552.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	89,400	29.590000	2,645,346.00
TEXTRON INC	22,700	23.780000	539,806.00

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,200	62.640000	1,829,088.00
TIFFANY & CO	9,900	62.070000	614,493.00
TIME WARNER CABLE	24,600	93.550000	2,301,330.00
TIME WARNER INC	75,500	46.150000	3,484,325.00
TJX COMPANIES INC	57,700	43.910000	2,533,607.00
TOLL BROTHERS INC	11,700	32.470000	379,899.00
TORCHMARK CORP	8,300	51.840000	430,272.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,400	21.980000	272,552.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,800	90.730000	526,234.00
TRANSDIGM GROUP INC	3,700	132.400000	489,880.00
TRAVELERS COS INC/THE	30,300	71.270000	2,159,481.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	9,900	54.860000	543,114.00
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,900	49.910000	394,289.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	35,100	27.660000	970,866.00
TYSON FOODS INC-CL A	22,100	19.250000	425,425.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,900	92.200000	451,780.00
ULTRA PETROLEUM CORP	11,300	22.690000	256,397.00
UNION PACIFIC CORP	37,500	121.980000	4,574,250.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,016	20.100000	120,921.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	56,800	71.980000	4,088,464.00
UNITED STATES STEEL CORP	11,800	21.640000	255,352.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	67,700	78.610000	5,321,897.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,600	53.920000	4,399,872.00
UNUM GROUP	22,000	20.230000	445,060.00
URBAN OUTFITTERS INC	9,000	37.860000	340,740.00
URS CORP	6,100	35.490000	216,489.00
US BANCORP	149,000	32.580000	4,854,420.00
VALERO ENERGY CORP	44,000	31.920000	1,404,480.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,000	69.420000	624,780.00
VERIFONE SYSTEMS INC	8,400	30.810000	258,804.00
VERISIGN INC	12,900	40.870000	527,223.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	11,400	48.090000	548,226.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	222,800	43.760000	9,749,728.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,800	41.460000	696,528.00
VF CORP	7,000	158.530000	1,109,710.00
VIACOM INC-CLASS B	37,200	50.480000	1,877,856.00
VIRGIN MEDIA INC	20,300	34.010000	690,403.00
VISA INC-CLASS A SHARES	41,300	148.120000	6,117,356.00
VMWARE INC-CLASS A	6,300	89.710000	565,173.00
VULCAN MATERIALS CO	9,800	49.240000	482,552.00
WALGREEN CO	67,400	33.090000	2,230,266.00
WAL-MART STORES INC	145,900	70.200000	10,242,180.00
WALT DISNEY CO/THE	133,600	49.260000	6,581,136.00
WALTER ENERGY INC	5,500	29.260000	160,930.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	17,900	11.940000	213,726.00
WASHINGTON POST-CLASS B	400	352.500000	141,000.00
WASTE MANAGEMENT INC	35,300	32.360000	1,142,308.00
WATERS CORP	7,000	83.640000	585,480.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	10,000	86.080000	860,800.00
WEATHERFORD INTL LTD	60,000	9.830000	589,800.00
WELLPOINT INC	25,700	56.060000	1,440,742.00
WELLS FARGO & CO	396,100	33.200000	13,150,520.00
WESTERN DIGITAL CORP	18,600	35.090000	652,674.00
WESTERN UNION CO	49,100	12.800000	628,480.00
WHIRLPOOL CORP	6,000	102.730000	616,380.00
WHITING PETROLEUM CORP	9,000	44.970000	404,730.00
WHOLE FOODS MARKET INC	13,800	95.060000	1,311,828.00
WILLIAMS COS INC	49,300	33.440000	1,648,592.00
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	14,400	34.710000	499,824.00
WINDSTREAM CORP	46,900	8.320000	390,208.00
WISCONSIN ENERGY CORP	18,300	36.190000	662,277.00
WR BERKLEY CORP	9,300	40.060000	372,558.00
WW GRAINGER INC	4,700	191.510000	900,097.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,900	50.160000	596,904.00
WYNN RESORTS LTD	6,300	109.330000	688,779.00
XCEL ENERGY INC	38,400	26.020000	999,168.00
XEROX CORP	106,000	6.660000	705,960.00
XILINX INC	21,400	34.190000	731,666.00
XL GROUP PLC	25,500	24.360000	621,180.00

	XYLEM INC	14,800	25.520000	377,696.00	
	YAHOO! INC	91,700	18.570000	1,702,869.00	
	YUM! BRANDS INC	36,100	74.000000	2,671,400.00	
	ZIMMER HOLDINGS INC	13,800	66.840000	922,392.00	
	アメリカドル 小計	23,804,928		1,014,185,041.98 (83,802,110,018)	
カナダドル					
	AGNICO-EAGLE MINES LTD	13,400	55.640000	745,576.00	
	AGRIUM INC	11,800	100.030000	1,180,354.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,600	47.500000	456,000.00	
	ARC RESOURCES LTD	22,400	24.570000	550,368.00	
	ATHABASCA OIL CORP	23,600	11.000000	259,600.00	
	BANK OF MONTREAL	50,600	58.950000	2,982,870.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,400	54.500000	4,708,800.00	
	BARRICK GOLD CORP	78,800	35.190000	2,772,972.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	9,300	45.650000	424,545.00	
	BCE INC	19,900	42.150000	838,785.00	
	BELL ALIANT INC	5,500	27.220000	149,710.00	
	BOMBARDIER INC-B	109,400	3.080000	336,952.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	13,200	16.240000	214,368.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	44,900	34.210000	1,536,029.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	20,800	16.240000	337,792.00	
	CAE INC	18,000	9.700000	174,600.00	
	CAMECO CORP	31,100	17.490000	543,939.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,300	79.800000	2,577,540.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,800	87.360000	3,040,128.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,700	27.940000	2,422,398.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	37,100	20.620000	765,002.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,400	92.500000	1,239,500.00	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	67.710000	399,489.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,200	65.440000	274,848.00	
	CATAMARAN CORP	15,200	49.350000	750,120.00	
	CENOVUS ENERGY INC	59,400	33.420000	1,985,148.00	
	CENTERRA GOLD INC	11,300	9.900000	111,870.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	17,300	23.820000	412,086.00	
	CI FINANCIAL CORP	12,900	23.210000	299,409.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	27,300	39.050000	1,066,065.00	
	ELDORADO GOLD CORP	53,600	15.380000	824,368.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	2,000	57.310000	114,620.00	
	ENBRIDGE INC	59,200	39.100000	2,314,720.00	
	ENCANA CORP	57,700	21.420000	1,235,934.00	
	ENERPLUS CORP	16,700	12.950000	216,265.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,600	368.910000	590,256.00	
	FINNING INTERNATIONAL INC	12,600	22.940000	289,044.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	37,700	21.840000	823,368.00	
	FORTIS INC	14,500	32.960000	477,920.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,400	57.700000	657,780.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,500	33.170000	281,945.00	
	GOLDCORP INC	63,800	40.780000	2,601,764.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	22,100	23.560000	520,676.00	
	HUSKY ENERGY INC	27,400	27.360000	749,664.00	
	IAMGOLD CORP	30,100	12.080000	363,608.00	
	IGM FINANCIAL INC	7,900	40.990000	323,821.00	
	IMPERIAL OIL LTD	23,900	43.450000	1,038,455.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,700	28.220000	189,074.00	
	INMET MINING CORPORATION	4,500	54.050000	243,225.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,100	63.680000	643,168.00	
	KINROSS GOLD CORP	91,500	10.030000	917,745.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,400	33.500000	281,400.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	17,300	44.900000	776,770.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	141,400	12.430000	1,757,602.00	
	MEG ENERGY CORP	9,900	36.210000	358,479.00	
	METRO INC	7,700	60.630000	466,851.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	12,700	76.860000	976,122.00	
	NEW GOLD INC	34,900	10.440000	364,356.00	
	NEXEN INC	41,500	25.080000	1,040,820.00	
	ONEX CORPORATION	7,400	40.550000	300,070.00	
	OPEN TEXT CORP	4,300	54.800000	235,640.00	
	OSISKO MINING CORP	29,700	8.600000	255,420.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	22,800	21.670000	494,076.00	

