

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年3月7日
【計算期間】	第10期（自平成27年6月9日 至平成27年12月8日）
【ファンド名】	MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 金上 孝
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	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）
【提出書類】	募集事項等記載書面
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年3月7日
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 金上 孝
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【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）

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

【証券情報】**(1) 【ファンドの名称】**

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国際投信が運用する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国際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国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <http://maxis.muam.jp/>

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

なお、当ファンドでは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国際投信株式会社

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

(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国際投信株式会社

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

(7) 【申込期間】

平成28年3月8日から平成29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、下記にてご確認ください。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（9）【払込期日】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（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。

【有価証券報告書】

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

日本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。

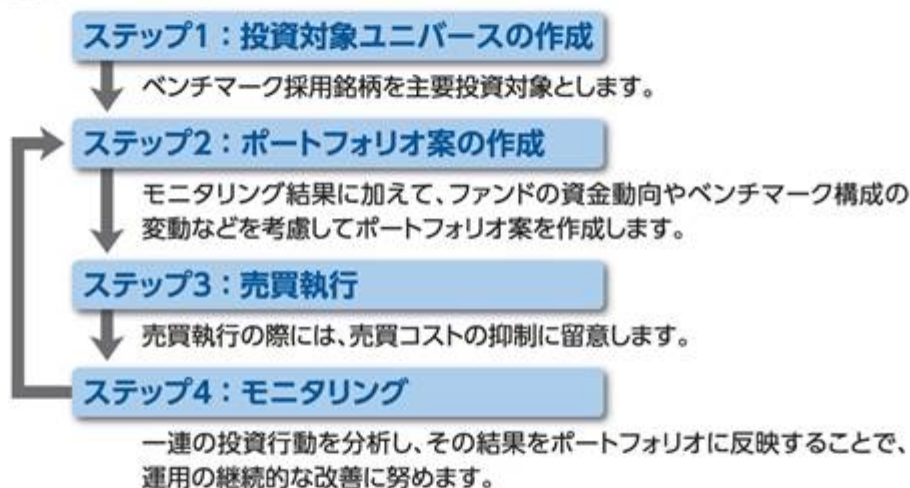
ファンドの特色

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。

＜運用プロセスのイメージ＞



❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

＜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、日本を除く世界の先進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.msicibarra.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.msicibarra.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。

<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回の決算時に分配を行います。

- ・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(マクス)」の由来

「MAXIS(マクス)」は三菱UFJ国際投信が運用する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「お客さまの投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJ国際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ためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社および MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしている MSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI 指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社および MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社および MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社および MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

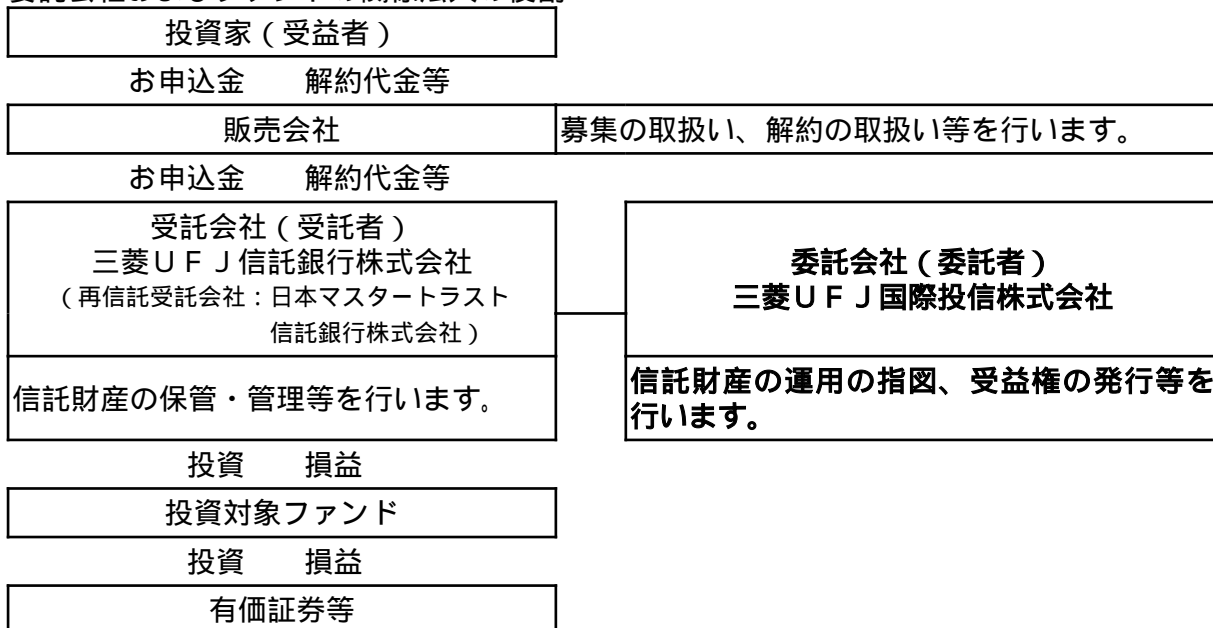
（２）【ファンドの沿革】

平成22年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27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
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成27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	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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、「マネープールファンド（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 >

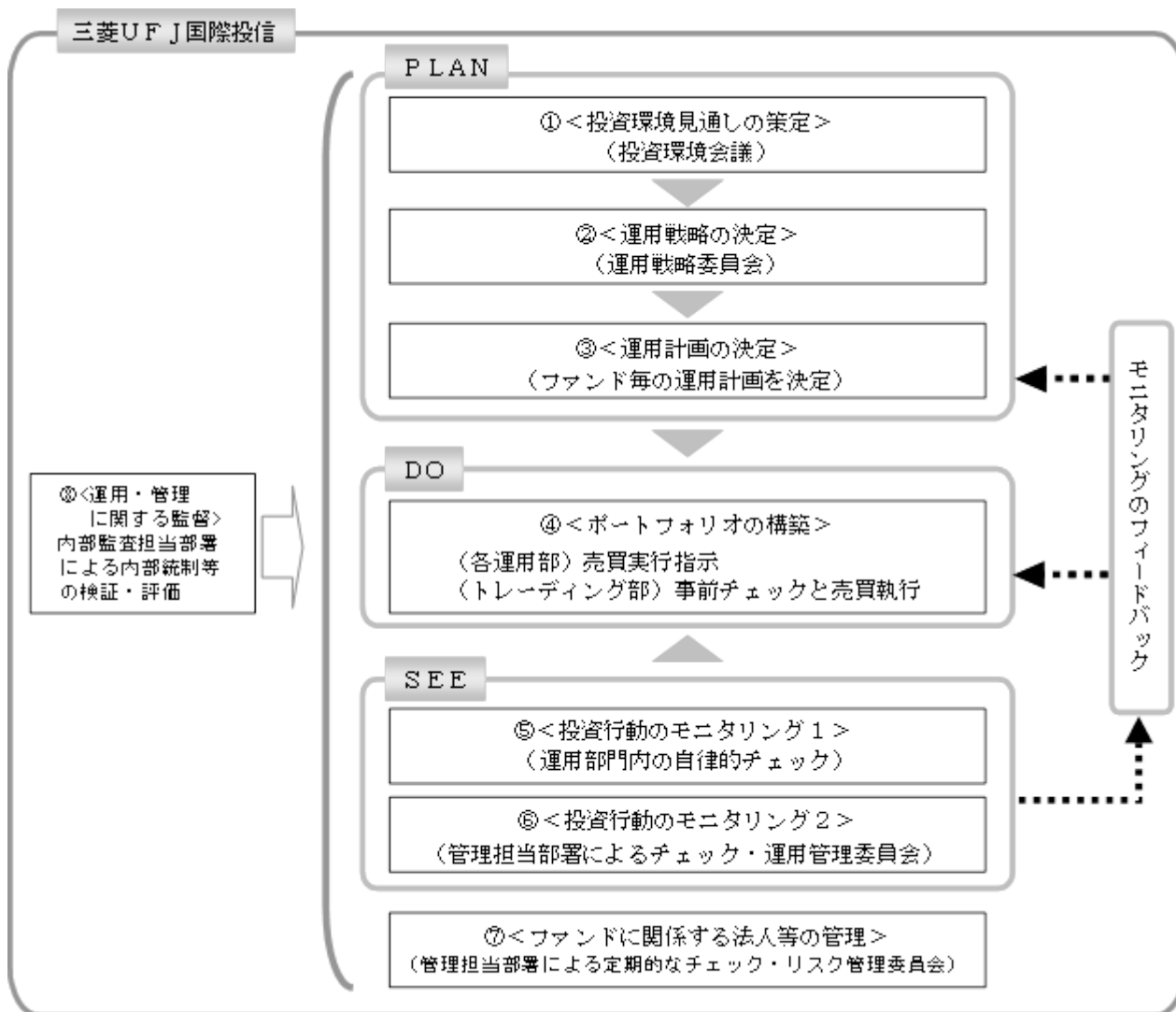
ファンド名	MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資対象	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
投資態度	外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式に実質的な投資を行い、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
投資制限	①株式への実質投資割合に制限を設けません。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。 ⑦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。 ⑧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。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年0.108%(税込)
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2010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	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	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	投資成果をMSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。 ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
投資制限	①株式への投資割合に制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③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。 ④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。 ⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。 ⑦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。 ⑧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。
運用管理費用(信託報酬)	ありません。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	基準価額の0.1%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2001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	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。 ⑨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。 ⑩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。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年0.0324%(税込)
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2010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	①株式への投資は行いません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等を行うことができます。 ④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。 ⑤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。
運用管理費用(信託報酬)	ありません。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2005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。

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

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

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

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

投資信託は預貯金と異なります。

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

価格変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

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カイ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。

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

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

価格変動リスク・為替変動リスク

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

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

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

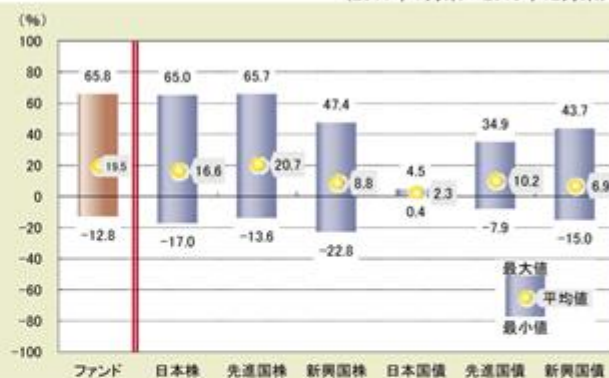
(3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移



●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年1月末～2015年12月末)



・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。

・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

・2011年10月以前はベンチマークの年間騰落率を用いています。

・グラフは、ファンド(ベンチマークの年間騰落率を含みます。以下同じ。)と代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

・全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

・2011年1月～2015年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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国際投信株式会社

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

(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0.162%（税抜 年0.15%）以内の率

100口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 ×（保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

信託報酬の配分は以下の通りです。

委託会社	受託会社
年0.1188% （税抜 年0.11%）	年0.0432% （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は、次の通りとなります。

年0.27%（税込）程度

（注）上記は、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（FOFs用）（適格機関投資家限定）	年0.108%
マネープールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	年0.0324%

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（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0.0081%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.0081%（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（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。

費用または費用を対価とする役務の内容について

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

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は、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。

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

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

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、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。

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

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。

上場証券投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託やETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設する(ETFの配当金の受取方法については、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。)など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

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。

上記は平成27年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

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27年12月30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	6,436,762,631	99.82
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		11,659,184	0.18
純資産総額		6,448,421,815	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27年12月30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		3,189,158,359	2.0594 2.0183	6,567,752,724 6,436,678,315		99.82
日本	マネーボールファンド(FOFs 用)(適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券		84,039	1.0034 1.0033	84,324 84,316		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27年12月30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27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
第5計算期間末日 (平成25年6月8日)	2,685,028,333 (分配付) 2,656,148,333 (分配落)	1,413.17 (分配付) 1,397.97 (分配落)	1,392
第6計算期間末日 (平成25年12月8日)	3,237,005,769 (分配付) 3,213,205,769 (分配落)	1,618.50 (分配付) 1,606.60 (分配落)	1,618
第7計算期間末日 (平成26年6月8日)	4,259,183,413 (分配付) 4,214,783,413 (分配落)	1,774.66 (分配付) 1,756.16 (分配落)	1,751
第8計算期間末日 (平成26年12月8日)	5,290,793,779 (分配付) 5,257,293,779 (分配落)	2,116.32 (分配付) 2,102.92 (分配落)	2,156

第9計算期間末日 （平成27年 6月 8日）	6,172,194,583（分配付） 6,116,194,583（分配落）	2,204.36（分配付） 2,184.36（分配落）	2,218
第10計算期間末日 （平成27年12月 8日）	6,629,014,869（分配付） 6,580,374,869（分配落）	2,071.57（分配付） 2,056.37（分配落）	2,078
平成26年12月末日	5,406,008,480	2,079.23	2,074
平成27年 1月末日	5,573,603,550	1,990.57	2,028
2月末日	5,890,968,824	2,103.92	2,092
3月末日	5,879,560,492	2,099.84	2,090
4月末日	5,934,009,596	2,119.29	2,119
5月末日	6,197,336,480	2,213.33	2,219
6月末日	5,896,311,288	2,105.83	2,124
7月末日	6,276,551,997	2,164.33	2,175
8月末日	5,976,475,719	1,992.16	2,008
9月末日	5,753,094,732	1,855.84	1,914
10月末日	6,378,556,783	2,057.60	2,083
11月末日	6,654,386,726	2,079.50	2,093
12月末日	6,448,421,815	2,015.13	2,022

【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
第5計算期間	15円20銭
第6計算期間	11円90銭
第7計算期間	18円50銭
第8計算期間	13円40銭
第9計算期間	20円00銭
第10計算期間	15円20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
第5計算期間	31.62
第6計算期間	15.77
第7計算期間	10.46
第8計算期間	20.50
第9計算期間	4.82
第10計算期間	5.16

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

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	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
第5計算期間	100,000		1,900,000
第6計算期間	100,000		2,000,000
第7計算期間	400,000		2,400,000
第8計算期間	100,000		2,500,000
第9計算期間	300,000		2,800,000
第10計算期間	400,000		3,200,000

<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27年12月30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	6,436,500,554	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		299,466	0.00
純資産総額		6,436,800,020	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27年12月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段:帳簿価額 下段:評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	外国株式インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		2,910,599,871	2.2503 2.2114	6,549,722,890 6,436,500,554		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27年12月30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27年12月30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	155,964,592,103	60.69
	イギリス	19,956,265,029	7.76
	スイス	9,836,628,120	3.83
	ドイツ	9,435,489,966	3.67
	フランス	9,351,018,690	3.64
	カナダ	8,341,927,309	3.25
	オーストラリア	6,405,620,006	2.49
	オランダ	3,464,758,801	1.35
	スペイン	3,336,015,838	1.30
	香港	3,019,960,313	1.18
	スウェーデン	2,976,790,171	1.16
	イタリア	2,261,684,532	0.88
	デンマーク	1,970,467,533	0.77
	ベルギー	1,510,730,350	0.59
	シンガポール	1,195,278,426	0.47
	フィンランド	939,840,140	0.37
	イスラエル	703,777,451	0.27
	ノルウェー	577,542,433	0.22
	アイルランド	407,919,922	0.16
	ルクセンブルグ	186,650,651	0.07
オーストリア	185,155,055	0.07	
ニュージーランド	162,890,081	0.06	
ポルトガル	154,583,425	0.06	
投資証券	アメリカ	4,790,849,154	1.86
	オーストラリア	593,916,428	0.23
	フランス	372,226,001	0.14
	イギリス	350,100,813	0.14
	香港	112,503,468	0.04
	シンガポール	95,617,373	0.04
	カナダ	51,846,643	0.02
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		8,290,998,346	3.22
純資産総額		257,003,644,571	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27年12月30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)	9,755,646,058	3.80

(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27年12月30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	394,265	14,789.19 13,115.13	5,830,992,033 5,170,837,281		2.01
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	525,300	5,777.21 6,820.49	3,035,283,905 3,582,806,286		1.39

アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	288,284	10,197.57 9,547.48	2,939,833,999 2,752,387,915		1.07
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	652,573	3,289.03 3,772.68	2,146,818,733 2,461,949,627		0.96
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	191,430	12,081.50 12,547.05	2,312,869,280 2,401,883,370		0.93
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	27,487	57,395.88 83,699.72	1,577,642,430 2,300,654,250		0.90
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	337,120	6,633.55 6,668.52	2,236,394,596 2,248,093,788		0.87
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	255,647	7,857.74 8,089.31	2,008,830,620 2,068,008,523		0.80
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・ タバコ	220,383	8,863.66 9,132.22	1,953,613,212 2,012,587,803		0.78
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・ サービス	21,403	69,538.90 93,665.72	1,488,357,332 2,004,727,533		0.78
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	148,423	10,143.30 12,936.62	1,505,567,852 1,920,093,226		0.75
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・ サービス	20,040	71,370.96 95,759.51	1,430,294,726 1,919,020,692		0.75
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・ パーソナル用品	187,498	9,508.89 9,692.21	1,782,951,725 1,817,271,790		0.71
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	425,075	4,029.58 4,212.90	1,713,218,604 1,790,801,570		0.70
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	426,361	4,063.35 3,959.62	1,732,847,752 1,688,230,228		0.66
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	157,278	11,411.94 10,633.00	1,795,035,659 1,672,336,974		0.65
スイス	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	48,571	32,366.85 33,843.32	1,572,107,320 1,643,803,895		0.64
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	281,062	5,848.37 5,693.99	1,643,819,804 1,600,366,493		0.62
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・ タバコ	285,647	4,965.51 5,271.86	1,418,468,855 1,505,891,878		0.59
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	721,612	1,986.44 2,084.14	1,434,081,534 1,503,941,010		0.59
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	110,854	13,074.12 12,914.91	1,449,391,264 1,431,670,408		0.56
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	88,773	13,878.59 16,125.55	1,232,077,160 1,431,514,071		0.56
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	130,013	12,294.98 11,005.66	1,598,576,768 1,430,879,198		0.56
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・ 半導体製造装置	328,551	3,929.47 4,274.41	1,291,103,020 1,404,364,439		0.55
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	208,079	6,467.10 6,389.91	1,345,902,645 1,329,607,705		0.52
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	株式	各種金融	81,896	17,178.48 16,178.62	1,406,856,126 1,324,964,705		0.52
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,351,898	1,072.68 973.63	1,452,264,991 1,316,256,397		0.51
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・ サービス	134,893	8,524.71 9,553.51	1,150,050,532 1,288,702,717		0.50
アメリカ	GILEAD SCIENCES INC	株式	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	101,462	12,606.15 12,466.24	1,279,156,401 1,264,850,616		0.49
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	194,714	6,983.31 6,433.33	1,359,807,600 1,252,660,858		0.49

(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27年12月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	6.39
	素材	4.13
	資本財	6.87
	商業・専門サービス	0.88
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	1.68
	耐久消費財・アパレル	1.72
	消費者サービス	1.80
	メディア	2.88
	小売	3.93
	食品・生活必需品小売り	2.08
	食品・飲料・タバコ	6.14
	家庭用品・パーソナル用品	2.15
	ヘルスケア機器・サービス	3.53
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.06
	銀行	8.94
	各種金融	3.98
	保険	4.29
	不動産	0.63
	ソフトウェア・サービス	8.44
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.99
	電気通信サービス	3.09
	公益事業	3.11
半導体・半導体製造装置	1.80	
小計	94.30	
投資証券		2.48
合計		96.77

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成27年12月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引								
SP EMINI (2016年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	510	アメリカドル	51,695,920.59	52,855,125.00	6,374,856,626	2.48
FTSE100 (2016年3月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	69	イギリスポンド	4,174,637.50	4,314,570.00	771,358,824	0.30
SP/TSE60 (2016年3月限)	モントリオール取引所	買建	25	カナダドル	3,812,621.75	3,882,500.00	338,476,350	0.13
SPI 200 (2016年3月限)	シドニー先物取引所	買建	32	オーストラリアドル	3,972,928.00	4,199,200.00	369,193,664	0.14
EURO ST (2016年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	349	ユーロ	11,402,799.75	11,513,510.00	1,517,135,212	0.59
SWISS IX (2016年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	36	スイスフラン	3,085,065.00	3,165,120.00	384,625,382	0.15

(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27年12月30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	104,701	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		264	0.25
純資産総額		104,965	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27年12月30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		102,820	1.0185 1.0183	104,723 104,701		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27年12月30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27年12月30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	4,946,581,787	80.33
特殊債券	日本	300,459,000	4.88
社債券	日本	479,394,794	7.79
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		431,036,511	7.00
純資産総額		6,157,472,092	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27年12月30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568回国庫短期証券	国債証券		2,500,000	100.01 100.0014	2,500,380,000 2,500,035,000	2016/02/15	40.60
日本	第566回国庫短期証券	国債証券		1,700,000	100.00 100.0009	1,700,000,000 1,700,015,300	2016/02/01	27.61
日本	第567回国庫短期証券	国債証券		500,000	100.00 100.0012	500,000,000 500,006,000	2016/02/08	8.12

日本	第3回コニカミノルタホールディングス	社債券		200,000	100.48 100.4280	200,966,000 200,856,000	0.610000 2016/12/02	3.26
日本	第300回北陸電力	社債券		177,900	100.36 100.2860	178,540,440 178,408,794	0.500000 2016/11/30	2.90
日本	い第731号農林債券	特殊債券		100,000	100.25 100.1900	100,256,000 100,190,000	0.750000 2016/04/27	1.63
日本	い第732号農林債券	特殊債券		100,000	100.24 100.1830	100,247,000 100,183,000	0.600000 2016/05/27	1.63
日本	第3回興銀リース	社債券		100,000	100.12 100.1300	100,122,000 100,130,000	0.267000 2016/12/02	1.63
日本	い第729号農林債券	特殊債券		100,000	100.13 100.0860	100,139,000 100,086,000	0.750000 2016/02/26	1.63
日本	第342回利付国債(2年)	国債証券		100,000	100.07 100.0730	100,079,000 100,073,000	0.100000 2016/07/15	1.63
日本	第343回利付国債(2年)	国債証券		83,750	100.09 100.0850	83,825,375 83,821,187	0.100000 2016/08/15	1.36
日本	第340回利付国債(2年)	国債証券		62,600	100.05 100.0500	62,636,308 62,631,300	0.100000 2016/05/15	1.02

(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27年12月30日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	80.33
特殊債券	4.88
社債券	7.79
合計	93.00

(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

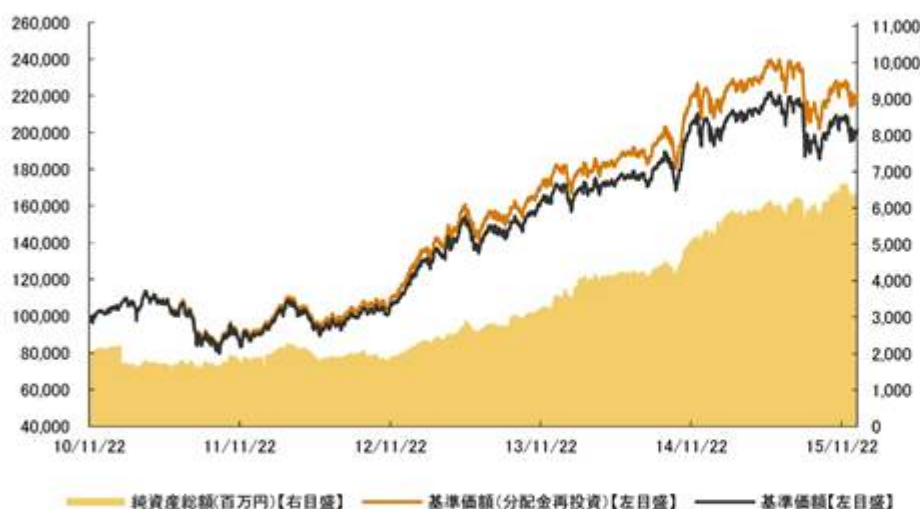
該当事項はありません。

[参考情報]



運用実績

■ 基準価額・純資産の推移（設定日～2015年12月30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)を再投資したものと計算

■ 分配の推移

2015年12月	1,520円
2015年6月	2,000円
2014年12月	1,340円
2014年6月	1,850円
2013年12月	1,190円
2013年6月	1,520円
設定来累計	13,460円

・分配金は100口当たり、税引前

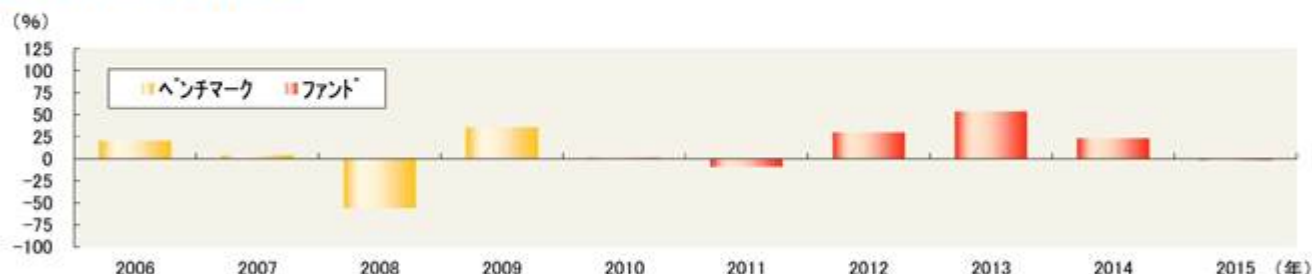
■ 主要な資産の状況（2015年12月30日現在）

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	65.1%	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%
ユーロ	12.8%	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.4%
イギリスポンド	8.2%	3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.1%
スイスフラン	4.0%	4 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	1.0%
カナダドル	3.4%	5 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	0.9%
オーストラリアドル	2.8%	6 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	0.9%
香港ドル	1.3%	7 WELLS FARGO & CO	銀行	アメリカ	0.9%
スウェーデンクローネ	1.2%	8 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	0.8%
その他	1.2%	9 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.8%
合計	100.0%	10 ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	3.8%

・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)

■ 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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</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。</p> <p>ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/ MAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/</p>
申込手数料	<p>販売会社が定める額 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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：毎営業日の9:00～17:00）</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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</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>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)</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(FOFs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		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)	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(FOFs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							
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)	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(FOFs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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/ MAXIS専用サイト http://maxis.muam.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、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を發します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。</p> <p>併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。</p>
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し、</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、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。</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	<p>投資信託及び投資法人に関する法律により、当ファンドの交付運用報告書および運用報告書（全体版）の作成・交付は行いません。運用内容については、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国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/</p>
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	<p>委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。</p>

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 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。

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権および名義登録	<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）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>
償還金に対する請求権	<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。
換金（解約）請求権	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成27年6月9日から平成27年12月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 [平成27年6月8日現在]	第10期 [平成27年12月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,516,751	19,659,160
投資信託受益証券	6,159,829,612	6,616,060,068
未収利息	29	31
流動資産合計	6,178,346,392	6,635,719,259
資産合計	6,178,346,392	6,635,719,259
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	56,000,000	48,640,000
未払受託者報酬	1,235,116	1,331,878
未払委託者報酬	3,396,532	3,662,593
その他未払費用	1,520,161	1,709,919
流動負債合計	62,151,809	55,344,390
負債合計	62,151,809	55,344,390
純資産の部		
元本等		
元本	2,800,000,000	3,200,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,316,194,583	3,380,374,869
(分配準備積立金)	16,246	94,588
元本等合計	6,116,194,583	6,580,374,869
純資産合計	6,116,194,583	6,580,374,869
負債純資産合計	6,178,346,392	6,635,719,259

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 9 期 自 平成26年12月 9日 至 平成27年 6月 8日	第 10 期 自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8日
営業収益		
受取配当金	62,463,036	55,756,088
受取利息	5,384	7,463
有価証券売買等損益	262,587,776	334,751,056
営業収益合計	325,056,196	278,987,505
営業費用		
受託者報酬	1,235,116	1,331,878
委託者報酬	3,396,532	3,662,593
その他費用	₁ 1,822,744	₁ 2,050,738
営業費用合計	6,454,392	7,045,209
営業利益又は営業損失（ ）	318,601,804	286,032,714
経常利益又は経常損失（ ）	318,601,804	286,032,714
当期純利益又は当期純損失（ ）	318,601,804	286,032,714
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,757,293,779	3,316,194,583
剰余金増加額又は欠損金減少額	296,299,000	398,853,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	296,299,000	398,853,000
分配金	₂ 56,000,000	₂ 48,640,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,316,194,583	3,380,374,869

(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	投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 [平成27年6月8日現在]	第10期 [平成27年12月8日現在]
1 期首元本額	2,500,000,000円	2,800,000,000円
期中追加設定元本額	300,000,000円	400,000,000円
期中一部解約元本額		
2 受益権の総数	2,800,000口	3,200,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	2,184.36円 (218,436円)	2,056.37円 (205,637円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期(自平成26年12月9日 至平成27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	62,468,420円
分配準備積立金額	B	2,218円
配当等収益合計額	C=A+B	62,470,638円
経費	D	6,454,392円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	56,016,246円
収益分配金金額	F	56,000,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	16,246円
当ファンドの期末残存口数	H	2,800,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	2,000円

第10期(自平成27年6月9日 至平成27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	55,763,551円
分配準備積立金額	B	16,246円
配当等収益合計額	C=A+B	55,779,797円
経費	D	7,045,209円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	48,734,588円
収益分配金金額	F	48,640,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	94,588円
当ファンドの期末残存口数	H	3,200,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,520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9期 (自平成26年12月9日 至平成27年6月8日)	第10期 (自平成27年6月9日 至平成27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、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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。 投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同 左 同 左 同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>また、投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同 左 同 左
------------------	---	----------------

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 9 期 [平成27年6月8日現在]	第 10 期 [平成27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	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 9 期 [平成27年6月8日現在]	第 10 期 [平成27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)	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	262,589,658	334,697,559
合計	262,589,658	334,697,559

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,212,574,412	6,615,975,744	
	マネーブルファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	84,039	84,324	
	投資信託受益証券 小計	3,212,658,451	6,616,060,068	
	合計	3,212,658,451	6,616,060,068	

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>

当ファンドは投資信託受益証券を主要投資対象としております。
貸借対照表の資産の部に計上された投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「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 9 期	第 10 期
	[平成27年5月25日現在]	[平成27年11月25日現在]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,237,846	3,524,253
親投資信託受益証券	6,050,706,168	6,543,870,676
未収入金	62,688,541	56,024,639
未収利息	4	5
流動資産合計	6,116,632,559	6,603,419,573
資産合計	6,116,632,559	6,603,419,573
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	62,463,036	55,756,087
未払受託者報酬	877,335	963,777
未払委託者報酬	2,147,911	2,359,526
流動負債合計	65,488,282	59,079,390
負債合計	65,488,282	59,079,390
純資産の部		
元本等		
元本	2,788,528,429	3,186,062,153
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,262,615,848	3,358,278,030
（分配準備積立金）	(2,521,623,768)	(2,502,980,551)
元本等合計	6,051,144,277	6,544,340,183
純資産合計	6,051,144,277	6,544,340,183
負債純資産合計	6,116,632,559	6,603,419,573

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 9 期	第 10 期
	自 平成26年11月26日 至 平成27年 5月25日	自 平成27年 5月26日 至 平成27年11月25日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
受取利息	413	523
有価証券売買等損益	425,781,589	242,806,516
営業収益合計	425,782,002	242,805,993
営業費用		
受託者報酬	877,335	963,777
委託者報酬	2,147,911	2,359,526
営業費用合計	3,025,246	3,323,303
営業利益又は営業損失（ ）	422,756,756	246,129,296
経常利益又は経常損失（ ）	422,756,756	246,129,296
当期純利益又は当期純損失（ ）	422,756,756	246,129,296
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 （ ）	1,075,757	448,109
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,607,604,551	3,262,615,848
剰余金増加額又は欠損金減少額	314,470,498	427,747,934
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	314,470,498	427,747,934
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,677,164	29,752,260
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	18,677,164	29,752,260
分配金	62,463,036	55,756,087
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,262,615,848	3,358,278,030

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 [平成27年5月25日現在]	第10期 [平成27年11月25日現在]
1 期首元本額	2,489,952,422円	2,788,528,429円
期中追加設定元本額	316,452,460円	423,008,519円
期中一部解約元本額	17,876,453円	25,474,795円
2 受益権の総数	2,788,528,429口	3,186,062,153口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1700円 (21,700円)	2.0541円 (20,541円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期(自平成26年11月26日 至平成27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	70,516,159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	351,164,840円
収益調整金額	C	798,842,505円
分配準備積立金額	D	2,162,405,805円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,382,929,309円
当ファンドの期末残存口数	F	2,788,528,429口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,131円
1万口当たり分配金額	H	224円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	62,463,036円

第10期(自平成27年5月26日 至平成27年11月25日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	59,874,081円
費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	1,296,492,517円
分配準備積立金額	D	2,498,862,557円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,855,229,155円
当ファンドの期末残存口数	F	3,186,062,153口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,100円
1万口当たり分配金額	H	175円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	55,756,087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9期 (自平成26年11月26日 至平成27年5月25日)	第10期 (自平成27年5月26日 至平成27年11月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。	同左
	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	<p>また、親投資信託受益証券に係るデリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p>	同 左 同 左
------------------	--	----------------