PAN AMERICAN SILVER CORP	12,600	19.240000	242,424.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	23,400	28.100000	657,540.00	
PENGROWTH ENERGY CORP	37,300	5.250000	195,825.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	38,000	10.830000	411,540.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	67,200	38.320000	2,575,104.00	
POWER CORP OF CANADA	27,300	24.400000	666,120.00	
POWER FINANCIAL CORP	19,600	25.970000	509,012.00	
PRECISION DRILLING CORP	15,700	7.190000	112,883.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	15,100	20.280000	306,228.00	
RESEARCH IN MOTION	36,500	11.610000	423,765.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	8,000	21.800000	174,400.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	31,500	43.460000	1,368,990.00	
ROYAL BANK OF CANADA	113,400	57.950000	6,571,530.00	
SAPUTO INC	10,100	44.900000	453,490.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,900	21.640000	668,676.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	16,900	41.900000	708,110.00	
SILVER WHEATON CORP	28,100	36.770000	1,033,237.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,300	41.540000	469,402.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,800	27.150000	1,270,620.00	
SUNCOR ENERGY INC	123,300	33.450000	4,124,385.00	
TALISMAN ENERGY INC	80,400	11.680000	939,072.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	45,100	32.640000	1,472,064.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	11,700	64.490000	754,533.00	
THOMSON REUTERS CORP	29,300	27.310000	800,183.00	
TIM HORTONS INC	12,300	46.860000	576,378.00	
TORONTO-DOMINION BANK	71,700	81.400000	5,836,380.00	
TOURMALINE OIL CORP	9,700	33.700000	326,890.00	
TRANSALTA CORP	20,300	15.130000	307,139.00	
TRANSCANADA CORP	55,200	45.360000	2,503,872.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	30,800	7.340000	226,072.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	23,200	55.380000	1,284,816.00	
VERMILION ENERGY INC	7,300	48.900000	356,970.00	
VITERRA INC	23,600	15.670000	369,812.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,800	63.690000	242,022.00	
YAMANA GOLD INC	59,500	19.350000	1,151,325.00	
カナダドル 小計	3,024,900		96,372,698.00 (8,018,208,473)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	43,131	14.160000	610,734.96	
ALS LTD	27,360	8.690000	237,758.40	
ALUMINA LTD	211,345	0.890000	188,097.05	
AMCOR LIMITED	93,021	7.810000	726,494.01	
AMP LTD	231,903	4.560000	1,057,477.68	
APA GROUP	65,335	5.370000	350,848.95	
ASCIANO LTD	80,533	4.230000	340,654.59	
ASX LTD	14,445	29.290000	423,094.05	
AUST AND NZ BANKING GROUP	211,408	23.600000	4,989,228.80	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,612	7.820000	247,205.84	
BHP BILLITON LTD	252,808	33.750000	8,532,270.00	
BORAL LTD	58,154	3.950000	229,708.30	
BRAMBLES LTD	123,946	7.130000	883,734.98	
CALTEX AUSTRALIA LTD	12,898	17.850000	230,229.30	
COCA-COLA AMATIL LTD	44,445	13.550000	602,229.75	
COCHLEAR LTD	4,643	74.700000	346,832.10	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	125,488	58.950000	7,397,517.60	
COMPUTERSHARE LTD	38,258	8.540000	326,723.32	
CROWN LTD	31,938	10.060000	321,296.28	
CSL LTD	39,697	47.360000	1,880,049.92	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	52,860	3.580000	189,238.80	
FAIRFAX MEDIA LTD	152,684	0.430000	65,654.12	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,659	3.680000	425,625.12	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	44,167	1.825000	80,604.77	
ILUKA RESOURCES LTD	33,792	7.880000	266,280.96	
INCITEC PIVOT LTD	122,641	3.160000	387,545.56	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	167,598	4.450000	745,811.10	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	35,024	8.800000	308,211.20	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,861	16.880000	200,213.68	
LEND LEASE GROUP	42,089	8.520000	358,598.28	
LYNAS CORP LTD	130,000	0.720000	93,600.00	
MACQUARIE GROUP LTD	25,991	31.070000	807,540.37	

METCASH LTD	71,035	3.500000	248,622.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	176,104	23.630000	4,161,337.52	
NEWCREST MINING LTD	59,116	25.350000	1,498,590.60	
ORICA LTD	28,337	23.180000	656,851.66	
ORIGIN ENERGY LTD	87,622	10.560000	925,288.32	
OZ MINERALS LTD	26,401	7.120000	187,975.12	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.275000	107,938.95	
QBE INSURANCE GROUP LTD	93,197	10.760000	1,002,799.72	
QR NATIONAL LTD	141,692	3.570000	505,840.44	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,223	25.330000	258,948.59	
RIO TINTO LTD	33,877	57.180000	1,937,086.86	
SANTOS LTD	74,010	10.940000	809,669.40	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	11,143	8.510000	94,826.93	
SONIC HEALTHCARE LTD	29,332	12.850000	376,916.20	
SP AUSNET	120,000	1.045000	125,400.00	
SUNCORP GROUP LTD	101,414	9.490000	962,418.86	
TABCORP HOLDINGS LTD	58,291	2.750000	160,300.25	
TATTS GROUP LTD	101,040	2.820000	284,932.80	
TELSTRA CORP LTD	344,664	4.270000	1,471,715.28	
TOLL HOLDINGS LTD	57,066	4.350000	248,237.10	
TRANSURBAN GROUP	102,793	6.100000	627,037.30	
WESFARMERS LTD	79,117	34.930000	2,763,556.81	
WESTPAC BANKING CORP	238,971	24.940000	5,959,936.74	
WHITEHAVEN COAL LTD	38,500	2.810000	108,185.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	51,726	33.640000	1,740,062.64	
WOOLWORTHS LTD	96,005	28.660000	2,751,503.30	
WORLEYPARSONS LTD	15,483	24.550000	380,107.65	
オーストラリアドル 小計	5,008,551		64,207,196.38 (5,548,785,911)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	85,351	2.120000	180,944.12	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	65,035	3.427000	222,874.94	
ADMIRAL GROUP PLC	15,622	10.980000	171,529.56	
AGGREKO PLC	21,510	21.930000	471,714.30	
AMEC PLC	25,698	10.360000	266,231.28	
ANGLO AMERICAN PLC	109,066	17.190000	1,874,844.54	
ANTOFAGASTA PLC	30,767	12.610000	387,971.87	
ARM HOLDINGS PLC	109,401	7.425000	812,302.42	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,635	14.500000	415,207.50	
ASTRAZENECA PLC	99,090	28.905000	2,864,196.45	
AVIVA PLC	230,022	3.460000	795,876.12	
BABCOCK INTL GROUP PLC	28,798	9.760000	281,068.48	
BAE SYSTEMS PLC	256,815	3.103000	796,896.94	
BALFOUR BEATTY PLC	53,446	2.499000	133,561.55	
BARCLAYS PLC	916,973	2.542000	2,330,945.36	
BG GROUP PLC	266,274	10.765000	2,866,439.61	
BHP BILLITON PLC	166,764	19.455000	3,244,393.62	
BP PLC	1,497,164	4.355000	6,520,149.22	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	153,295	32.240000	4,942,230.80	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	84,823	7.775000	659,498.82	
BT GROUP PLC	608,315	2.267000	1,379,050.10	
BUNZL PLC	27,504	10.650000	292,917.60	
BURBERRY GROUP PLC	35,376	12.400000	438,662.40	
CAPITA PLC	51,179	7.350000	376,165.65	
CARNIVAL PLC	13,753	25.370000	348,913.61	
CENTRICA PLC	411,338	3.222000	1,325,331.03	
COBHAM PLC	79,780	2.043000	162,990.54	
COMPASS GROUP PLC	149,340	7.160000	1,069,274.40	
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,278	23.320000	239,682.96	
DIAGEO PLC	196,918	18.775000	3,697,135.45	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	23,840	2.745000	65,440.80	
EXPERIAN PLC	80,239	10.270000	824,054.53	
FRESNILLO PLC	14,339	19.760000	283,338.64	

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリスポンド					
	G4S PLC	105,850	2.471000	261,555.35	
	GKN PLC	127,117	2.184000	277,623.52	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	394,054	13.470000	5,307,907.38	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	297,502	3.428500	1,019,985.60	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,426,097	6.259000	8,925,941.12	
	ICAP PLC	41,055	2.925000	120,085.87	
	IMI PLC	25,537	10.170000	259,711.29	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	77,838	24.840000	1,933,495.92	
	INMARSAT PLC	37,435	5.805000	217,310.17	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21,398	16.910000	361,840.18	
	INTERTEK GROUP PLC	12,696	29.600000	375,801.60	
	INVENSYS PLC	62,894	2.230000	140,253.62	
	INVESTEC PLC	42,361	3.848000	163,005.12	
	ITV PLC	286,433	0.967500	277,123.92	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,486	23.260000	383,464.36	
	KAZAKHMYS PLC	18,604	6.935000	129,018.74	
	KINGFISHER PLC	184,361	2.807000	517,501.32	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	467,346	1.431000	668,772.12	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,319,181	0.464050	1,540,265.94	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	14,437	9.855000	142,276.63	
	LONMIN PLC	12,600	2.914000	36,716.40	
	MAN GROUP PLC	138,891	0.776000	107,779.41	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	124,159	3.807000	472,673.31	
	MEGGITT PLC	60,487	3.818000	230,939.36	
	MELROSE PLC	100,000	2.163000	216,300.00	
	NATIONAL GRID PLC	281,857	7.110000	2,004,003.27	
	NEXT PLC	13,453	36.200000	486,998.60	
	OLD MUTUAL PLC	378,141	1.711000	646,999.25	
	PEARSON PLC	65,174	11.890000	774,918.86	
	PETROFAC LTD	20,459	16.300000	333,481.70	
	PRUDENTIAL PLC	199,101	8.890000	1,770,007.89	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	6,986	66.550000	464,918.30	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,783	38.620000	1,961,239.46	
	REED ELSEVIER PLC	95,946	6.245000	599,182.77	
	RESOLUTION LTD	116,321	2.338000	271,958.49	
	REXAM PLC	66,364	4.396000	291,736.14	
	RIO TINTO PLC	105,532	30.065000	3,172,819.58	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS- C	11,130,960	0.001000	11,130.96	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	146,460	8.750000	1,281,525.00	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	161,188	2.940000	473,892.72	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	290,633	20.855000	6,061,151.21	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	207,748	21.545000	4,475,930.66	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	286,691	1.147000	328,834.57	
	SABMILLER PLC	74,728	28.340000	2,117,791.52	
	SAGE GROUP PLC/THE	104,276	3.077000	320,857.25	
	SAINSBURY (J) PLC	99,565	3.336000	332,148.84	
	SCHRODERS PLC	8,259	15.890000	131,235.51	
	SERCO GROUP PLC	40,290	5.555000	223,810.95	
	SEVERN TRENT PLC	18,744	15.710000	294,468.24	
	SHIRE PLC	44,140	17.970000	793,195.80	
	SMITH & NEPHEW PLC	72,230	6.575000	474,912.25	
	SMITHS GROUP PLC	29,471	10.620000	312,982.02	
	SSE PLC	73,007	14.060000	1,026,478.42	
	STANDARD CHARTERED PLC	188,264	14.375000	2,706,295.00	
	STANDARD LIFE PLC	187,216	3.078000	576,250.84	
	TATE & LYLE PLC	37,539	7.735000	290,364.16	
	TESCO PLC	633,168	3.180000	2,013,474.24	
	TUI TRAVEL PLC	32,165	2.629000	84,561.78	
	TULLOW OIL PLC	70,386	13.930000	980,476.98	
	UNILEVER PLC	100,217	23.750000	2,380,153.75	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,530	6.725000	346,539.25	
	VEDANTA RESOURCES PLC	7,455	10.790000	80,439.45	
	VODAFONE GROUP PLC	3,870,547	1.587000	6,142,558.08	
	WEIR GROUP PLC/THE	15,942	17.850000	284,564.70	
	WHITBREAD PLC	14,119	23.550000	332,502.45	

WM MORRISON SUPERMARKETS	183,378	2.617000	479,900.22	
WOLSELEY PLC	22,848	28.150000	643,171.20	
WPP PLC	98,126	8.480000	832,108.48	
XSTRATA PLC	164,532	10.200000	1,678,226.40	
イギリスポンド 小計	33,227,506		116,119,380.67 (15,380,011,969)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	172,512	17.500000	3,018,960.00	
ACTELION LTD-REG	8,929	44.940000	401,269.26	
ADECCO SA-REG	10,297	45.370000	467,174.89	
ARYZTA AG	7,350	46.250000	339,937.50	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,043	77.850000	314,747.55	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	200	494.000000	98,800.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	110	928.000000	102,080.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	41,215	68.600000	2,827,349.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	95,515	21.520000	2,055,482.80	
GAM HOLDING AG	14,202	12.250000	173,974.50	
GEBERIT AG-REG	3,106	193.700000	601,632.20	
GIVAUDAN-REG	646	923.500000	596,581.00	
HOLCIM LTD-REG	18,004	61.900000	1,114,447.60	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,368	31.710000	582,449.28	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,257	115.000000	489,555.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	58	2,946.000000	170,868.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	34,075.000000	272,600.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,916	43.890000	171,873.24	
NESTLE SA-REG	259,364	59.800000	15,509,967.20	
NOVARTIS AG-REG	180,822	56.350000	10,189,319.70	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,257	62.500000	141,062.50	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	974	194.700000	189,637.80	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	55,242	179.100000	9,893,842.20	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,723	124.400000	214,341.20	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,733	126.600000	472,597.80	
SGS SA-REG	430	2,025.000000	870,750.00	
SIKA AG-BR	182	1,962.000000	357,084.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,848	102.500000	394,420.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	635	105.500000	66,992.50	
SULZER AG-REG	1,914	140.200000	268,342.80	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,448	438.700000	1,073,937.60	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,396	75.600000	256,737.60	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,256	130.700000	294,859.20	
SWISS PRIME SITE-REG	3,731	74.500000	277,959.50	
SWISS RE AG	27,515	66.700000	1,835,250.50	
SWISSCOM AG-REG	1,830	383.700000	702,171.00	
SYNGENTA AG-REG	7,449	363.900000	2,710,691.10	
TRANSOCEAN LTD	27,717	42.890000	1,188,782.13	
UBS AG-REG	285,049	14.740000	4,201,622.26	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,605	232.200000	2,694,681.00	
スイスフラン 小計	1,286,856		67,604,831.41 (6,014,801,850)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	802,200	30.350000	24,346,770.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,600	89.700000	1,399,320.00	
BANK OF EAST ASIA	113,820	29.550000	3,363,381.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	291,500	24.100000	7,025,150.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	105,000	13.880000	1,457,400.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	109,000	117.300000	12,785,700.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	38,000	46.300000	1,759,400.00	
CLP HOLDINGS LTD	141,500	67.050000	9,487,575.00	
FIRST PACIFIC CO	164,000	8.360000	1,371,040.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	159,000	4.090000	650,310.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	111,000	28.750000	3,191,250.00	
HANG LUNG GROUP LTD	66,000	44.300000	2,923,800.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	176,000	27.600000	4,857,600.00	
HANG SENG BANK LTD	61,600	117.500000	7,238,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	78,000	54.750000	4,270,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	406,482	20.850000	8,475,149.70	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	80,900	128.000000	10,355,200.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	38,500	29.700000	1,143,450.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	166,000	78.950000	13,105,700.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	51,000	36.800000	1,876,800.00	