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 9 期 [平成27年5月25日現在]	第 10 期 [平成27年11月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第 9 期 [平成27年5月25日現在]	第 10 期 [平成27年11月25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	421,425,531	240,491,084
合計	421,425,531	240,491,084

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,907,999,234	6,543,870,676	
	親投資信託受益証券 小計	2,907,999,234	6,543,870,676	
	合計	2,907,999,234	6,543,870,676	

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>

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成27年5月25日現在]	[平成27年11月25日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,366,857,539	3,010,183,385
コール・ローン	228,488,528	272,017,187
株式	222,780,223,256	231,504,345,647
投資証券	5,094,174,577	5,909,500,387
派生商品評価勘定	21,016,463	81,064,321
未収入金	1,065,161,251	1,068,925
未収配当金	461,257,636	447,919,421
未収利息	341	438
差入委託証拠金	874,413,271	1,190,445,176
流動資産合計	232,891,592,862	242,416,544,887
資産合計	232,891,592,862	242,416,544,887
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,453,670	16,660,000
未払金	9,720,510	89,396,774
未払解約金	2,215,737,136	357,411,058
流動負債合計	2,237,911,316	463,467,832
負債合計	2,237,911,316	463,467,832
純資産の部		
元本等		
元本	1 97,898,018,926	107,519,329,500
剰余金		
剰余金又は欠損金()	132,755,662,620	134,433,747,555
元本等合計	230,653,681,546	241,953,077,055
純資産合計	230,653,681,546	241,953,077,055
負債純資産合計	232,891,592,862	242,416,544,887

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年5月25日現在]	[平成27年11月25日現在]
1 期首	平成26年11月26日	平成27年5月26日
期首元本額	104,469,642,189円	97,898,018,926円
期首からの追加設定元本額	21,260,798,659円	37,145,373,136円
期首からの一部解約元本額	27,832,421,922円	27,524,062,562円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー(海外株式)	415,457,255円	501,884,814円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,498,213,444円	14,696,826,498円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	690,622,602円	917,051,981円
eMAXIS バランス(波乗り型)	65,567,750円	86,259,980円
コアバランス	394,294円	389,145円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	3,848,219,811円	5,185,650,842円
eMAXIS 全世界株式インデックス	1,991,669,005円	2,271,319,407円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	1,618,762,387円	441,364,700円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	3,512,602,967円	
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	59,788,930円	
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	9,528,908円	1,324,095円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	58,863,463円	
eMAXIS バランス(4資産均等型)		1,413,717円

三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	20,292,640,656円	16,271,624,466円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,758,964,513円	16,286,926,157円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	362,905,290円	326,615,420円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,922,300,918円	2,812,136,875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)	9,591,077,052円	23,504,127,251円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	294,216,314円	279,654,659円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	127,225,923円	118,565,748円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,974,329,926円	1,909,155,622円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	2,568,102,444円	2,907,999,234円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	76,002,753円	61,269,221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)	7,043,846,427円	9,031,733,985円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	30,343,071円	55,163,309円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	151,161,931円	364,293,063円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,088,463,137円	1,964,430,441円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	11,131,249円	8,734,258円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	45,900,948円	27,514,040円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	69,955,239円	60,187,511円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	62,277,616円	53,922,570円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	389,991,436円	267,920,747円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	44,207,211円	36,327,650円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	431,718,585円	332,818,345円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	101,861,387円	78,291,301円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	783,531,540円	592,994,991円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,888,828,102円	3,996,564,200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)	165,212,121円	169,234,732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)	694,604,546円	703,641,480円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)	622,134,349円	647,443,324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)	535,393,426円	546,553,721円
(合計)	97,898,018,926円	107,519,329,500円
2 受益権の総数	97,898,018,926口	107,519,329,500口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3561円 (23,561円)	2.2503円 (22,503円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成26年11月26日 至平成27年5月25日)	(自平成27年5月26日 至平成27年11月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左

3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成27年5月25日現在]	[平成27年11月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成27年5月25日現在]	[平成27年11月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,397,430,571	5,611,759,860
投資証券	46,333,975	64,458,164
合計	2,443,764,546	5,547,301,696

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区 分	種 類	[平成27年5月25日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,511,045,985		2,523,283,456	12,237,471
合 計		2,511,045,985		2,523,283,456	12,237,471

区 分	種 類	[平成27年11月25日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,719,457,257		4,783,282,073	63,824,816
合 計		4,719,457,257		4,783,282,073	63,824,816

（注）時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

区分	種類	[平成27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	1,404,680,920		1,411,604,000	6,923,080
	カナダドル	89,345,320		89,073,000	272,320
	オーストラリアドル	30,412,032		30,409,600	2,432
	イギリスポンド	198,711,860		197,767,500	944,360
	スイスフラン	84,021,300		83,830,500	190,800
	香港ドル	31,230,240		31,380,000	149,760
	シンガポールドル	17,239,680		17,265,300	25,620
	スウェーデンクローネ	31,966,000		31,856,000	110,000
	ノルウェークローネ	7,944,200		7,940,000	4,200
	ユーロ	309,409,670		307,510,000	1,899,670
合計	2,204,961,222		2,208,635,900	3,674,678	

区分	種類	[平成27年11月25日現在]			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	165,870,045		165,267,000	603,045
	買建				
	アメリカドル	281,585,320		281,566,000	19,320
	オーストラリアドル	8,889,820		8,889,000	820
	イギリスポンド	36,943,120		36,942,000	1,120
	スイスフラン	36,154,740		36,153,000	1,740
	ユーロ	39,126,540		39,126,000	540
合計	568,569,585		567,943,000	579,505	

(注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	3M CO	41,101	157.750000	6,483,682.75	
	ABBOTT LABORATORIES	96,459	45.450000	4,384,061.55	
	ABBVIE INC	111,483	61.130000	6,814,955.79	
	ACCENTURE PLC-CL A	40,586	107.350000	4,356,907.10	
	ACE LTD	21,305	115.560000	2,462,005.80	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	32,964	36.840000	1,214,393.76	
	ACUITY BRANDS INC	2,823	226.160000	638,449.68	
	ADOBE SYSTEMS INC	32,433	92.000000	2,983,836.00	
	ADT CORP/THE	11,080	34.350000	380,598.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	4,743	163.190000	774,010.17	
	AES CORP	44,548	9.900000	441,025.20	
	AETNA INC	22,793	106.080000	2,417,881.44	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,546	175.540000	622,464.84	
	AFLAC INC	28,074	65.390000	1,835,758.86	
	AGCO CORP	5,118	49.140000	251,498.52	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,768	40.670000	885,304.56	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,227	139.470000	1,844,769.69	
AIRGAS INC	4,411	138.250000	609,820.75	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	11,579	56.620000	655,602.98	
ALBEMARLE CORP	7,256	53.010000	384,640.56	
ALCOA INC	84,671	9.090000	769,659.39	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14,524	177.800000	2,582,367.20	
ALKERMES PLC	9,647	74.260000	716,386.22	
ALLEGHANY CORP	1,039	508.880000	528,726.32	
ALLERGAN PLC	25,434	311.430000	7,920,910.62	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,025	285.450000	1,148,936.25	
ALLIANT ENERGY CORP	7,434	60.090000	446,709.06	
ALLSTATE CORP	26,465	62.940000	1,665,707.10	
ALLY FINANCIAL INC	28,057	19.800000	555,528.60	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,897	104.760000	513,009.72	
ALPHABET INC-CL A	18,682	769.630000	14,378,227.66	
ALPHABET INC-CL C	19,983	748.280000	14,952,879.24	
ALTERA CORP	19,700	52.820000	1,040,554.00	
ALTRIA GROUP INC	127,457	57.570000	7,337,699.49	
AMAZON.COM INC	25,653	671.150000	17,217,010.95	
AMEREN CORPORATION	15,892	43.220000	686,852.24	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,410	41.230000	470,434.30	
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,912	55.790000	1,780,370.48	
AMERICAN EXPRESS CO	59,228	71.630000	4,242,501.64	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	86,358	63.120000	5,450,916.96	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,852	56.880000	674,141.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,748	112.600000	1,322,824.80	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,521	98.500000	1,331,818.50	
AMETEK INC	15,663	56.460000	884,332.98	
AMGEN INC	49,271	162.780000	8,020,333.38	
AMPHENOL CORP-CL A	20,061	54.690000	1,097,136.09	
ANADARKO PETROLEUM CORP	32,918	62.020000	2,041,574.36	
ANALOG DEVICES INC	20,329	60.420000	1,228,278.18	
ANSYS INC	5,828	92.530000	539,264.84	
ANTERO RESOURCES CORP	5,364	21.270000	114,092.28	
ANTHEM INC	17,138	131.630000	2,255,874.94	
AON PLC	18,264	94.750000	1,730,514.00	
APACHE CORP	24,423	50.910000	1,243,374.93	
APPLE INC	373,344	118.880000	44,383,134.72	
APPLIED MATERIALS INC	79,765	18.380000	1,466,080.70	
ARAMARK	14,734	33.000000	486,222.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,057	73.600000	592,995.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,182	36.040000	1,448,159.28	
ARROW ELECTRONICS INC	6,195	56.180000	348,035.10	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,893	44.130000	480,708.09	
ASHLAND INC	4,168	112.310000	468,108.08	
ASSURANT INC	4,394	85.610000	376,170.34	
AT&T INC	398,299	33.390000	13,299,203.61	
AUTODESK INC	14,765	63.080000	931,376.20	
AUTOLIV INC	5,718	125.010000	714,807.18	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	30,427	86.710000	2,638,325.17	
AUTONATION INC	4,788	63.500000	304,038.00	
AUTOZONE INC	2,056	779.660000	1,602,980.96	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,826	128.340000	2,159,448.84	
AVERY DENNISON CORP	5,884	66.110000	388,991.24	
AVNET INC	8,786	45.170000	396,863.62	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	9,200	29.210000	268,732.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,512	56.090000	365,258.08	
B/E AEROSPACE INC	6,878	46.330000	318,657.74	
BAKER HUGHES INC	28,341	53.090000	1,504,623.69	
BALL CORP	8,490	69.320000	588,526.80	
BANK OF AMERICA CORP	680,441	17.470000	11,887,304.27	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	72,647	43.680000	3,173,220.96	
BAXALTA INC	35,178	35.670000	1,254,799.26	
BAXTER INTERNATIONAL INC	35,212	38.040000	1,339,464.48	
BB&T CORP	50,469	38.490000	1,942,551.81	
BECTON DICKINSON AND CO	13,568	150.550000	2,042,662.40	
BED BATH & BEYOND INC	11,067	54.130000	599,056.71	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	75,540	135.540000	10,238,691.60
BEST BUY CO INC	20,536	31.530000	647,500.08
BIOGEN INC	15,243	289.150000	4,407,513.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,401	97.800000	1,017,217.80
BLACKROCK INC	7,995	356.810000	2,852,695.95
BOEING CO/THE	42,569	148.650000	6,327,881.85
BORGWARNER INC	14,664	43.080000	631,725.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	86,840	18.320000	1,590,908.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	108,032	67.820000	7,326,730.24
BROADCOM CORP-CL A	35,845	54.110000	1,939,572.95
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,764	104.930000	814,676.52
BUNGE LTD	9,299	67.050000	623,497.95
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,491	68.220000	647,476.02
CA INC	21,292	28.200000	600,434.40
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,917	30.490000	393,839.33
CABOT OIL & GAS CORP	26,804	19.200000	514,636.80
CALPINE CORP	23,092	15.080000	348,227.36
CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,415	68.720000	853,158.80
CAMPBELL SOUP CO	12,126	51.330000	622,427.58
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,383	78.630000	2,782,165.29
CARDINAL HEALTH INC	21,423	86.760000	1,858,659.48
CARMAX INC	13,569	57.310000	777,639.39
CARNIVAL CORP	26,908	50.390000	1,355,894.12
CATERPILLAR INC	37,152	71.400000	2,652,652.80
CBRE GROUP INC - A	19,432	36.860000	716,263.52
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	29,418	50.540000	1,486,785.72
CDK GLOBAL INC	8,836	48.300000	426,778.80
CELANESE CORP-SERIES A	9,938	71.370000	709,275.06
CELGENE CORP	51,402	112.670000	5,791,463.34
CENTENE CORP	7,311	56.980000	416,580.78
CENTERPOINT ENERGY INC	26,840	17.060000	457,890.40
CENTURYLINK INC	36,497	27.230000	993,813.31
CERNER CORP	20,056	59.180000	1,186,914.08
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	15,256	45.800000	698,724.80
CHARTER COMMUNICATION-A	5,453	186.110000	1,014,857.83
CHENIERE ENERGY INC	14,585	49.700000	724,874.50
CHESAPEAKE ENERGY CORP	38,734	5.490000	212,649.66
CHEVRON CORP	121,830	91.350000	11,129,170.50
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,319	42.170000	266,472.23
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,009	577.790000	1,160,780.11
CHUBB CORP	14,998	130.840000	1,962,338.32
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,463	86.630000	733,149.69
CIGNA CORP	16,681	134.260000	2,239,591.06
CIMAREX ENERGY CO	6,075	122.030000	741,332.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,127	61.280000	620,582.56
CINTAS CORP	6,319	91.670000	579,262.73
CISCO SYSTEMS INC	329,542	27.270000	8,986,610.34
CIT GROUP INC	11,265	42.200000	475,383.00
CITIGROUP INC	196,583	54.180000	10,650,866.94
CITIZENS FINANCIAL GROUP	34,199	26.130000	893,619.87
CITRIX SYSTEMS INC	10,394	76.880000	799,090.72
CLOROX COMPANY	8,496	124.790000	1,060,215.84
CME GROUP INC	20,774	96.160000	1,997,627.84
CMS ENERGY CORP	18,164	35.020000	636,103.28
COACH INC	17,875	32.170000	575,038.75
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	18,866	8.090000	152,625.94
COCA-COLA CO/THE	268,290	43.360000	11,633,054.40
COCA-COLA ENTERPRISES	14,354	50.820000	729,470.28
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,576	64.580000	2,555,818.08
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,660	66.820000	3,719,201.20
COLUMBIA PIPELINE GROUP	20,534	19.380000	397,948.92
COMCAST CORP-CLASS A	137,649	61.660000	8,487,437.34
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	25,862	61.780000	1,597,754.36
COMERICA INC	11,512	46.260000	532,545.12
COMPUTER SCIENCES CORP	8,996	69.560000	625,761.76
CONAGRA FOODS INC	27,667	41.550000	1,149,563.85
CONCHO RESOURCES INC	8,298	112.530000	933,773.94

CONOCOPHILLIPS	79,875	55.320000	4,418,685.00	
CONSOL ENERGY INC	14,775	7.520000	111,108.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	19,100	62.350000	1,190,885.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,103	141.340000	1,569,298.02	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,036	36.840000	222,366.24	
COOPER COS INC/THE	3,123	144.350000	450,805.05	
CORE LABORATORIES N.V.	2,776	118.750000	329,650.00	
CORNING INC	81,498	18.960000	1,545,202.08	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,502	162.190000	4,622,739.38	
CR BARD INC	4,811	186.240000	896,000.64	
CROWN HOLDINGS INC	9,024	51.980000	469,067.52	
CSX CORP	64,093	29.030000	1,860,619.79	
CUMMINS INC	11,144	98.680000	1,099,689.92	
CVS HEALTH CORP	73,105	92.250000	6,743,936.25	
DANAHER CORP	39,746	96.510000	3,835,886.46	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,315	56.330000	412,053.95	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	11,151	73.500000	819,598.50	
DEERE & CO	20,545	76.340000	1,568,405.30	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	18,721	86.940000	1,627,603.74	
DELTA AIR LINES INC	13,454	47.240000	635,566.96	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,069	61.120000	554,297.28	
DEVON ENERGY CORP	25,294	46.550000	1,177,435.70	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,025	39.840000	240,036.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,657	56.810000	1,628,004.17	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,528	30.950000	294,891.60	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,905	29.250000	523,721.25	
DISH NETWORK CORP-A	14,556	62.960000	916,445.76	
DOLLAR GENERAL CORP	19,651	65.600000	1,289,105.60	
DOLLAR TREE INC	14,435	74.160000	1,070,499.60	
DOMINION RESOURCES INC/VA	38,601	67.480000	2,604,795.48	
DOVER CORP	10,390	65.910000	684,804.90	
DOW CHEMICAL CO/THE	72,851	53.380000	3,888,786.38	
DR HORTON INC	21,401	32.740000	700,668.74	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,425	89.440000	1,111,292.00	
DTE ENERGY COMPANY	11,716	80.210000	939,740.36	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	58,643	67.420000	3,953,711.06	
DUKE ENERGY CORP	44,929	68.080000	3,058,766.32	
DUN & BRADSTREET CORP	2,339	107.650000	251,793.35	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,806	30.060000	565,308.36	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,658	72.170000	697,017.86	
EATON CORP PLC	30,241	57.690000	1,744,603.29	
EATON VANCE CORP	7,597	36.020000	273,643.94	
EBAY INC	70,850	29.000000	2,054,650.00	
ECOLAB INC	17,376	119.720000	2,080,254.72	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,015	81.700000	328,025.50	
EDISON INTERNATIONAL	21,215	59.700000	1,266,535.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,974	160.410000	1,118,699.34	
ELECTRONIC ARTS INC	20,397	67.060000	1,367,822.82	
ELI LILLY & CO	64,806	83.880000	5,435,927.28	
EMC CORP/MA	125,863	25.470000	3,205,730.61	
EMERSON ELECTRIC CO	43,271	50.070000	2,166,578.97	
ENDO INTERNATIONAL PLC	13,299	60.280000	801,663.72	
ENERGEN CORP	5,097	61.570000	313,822.29	
ENSCO PLC-CL A	15,105	17.270000	260,863.35	
ENERGY CORP	11,720	66.480000	779,145.60	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,023	27.940000	335,922.62	
EOG RESOURCES INC	35,572	85.140000	3,028,600.08	
EQT CORP	9,873	59.520000	587,640.96	
EQUIFAX INC	7,746	110.050000	852,447.30	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,937	85.570000	1,278,159.09	
EVEREST RE GROUP LTD	2,860	184.800000	528,528.00	
EVERSOURCE ENERGY	20,734	50.650000	1,050,177.10	
EXELON CORP	55,957	27.780000	1,554,485.46	
EXPEDIA INC	6,696	121.270000	812,023.92	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,460	49.230000	613,405.80	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	47,215	86.170000	4,068,516.55	
EXXON MOBIL CORP	270,917	81.880000	22,182,683.96	