KERRY PROPERTIES LTD	57,000	39.250000	2,237,250.00	
LI & FUNG LTD	468,000	12.400000	5,803,200.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	35,500	17.140000	608,470.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	81,200	13.720000	1,114,064.00	
MTR CORP	113,500	30.250000	3,433,375.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	287,000	12.380000	3,553,060.00	
NWS HOLDINGS LTD	106,500	12.040000	1,282,260.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	16,500	48.250000	796,125.00	
PCCW LTD	333,000	3.190000	1,062,270.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	107,000	68.300000	7,308,100.00	
SANDS CHINA LTD	186,400	32.950000	6,141,880.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	15.060000	1,746,960.00	
SINO LAND CO	225,400	13.720000	3,092,488.00	
SJM HOLDINGS LTD	148,000	18.040000	2,669,920.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	124,000	113.800000	14,111,200.00	
SWIRE PACIFIC LTD-A	55,500	95.250000	5,286,375.00	
WHARF HOLDINGS LTD	117,000	57.600000	6,739,200.00	
WHEELOCK & CO LTD	69,000	35.950000	2,480,550.00	
WING HANG BANK LTD	15,500	79.750000	1,236,125.00	
WYNN MACAU LTD	120,400	21.750000	2,618,700.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	60,000	26.800000	1,608,000.00	
香港ドル 小計	6,017,502		196,013,067.70 (2,089,499,301)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	202,000	3.410000	688,820.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	95,000	1.875000	178,125.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	43,000	11.280000	485,040.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	157,000	1.660000	260,620.00	
COSCO CORP SINGAPORE LTD	86,000	0.915000	78,690.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	143,000	13.880000	1,984,840.00	
FRASER AND NEAVE LTD	72,000	9.390000	676,080.00	
GENTING SINGAPORE PLC	512,000	1.220000	624,640.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	160,000	2.550000	408,000.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	553,360	0.610000	337,549.60	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	48.790000	390,320.00	
KEPPEL CORP LTD	115,000	10.620000	1,221,300.00	
KEPPEL LAND LTD	60,000	3.410000	204,600.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.135000	111,230.00	
NOBLE GROUP LTD	304,090	1.075000	326,896.75	
OLAM INTERNATIONAL LTD	117,000	1.655000	193,635.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	204,000	9.140000	1,864,560.00	
SEBMCORP INDUSTRIES LTD	82,000	4.960000	406,720.00	
SEBMCORP MARINE LTD	69,000	4.390000	302,910.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	43,340	10.500000	455,070.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69,000	6.630000	457,470.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,250	4.080000	502,860.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	121,000	3.510000	424,710.00	
SINGAPORE TELECOM LTD	632,260	3.140000	1,985,296.40	
STARHUB LTD	40,000	3.630000	145,200.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	101,000	18.090000	1,827,090.00	
UOL GROUP LTD	39,000	5.430000	211,770.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	162,000	3.150000	510,300.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	168,000	0.905000	152,040.00	
シンガポールドル 小計	4,579,300		17,416,382.75 (1,177,347,473)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81,688	2.650000	216,473.20	
CONTACT ENERGY LTD	26,093	5.080000	132,552.44	
FLETCHER BUILDING LTD	50,812	7.990000	405,987.88	
SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP	49,774	3.790000	188,643.46	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	154,426	2.360000	364,445.36	
ニュージーランドドル 小計	362,793		1,308,102.34 (89,055,607)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	27,920	124.700000	3,481,624.00	
ASSA ABLOY AB-B	26,646	235.500000	6,275,133.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	54,156	169.400000	9,174,026.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	29,907	151.200000	4,521,938.40	
BOLIDEN AB	20,204	115.700000	2,337,602.80	
ELECTROLUX AB-SER B	19,232	173.500000	3,336,752.00	

ELEKTA AB-B SHS	28,320	94.050000	2,663,496.00	
ERICSSON LM-B SHS	238,951	59.900000	14,313,164.90	
GETINGE AB-B SHS	15,461	212.200000	3,280,824.20	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	74,538	218.500000	16,286,553.00	
HEXAGON AB-B SHS	18,406	163.900000	3,016,743.40	
HOLMEN AB-B SHARES	4,448	186.200000	828,217.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	29,317	39.050000	1,144,828.85	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	15,038	127.600000	1,918,848.80	
INVESTOR AB-B SHS	34,889	148.900000	5,194,972.10	
LUNDIN PETROLEUM AB	17,448	156.800000	2,735,846.40	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,766	568.500000	2,709,471.00	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,572	216.500000	773,338.00	
NORDEA BANK AB	206,816	60.550000	12,522,708.80	
RATOS AB-B SHS	15,854	64.250000	1,018,619.50	
SANDVIK AB	77,537	96.250000	7,462,936.25	
SCANIA AB-B SHS	24,907	136.500000	3,399,805.50	
SECURITAS AB-B SHS	26,395	51.400000	1,356,703.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	114,334	53.300000	6,094,002.20	
SKANSKA AB-B SHS	30,147	104.700000	3,156,390.90	
SKF AB-B SHARES	30,364	160.200000	4,864,312.80	
SSAB AB-A SHARES	12,259	53.450000	655,243.55	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,824	132.000000	6,180,768.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	38,644	230.900000	8,922,899.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	64,988	120.000000	7,798,560.00	
SWEDISH MATCH AB	15,894	224.300000	3,565,024.20	
TELE2 AB-B SHS	25,798	116.400000	3,002,887.20	
TELIASONERA AB	173,143	44.910000	7,775,852.13	
VOLVO AB-B SHS	111,474	93.250000	10,394,950.50	
スウェーデンクローネ 小計	1,678,597		172,165,044.98 (2,145,176,460)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	13,200	106.400000	1,404,480.00	
DNB ASA	78,339	71.500000	5,601,238.50	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,111	83.550000	1,095,424.05	
NORSK HYDRO ASA	70,019	26.190000	1,833,797.61	
ORKLA ASA	61,733	46.220000	2,853,299.26	
SEADRILL LTD	28,236	222.600000	6,285,333.60	
STATOIL ASA	88,313	139.800000	12,346,157.40	
SUBSEA 7 SA	21,777	131.200000	2,857,142.40	
TELENOR ASA	57,520	116.400000	6,695,328.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	14,467	273.500000	3,956,724.50	
ノルウェークローネ 小計	446,715		44,928,925.32 (657,310,177)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	46	38,840.000000	1,786,640.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	105	41,120.000000	4,317,600.00	
CARLSBERG AS-B	8,209	546.000000	4,482,114.00	
COLOPLAST-B	1,704	1,336.000000	2,276,544.00	
DANSKE BANK A/S	53,139	95.000000	5,048,205.00	
DSV A/S	15,776	135.300000	2,134,492.80	
NOVO NORDISK A/S-B	32,079	921.000000	29,544,759.00	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,190	152.100000	2,918,799.00	
TDC A/S	40,164	39.210000	1,574,830.44	
TRYG A/S	1,908	404.300000	771,404.40	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,242	475.200000	1,065,398.40	
デンマーククローネ 小計	174,562		55,920,787.04 (803,022,501)	
イスラエルシェゲル				
BANK HAPOLIM BM	81,230	15.660000	1,272,061.80	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	97,273	12.900000	1,254,821.70	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	174,078	4.791000	834,007.69	
ISRAEL CHEMICALS LTD	35,743	46.630000	1,666,696.09	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	227	2,458.000000	557,966.00	
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,800	330.000000	924,000.00	
NICE SYSTEMS LTD	5,776	127.400000	735,862.40	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	73,846	154.200000	11,387,053.20	
イスラエルシェゲル 小計	470,973		18,632,468.88 (398,734,834)	
ユーロ				
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	29,883	11.140000	332,896.62	

ACCIONA SA	2,042	48.185000	98,393.77
ACCOR SA	12,412	25.110000	311,665.32
ACERINOX SA	7,250	8.451000	61,269.75
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,624	16.290000	189,354.96
ADIDAS AG	16,220	66.160000	1,073,115.20
ADP	2,678	59.860000	160,305.08
AEGON NV	133,547	4.388000	586,004.23
AGEAS	18,939	20.450000	387,302.55
AIR LIQUIDE SA	24,482	94.450000	2,312,324.90
AKZO NOBEL	18,585	42.535000	790,512.97
ALCATEL-LUCENT	185,432	0.891000	165,219.91
ALLIANZ SE-REG	35,568	98.120000	3,489,932.16
ALSTOM	16,380	27.550000	451,269.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	24,875	18.000000	447,750.00
ANDRITZ AG	5,832	47.900000	279,352.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	63,085	66.890000	4,219,755.65
ARCELORMITTAL	74,900	11.710000	877,079.00
ARKEMA	4,790	76.670000	367,249.30
ASML HOLDING NV	32,863	44.600000	1,465,689.80
ASSICURAZIONI GENERALI	90,957	12.710000	1,156,063.47
ATLANTIA SPA	26,010	12.750000	331,627.50
ATOS	4,454	54.000000	240,516.00
AUTOGRILL SPA	7,826	7.365000	57,638.49
AXA SA	138,886	12.350000	1,715,242.10
AXEL SPRINGER AG	3,401	33.070000	112,471.07
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	485,915	0.201400	97,863.28
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	422,047	6.460000	2,726,423.62
BANCO DE SABADELL SA	221,429	1.972000	436,657.98
BANCO POPOLARE SCARL	130,709	1.149000	150,184.64
BANCO POPULAR ESPANOL	349,343	0.550000	192,138.65
BANCO SANTANDER SA	773,261	5.810000	4,492,646.41
BASF SE	71,987	67.540000	4,862,001.98
BAYER AG-REG	64,867	69.740000	4,523,824.58
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,115	65.780000	1,717,844.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,702	45.175000	167,237.85
BEIERSDORF AG	8,500	60.150000	511,275.00
BELGACOM SA	13,508	22.615000	305,483.42
BNP PARIBAS	76,359	42.600000	3,252,893.40
BOSKALIS WESTMINSTER	5,800	31.120000	180,496.00
BOUYGUES SA	14,729	18.370000	270,571.73
BRENTAG AG	4,100	96.940000	397,454.00
BUREAU VERITAS SA	4,387	84.610000	371,184.07
CAIXABANK	64,431	2.772000	178,602.73
CAP GEMINI	11,302	31.425000	355,165.35
CARREFOUR SA	45,967	18.850000	866,477.95
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,324	68.670000	296,929.08
CELESIO AG	6,516	13.205000	86,043.78
CHRISTIAN DIOR	4,275	118.450000	506,373.75
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	12,146	23.585000	286,463.41
CNP ASSURANCES	11,531	11.060000	127,532.86
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	16,655	17.220000	286,799.10
COLRUYT SA	5,864	35.970000	210,928.08
COMMERZBANK AG	290,419	1.349000	391,775.23
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	30,393	30.000000	911,790.00
CONTINENTAL AG	6,257	80.390000	503,000.23
CREDIT AGRICOLE SA	82,083	5.800000	476,081.40
CRH PLC	58,167	13.995000	814,047.16
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	71,505	37.030000	2,647,830.15
DANONE	45,562	48.835000	2,225,020.27
DASSAULT SYSTEMES SA	4,676	85.030000	397,600.28
DE MASTER BLENDEERS1753 NV	48,700	9.020000	439,274.00
DELHAIZE GROUP	7,843	27.315000	214,231.54
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	73,123	33.805000	2,471,923.01
DEUTSCHE BOERSE AG	15,464	42.600000	658,766.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,144	12.585000	228,342.24
DEUTSCHE POST AG-REG	66,821	15.795000	1,055,437.69
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	221,854	8.411000	1,866,013.99
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,659	4.826000	220,350.33
E.ON SE	141,891	13.910000	1,973,703.81

EADS NV	31,905	24.895000	794,274.97	
EDENRED	12,975	23.395000	303,550.12	
EDF	19,286	14.730000	284,082.78	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	165,382	1.950000	322,494.90	
ELAN CORP PLC	42,186	8.110000	342,128.46	
ELISA OYJ	11,720	16.740000	196,192.80	
ENAGAS SA	13,875	15.080000	209,235.00	
ENEL GREEN POWER SPA	136,769	1.293000	176,842.31	
ENEL SPA	512,156	2.922000	1,496,519.83	
ENI SPA	201,474	18.020000	3,630,561.48	
ERSTE GROUP BANK AG	17,718	21.190000	375,444.42	
ESSILOR INTERNATIONAL	15,896	74.230000	1,179,960.08	
EURAZEO	2,774	36.645000	101,653.23	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	10,840	23.735000	257,287.40	
EXOR SPA	5,660	18.710000	105,898.60	
FERROVIAL SA	34,016	11.255000	382,850.08	
FIAT INDUSTRIAL	67,349	8.510000	573,139.99	
FIAT SPA	64,516	3.412000	220,128.59	
FINMECCANICA SPA	31,249	3.872000	120,996.12	
FORTUM OYJ	35,233	13.960000	491,852.68	
FRANCE TELECOM SA	145,065	8.251000	1,196,931.31	
FRAPORT AG	2,774	42.600000	118,172.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRESENIUS SE & CO KGAA	16,519	51.350000	848,250.65	
FUGRO NV-CVA	9,848	86.270000	849,586.96	
FUGRO NV-CVA	5,393	43.165000	232,788.84	
GALP ENERGIA SGPS SA	20,637	12.400000	255,898.80	
GAS NATURAL SDG SA	28,883	12.300000	355,260.90	
GDF SUEZ	100,878	17.180000	1,733,084.04	
GEA GROUP AG	14,472	24.555000	355,359.96	
GEMALTO	6,439	71.150000	458,134.85	
GRIFOLS SA	11,671	24.590000	286,989.89	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,173	59.550000	367,602.15	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	48,434	5.616000	272,005.34	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,400	57.000000	250,800.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,630	39.565000	420,575.95	
HEINEKEN HOLDING NV	8,071	40.905000	330,144.25	
HEINEKEN NV	18,082	49.670000	898,132.94	
HENKEL AG & CO KGAA	10,561	51.570000	544,630.77	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,813	62.880000	868,561.44	
HOCHTIEF AG	2,392	39.750000	95,082.00	
HUGO BOSS AG -ORD	2,092	80.700000	168,824.40	
IBERDROLA SA	303,524	4.022000	1,220,773.52	
ILIAD SA	1,783	133.650000	238,297.95	
IMERYS SA	2,595	45.270000	117,475.65	
IMMOFINANZ AG	72,491	3.020000	218,922.82	
INDITEX	17,220	102.450000	1,764,189.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	88,747	5.916000	525,027.25	
ING GROEP NV-CVA	304,648	6.938000	2,113,647.82	
INTESA SANPAOLO	811,570	1.272000	1,032,317.04	
INTESA SANPAOLO-RSP	65,939	1.045000	68,906.25	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	69,461	2.080000	144,478.88	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248			
JERONIMO MARTINS	18,589	14.500000	269,540.50	
K+S AG-REG	13,266	33.175000	440,099.55	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	7,148	54.500000	389,566.00	
KBC GROEP NV	12,738	22.560000	287,369.28	
KERRY GROUP PLC-A	11,990	39.630000	475,163.70	
KESKO OYJ-B SHS	5,314	24.430000	129,821.02	
KONE OYJ-B	12,015	56.700000	681,250.50	
KONINKLIJKE AHOLD NV	82,085	9.612000	789,001.02	
KONINKLIJKE DSM NV	12,143	43.225000	524,881.17	
KONINKLIJKE KPN NV	77,719	4.283000	332,870.47	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	81,330	20.090000	1,633,919.70	