F5 NETWORKS INC	4,667	102.820000	479,860.94	
FACEBOOK INC-A	138,454	105.740000	14,640,125.96	
FASTENAL CO	18,186	39.810000	723,984.66	
FEDEX CORP	17,488	163.190000	2,853,866.72	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	18,370	64.780000	1,190,008.60	
FIFTH THIRD BANCORP	52,421	20.510000	1,075,154.71	
FIREEYE INC	7,090	22.860000	162,077.40	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,242	68.690000	634,832.98	
FIRSTENERGY CORP	27,498	31.160000	856,837.68	
FISERV INC	15,353	95.230000	1,462,066.19	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,065	154.720000	783,656.80	
FLEXTRONICS INTL LTD	36,545	11.240000	410,765.80	
FLIR SYSTEMS INC	9,088	30.170000	274,184.96	
FLOWSERVE CORP	8,725	46.630000	406,846.75	
FLUOR CORP	9,535	48.400000	461,494.00	
FMC CORP	8,616	42.650000	367,472.40	
FMC TECHNOLOGIES INC	14,989	34.200000	512,623.80	
FNF GROUP	16,393	35.790000	586,705.47	
FOOT LOCKER INC	9,049	65.240000	590,356.76	
FORD MOTOR CO	240,368	14.550000	3,497,354.40	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	10,352	55.290000	572,362.08	
FRANKLIN RESOURCES INC	25,999	41.290000	1,073,498.71	
FREEMPORT-MCMORAN INC	67,286	8.300000	558,473.80	
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,000	35.550000	248,850.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,577	4.900000	365,427.30	
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,919	37.910000	262,299.29	
GAP INC/THE	16,219	27.810000	451,050.39	
GARMIN LTD	7,395	38.270000	283,006.65	
GARTNER INC	5,388	90.920000	489,876.96	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,111	145.530000	2,635,693.83	
GENERAL ELECTRIC CO	611,781	30.660000	18,757,205.46	
GENERAL MILLS INC	38,637	57.970000	2,239,786.89	
GENERAL MOTORS CO	93,699	36.220000	3,393,777.78	
GENUINE PARTS CO	9,850	89.660000	883,151.00	
GILEAD SCIENCES INC	95,232	106.570000	10,148,874.24	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,188	188.670000	4,752,219.96	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,504	34.470000	603,362.88	
H&R BLOCK INC	15,269	36.610000	558,998.09	
HALLIBURTON CO	55,506	39.740000	2,205,808.44	
HANESBRANDS INC	26,019	31.480000	819,078.12	
HARLEY-DAVIDSON INC	13,481	49.540000	667,848.74	
HARMAN INTERNATIONAL	4,602	103.570000	476,629.14	
HARRIS CORP	8,027	82.450000	661,826.15	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	27,203	45.700000	1,243,177.10	
HASBRO INC	7,250	75.680000	548,680.00	
HCA HOLDINGS INC	21,493	68.990000	1,482,802.07	
HELMERICH & PAYNE	6,987	58.500000	408,739.50	
HENRY SCHEIN INC	5,419	154.590000	837,723.21	
HERSHEY CO/THE	9,741	86.520000	842,791.32	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,250	16.070000	405,767.50	
HESS CORP	16,761	61.360000	1,028,454.96	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	118,692	13.690000	1,624,893.48	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	32,002	23.450000	750,446.90	
HOLLYFRONTIER CORP	11,981	50.460000	604,561.26	
HOLOGIC INC	15,513	40.010000	620,675.13	
HOME DEPOT INC	84,173	133.600000	11,245,512.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	48,119	103.170000	4,964,437.23	
HORMEL FOODS CORP	9,421	71.320000	671,905.72	
HP INC	118,692	14.640000	1,737,650.88	
HUMANA INC	9,775	168.410000	1,646,207.75	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,069	77.350000	469,437.15	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	52,334	11.660000	610,214.44	
IHS INC-CLASS A	4,471	121.020000	541,080.42	
ILLINOIS TOOL WORKS	21,425	93.390000	2,000,880.75	
ILLUMINA INC	9,339	176.290000	1,646,372.31	
INCYTE CORP	10,453	111.720000	1,167,809.16	
INGERSOLL-RAND PLC	17,151	58.500000	1,003,333.50	

INTEL CORP	307,401	34.360000	10,562,298.36
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,212	259.150000	1,868,989.80
INTERNATIONAL PAPER CO	25,980	41.830000	1,086,743.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,794	22.970000	615,458.18
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60,606	138.600000	8,399,991.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,254	120.090000	630,952.86
INTUIT INC	16,966	99.760000	1,692,528.16
INTUITIVE SURGICAL INC	2,389	516.740000	1,234,491.86
INVESCO LTD	27,877	33.190000	925,237.63
ISIS PHARMACEUTICALS INC	7,755	61.730000	478,716.15
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,104	43.970000	356,332.88
JARDEN CORP	12,855	46.620000	599,300.10
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,966	147.020000	583,081.32
JM SMUCKER CO/THE	7,364	122.140000	899,438.96
JOHNSON & JOHNSON	179,675	102.040000	18,334,037.00
JOHNSON CONTROLS INC	42,438	45.510000	1,931,353.38
JONES LANG LASALLE INC	2,899	165.520000	479,842.48
JPMORGAN CHASE & CO	240,444	66.780000	16,056,850.32
JUNIPER NETWORKS INC	23,063	30.430000	701,807.09
KANSAS CITY SOUTHERN	7,175	91.410000	655,866.75
KELLOGG CO	17,139	67.860000	1,163,052.54
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,461	48.850000	364,469.85
KEYCORP	54,878	13.140000	721,096.92
KIMBERLY-CLARK CORP	23,586	121.110000	2,856,500.46
KINDER MORGAN INC	119,425	24.410000	2,915,164.25
KLA-TENCOR CORP	10,380	66.460000	689,854.80
KOHL'S CORP	13,114	48.530000	636,422.42
KRAFT HEINZ CO/THE	38,603	74.470000	2,874,765.41
KROGER CO	60,355	37.120000	2,240,377.60
L BRANDS INC	16,098	96.880000	1,559,574.24
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,338	124.610000	665,168.18
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,501	121.180000	787,791.18
LAM RESEARCH CORP	10,260	77.290000	792,995.40
LAS VEGAS SANDS CORP	25,856	44.900000	1,160,934.40
LEAR CORP	5,050	125.230000	632,411.50
LEGG MASON INC	6,433	42.810000	275,396.73
LEGGETT & PLATT INC	8,914	46.760000	416,818.64
LENNAR CORP-A	11,280	51.640000	582,499.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,337	18.010000	384,279.37
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	19,547	50.900000	994,942.30
LIBERTY GLOBAL PLC-A	16,323	41.630000	679,526.49
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	40,172	39.860000	1,601,255.92
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	29,003	26.260000	761,618.78
LIBERTY MEDIA CORP - A	5,961	40.400000	240,824.40
LIBERTY MEDIA CORP - C	13,381	38.740000	518,379.94
LINCOLN NATIONAL CORP	16,369	54.750000	896,202.75
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,525	45.370000	704,369.25
LINKEDIN CORP - A	7,148	246.920000	1,764,984.16
LKQ CORP	19,733	29.790000	587,846.07
LOCKHEED MARTIN CORP	17,427	226.430000	3,945,995.61
LOEWS CORP	19,204	37.860000	727,063.44
LOWE'S COS INC	61,363	77.390000	4,748,882.57
LULULEMON ATHLETICA INC	7,346	52.730000	387,354.58
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,066	96.320000	2,510,677.12
M & T BANK CORP	9,391	124.590000	1,170,024.69
MACY'S INC	21,841	39.630000	865,558.83
MALLINCKRODT PLC	7,566	66.090000	500,036.94
MANPOWERGROUP INC	5,077	90.450000	459,214.65
MARATHON OIL CORP	43,725	18.500000	808,912.50
MARATHON PETROLEUM CORP	35,204	57.190000	2,013,316.76
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	14,250	70.980000	1,011,465.00
MARSH & MCLENNAN COS	34,894	55.500000	1,936,617.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,719	160.970000	598,647.43
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,800	8.550000	229,140.00
MASCO CORP	22,580	30.190000	681,690.20
MASTERCARD INC-CLASS A	65,106	98.500000	6,412,941.00
MATTEL INC	21,902	24.370000	533,751.74

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,423	38.720000	713,338.56
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,508	85.280000	640,282.24
MCDONALD'S CORP	62,088	114.280000	7,095,416.64
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	17,747	96.880000	1,719,329.36
MCKESSON CORP	15,003	189.800000	2,847,569.40
MDU RESOURCES GROUP INC	12,103	17.580000	212,770.74
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	13,126	81.160000	1,065,306.16
MEDIVATION INC	10,187	40.620000	413,795.94
MEDTRONIC PLC	91,763	76.560000	7,025,375.28
MERCK & CO. INC.	183,061	53.480000	9,790,102.28
METLIFE INC	61,404	50.520000	3,102,130.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,816	340.150000	617,712.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	29,207	22.960000	670,592.72
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,855	42.800000	550,194.00
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,684	47.230000	646,295.32
MICRON TECHNOLOGY INC	70,013	15.630000	1,094,303.19
MICROSOFT CORP	498,011	54.250000	27,017,096.75
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,028	192.560000	775,631.68
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,927	92.110000	914,375.97
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,415	43.980000	4,636,151.70
MONSANTO CO	30,843	95.560000	2,947,357.08
MONSTER BEVERAGE CORP	9,263	152.260000	1,410,384.38
MOODY'S CORP	11,811	103.490000	1,222,320.39
MORGAN STANLEY	95,734	33.590000	3,215,705.06
MOSAIC CO/THE	21,390	31.530000	674,426.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,327	71.960000	743,130.92
MURPHY OIL CORP	10,920	29.570000	322,904.40
MYLAN NV	27,000	50.390000	1,360,530.00
NABORS INDUSTRIES LTD	18,900	10.270000	194,103.00
NASDAQ INC	7,650	58.490000	447,448.50
NATIONAL OILWELL VARCO INC	25,100	38.610000	969,111.00
NAVIENT CORP	25,063	11.870000	297,497.81
NETAPP INC	20,214	30.930000	625,219.02
NETFLIX INC	26,129	123.310000	3,221,966.99
NETSUITE INC	2,522	85.160000	214,773.52
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,812	16.000000	460,992.00
NEWELL RUBBERMAID INC	17,437	44.690000	779,259.53
NEWMONT MINING CORP	34,292	18.000000	617,256.00
NEWS CORP - CLASS A	24,731	14.430000	356,868.33
NEXTERA ENERGY INC	28,874	99.410000	2,870,364.34
NIelsen HOLDINGS PLC	22,668	46.930000	1,063,809.24
NIKE INC -CL B	44,214	132.510000	5,858,797.14
NOBLE ENERGY INC	27,768	37.000000	1,027,416.00
NORDSTROM INC	9,243	57.710000	533,413.53
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,780	94.550000	1,870,199.00
NORTHERN TRUST CORP	14,358	75.100000	1,078,285.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,936	188.000000	2,243,968.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	10,410	57.230000	595,764.30
NRG ENERGY INC	21,679	12.620000	273,588.98
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,252	20.780000	337,716.56
NUCOR CORP	20,647	42.160000	870,477.52
NVIDIA CORP	34,890	31.170000	1,087,521.30
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,763	75.900000	3,777,011.70
OCEANEERING INTL INC	6,386	44.210000	282,325.06
OGE ENERGY CORP	13,095	25.780000	337,589.10
OMNICOM GROUP	15,829	73.010000	1,155,675.29
ONEOK INC	13,545	30.280000	410,142.60
ORACLE CORP	226,371	39.460000	8,932,599.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,541	267.460000	1,749,455.86
P G & E CORP	31,232	52.550000	1,641,241.60
PACCAR INC	22,976	51.460000	1,182,344.96
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,324	68.380000	432,435.12
PALO ALTO NETWORKS INC	4,617	182.850000	844,218.45
PARKER HANNIFIN CORP	8,979	103.590000	930,134.61
PARTNERRE LTD	3,082	139.200000	429,014.40
PATTERSON COS INC	5,653	45.710000	258,398.63
PAYCHEX INC	21,119	54.180000	1,144,227.42

PAYPAL HOLDINGS INC	70,585	35.120000	2,478,945.20
PENTAIR PLC	11,648	56.540000	658,577.92
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	19,860	16.640000	330,470.40
PEPCO HOLDINGS INC	16,512	25.670000	423,863.04
PEPSICO INC	95,641	100.630000	9,624,353.83
PERRIGO CO PLC	9,547	150.000000	1,432,050.00
PFIZER INC	398,997	31.970000	12,755,934.09
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,385	86.900000	8,723,456.50
PHILLIPS 66	35,142	93.130000	3,272,774.46
PINNACLE WEST CAPITAL	7,263	63.060000	458,004.78
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,674	147.940000	1,431,171.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,538	95.150000	3,191,140.70
POLARIS INDUSTRIES INC	4,086	106.450000	434,954.70
PPG INDUSTRIES INC	17,679	105.490000	1,864,957.71
PPL CORP	43,435	33.930000	1,473,749.55
PRAXAIR INC	18,679	114.030000	2,129,966.37
PRECISION CASTPARTS CORP	8,958	231.300000	2,071,985.40
PRICELINE GROUP INC/THE	3,359	1,240.180000	4,165,764.62
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,082	50.750000	968,411.50
PROCTER & GAMBLE CO/THE	175,739	76.450000	13,435,246.55
PROGRESSIVE CORP	38,038	31.740000	1,207,326.12
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,330	85.920000	2,520,033.60
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,905	39.190000	1,289,546.95
PULTEGROUP INC	21,191	19.510000	413,436.41
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	1,876	73.090000	137,116.84
PVH CORP	5,350	92.600000	495,410.00
QORVO INC	9,667	55.750000	538,935.25
QUALCOMM INC	105,614	49.410000	5,218,387.74
QUANTA SERVICES INC	13,206	21.760000	287,362.56
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,305	68.250000	635,066.25
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	5,974	69.160000	413,161.84
RACKSPACE HOSTING INC	7,388	25.780000	190,462.64
RALPH LAUREN CORP	3,898	124.990000	487,211.02
RANGE RESOURCES CORP	10,935	30.780000	336,579.30
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,387	58.080000	487,116.96
RAYTHEON COMPANY	19,774	126.360000	2,498,642.64
REALOGY HOLDINGS CORP	9,485	41.510000	393,722.35
RED HAT INC	11,895	82.050000	975,984.75
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,925	567.470000	2,794,789.75
REGIONS FINANCIAL CORP	86,642	10.130000	877,683.46
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,969	110.650000	328,519.85
REPUBLIC SERVICES INC	15,938	43.860000	699,040.68
RESMED INC	9,133	59.090000	539,668.97
REYNOLDS AMERICAN INC	55,631	46.690000	2,597,411.39
RITE AID CORP	64,010	7.880000	504,398.80
ROBERT HALF INTL INC	8,759	50.880000	445,657.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,723	104.010000	907,279.23
ROCKWELL COLLINS INC	8,578	94.010000	806,417.78
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,520	192.510000	1,255,165.20
ROSS STORES INC	26,784	52.420000	1,404,017.28
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,405	92.020000	1,049,488.10
SALESFORCE.COM INC	40,377	80.390000	3,245,907.03
SANDISK CORP	13,476	74.430000	1,003,018.68
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,405	105.500000	886,727.50
SCANA CORP	8,938	59.580000	532,526.04
SCHLUMBERGER LTD	82,290	78.180000	6,433,432.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	76,622	33.500000	2,566,837.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,846	57.870000	280,438.02
SEAGATE TECHNOLOGY	20,529	34.270000	703,528.83
SEALED AIR CORP	13,643	45.010000	614,071.43
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,149	54.270000	496,516.23
SEMPRA ENERGY	15,319	100.280000	1,536,189.32
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	11,036	45.840000	505,890.24
SERVICENOW INC	9,478	86.700000	821,742.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,135	276.320000	1,418,903.20
SIGNET JEWELERS LTD	4,944	134.890000	666,896.16
SIRIUS XM HOLDINGS INC	160,381	4.110000	659,165.91

SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,396	79.720000	988,209.12
SNAP-ON INC	3,789	169.220000	641,174.58
SOUTHERN CO/THE	59,052	44.810000	2,646,120.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,165	46.230000	516,157.95
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,820	9.260000	229,833.20
SPECTRA ENERGY CORP	43,477	27.280000	1,186,052.56
SPLUNK INC	8,113	59.500000	482,723.50
SPRINT CORP	51,403	3.830000	196,873.49
ST JUDE MEDICAL INC	18,137	62.780000	1,138,640.86
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,962	107.480000	1,070,715.76
STAPLES INC	41,332	12.250000	506,317.00
STARBUCKS CORP	97,177	61.960000	6,021,086.92
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,065	71.810000	794,577.65
STATE STREET CORP	26,660	72.340000	1,928,584.40
STERICYCLE INC	5,499	123.600000	679,676.40
STRYKER CORP	22,074	96.610000	2,132,569.14
SUNTRUST BANKS INC	33,407	43.410000	1,450,197.87
SYMANTEC CORP	44,057	19.810000	872,769.17
SYNCHRONY FINANCIAL	54,030	31.340000	1,693,300.20
SYNOPSIS INC	10,061	49.520000	498,220.72
SYSCO CORP	38,450	41.320000	1,588,754.00
T ROWE PRICE GROUP INC	16,856	75.620000	1,274,650.72
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,300	95.020000	313,566.00
TARGET CORP	39,293	72.890000	2,864,066.77
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,617	36.340000	640,201.78
TE CONNECTIVITY LTD	26,349	67.390000	1,775,659.11
TEGNA INC	13,928	28.100000	391,376.80
TERADATA CORP	9,565	29.880000	285,802.20
TESLA MOTORS INC	6,144	218.250000	1,340,928.00
TESORO CORP	8,157	118.240000	964,483.68
TEXAS INSTRUMENTS INC	67,418	57.850000	3,900,131.30
TEXTRON INC	17,998	43.180000	777,153.64
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,797	137.960000	3,558,954.12
TIFFANY & CO	8,365	79.320000	663,511.80
TIME WARNER CABLE	18,333	183.650000	3,366,855.45
TIME WARNER INC	53,434	70.190000	3,750,532.46
TJX COMPANIES INC	44,081	70.530000	3,109,032.93
T-MOBILE US INC	18,412	38.390000	706,836.68
TOLL BROTHERS INC	10,782	37.370000	402,923.34
TORCHMARK CORP	8,157	60.860000	496,435.02
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,797	55.350000	597,613.95
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,496	134.150000	603,138.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,843	91.000000	804,713.00
TRANSDIGM GROUP INC	3,468	235.870000	817,997.16
TRAVELERS COS INC/THE	20,627	115.440000	2,381,180.88
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,795	22.580000	379,231.10
TRIPADVISOR INC	7,622	82.980000	632,473.56
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	28,622	30.250000	865,815.50
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	81,412	29.850000	2,430,148.20
TWITTER INC	31,823	25.520000	812,122.96
TYCO INTERNATIONAL PLC	27,200	35.210000	957,712.00
TYSON FOODS INC-CL A	19,688	49.090000	966,483.92
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,958	170.830000	676,145.14
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,616	92.080000	1,069,601.28
UNION PACIFIC CORP	56,970	84.800000	4,831,056.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,348	56.800000	360,566.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	45,509	103.400000	4,705,630.60
UNITED RENTALS INC	6,274	77.410000	485,670.34
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,780	97.360000	5,333,380.80
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,990	154.230000	461,147.70
UNITEDHEALTH GROUP INC	61,683	113.190000	6,981,898.77
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,946	124.310000	739,147.26
UNUM GROUP	16,140	36.690000	592,176.60
URBAN OUTFITTERS INC	6,782	24.040000	163,039.28
US BANCORP	114,839	43.860000	5,036,838.54
VALERO ENERGY CORP	32,954	73.030000	2,406,630.62
VANTIV INC - CL A	9,469	52.090000	493,240.21

VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,462	80.910000	522,840.42	
VERISIGN INC	6,815	88.540000	603,400.10	
VERISK ANALYTICS INC	10,372	73.660000	764,001.52	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	264,294	45.190000	11,943,445.86	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,800	133.130000	2,103,454.00	
VF CORP	21,999	66.350000	1,459,633.65	
VIACOM INC-CLASS B	22,447	50.910000	1,142,776.77	
VISA INC-CLASS A SHARES	126,854	79.790000	10,121,680.66	
VMWARE INC-CLASS A	5,199	60.350000	313,759.65	
VOYA FINANCIAL INC	14,797	40.890000	605,049.33	
VULCAN MATERIALS CO	8,605	104.730000	901,201.65	
WABCO HOLDINGS INC	3,611	105.830000	382,152.13	
WABTEC CORP	6,266	78.910000	494,450.06	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	56,543	82.930000	4,689,110.99	
WAL-MART STORES INC	104,437	59.920000	6,257,865.04	
WALT DISNEY CO/THE	104,461	117.950000	12,321,174.95	
WASTE MANAGEMENT INC	29,635	53.980000	1,599,697.30	
WATERS CORP	5,367	132.830000	712,898.61	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	50,313	11.070000	556,964.91	
WEC ENERGY GROUP INC	20,586	49.380000	1,016,536.68	
WELLS FARGO & CO	316,949	55.280000	17,520,940.72	
WESTERN DIGITAL CORP	14,931	61.830000	923,183.73	
WESTERN UNION CO	33,479	18.820000	630,074.78	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,006	60.550000	182,013.30	
WESTROCK CO	16,900	50.500000	853,450.00	
WHIRLPOOL CORP	5,088	164.690000	837,942.72	
WHITEWAVE FOODS CO	11,344	40.440000	458,751.36	
WHITING PETROLEUM CORP	13,212	17.180000	226,982.16	
WHOLE FOODS MARKET INC	23,182	29.560000	685,259.92	
WILLIAMS COS INC	46,124	37.140000	1,713,045.36	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,448	46.310000	483,846.88	
WORKDAY INC-CLASS A	6,943	82.700000	574,186.10	
WR BERKLEY CORP	6,473	55.720000	360,675.56	
WW GRAINGER INC	3,898	198.460000	773,597.08	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,778	76.390000	594,161.42	
WYNN RESORTS LTD	5,248	62.950000	330,361.60	
XCEL ENERGY INC	33,090	35.730000	1,182,305.70	
XEROX CORP	67,712	10.610000	718,424.32	
XILINX INC	16,773	49.230000	825,734.79	
XL GROUP PLC	19,808	38.180000	756,269.44	
XYLEM INC	11,733	37.480000	439,752.84	
YAHOO! INC	57,730	32.960000	1,902,780.80	
YUM! BRANDS INC	28,014	72.380000	2,027,653.32	
ZILLOW GROUP INC - A	3,277	26.410000	86,545.57	
ZILLOW GROUP INC - C	6,300	24.810000	156,303.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,196	101.920000	1,141,096.32	
ZOETIS INC	30,787	46.930000	1,444,833.91	
アメリカドル 小計	20,575,600		1,223,796,421.63 (149,829,395,900)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	14,000	35.510000	497,140.00	
AGRIUM INC	8,800	129.750000	1,141,800.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	27,200	61.080000	1,661,376.00	
ALTAGAS LTD	9,400	31.490000	296,006.00	
ARC RESOURCES LTD	22,000	18.350000	403,700.00	
ATCO LTD -CLASS I	5,100	35.840000	182,784.00	
BANK OF MONTREAL	41,900	76.740000	3,215,406.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,800	60.310000	4,752,428.00	
BARRICK GOLD CORP	75,500	9.840000	742,920.00	
BCE INC	9,300	56.450000	524,985.00	
BLACKBERRY LTD	32,600	10.580000	344,908.00	
BOMBARDIER INC-B	125,000	1.180000	147,500.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	56,100	45.450000	2,549,745.00	
CAE INC	17,400	15.050000	261,870.00	
CAMECO CORP	25,600	16.170000	413,952.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	25,800	99.790000	2,574,582.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	52,100	78.060000	4,066,926.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	71,000	33.290000	2,363,590.00
CANADIAN OIL SANDS LTD	31,400	8.820000	276,948.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,100	194.680000	1,966,268.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,800	123.680000	593,664.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,200	32.470000	266,254.00
CENOVUS ENERGY INC	53,700	20.300000	1,090,110.00
CGI GROUP INC - CLASS A	14,500	57.140000	828,530.00
CI FINANCIAL CORP	15,500	31.190000	483,445.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	561.220000	673,464.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	32,000	17.940000	574,080.00
DOLLARAMA INC	8,000	89.090000	712,720.00
ELDORADO GOLD CORP	46,300	4.090000	189,367.00
EMPIRE CO LTD 'A'	11,000	26.680000	293,480.00
ENBRIDGE INC	55,600	48.710000	2,708,276.00
ENCANA CORP	54,500	11.360000	619,120.00
ENERPLUS CORP	13,700	6.950000	95,215.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,400	678.350000	949,690.00
FINNING INTERNATIONAL INC	11,100	19.610000	217,671.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	6,800	19.450000	132,260.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	44,400	4.890000	217,116.00
FORTIS INC	18,300	36.840000	674,172.00
FRANCO-NEVADA CORP	10,100	63.760000	643,976.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14,900	41.150000	613,135.00
GOLDCORP INC	53,900	15.770000	850,003.00
GREAT-WEST LIFECO INC	19,400	35.590000	690,446.00
HUSKY ENERGY INC	22,300	18.620000	415,226.00
IGM FINANCIAL INC	6,500	38.060000	247,390.00
IMPERIAL OIL LTD	19,200	43.360000	832,512.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,500	42.600000	276,900.00
INTACT FINANCIAL CORP	8,600	88.100000	757,660.00
INTER PIPELINE LTD	21,700	23.310000	505,827.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	5,400	20.520000	110,808.00
KEYERA CORP	11,000	38.460000	423,060.00
KINROSS GOLD CORP	74,200	2.580000	191,436.00
LOBLAW COMPANIES LTD	14,700	69.580000	1,022,826.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,600	59.410000	1,580,306.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	127,800	21.750000	2,779,650.00
MEG ENERGY CORP	10,800	11.080000	119,664.00
METHANEX CORP	5,900	51.590000	304,381.00
METRO INC	16,200	38.350000	621,270.00
NATIONAL BANK OF CANADA	21,400	42.670000	913,138.00
ONEX CORPORATION	5,600	81.060000	453,936.00
OPEN TEXT CORP	7,900	63.550000	502,045.00
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	4,600	8.840000	40,664.00
PEMBINA PIPELINE CORP	22,000	31.230000	687,060.00
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,800	26.820000	262,836.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	54,000	26.510000	1,431,540.00
POWER CORP OF CANADA	24,200	31.140000	753,588.00
POWER FINANCIAL CORP	16,200	33.570000	543,834.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,200	25.900000	238,280.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	13,110	47.900000	627,969.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	23,500	51.420000	1,208,370.00
ROYAL BANK OF CANADA	96,200	75.260000	7,240,012.00
SAPUTO INC	16,500	32.680000	539,220.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,100	27.370000	714,357.00
SILVER WHEATON CORP	26,100	16.890000	440,829.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,800	42.010000	411,698.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	39,700	43.740000	1,736,478.00
SUNCOR ENERGY INC	93,700	37.000000	3,466,900.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	36,500	5.620000	205,130.00
TELUS CORP	11,600	41.330000	479,428.00
THOMSON REUTERS CORP	23,000	52.920000	1,217,160.00
TORONTO-DOMINION BANK	119,900	54.430000	6,526,157.00
TOURMALINE OIL CORP	11,600	25.730000	298,468.00
TRANSALTA CORP	19,500	5.580000	108,810.00
TRANSCANADA CORP	46,000	43.310000	1,992,260.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	65,100	3.490000	227,199.00

VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	21,100	116.360000	2,455,196.00	
VERESEN INC	18,700	10.570000	197,659.00	
VERMILION ENERGY INC	7,100	39.510000	280,521.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,500	52.640000	236,880.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,300	110.000000	363,000.00	
YAMANA GOLD INC	60,800	2.750000	167,200.00	
			89,657,766.00	
カナダドル 小計	2,584,110		(8,252,100,782)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	44,936	16.950000	761,665.20	
ALUMINA LTD	165,346	1.195000	197,588.47	
AMCOR LIMITED	78,062	13.710000	1,070,230.02	
AMP LTD	193,949	5.750000	1,115,206.75	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	35,602	9.540000	339,643.08	
ASCIANO LTD	41,092	8.810000	362,020.52	
ASX LTD	12,864	41.850000	538,358.40	
AURIZON HOLDINGS LTD	140,235	5.540000	776,901.90	
AUSNET SERVICES	127,004	1.515000	192,411.06	
AUST AND NZ BANKING GROUP	179,850	27.770000	4,994,434.50	
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,805	14.280000	354,215.40	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	30,029	11.230000	337,225.67	
BHP BILLITON LIMITED	208,612	19.710000	4,111,742.52	
BORAL LTD	50,818	5.630000	286,105.34	
BRAMBLES LTD	102,924	11.050000	1,137,310.20	
CALTEX AUSTRALIA LTD	17,701	32.560000	576,344.56	
CIMIC GROUP LTD	7,087	25.710000	182,206.77	
COCA-COLA AMATIL LTD	37,813	9.420000	356,198.46	
COCHLEAR LTD	3,781	94.430000	357,039.83	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	110,307	79.640000	8,784,849.48	
COMPUTERSHARE LTD	31,199	11.850000	369,708.15	
CROWN RESORTS LTD	23,904	11.920000	284,935.68	
CSL LTD	30,409	98.770000	3,003,496.93	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	3,842	35.970000	138,196.74	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,489	2.110000	214,141.79	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,171	4.050000	150,542.55	
HEALTHSCOPE LTD	75,659	2.640000	199,739.76	
ILUKA RESOURCES LTD	27,673	5.960000	164,931.08	
INCITEC PIVOT LTD	110,125	3.810000	419,576.25	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	154,085	5.640000	869,039.40	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	29,545	16.570000	489,560.65	
LEND LEASE GROUP	36,275	12.660000	459,241.50	
MACQUARIE GROUP LTD	19,612	81.900000	1,606,222.80	
MEDIBANK PRIVATE LTD	180,721	2.300000	415,658.30	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	170,107	29.820000	5,072,590.74	
NEWCREST MINING LTD	49,905	11.300000	563,926.50	
ORICA LTD	24,220	16.120000	390,426.40	
ORIGIN ENERGY LTD	113,907	5.440000	619,654.08	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	16,173	8.010000	129,545.73	
QANTAS AIRWAYS LTD	38,562	3.690000	142,293.78	
QBE INSURANCE GROUP LTD	89,271	12.630000	1,127,492.73	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,379	67.080000	629,143.32	
REA GROUP LTD	3,530	50.100000	176,853.00	
RIO TINTO LTD	27,586	47.420000	1,308,128.12	
SANTOS LTD	103,293	4.030000	416,270.79	
SANTOS LTD-RTS	38,442	0.160000	6,150.72	
SEEK LTD	21,549	14.400000	310,305.60	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,198	20.210000	509,251.58	
SOUTH32 LTD	345,300	1.190000	410,907.00	
SUNCORP GROUP LTD	84,566	13.530000	1,144,177.98	
SYDNEY AIRPORT	73,190	6.320000	462,560.80	
TABCORP HOLDINGS LTD	54,923	4.590000	252,096.57	
TATTS GROUP LTD	96,577	4.160000	401,760.32	
TELSTRA CORP LTD	279,631	5.420000	1,515,600.02	
TPG TELECOM LTD	19,016	10.510000	199,858.16	
TRANSURBAN GROUP	126,437	10.320000	1,304,829.84	
TREASURY WINE ESTATES LTD	42,710	7.620000	325,450.20	
WESFARMERS LTD	73,218	39.180000	2,868,681.24	