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ					
	LAFARGE SA	14,831	44.675000	662,574.92	
	LAGARDERE S.C.A.	9,629	22.350000	215,208.15	
	LANXESS AG	6,531	65.450000	427,453.95	
	LEGRAND SA	18,523	30.170000	558,838.91	
	LINDE AG	14,510	131.700000	1,910,967.00	
	L'OREAL	18,891	104.400000	1,972,220.40	
	LUXOTTICA GROUP SPA	8,861	30.850000	273,361.85	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	20,027	130.550000	2,614,524.85	
	MAN SE	3,277	80.430000	263,569.11	
	MAPFRE SA	60,537	2.230000	134,997.51	
	MEDIASET SPA	58,500	1.304000	76,284.00	
	MEDIOBANCA SPA	45,048	4.224000	190,282.75	
	MERCK KGAA	4,982	100.250000	499,445.50	
	METRO AG	11,047	22.155000	244,746.28	
	METSO OYJ	10,105	28.810000	291,125.05	
	MICHELIN (CGDE)	14,253	69.400000	989,158.20	
	MOBISTAR SA	2,475	19.985000	49,462.87	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,199	129.900000	1,844,450.10	
	NATIXIS	79,227	2.425000	192,125.47	
	NESTE OIL OYJ	13,107	9.810000	128,579.67	
	NOKIA OYJ	286,837	2.754000	789,949.09	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	8,978	31.440000	282,268.32	
	OMV AG	11,398	27.240000	310,481.52	
	ORION OYJ-CLASS B	7,072	20.100000	142,147.20	
	PERNOD-RICARD SA	16,644	86.740000	1,443,700.56	
	PEUGEOT SA	21,826	4.753000	103,738.97	
	PIRELLI & C.	17,226	8.475000	145,990.35	
	POHJOLA BANK PLC-A SHS	11,086	10.580000	117,289.88	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	11,954	53.260000	636,670.04	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	51,177	3.674000	188,024.29	
	PPR	5,837	139.850000	816,304.45	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PRF	7,592	21.920000	166,416.64	
	PRYSMIAN SPA	16,699	14.750000	246,310.25	
	PUBLICIS GROUPE	14,062	43.605000	613,173.51	
	QIAGEN N.V.	19,850	14.175000	281,373.75	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,565	32.685000	116,522.02	
	RANDSTAD HOLDING NV	9,474	24.075000	228,086.55	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,582	36.250000	311,097.50	
	REED ELSEVIER NV	55,490	10.765000	597,349.85	
	REMY COINTREAU	1,488	85.480000	127,194.24	
	RENAULT SA	15,385	38.190000	587,553.15	
	REPSOL SA	64,508	16.730000	1,079,218.84	
	REXEL SA	8,736	14.700000	128,419.20	
	RWE AG	38,382	32.380000	1,242,809.16	
	RWE AG-NON VTG PREF	2,346	29.300000	68,737.80	
	SAFRAN SA	17,463	31.000000	541,353.00	
	SAIPEM SPA	21,262	33.700000	716,529.40	
	SALZGITTER AG	3,128	33.560000	104,975.68	
	SAMPO OYJ-A SHS	32,903	24.690000	812,375.07	
	SANOFI	93,162	69.300000	6,456,126.60	
	SAP AG	72,139	59.630000	4,301,648.57	
	SBM OFFSHORE NV	12,440	8.145000	101,323.80	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	40,755	52.900000	2,155,939.50	
	SCOR SE	12,398	20.180000	250,191.64	
	SES	22,479	21.295000	478,690.30	
	SIEMENS AG-REG	64,425	78.280000	5,043,189.00	
	SNAM SPA	136,195	3.420000	465,786.90	
	SOCIETE BIC SA	2,250	99.870000	224,707.50	
	SOCIETE GENERALE	54,663	27.135000	1,483,280.50	
	SODEXO	7,660	61.910000	474,230.60	
	SOLVAY SA	4,644	99.890000	463,889.16	
	STMICROELECTRONICS NV	48,058	4.678000	224,815.32	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	42,501	4.928000	209,444.92	
	SUEDZUCKER AG	4,799	29.250000	140,370.75	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	23,106	8.164000	188,637.38	

TECHNIP SA	7,997	87.830000	702,376.51	
TELECOM ITALIA SPA	722,016	0.701000	506,133.21	
TELECOM ITALIA-RSP	454,039	0.604500	274,466.57	
TELEFONICA SA	317,834	10.260000	3,260,976.84	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,491	5.271000	81,653.06	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,189	35.175000	147,348.07	
TENARIS SA	37,781	15.230000	575,404.63	
TERNA SPA	104,532	2.858000	298,752.45	
THALES SA	7,336	26.910000	197,411.76	
THYSSENKRUPP AG	30,811	16.790000	517,316.69	
TNT EXPRESS NV	25,247	7.305000	184,429.33	
TOTAL SA	167,463	38.600000	6,464,071.80	
UBI BANCA SCPA	65,520	2.826000	185,159.52	
UCB SA	8,572	43.070000	369,196.04	
UMICORE	8,992	39.295000	353,340.64	
UNICREDIT SPA	317,123	3.552000	1,126,420.89	
UNILEVER NV-CVA	128,387	28.740000	3,689,842.38	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,427	16.250000	120,688.75	
UPM-KYMMENE OYJ	41,542	8.490000	352,691.58	
VALLOUREC	7,908	38.000000	300,504.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,852	8.112000	217,823.42	
VERBUND AG	6,128	17.300000	106,014.40	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	2,881	35.075000	101,051.07	
VINCI SA	36,723	33.690000	1,237,197.87	
VIVENDI	102,708	16.590000	1,703,925.72	
VOESTALPINE AG	8,689	24.080000	209,231.12	
VOLKSWAGEN AG	2,309	150.850000	348,312.65	
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,429	162.250000	1,854,355.25	
VOPAK	5,604	56.340000	315,729.36	
WACKER CHEMIE AG	1,300	44.250000	57,525.00	
WARTSILA OYJ ABP	13,374	32.230000	431,044.02	
WENDEL	2,600	69.360000	180,336.00	
WOLTERS KLUWER	24,628	14.510000	357,352.28	
ZARDOYA OTIS SA	11,750	9.700000	113,975.00	
ZODIAC AEROSPACE	2,528	81.210000	205,298.88	
ユーロ小計	13,721,914		179,197,183.52 (19,195,602,298)	
合計	93,805,097		145,319,666,872 (145,319,666,872)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨		口数(口)	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,400.00	804,164.00	
	AMERICAN TOWER CORP	31,300.00	2,346,874.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	76,900.00	1,135,044.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,500.00	964,050.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,700.00	1,205,802.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,000.00	391,080.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000.00	579,420.00	
	DUKE REALTY CORP	19,400.00	260,542.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	24,000.00	1,307,040.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,300.00	549,398.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	32,800.00	623,856.00	
	HCP INC	35,800.00	1,635,702.00	
	HEALTH CARE REIT INC	20,300.00	1,223,278.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	57,000.00	836,760.00	
	KIMCO REALTY CORP	32,000.00	613,440.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,900.00	308,919.00	
	MACERICH CO/THE	10,800.00	615,276.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	13,300.00	559,132.00	
	PROLOGIS INC	37,000.00	1,261,330.00	
	PUBLIC STORAGE	11,500.00	1,670,605.00	
	RAYONIER INC	9,600.00	473,472.00	
	REALTY INCOME CORP	9,500.00	373,635.00	