WESTPAC BANKING CORP	211,581	31.710000	6,709,233.51	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,204	29.710000	1,432,140.84	
WOOLWORTHS LTD	82,478	24.050000	1,983,595.90	
WORLEYPARSONS LTD	12,960	6.040000	78,278.40	
オーストラリアドル 小計	4,756,439		66,107,893.58 (5,877,652,818)	
イギリス債券				
3I GROUP PLC	62,914	4.931000	310,228.93	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	60,088	3.345000	200,994.36	
ADMIRAL GROUP PLC	13,553	15.890000	215,357.17	
AGGREKO PLC	16,531	10.180000	168,285.58	
AMEC FOSTER WHEELER PLC	25,162	4.400000	110,712.80	
ANGLO AMERICAN PLC	90,494	4.520000	409,032.88	
ANTOFAGASTA PLC	25,410	4.963000	126,109.83	
ARM HOLDINGS PLC	91,519	10.840000	992,065.96	
ASHTED GROUP PLC	32,671	10.320000	337,164.72	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	23,099	34.420000	795,067.58	
ASTRAZENECA PLC	81,879	44.635000	3,654,669.16	
AVIVA PLC	261,989	5.005000	1,311,254.94	
BABCOCK INTL GROUP PLC	16,213	10.350000	167,804.55	
BAE SYSTEMS PLC	204,836	5.005000	1,025,204.18	
BARCLAYS PLC	1,085,380	2.200500	2,388,378.69	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,418	5.595000	360,418.71	
BG GROUP PLC	221,308	10.030000	2,219,719.24	
BHP BILLITON PLC	136,839	8.758000	1,198,435.96	
BP PLC	1,182,968	3.859000	4,565,073.51	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	120,814	38.500000	4,651,339.00	
BT GROUP PLC	542,428	4.852000	2,631,860.65	
BUNZL PLC	21,728	18.760000	407,617.28	
BURBERRY GROUP PLC	28,779	11.950000	343,909.05	
CAPITA PLC	43,145	12.280000	529,820.60	
CARNIVAL PLC	11,951	33.930000	405,497.43	
CENTRICA PLC	323,208	2.116000	683,908.12	
COBHAM PLC	73,719	2.918000	215,112.04	
COCA-COLA HBC AG-DI	12,981	16.170000	209,902.77	
COMPASS GROUP PLC	107,523	10.800000	1,161,248.40	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,806	27.600000	243,045.60	
DIAGEO PLC	162,965	18.940000	3,086,557.10	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	89,025	4.028000	358,592.70	
DIXONS CARPHONE PLC	63,248	4.537000	286,956.17	
EASYJET PLC	10,727	15.940000	170,988.38	
EXPERIAN PLC	63,950	11.910000	761,644.50	
FRESNILLO PLC	14,321	7.140000	102,251.94	
G4S PLC	100,931	2.148000	216,799.78	
GKN PLC	106,852	2.930000	313,076.36	
GLAXOSMITHKLINE PLC	315,348	13.430000	4,235,123.64	
GLENCORE PLC	792,287	0.939800	744,591.32	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,917	14.480000	244,958.16	
HSBC HOLDINGS PLC	1,264,090	5.301000	6,700,941.09	
ICAP PLC	35,778	5.020000	179,605.56	
IMI PLC	17,549	9.290000	163,030.21	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	62,045	35.300000	2,190,188.50	
INMARSAT PLC	29,132	10.510000	306,177.32	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	15,322	24.410000	374,010.02	
INTERTEK GROUP PLC	10,444	26.650000	278,332.60	
INVESTEC PLC	35,768	5.570000	199,227.76	
ITV PLC	248,459	2.587000	642,763.43	
JOHNSON MATTHEY PLC	13,289	27.790000	369,301.31	
KINGFISHER PLC	150,637	3.421000	515,329.17	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	385,048	2.680000	1,031,928.64	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,699,017	0.716000	2,648,496.17	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,305	25.760000	523,056.80	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	106,825	4.960000	529,852.00	
MEGGITT PLC	50,874	3.835000	195,101.79	
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,422	2.818000	181,541.19	
MERLIN ENTERTAINMENT	45,946	3.959000	181,900.21	
MONDI PLC	23,820	14.970000	356,585.40	

NATIONAL GRID PLC	243,277	9.405000	2,288,020.18	
NEXT PLC	9,416	77.000000	725,032.00	
OLD MUTUAL PLC	319,188	2.069000	660,399.97	
PEARSON PLC	52,953	8.085000	428,125.00	
PERSIMMON PLC	19,902	17.820000	354,653.64	
PETROFAC LTD	16,798	7.705000	129,428.59	
PRUDENTIAL PLC	166,616	15.105000	2,516,734.68	
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,015	40.700000	244,810.50	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	41,624	62.540000	2,603,164.96	
RELX PLC	72,764	11.560000	841,151.84	
REXAM PLC	45,563	5.680000	258,797.84	
RIO TINTO PLC	81,927	22.740000	1,863,019.98	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	118,996	5.880000	699,696.48	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	11,116,769	0.001000	11,116.76	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	211,565	3.023000	639,560.99	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	252,342	16.500000	4,163,643.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	158,044	16.675000	2,635,383.70	
ROYAL MAIL PLC	51,943	4.874000	253,170.18	
RSA INSURANCE GROUP PLC	65,816	4.294000	282,613.90	
SABMILLER PLC	63,386	40.200000	2,548,117.20	
SAGE GROUP PLC/THE	70,086	5.585000	391,430.31	
SAINSBURY (J) PLC	86,642	2.502000	216,778.28	
SCHRODERS PLC	8,046	28.980000	233,173.08	
SEVERN TRENT PLC	15,699	21.650000	339,883.35	
SHIRE PLC	38,355	46.460000	1,781,973.30	
SKY PLC	67,016	11.010000	737,846.16	
SMITH & NEPHEW PLC	57,970	11.070000	641,727.90	
SMITHS GROUP PLC	25,611	10.180000	260,719.98	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	17,419	6.805000	118,536.29	
SSE PLC	64,613	14.290000	923,319.77	
ST JAMES'S PLACE PLC	34,000	9.660000	328,440.00	
STANDARD CHARTERED PLC	212,096	5.501000	1,166,740.09	
STANDARD CHARTERED PLC-RTS	47,084	0.840000	39,550.56	
STANDARD LIFE PLC	127,804	4.025000	514,411.10	
TATE & LYLE PLC	30,094	5.950000	179,059.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	211,265	1.781000	376,262.96	
TESCO PLC	527,171	1.644000	866,669.12	
TRAVIS PERKINS PLC	16,155	19.550000	315,830.25	
TUI AG-DI	32,342	10.700000	346,059.40	
TULLOW OIL PLC	58,894	2.033000	119,731.50	
UNILEVER PLC	83,136	28.330000	2,355,242.88	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,806	9.580000	429,241.48	
VODAFONE GROUP PLC	1,718,327	2.193000	3,768,291.11	
WEIR GROUP PLC/THE	13,786	11.280000	155,506.08	
WHITBREAD PLC	11,780	43.060000	507,246.80	
WILLIAM HILL PLC	56,941	3.470000	197,585.27	
WM MORRISON SUPERMARKETS	143,215	1.516000	217,113.94	
WOLSELEY PLC	16,887	37.590000	634,782.33	
WPP PLC	84,360	14.850000	1,252,746.00	
イギリス債券 小計	30,044,198		103,690,688.89 (19,153,744,051)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	142,506	18.950000	2,700,488.70	
ACTELION LTD-REG	6,664	138.900000	925,629.60	
ADECCO SA-REG	11,032	67.300000	742,453.60	
ARYZTA AG	5,634	46.760000	263,445.84	
BALOISE HOLDING AG - REG	3,227	122.500000	395,307.50	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	143	1,072.000000	153,296.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	63	6,080.000000	383,040.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	33,831	74.600000	2,523,792.60	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	116,347	21.200000	2,466,556.40	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-RTS	100,847	0.500000	50,423.50	
DUFREY AG-REG	2,618	116.900000	306,044.20	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	535	411.250000	220,018.75	
GEBERIT AG-REG	2,455	333.600000	818,988.00	
GIVAUDAN-REG	600	1,804.000000	1,082,400.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	14,527	47.010000	682,914.27	

KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,559	134.400000	478,329.60	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	28,124	53.600000	1,507,446.40	
LINDT&SPRUENGLI	7	73,800.000000	516,600.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,446	158.900000	547,569.40	
NESTLE SA-REG	208,978	74.800000	15,631,554.40	
NOVARTIS AG-REG	147,460	88.000000	12,976,480.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,003	63.400000	126,990.20	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,041	361.500000	376,321.50	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	45,531	266.900000	12,152,223.90	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,370	165.700000	227,009.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,868	165.000000	473,220.00	
SGS SA-REG	355	1,872.000000	664,560.00	
SIKA AG-BR	140	3,330.000000	466,200.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,492	128.500000	448,722.00	
SULZER AG-REG	1,557	103.600000	161,305.20	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,991	353.500000	703,818.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,240	66.700000	216,108.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,074	243.500000	505,019.00	
SWISS PRIME SITE-REG	4,296	75.450000	324,133.20	
SWISS RE AG	22,788	95.700000	2,180,811.60	
SWISSCOM AG-REG	1,678	506.000000	849,068.00	
SYNGENTA AG-REG	6,024	373.800000	2,251,771.20	
TRANSOCEAN LTD	23,517	14.540000	341,937.18	
UBS GROUP AG-REG	236,731	19.430000	4,599,683.33	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,729	263.400000	2,562,618.60	
スイスフラン 小計	1,203,028		75,004,299.17 (9,038,768,092)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	781,200	47.800000	37,341,360.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,700	62.800000	985,960.00	
BANK OF EAST ASIA	76,220	28.650000	2,183,703.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	239,000	24.600000	5,879,400.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	81,000	14.860000	1,203,660.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	69.050000	2,831,050.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	174,868	52.350000	9,154,339.80	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	174,368	104.000000	18,134,272.00	
CLP HOLDINGS LTD	123,500	66.400000	8,200,400.00	
FIRST PACIFIC CO	158,000	4.990000	788,420.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	151,000	23.450000	3,540,950.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	145,000	19.020000	2,757,900.00	
HANG SENG BANK LTD	49,400	142.700000	7,049,380.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	74,868	48.550000	3,634,841.40	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	170,000	9.790000	1,664,300.00	
HONG KONG & CHINA GAS	454,578	15.600000	7,091,416.80	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	72,600	210.800000	15,304,080.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	41,000	32.800000	1,344,800.00	
KERRY PROPERTIES LTD	41,500	22.350000	927,525.00	
LI & FUNG LTD	380,000	5.600000	2,128,000.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	63,200	10.240000	647,168.00	
MTR CORP	96,000	36.750000	3,528,000.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	349,000	7.850000	2,739,650.00	
NWS HOLDINGS LTD	97,500	11.140000	1,086,150.00	
PCCW LTD	264,000	4.550000	1,201,200.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	90,000	72.650000	6,538,500.00	
SANDS CHINA LTD	157,200	26.400000	4,150,080.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	84,000	7.200000	604,800.00	
SINO LAND CO	195,400	11.860000	2,317,444.00	
SJM HOLDINGS LTD	130,000	5.920000	769,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	111,000	98.300000	10,911,300.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	38,000	88.250000	3,353,500.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	75,200	22.700000	1,707,040.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	89,000	31.500000	2,803,500.00	
WH GROUP LTD	378,000	3.900000	1,474,200.00	
WHARF HOLDINGS LTD	87,000	45.700000	3,975,900.00	
WHEELLOCK & CO LTD	59,000	34.550000	2,038,450.00	
WYNN MACAU LTD	101,200	9.950000	1,006,940.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	48,000	27.650000	1,327,200.00	

香港ドル 小計	5,957,502		184,326,380.00 (2,912,356,804)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	169,500	3.130000	530,535.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	27,000	7.520000	203,040.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	142,600	3.050000	434,930.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	114,800	16.910000	1,941,268.00	
GENTING SINGAPORE PLC	397,000	0.795000	315,615.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	207,100	2.130000	441,123.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	463,360	0.360000	166,809.60	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	7,700	32.440000	249,788.00	
KEPPEL CORP LTD	94,800	6.840000	648,432.00	
NOBLE GROUP LTD	317,090	0.405000	128,421.45	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	195,700	8.860000	1,733,902.00	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	64,700	3.370000	218,039.00	
SEBACORP MARINE LTD	57,000	2.170000	123,690.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	38,340	10.740000	411,771.60	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	53,600	7.680000	411,648.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	107,250	3.990000	427,927.50	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	104,700	2.960000	309,912.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	519,560	3.870000	2,010,697.20	
STARHUB LTD	44,400	3.680000	163,392.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	84,500	19.890000	1,680,705.00	
UOL GROUP LTD	32,200	6.160000	198,352.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	125,900	2.940000	370,146.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	128,000	1.140000	145,920.00	
シンガポールドル 小計	3,496,800		13,266,064.35 (1,155,208,883)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	63,064	5.290000	333,608.56	
CONTACT ENERGY LTD	48,451	5.050000	244,677.55	
FLETCHER BUILDING LTD	44,362	7.120000	315,857.44	
MERIDIAN ENERGY LTD	86,171	2.330000	200,778.43	
MIGHTY RIVER POWER	45,211	2.830000	127,947.13	
RYMAN HEALTHCARE LTD	24,356	7.940000	193,386.64	
SPARK NEW ZEALAND LTD	118,824	3.290000	390,930.96	
ニュージーランドドル 小計	430,439		1,807,186.71 (145,207,452)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	18,998	153.800000	2,921,892.40	
ASSA ABLOY AB-B	65,041	178.800000	11,629,330.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	43,495	226.900000	9,869,015.50	
ATLAS COPCO AB-B SHS	25,344	208.800000	5,291,827.20	
BOLIDEN AB	17,624	153.100000	2,698,234.40	
ELECTROLUX AB-SER B	15,566	247.000000	3,844,802.00	
ERICSSON LM-B SHS	197,268	82.450000	16,264,746.60	
GETINGE AB-B SHS	12,942	214.100000	2,770,882.20	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	61,522	312.800000	19,244,081.60	
HEXAGON AB-B SHS	16,812	307.800000	5,174,733.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	26,792	55.250000	1,480,258.00	
ICA GRUPPEN AB	4,996	318.000000	1,588,728.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,447	153.200000	1,600,480.40	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	15,251	262.500000	4,003,387.50	
INVESTOR AB-B SHS	29,481	321.000000	9,463,401.00	
LUNDIN PETROLEUM AB	14,182	134.500000	1,907,479.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,285	504.500000	2,161,782.50	
NORDEA BANK AB	196,795	93.950000	18,488,890.25	
SANDVIK AB	69,070	83.000000	5,732,810.00	
SECURITAS AB-B SHS	20,285	130.600000	2,649,221.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	98,386	89.550000	8,810,466.30	
SKANSKA AB-B SHS	24,588	164.100000	4,034,890.80	
SKF AB-B SHARES	25,712	153.200000	3,939,078.40	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	38,125	247.900000	9,451,187.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,015	114.500000	11,108,217.50	
SWEDBANK AB - A SHARES	58,669	188.900000	11,082,574.10	
SWEDISH MATCH AB	12,783	291.700000	3,728,801.10	
TELE2 AB-B SHS	20,539	86.050000	1,767,380.95	
TELIASONERA AB	167,908	42.030000	7,057,173.24	

VOLVO AB-B SHS	99,591	86.000000	8,564,826.00	
スウェーデンクローネ 小計	1,509,512		198,330,579.84 (2,796,461,175)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	63,328	111.000000	7,029,408.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,017	137.600000	1,791,139.20	
NORSK HYDRO ASA	86,749	32.450000	2,815,005.05	
ORKLA ASA	53,002	70.650000	3,744,591.30	
SEADRILL LTD	23,810	55.000000	1,309,550.00	
STATOIL ASA	72,271	136.100000	9,836,083.10	
SUBSEA 7 SA	17,161	70.700000	1,213,282.70	
TELENOR ASA	48,651	151.700000	7,380,356.70	
YARA INTERNATIONAL ASA	11,660	393.500000	4,588,210.00	
ノルウェークローネ 小計	389,649		39,707,626.05 (562,259,984)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	253	9,950.000000	2,517,350.00	
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	459	10,150.000000	4,658,850.00	
CARLSBERG AS-B	6,941	591.000000	4,102,131.00	
COLOPLAST-B	7,218	554.000000	3,998,772.00	
DANSKE BANK A/S	45,778	186.700000	8,546,752.60	
DSV A/S	11,472	271.200000	3,111,206.40	
ISS A/S	9,646	237.300000	2,288,995.80	
NOVO NORDISK A/S-B	127,018	375.600000	47,707,960.80	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	15,162	329.200000	4,991,330.40	
PANDORA A/S	7,135	805.000000	5,743,675.00	
TDC A/S	52,401	36.610000	1,918,400.61	
TRYG A/S	7,788	129.000000	1,004,652.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,543	434.200000	6,314,570.60	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,589	659.500000	1,047,945.50	
デンマーククローネ 小計	307,403		97,952,592.71 (1,712,211,320)	
イスラエルシェケル				
AZRIELI GROUP	2,354	146.100000	343,919.40	
BANK HAPOLIM BM	68,145	20.580000	1,402,424.10	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,044	14.320000	1,289,430.08	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	124,083	8.070000	1,001,349.81	
DELEK GROUP LTD	322	915.000000	294,630.00	
ISRAEL CHEMICALS LTD	32,780	19.050000	624,459.00	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	191	840.000000	160,440.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,256	46.130000	426,979.28	
NICE SYSTEMS LTD	3,673	245.500000	901,721.50	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	55,969	240.100000	13,438,156.90	
イスラエルシェケル 小計	386,817		19,883,510.07 (629,909,599)	
ユーロ				
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	27,512	14.085000	387,506.52	
ACCOR SA	13,541	38.600000	522,682.60	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,488	30.620000	382,382.56	
ADIDAS AG	13,554	87.570000	1,186,923.78	
ADP	1,962	105.750000	207,481.50	
AEGON NV	116,983	5.538000	647,851.85	
AENA SA	4,382	103.300000	452,660.60	
AGEAS	13,041	40.990000	534,550.59	
AIR LIQUIDE SA	22,290	114.150000	2,544,403.50	
AIRBUS GROUP SE	38,280	65.590000	2,510,785.20	
AKZO NOBEL	15,918	65.180000	1,037,535.24	
ALCATEL-LUCENT	183,289	3.720000	681,835.08	
ALLIANZ SE-REG	29,592	161.750000	4,786,506.00	
ALSTOM	14,032	28.710000	402,858.72	
ALTICE NV - A	23,916	12.940000	309,473.04	
ALTICE NV - B	7,100	13.150000	93,365.00	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	28,971	37.240000	1,078,880.04	
ANDRITZ AG	5,088	48.600000	247,276.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	52,518	120.000000	6,302,160.00	
ARCELORMITTAL	64,550	4.595000	296,607.25	
ARKEMA	4,240	65.760000	278,822.40	
ASML HOLDING NV	22,463	84.110000	1,889,362.93	

ASSICURAZIONI GENERALI	75,476	17.510000	1,321,584.76	
ATLANTIA SPA	26,923	23.890000	643,190.47	
ATOS SE	5,596	75.320000	421,490.72	
AXA SA	127,079	24.485000	3,111,529.31	
AXEL SPRINGER SE	2,886	51.320000	148,109.52	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	163,764	1.444000	236,475.21	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	412,593	7.763000	3,202,959.45	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	2,448,742	0.050000	122,437.10	
BANCO DE SABADELL SA	319,119	1.752000	559,096.48	
BANCO POPOLARE SC	23,435	13.500000	316,372.50	
BANCO POPULAR ESPANOL	109,908	3.387000	372,258.39	
BANCO SANTANDER SA	934,770	5.192000	4,853,325.84	
BANK OF IRELAND	1,827,226	0.351000	641,356.32	
BANKIA SA	296,948	1.189000	353,071.17	
BANKINTER SA	43,470	6.780000	294,726.60	
BASF SE	59,497	76.520000	4,552,710.44	
BAYER AG-REG	53,588	122.900000	6,585,965.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,461	96.760000	2,076,566.36	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,499	74.510000	260,710.49	
BEIERSDORF AG	6,516	87.010000	566,957.16	
BNP PARIBAS	68,603	54.960000	3,770,420.88	
BOLLORE	56,587	4.238000	239,815.70	
BOSKALIS WESTMINSTER	5,559	41.890000	232,866.51	
BOUYGUES SA	13,102	34.735000	455,097.97	
BRENNTAG AG	10,035	50.170000	503,455.95	
BUREAU VERITAS SA	17,244	19.010000	327,808.44	
CAIXABANK S.A	169,262	3.525000	596,648.55	
CAP GEMINI	10,081	82.200000	828,658.20	
CARREFOUR SA	35,698	28.115000	1,003,649.27	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,642	54.660000	199,071.72	
CHRISTIAN DIOR SE	3,537	170.600000	603,412.20	
CNH INDUSTRIAL NV	61,483	6.195000	380,887.18	
CNP ASSURANCES	11,075	13.080000	144,861.00	
COLRUYT SA	4,567	46.055000	210,333.18	
COMMERZBANK AG	68,880	10.270000	707,397.60	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	30,930	40.150000	1,241,839.50	
CONTINENTAL AG	7,132	216.700000	1,545,504.40	
CREDIT AGRICOLE SA	66,699	11.205000	747,362.29	
CRH PLC	54,199	26.855000	1,455,514.14	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	62,386	78.450000	4,894,181.70	
DANONE	37,540	64.040000	2,404,061.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,287	73.370000	608,017.19	
DELHAIZE GROUP	6,718	91.130000	612,211.34	
DELTA LLOYD NV	14,151	7.316000	103,528.71	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	89,321	23.700000	2,116,907.70	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,511	79.020000	988,619.22	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,599	12.910000	201,383.09	
DEUTSCHE POST AG-REG	62,855	26.755000	1,681,685.52	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	205,803	16.960000	3,490,418.88	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	21,857	24.830000	542,709.31	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	39,774	5.941000	236,297.33	
E.ON SE	129,825	8.799000	1,142,330.17	
EDENRED	13,315	18.915000	251,853.22	
EDF	15,781	13.965000	220,381.66	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	150,981	3.198000	482,837.23	
ELISA OYJ	9,224	34.750000	320,534.00	
ENAGAS SA	14,132	27.510000	388,771.32	
ENDESA SA	20,744	19.315000	400,670.36	
ENEL GREEN POWER SPA	115,127	1.937000	223,000.99	
ENEL SPA	458,113	4.050000	1,855,357.65	
ENGIE	94,894	16.195000	1,536,808.33	
ENI SPA	164,742	15.050000	2,479,367.10	
ERSTE GROUP BANK AG	18,213	28.390000	517,067.07	
ESSILOR INTERNATIONAL	13,294	119.250000	1,585,309.50	
EURAZEO	2,596	61.640000	160,017.44	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,080	27.950000	309,686.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,036	33.795000	305,371.62	

EXOR SPA	6,358	40.220000	255,718.76
FERROVIAL SA	28,708	22.190000	637,030.52
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	58,287	13.060000	761,228.22
FINMECCANICA SPA	26,204	13.120000	343,796.48
FORTUM OYJ	29,043	13.770000	399,922.11
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	2,748	56.440000	155,097.12
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	14,142	76.480000	1,081,580.16
FRESENIUS SE & CO KGAA	24,639	67.210000	1,655,987.19
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,508	43.160000	194,565.28
GALP ENERGIA SGPS SA	24,924	9.739000	242,734.83
GAS NATURAL SDG SA	22,924	19.720000	452,061.28
GEA GROUP AG	11,857	37.870000	449,024.59
GEMALTO	5,176	56.850000	294,255.60
GRIFOLS SA	9,643	43.310000	417,638.33
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,237	77.160000	404,086.92
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,756	11.905000	366,150.18
HANNOVER RUECK SE	3,901	108.800000	424,428.80
HEIDELBERGCEMENT AG	9,116	72.850000	664,100.60
HEINEKEN HOLDING NV	6,561	72.990000	478,887.39
HEINEKEN NV	14,940	83.020000	1,240,318.80
HENKEL AG & CO KGAA	6,728	88.180000	593,275.04
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,528	103.800000	1,196,606.40
HERMES INTERNATIONAL	1,713	324.350000	555,611.55
HUGO BOSS AG -ORD	4,323	80.810000	349,341.63
IBERDROLA SA	351,275	6.480000	2,276,262.00
ILIAD SA	1,700	207.750000	353,175.00
IMERYS SA	2,316	62.150000	143,939.40
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	70,672	32.300000	2,282,705.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	73,182	11.295000	826,590.69
ING GROEP NV-CVA	250,616	13.000000	3,258,008.00
INGENICO GROUP	3,550	110.500000	392,275.00
INTESA SANPAOLO	821,926	3.108000	2,554,546.00
INTESA SANPAOLO-RSP	59,932	2.876000	172,364.43
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	54,009	7.803000	421,432.22
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JC DECAUX SA	4,824	33.800000	163,051.20
JERONIMO MARTINS	16,283	12.830000	208,910.89
K+S AG-REG	12,379	24.065000	297,900.63
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,449	115.250000	166,997.25
KBC GROEP NV	16,269	54.220000	882,105.18
KERING	4,906	160.950000	789,620.70
KERRY GROUP PLC-A	10,704	72.600000	777,110.40
KONE OYJ-B	21,841	39.410000	860,753.81
KONINKLIJKE AHOLD NV	57,914	20.045000	1,160,886.13
KONINKLIJKE DSM NV	11,754	47.665000	560,254.41
KONINKLIJKE KPN NV	208,024	3.493000	726,627.83
KONINKLIJKE PHILIPS NV	60,549	25.125000	1,521,293.62
LAGARDERE SCA	7,643	26.905000	205,634.91
LANXESS AG	5,921	46.575000	275,770.57
LEGRAND SA	17,255	53.170000	917,448.35
LINDE AG	12,033	163.550000	1,967,997.15
L'OREAL	16,310	164.900000	2,689,519.00
LUXOTTICA GROUP SPA	10,951	61.250000	670,748.75
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,102	154.950000	2,804,904.90
MAN SE	2,284	93.890000	214,444.76
MAPFRE SA	68,164	2.544000	173,409.21
MEDIOBANCA SPA	36,357	8.975000	326,304.07
MERCK KGAA	8,372	93.280000	780,940.16
METRO AG	11,505	28.980000	333,414.90
METSO OYJ	7,270	22.680000	164,883.60
MICHELIN (CGDE)	12,066	92.400000	1,114,898.40
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,787	183.000000	1,974,021.00
NATIXIS	60,637	5.569000	337,687.45
NESTE OYJ	8,278	25.250000	209,019.50
NN GROUP NV	15,466	32.525000	503,031.65
NOKIA OYJ	238,419	6.820000	1,626,017.58
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,348	35.370000	259,898.76

NUMERICABLE-SFR	6,323	37.965000	240,052.69
OCI NV	5,477	22.470000	123,068.19
OMV AG	9,542	26.325000	251,193.15
ORANGE	128,767	16.160000	2,080,874.72
ORION OYJ-CLASS B	6,579	32.830000	215,988.57
OSRAM LICHT AG	5,763	38.545000	222,134.83
PERNOD RICARD SA	13,747	106.100000	1,458,556.70
PEUGEOT SA	28,003	16.085000	450,428.25
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,880	44.415000	438,820.20
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	14,218	48.445000	688,791.01
PROXIMUS	9,859	31.285000	308,438.81
PRYSMIAN SPA	12,601	19.730000	248,617.73
PUBLICIS GROUPE	12,191	55.880000	681,233.08
QIAGEN N.V.	14,286	24.755000	353,649.93
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,701	15.005000	115,553.50
RANDSTAD HOLDING NV	8,321	56.750000	472,216.75
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,097	79.830000	566,553.51
RELX NV	66,134	15.715000	1,039,295.81
REMY COINTREAU	1,599	66.640000	106,557.36
RENAULT SA	12,451	91.230000	1,135,904.73
REPSOL SA	68,392	12.310000	841,905.52
REXEL SA	18,872	12.780000	241,184.16
RTL GROUP	2,498	81.920000	204,636.16
RWE AG	31,769	10.665000	338,816.38
SAFRAN SA	18,919	67.300000	1,273,248.70
SAIPEM SPA	17,100	8.010000	136,971.00
SAMPO OYJ-A SHS	28,981	45.640000	1,322,692.84
SANOFI	76,265	81.780000	6,236,951.70
SAP SE	63,676	73.590000	4,685,916.84
SCHNEIDER ELECTRIC SE	35,960	57.530000	2,068,778.80
SCOR SE	9,929	36.280000	360,224.12
SES	20,801	26.225000	545,506.22
SIEMENS AG-REG	51,357	94.540000	4,855,290.78
SNAM SPA	137,380	4.730000	649,807.40
SOCIETE BIC SA	1,865	151.150000	281,894.75
SOCIETE GENERALE SA	46,976	43.495000	2,043,221.12
SODEXO	6,099	90.490000	551,898.51
SOLVAY SA	3,849	102.750000	395,484.75
STMICROELECTRONICS NV	41,248	6.548000	270,091.90
STORA ENSO OYJ-R SHS	35,494	9.075000	322,108.05
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	19,557	17.235000	337,064.89
SYMRISE AG	8,022	61.850000	496,160.70
TECHNIP SA	6,773	48.455000	328,185.71
TELECOM ITALIA SPA	744,443	1.153000	858,342.77
TELECOM ITALIA-RSP	388,579	1.022000	397,127.73
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	38,605	5.306000	204,838.13
TELEFONICA SA	296,437	11.485000	3,404,578.94
TELENET GROUP HOLDING NV	3,464	50.220000	173,962.08
TENARIS SA	30,561	12.000000	366,732.00
TERNA SPA	98,931	4.538000	448,948.87
THALES SA	6,806	69.230000	471,179.38
THYSSENKRUPP AG	23,833	19.200000	457,593.60
TNT EXPRESS NV	32,244	7.650000	246,666.60
TOTAL SA	139,688	46.085000	6,437,521.48
UBI BANCA SPA	58,568	6.395000	374,542.36
UCB SA	8,222	80.350000	660,637.70
UMICORE	6,170	38.435000	237,143.95
UNICREDIT SPA	309,877	5.410000	1,676,434.57
UNILEVER NV-CVA	105,520	41.275000	4,355,338.00
UNIPOLSAI SPA	70,766	2.384000	168,706.14
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,006	47.895000	383,447.37
UPM-KYMMENE OYJ	34,545	17.550000	606,264.75
VALEO SA	5,157	140.900000	726,621.30
VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,473	21.705000	639,711.46
VINCI SA	30,966	60.500000	1,873,443.00
VIVENDI	75,024	19.930000	1,495,228.32
VOESTALPINE AG	7,355	30.010000	220,723.55

VOLKSWAGEN AG	2,303	127.150000	292,826.45	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,521	115.900000	1,219,383.90	
VONOVIA SE	30,196	28.780000	869,040.88	
VOPAK	4,552	39.930000	181,761.36	
WARTSILA OYJ ABP	9,602	41.840000	401,747.68	
WENDEL	1,871	108.300000	202,629.30	
WOLTERS KLUWER	19,621	32.005000	627,970.10	
ZARDOYA OTIS SA	11,660	10.900000	127,094.00	
ZODIAC AEROSPACE	13,045	22.530000	293,903.85	
ユーロ 小計	17,085,806		225,725,109.55 (29,439,068,787)	
合計	88,727,303		231,504,345,647 (231,504,345,647)	

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨		口数	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	22,544.00	407,370.08	
	AMERICAN TOWER CORP	27,424.00	2,722,106.24	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	60,901.00	585,258.61	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,555.00	1,535,194.75	
	BOSTON PROPERTIES INC	9,940.00	1,239,219.80	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,550.00	286,324.50	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,604.00	425,791.92	
	COMMUNICATIONS SALES & LE	7,744.00	143,031.68	
	CROWN CASTLE INTL CORP	21,621.00	1,875,189.33	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,809.00	632,662.38	
	DUKE REALTY CORP	22,388.00	449,774.92	
	EQUINIX INC	3,816.00	1,118,889.36	
	EQUITY RESIDENTIAL	23,565.00	1,864,462.80	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,238.00	965,628.30	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,164.00	590,528.52	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,446.00	648,271.26	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	37,363.00	957,987.32	
	HCP INC	29,854.00	1,054,144.74	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	49,003.00	795,808.72	
	IRON MOUNTAIN INC	12,948.00	371,607.60	
	KIMCO REALTY CORP	26,723.00	696,935.84	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	9,635.00	324,603.15	
	MACERICH CO/THE	8,720.00	688,880.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	11,389.00	575,600.06	
	PROLOGIS INC	33,896.00	1,469,052.64	
	PUBLIC STORAGE	9,524.00	2,265,092.92	
	REALTY INCOME CORP	15,063.00	744,865.35	
	REGENCY CENTERS CORP	6,105.00	409,157.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,176.00	3,777,754.24	
	SL GREEN REALTY CORP	6,465.00	760,025.40	
	UDR INC	16,803.00	613,141.47	
	VENTAS INC	21,400.00	1,129,706.00	
	VEREIT INC	58,529.00	486,961.28	
	VORNADO REALTY TRUST	10,986.00	1,069,377.24	
	WELLTOWER INC	22,677.00	1,412,096.79	
	WEYERHAEUSER CO	33,499.00	1,077,662.83	
	投資証券 小計	691,067.00	36,170,165.14 (4,428,313,318)	
アメリカドル 小計		691,067.00	36,170,165.14 (4,428,313,318)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	8,700.00	186,876.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,000.00	254,300.00	
	投資証券 小計	18,700.00	441,176.00 (40,605,839)	
カナダドル 小計		18,700.00	441,176.00 (40,605,839)	
オーストラリアドル				
投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	63,854.00	495,507.04	
	GOODMAN GROUP	115,647.00	714,698.46	
	GPT GROUP	117,853.00	555,087.63	
	MIRVAC GROUP	244,388.00	471,668.84	
	SCENTRE GROUP	348,245.00	1,424,322.05	
	STOCKLAND	155,877.00	623,508.00	
	VICINITY CENTRES	222,372.00	629,312.76	
	WESTFIELD CORP	129,144.00	1,283,691.36	
	投資証券 小計	1,397,380.00	6,197,796.14 (551,046,054)	
オーストラリアドル 小計		1,397,380.00	6,197,796.14 (551,046,054)	
イギリスポンド				
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	62,872.00	514,607.32	
	HAMMERSON PLC	50,946.00	304,657.08	