	REGENCY CENTERS CORP	6,700.00	311,952.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,800.00	3,608,556.00	
	SL GREEN REALTY CORP	6,900.00	509,979.00	
	UDR INC	19,600.00	449,036.00	
	VENTAS INC	23,200.00	1,509,392.00	
	VORNADO REALTY TRUST	13,200.00	998,052.00	
	WEYERHAEUSER CO	42,000.00	1,122,240.00	
	投資証券 小計	630,400.00	28,248,026.00	(2,334,134,388)
	アメリカドル 小計	630,400.00	28,248,026.00	(2,334,134,388)
	カナダドル			
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,100.00	143,655.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11,300.00	304,422.00	
	投資証券 小計	17,400.00	448,077.00	(37,280,006)
	カナダドル 小計	17,400.00	448,077.00	(37,280,006)
	オーストラリアドル			
投資証券	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	95,834.00	206,043.10	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	142,816.00	277,063.04	
	DEXUS PROPERTY GROUP	376,494.00	374,611.53	
	GOODMAN GROUP	125,866.00	577,724.94	
	GPT GROUP	104,969.00	365,292.12	
	MIRVAC GROUP	271,719.00	396,709.74	
	STOCKLAND	178,728.00	616,611.60	
	WESTFIELD GROUP	170,019.00	1,774,998.36	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	227,831.00	692,606.24	
	投資証券 小計	1,694,276.00	5,281,660.67	(456,441,115)
	オーストラリアドル 小計	1,694,276.00	5,281,660.67	(456,441,115)
	イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	64,653.00	345,893.55	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	50,078.00	172,017.93	
	HAMMERSON PLC	57,875.00	268,540.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	60,685.00	482,445.75	
	SEGRO PLC	57,308.00	130,375.70	
	投資証券 小計	290,599.00	1,399,272.93	(185,333,699)
	イギリスポンド 小計	290,599.00	1,399,272.93	(185,333,699)
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	175,000.00	7,516,250.00	
	投資証券 小計	175,000.00	7,516,250.00	(80,123,225)
	香港ドル 小計	175,000.00	7,516,250.00	(80,123,225)
	シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,000.00	384,000.00	
	CAPITAMALL TRUST	201,000.00	414,060.00	
	投資証券 小計	361,000.00	798,060.00	(53,948,856)
	シンガポールドル 小計	361,000.00	798,060.00	(53,948,856)
	ユーロ			
投資証券	CORIO NV	5,173.00	171,045.24	
	FONCIERE DES REGIONS	1,756.00	107,432.08	
	GECINA SA	1,635.00	141,100.50	
	ICADE	1,941.00	130,493.43	
	KLEPIERRE	7,368.00	209,988.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,200.00	1,234,440.00	
	投資証券 小計	25,073.00	1,994,499.25	(213,650,759)
	ユーロ 小計	25,073.00	1,994,499.25	(213,650,759)
	合計		3,360,912,048	(3,360,912,048)

(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 574銘柄	97.29%		56.36%
	投資証券 29銘柄		2.71%	1.57%
カナダドル	株式 98銘柄	99.54%		5.39%
	投資証券 2銘柄		0.46%	0.03%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	92.40%		3.73%
	投資証券 9銘柄		7.60%	0.31%
イギリスポンド	株式 102銘柄	98.81%		10.34%
	投資証券 5銘柄		1.19%	0.12%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%		4.05%
香港ドル	株式 41銘柄	96.31%		1.41%
	投資証券 1銘柄		3.69%	0.05%
シンガポールドル	株式 29銘柄	95.62%		0.79%
	投資証券 2銘柄		4.38%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%		0.06%
スウェーデンクローネ	株式 34銘柄	100.00%		1.44%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%		0.44%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.00%		0.54%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%		0.27%
ユーロ	株式 233銘柄	98.90%		12.91%
	投資証券 6銘柄		1.10%	0.14%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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](#)

「マネーパールファンド（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3期	第4期
	[平成24年5月21日現在]	[平成24年11月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	286	297
親投資信託受益証券	113,921	118,443
流動資産合計	114,207	118,740
資産合計	114,207	118,740
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	114,039	118,509
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	168	231
(分配準備積立金)	129	167
元本等合計	114,207	118,740
純資産合計	114,207	118,740
負債純資産合計	114,207	118,740

(2) 損益及び剰余金計算書

	第3期	第4期
	自平成23年11月22日 至平成24年5月21日	自平成24年5月22日 至平成24年11月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益	40	56
営業収益合計	40	56
営業費用		
営業費用合計		
営業利益	40	56
経常利益	40	56
当期純利益	40	56
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		3
期首剰余金又は期首欠損金()	89	168
剰余金増加額又は欠損金減少額	39	34
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	39	34
剰余金減少額又は欠損金増加額		24
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		24
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()	168	231

(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、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年5月22日から平成24年11月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 [平成24年5月21日現在]	第4期 [平成24年11月20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 30,000円	114,039円 20,000円 15,530円
2 受益権の総数	114,039口	118,509口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0015円 (10,015円)	1.0019円 (10,019円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	
収益分配金額	I=F*H/10,000	

第4期(自平成24年5月22日至平成24年11月20日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	39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	14円
収益調整金額	C	64円
分配準備積立金額	D	114円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	231円
当ファンドの期末残存口数	F	118,509口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	19円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金額	I=F*H/10,000	

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第3期 (自平成23年11月22日 至平成24年5月21日)	第4期 (自平成24年5月22日 至平成24年11月20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3期 [平成24年5月21日現在]	第4期 [平成24年11月20日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2 時価の算定方法	(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3期 [平成24年5月21日現在]	第4期 [平成24年11月20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	44	57
合計	44	57

（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	116,475	118,443	
	親投資信託受益証券 小計	116,475	118,443	
	合計	116,475	118,443	

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。

[前へ](#) [次へ](#)