	INTU PROPERTIES PLC	60,807.00	194,704.01	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	51,248.00	621,638.24	
	SEGRO PLC	48,452.00	206,696.23	
	投資証券 小計	274,325.00	1,842,302.88 (340,310,187)	
	イギリスポンド 小計	274,325.00	1,842,302.88 (340,310,187)	
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	148,000.00	7,022,600.00	
	投資証券 小計	148,000.00	7,022,600.00 (110,957,080)	
	香港ドル 小計	148,000.00	7,022,600.00 (110,957,080)	
	シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	135,800.00	315,056.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	138,000.00	180,780.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	161,900.00	305,181.50	
	SUNTEC REIT	160,000.00	248,000.00	
	投資証券 小計	595,700.00	1,049,017.50 (91,348,443)	
	シンガポールドル 小計	595,700.00	1,049,017.50 (91,348,443)	
	ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	1,939.00	157,912.16	
	GECINA SA	2,240.00	250,096.00	
	ICADE	2,141.00	138,094.50	
	KLEPIERRE	14,255.00	585,666.67	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,377.00	1,528,248.05	
	投資証券 小計	26,952.00	2,660,017.38 (346,919,466)	
	ユーロ 小計	26,952.00	2,660,017.38 (346,919,466)	
	合計		5,909,500,387 (5,909,500,387)	

(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 599銘柄	97.13%		63.11%
	投資証券 36銘柄		2.87%	1.87%
カナダドル	株式 90銘柄	99.51%		3.48%
	投資証券 2銘柄		0.49%	0.02%
オーストラリアドル	株式 62銘柄	91.43%		2.48%
	投資証券 8銘柄		8.57%	0.23%
イギリスポンド	株式 109銘柄	98.25%		8.07%
	投資証券 5銘柄		1.75%	0.14%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.00%		3.81%
香港ドル	株式 39銘柄	96.33%		1.23%
	投資証券 1銘柄		3.67%	0.05%
シンガポールドル	株式 23銘柄	92.67%		0.49%
	投資証券 4銘柄		7.33%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%		0.06%
スウェーデンクローネ	株式 30銘柄	100.00%		1.18%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.00%		0.24%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.00%		0.72%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.00%		0.27%
ユーロ	株式 232銘柄	98.84%		12.40%
	投資証券 5銘柄		1.16%	0.15%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「マネーブルファンド（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9期	第10期
	[平成27年5月20日現在]	[平成27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	298	263
親投資信託受益証券	118,605	104,723
流動資産合計	118,903	104,986
資産合計	118,903	104,986
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	1	118,509
104,617		
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	394	369
(分配準備積立金)	(331)	(312)
元本等合計	118,903	104,986
純資産合計	118,903	104,986
負債純資産合計	118,903	104,986

(2) 損益及び剰余金計算書

	第9期	第10期
	自平成26年11月21日 至平成27年5月20日	自平成27年5月21日 至平成27年11月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益		20
営業収益合計		20
営業費用		
営業費用合計		
営業利益又は営業損失()		20
経常利益又は経常損失()		20
当期純利益又は当期純損失()		20
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		
期首剰余金又は期首欠損金()	394	394
剰余金減少額又は欠損金増加額		45
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額		45
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()	394	369

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 [平成27年5月20日現在]	第10期 [平成27年11月20日現在]
1 期首元本額	118,509円	118,509円
期中追加設定元本額		
期中一部解約元本額		13,892円
2 受益権の総数	118,509口	104,617口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0033円 (10,033円)	1.0035円 (10,035円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第9期(自平成26年11月21日 至平成27年5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	1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	63円
分配準備積立金額	D	330円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	394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	33円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第10期(自平成27年5月21日 至平成27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	
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	19円
収益調整金額	C	57円
分配準備積立金額	D	293円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	369円
当ファンドの期末残存口数	F	104,617口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	35円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第9期 (自平成26年11月21日 至平成27年5月20日)	第10期 (自平成27年5月21日 至平成27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に投資しております。当該投資対象は、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 9 期	第 10 期
	[平成27年5月20日現在]	[平成27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	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 9 期	第 10 期
	[平成27年5月20日現在]	[平成27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		20
合計		20

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	102,821	104,723	
	親投資信託受益証券 小計	102,821	104,723	
合計		102,821	104,723	

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>

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「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27年5月20日現在]	[平成27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	210,220,805	2,446,046,790
国債証券	1,750,095,800	25,387,817,093
未収利息	78,794	58,164
前払費用		109,093
流動資産合計	1,960,395,399	27,834,031,140
資産合計	1,960,395,399	27,834,031,140
負債の部		
流動負債		
未払解約金	802,372	562
流動負債合計	802,372	562
負債合計	802,372	562
純資産の部		
元本等		
元本	1,924,361,734	27,329,169,583
剰余金		
剰余金又は欠損金()	35,231,293	504,860,995
元本等合計	1,959,593,027	27,834,030,578
純資産合計	1,959,593,027	27,834,030,578
負債純資産合計	1,960,395,399	27,834,031,140

(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	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年5月20日現在]	[平成27年11月20日現在]
1 期首	平成26年11月21日	平成27年5月21日
期首元本額	2,330,826,446円	1,924,361,734円
期首からの追加設定元本額	10,374,332,763円	26,414,042,501円
期首からの一部解約元本額	10,780,797,475円	1,009,234,652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	288,416,273円	297,790,994円
三菱UFJ 新興国通貨建て債券ファンド(毎月決算型)	5,226,135円	5,226,135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)	14,525,380円	14,525,380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)	2,727,794円	1,628,029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)	101,543円	101,543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)	81,714,442円	47,179,877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)	152,186,197円	94,134,350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)	429,650円	233,263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)	7,467,710円	4,757,576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>	485,467,302円	414,316,230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)	128,906円	128,906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)	1,799,230円	1,033,322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	2,017,437円	2,017,196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)	248,106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)	712,999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)	862,076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)	299,514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>	981,935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)	389,070円	212,322円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(毎月分配型)	42,384,248円	42,384,248円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(毎月分配型)	3,558,532円	3,558,532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)	35,941,494円	23,960,741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)	938,449円	457,302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)	358,088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)	2,100,667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)	3,836,590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)	923,745円	383,682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>	5,525,461円	8,771,978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)	23,152,810円	13,745,897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)	5,011,602円	3,037,917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)	4,071,402円	1,970,066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)	43,682,881円	43,682,881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)	374,779円	374,779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)	780,306円	407,171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>	29,100,616円	38,911,455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)	1,784,459円	1,784,459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)	2,576,702円	2,576,702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)	3,148,614円	3,148,614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>	3,492,620円	3,492,263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)	78,483,503円	78,483,503円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	2,069,498円	1,285,463円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	1,726,413円	1,147,224円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	1,068円	1,068円
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	20,706円	20,706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	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	98,368円
三菱UFJ/UBS グローバル好利回りCBファンド2012-11(円ヘッジ)(限定追加型)	10,816,126円	
PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(毎月分配型)	47,835,444円	31,229,335円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回分配型)	168,137円	168,137円
PIMCO ニューワールド米ドルインカムファンド(年2回分配型)	472,643円	276,237円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<豪ドルコース>(年2回分配型)	20,660円	20,660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>(年2回分配型)	20,637円	89,380円

PIMCO ニューワールドインカムファンド<メキシコペソコース>(年2回分配型)	2,438,810円	1,554,984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<メキシコペソコース>(毎月分配型)	4,073,259円	2,668,957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<トルコリラコース>(毎月分配型)	688,506円	688,506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<米ドルコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658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<メキシコペソコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658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<トルコリラコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	491,449円	491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,828,976円	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	19,255,183円	19,255,183円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	554,804円	554,804円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	1,936,118円	1,936,118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	9,829円	9,829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	15,049,666円	15,049,666円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	20,551,717円	20,551,717円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	3,730,759円	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	5,059,469円	5,059,469円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	5,519,741円	3,653,886円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	252,058円	252,058円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>(毎月分配型)	6,618,213円	3,908,079円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(年2回分配型)	3,737,703円	3,737,703円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(年2回分配型)	6,435,081円	6,435,081円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(年2回分配型)	686,803円	686,803円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(年2回分配型)	627,788円	627,788円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(年2回分配型)	608,110円	608,110円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(年2回分配型)	46,726円	46,726円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>(年2回分配型)	895,906円	581,687円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドA>	36,583,200円	112,318,894円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<マネーボールファンドB>	980,075円	980,017円
三菱UFJ /ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(毎月決算型)	1,423,307円	1,423,307円
三菱UFJ /ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	3,270,787円	3,270,787円
三菱UFJ /ピムコ トータル・リターン・ファンド<米ドルヘッジ型>(年1回決算型)	1,168,184円	1,168,184円
三菱UFJ /ピムコ トータル・リターン・ファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	2,065,331円	2,065,331円
ピムコ・エマーシング・ボンド・オープン Cコース(為替ヘッジなし)(年1回決算型)	983円	983円
ピムコ・エマーシング・ボンド・オープン Dコース(為替ヘッジあり)(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJ / UBS グローバル好利回りCBファンド 2013-11(円ヘッジ)(限定追加型)	982,608円	982,608円

米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(毎月分配型)	2,827,156円	2,827,156円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(毎月分配型)	9,387,547円	9,387,547円
三菱UFJノビムコトータル・リターン・ファンド2014	256,356円	256,356円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>(毎月決算型)	3,545,187円	3,545,187円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	8,124,755円	8,124,755円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジあり>(年1回決算型)	2,990,177円	2,990,177円
米国バンクローン・オープン<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	3,377,211円	3,377,211円
PIMCOインカム戦略ファンド<円インカム>(毎月分配型)	151,268円	151,268円
PIMCOインカム戦略ファンド<円インカム>(年2回分配型)	168,922円	168,922円
PIMCOインカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	1,674,507円	1,674,507円
PIMCOインカム戦略ファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	658,018円	658,018円
PIMCOインカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	9,991,470円	9,991,470円
PIMCOインカム戦略ファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	1,616,484円	1,616,484円
三菱UFJノAMPオーストラリア・ハイインカム債券ファンド 豪ドル円プレミアム(毎月決算型)	25,537,767円	25,537,767円
三菱UFJ米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム(毎月分配型)	42,906,570円	42,906,570円
三菱UFJ米国バンクローンファンド 米ドル円プレミアム(年2回分配型)	8,585,548円	8,585,548円
PIMCO米国バンクローンファンド<円インカム>(毎月分配型)	10,804円	10,804円
PIMCO米国バンクローンファンド<円インカム>(年2回分配型)	10,804円	10,804円
PIMCO米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	1,375,824円	1,375,824円
PIMCO米国バンクローンファンド<米ドルインカム>(年2回分配型)	1,071,396円	1,071,396円
マルチストラテジー・ファンド(ラップ向け)	491,015円	491,015円
PIMCO米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(毎月分配型)	348,621円	918,198円
PIMCO米国バンクローンファンド<世界通貨分散コース>(年2回分配型)	59,905円	138,468円
三菱UFJ債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(毎月決算型)	983円	983円
三菱UFJ債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)	983円	983円
三菱UFJ債券バランスファンド<為替リスク軽減型>(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJ債券バランスファンド<為替ヘッジなし>(年1回決算型)	983円	983円
三菱UFJJリート不動産株ファンド<米ドル投資型>(3ヵ月決算型)	3,063,931円	3,063,931円
三菱UFJJリート不動産株ファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	6,324,266円	6,324,266円
Navioインド債券ファンド	885,566円	885,566円
Navioマネープールファンド	1,412,300円	1,883,381円
三菱UFJインド債券オープン(毎月決算型)	39,351円	39,351円
三菱UFJグローバル好利回りCBファンド2013-03(円ヘッジ)(限定追加型)		343,676,356円
三菱UFJバランス・イノベーション(株式抑制型)		10,531,117,458円
三菱UFJバランス・イノベーション(株式重視型)		13,274,970,563円
三菱UFJD Cバランス・イノベーション(KAKUSHIN)		112,195,605円
三菱UFJバランス・イノベーション(債券重視型)	22,527,760円	1,242,825,788円
三菱UFJノAMPオーストラリアREITファンド<Wプレミアム>(毎月決算型)	11,293,333円	11,293,333円
バンクローンファンドUSA(為替ヘッジあり)2014-08	11,276,260円	11,276,260円
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	116,474円	102,821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)	132,261,881円	7,644,146円
MUAMトピックスリスクコントロール(10%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)		195,410,633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)	34,396,392円	21,620,196円
(合計)	1,924,361,734円	27,329,169,583円
2 受益権の総数	1,924,361,734口	27,329,169,583口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0183円 (10,183円)	1.0185円 (10,185円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成26年11月21日 至平成27年5月20日)	(自平成27年5月21日 至平成27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、公社債に投資しております。当該投資対象は、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	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年5月20日現在]	[平成27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	売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成27年5月20日現在]	[平成27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	162,000	1,230,260
合計	162,000	1,230,260

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項
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336回利付国債(2年)	300,000,000	300,051,000	
	第340回利付国債(2年)	62,600,000	62,636,308	
	第342回利付国債(2年)	100,000,000	100,079,000	
	第343回利付国債(2年)	83,750,000	83,825,375	
	第554回国庫短期証券	3,110,000,000	3,110,000,000	
	第555回国庫短期証券	3,500,000,000	3,500,000,000	
	第557回国庫短期証券	3,640,000,000	3,640,000,000	
	第561回国庫短期証券	90,000,000	90,004,410	
	第563回国庫短期証券	5,000,000,000	5,000,280,000	
	第564回国庫短期証券	3,000,000,000	3,000,210,000	
	第566回国庫短期証券	3,000,000,000	3,000,261,000	
	第567回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,090,000	
	第568回国庫短期証券	2,500,000,000	2,500,380,000	
	国債証券 小計	25,386,350,000	25,387,817,093	
合計	25,386,350,000	25,387,817,093		

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。

2【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

平成27年12月30日現在
(単位:円)

資産総額	6,497,895,525
負債総額	49,473,710
純資産総額(-)	6,448,421,815
発行済口数	3,200,000 口
1口当たり純資産価額(/)	2,015.13 (100口当たり 201,513)

<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27年12月30日現在
(単位:円)

資産総額	6,437,467,375
負債総額	667,355
純資産総額(-)	6,436,800,020
発行済口数	3,189,158,359 口
1口当たり純資産価額(/)	2.0183 (1万口当たり 20,183)

<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27年12月30日現在
(単位:円)

資産総額	270,058,008,936
負債総額	13,054,364,365
純資産総額(-)	257,003,644,571
発行済口数	116,220,239,382 口
1口当たり純資産価額(/)	2.2114 (1万口当たり 22,114)

<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27年12月30日現在
(単位:円)

資産総額	104,965
負債総額	
純資産総額(-)	104,965
発行済口数	104,617 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0033 (1万口当たり 10,033)

<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27年12月30日現在
(単位:円)

資産総額	6,157,473,495
負債総額	1,403
純資産総額(-)	6,157,472,092
発行済口数	6,046,670,615 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0183 (1万口当たり 10,183)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）受益権の再分割

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

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

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

2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

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

（1）【貸借対照表】

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

（2）【損益計算書】

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

（3）【株主資本等変動計算書】

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成27年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成27年9月末現在)	事業の内容
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。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	4,500 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。
モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社	62,149 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27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51.0%（107,855株）を所有しています。

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

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成27年9月7日 有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書

平成27年6月30日 有価証券届出書の訂正届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・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28年1月6日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成27年6月9日から平成27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27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国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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