「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24年5月21日現在]	[平成24年11月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	647,903,487	744,245,252
国債証券	3,049,637,250	2,399,686,600
未収利息	1,492	1,691
流動資産合計	3,697,542,229	3,143,933,543
資産合計	3,697,542,229	3,143,933,543
負債の部		
流動負債		
未払金		299,922,300
未払解約金	1,183,211	5,479,760
流動負債合計	1,183,211	305,402,060
負債合計	1,183,211	305,402,060
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,636,601,179	2,791,289,779
剰余金		
剰余金又は欠損金()	59,757,839	47,241,704
元本等合計	3,696,359,018	2,838,531,483
純資産合計	3,696,359,018	2,838,531,483
負債純資産合計	3,697,542,229	3,143,933,543

(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24年5月21日現在]	[平成24年11月20日現在]
1 期首	平成23年11月22日	平成24年5月22日
期首元本額	4,926,216,651円	3,636,601,179円
期首からの追加設定元本額	1,892,504,577円	1,699,003,347円
期首からの一部解約元本額	3,182,120,049円	2,544,314,747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	120,912,458円	150,351,420円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)ファンド・マネジャー(新興国株式)	24,866,713円	24,866,713円
三菱UFJ 新興国債券ファンド(新興国債券)	32,418円	32,418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)	308,759円	62,865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)	38,059,510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)	997,724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)	170,286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)	126,013,765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)	584,396,001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)	724,288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)	1,480,020円	4,381,279円

三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	2,286,763,308円	1,329,480,546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)	197,649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)	2,712,786円	2,712,786円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネーボール・ファンド	12,374,921円	5,545,056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)	641,165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)	2,807,148円	1,843,150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)	2,571,019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)	1,694,849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<マネーボールファンド>	18,332,232円	22,438,640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)	1,784,527円	1,784,527円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド	68,417,834円	68,417,834円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド	1,081,386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)	55,440,512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)	2,363,393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)	929,681円	358,088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)	6,098,505円	2,100,667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)	12,197,893円	3,836,590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)	5,416,358円	1,787,931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<マネーボールファンド>	3,505,646円	4,531,823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)	19,365,265円	62,195,714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)	501,843円	1,170,608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)	3,276,715円	7,122,869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)	4,929,750円	23,252,961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)	560,929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)	1,613,828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<マネーボールファンド>	3,250,307円	128,949,771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)	2,221,253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)	42,187円	84,425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)	31,180円	52,890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)	35,726円	48,613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)	67,305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<マネーボールファンド>	981,935円	1,094,618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	1,582,418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	187,592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	623,073円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド ユーロ円プレミアム(毎月分配型)		878,816円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)		3,765円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)		984円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)		984円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)		984円
三菱UFJ 米国リートファンドA<為替ヘッジあり>(毎月決算型)		491,836円

三菱UFJ 米国リートファンドB<為替ヘッジなし> (毎月決算型)		98,368円
N a v i o インド債券ファンド	885,566円	885,566円
N a v i o マネープールファンド	1,005,262円	985,833円
三菱UFJ インド債券オープン(毎月決算型)		39,351円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	112,083円	116,475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	85,846,700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)	16,982,851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)	6,088,342円	15,244,519円
(合計)	3,636,601,179円	2,791,289,779円
2 受益権の総数	3,636,601,179口	2,791,289,779口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0164円 (10,164円)	1.0169円 (10,169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11月22日 至平成24年5月21日)	(自平成24年5月22日 至平成24年11月20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24年5月21日現在]	[平成24年11月20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24年5月21日現在]	[平成24年11月20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	14,291	4,327
合計	14,291	4,327

(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305回国庫短期証券	700,000,000	699,986,000	
	第308回国庫短期証券	300,000,000	299,985,000	
	第309回国庫短期証券	200,000,000	199,986,200	
	第313回国庫短期証券	100,000,000	99,986,500	
	第317回国庫短期証券	100,000,000	99,983,500	
	第319回国庫短期証券	100,000,000	99,981,600	
	第321回国庫短期証券	300,000,000	299,932,500	
	第323回国庫短期証券	100,000,000	99,975,800	
	第324回国庫短期証券	500,000,000	499,869,500	
		国債証券 小計	2,400,000,000	2,399,686,600
	合計	2,400,000,000	2,399,686,600	

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12月28日現在
(単位:円)

資産総額	2,053,261,426
負債総額	228,546
純資産総額(-)	2,053,032,880
発行済口数	1,800,000 口
1口当たり純資産価額(/)	1,140.57 (100口当たり 114,057)

<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12月28日現在
(単位:円)

資産総額	2,049,558,377
負債総額	180,674
純資産総額(-)	2,049,377,703
発行済口数	1,797,662,287 口
1口当たり純資産価額(/)	1.1400 (1万口当たり 11,400)

<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12月28日現在
(単位:円)

資産総額	158,018,606,657
負債総額	284,412,849
純資産総額(-)	157,734,193,808
発行済口数	134,196,788,155 口
1口当たり純資産価額(/)	1.1754 (1万口当たり 11,754)

<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12月28日現在
(単位:円)

資産総額	118,763
負債総額	
純資産総額(-)	118,763
発行済口数	118,509 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0021 (1万口当たり 10,021)

<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12月28日現在
(単位:円)

資産総額	2,774,666,155
負債総額	1,184
純資産総額(-)	2,774,664,971
発行済口数	2,728,144,095 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0171 (1万口当たり 10,171)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

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

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたとときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

平成24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。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

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

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（5名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成24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。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年12月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	399	6,256,417
追加型公社債投資信託	18	514,616
単位型株式投資信託	7	19,211
単位型公社債投資信託	3	83,295
合計	427	6,873,538

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

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

(2) 監査証明について

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

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

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

(4) 時効後支払損引当金

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

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

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

2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

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

2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

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

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

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

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

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

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第26期(平成23年3月31日現在)

(単位:千円)

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

第27期(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 未収委託者報酬

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

(4) 長期性預金

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

(5) 投資有価証券

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

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

(単位：千円)

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

第27期（平成24年3月31日現在）

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

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

第27期（平成24年3月31日現在）

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

3. 売却したその他有価証券

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

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

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

(デリバティブ取引関係)
重要な取引はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

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

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

(注)「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

(1) 退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

(2) 割引率

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

(3) 期待運用収益率

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

(4) 数理計算上の差異の処理年数

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

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

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第26期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

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

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

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

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

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

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

第27期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2.親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表
(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		16,996,643
有価証券		8,000,000
前払費用		336,791
未収入金		221,616
未収委託者報酬		3,698,009
未収収益		39,360
繰延税金資産		374,925
金銭の信託		30,000
その他		27,966
流動資産合計		29,725,313
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	269,044
器具備品	1	174,256
土地		1,205,031
有形固定資産合計		1,648,332
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		874,592
ソフトウェア仮勘定		414,462
その他		9
無形固定資産合計		1,304,887
投資その他の資産		
投資有価証券		13,875,312
関係会社株式		320,136
長期性預金		5,500,000
長期差入保証金		831,857
繰延税金資産		297,670
その他		15,035
投資その他の資産合計		20,840,011
固定資産合計		23,793,231
資産合計		53,518,545

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

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

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(自平成24年4月1日
至平成24年9月30日)

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

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

(4) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

[会計方針の変更]

第28期中間会計期間

(自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日)

(減価償却方法の変更)

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

なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

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

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

(金融商品関係)

第28期中間会計期間(平成24年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(2)有価証券、(3)未収委託者報酬

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

(4)長期性預金

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

(5)投資有価証券

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

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

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

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

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

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

重要な取引はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成24年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成24年9月末現在)	事業の内容
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。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
モルガン・スタンレーMUF G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。

2【関係業務の概要】

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

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成24年12月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の50.0%（62,050株）を所有しています。

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元金が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・換金時期については制限がありますのでご注意ください。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、上場証券投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成25年1月9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24年6月9日から平成24年12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12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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

長島 拓也

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山田 信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

[前へ](#)