

【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9月7日
【計算期間】	第11期（自平成27年12月9日 至平成28年6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 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【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）

（注）この有価証券報告書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第7条第4項の規定により、平成28年3月7日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書とみなされます。

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				日本	TOPIX
大型株	年4回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコク サイ インデッ クス(円換算 ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
中小型株	年6回	欧州				
債券	(隔月)	アジア				
一般	年12回	オセアニア				
公債	(毎月)	中南米				
社債	日々	アフリカ				
その他債券	その他	中近東 (中東)				その他 ()
クレジット 属性 ()	()	エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))						
資産複合 ()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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。

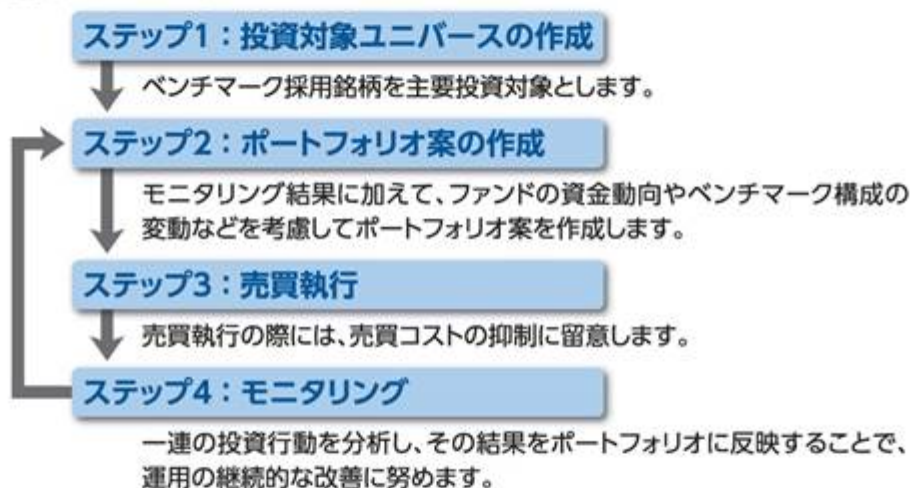
ファンドの特色

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。

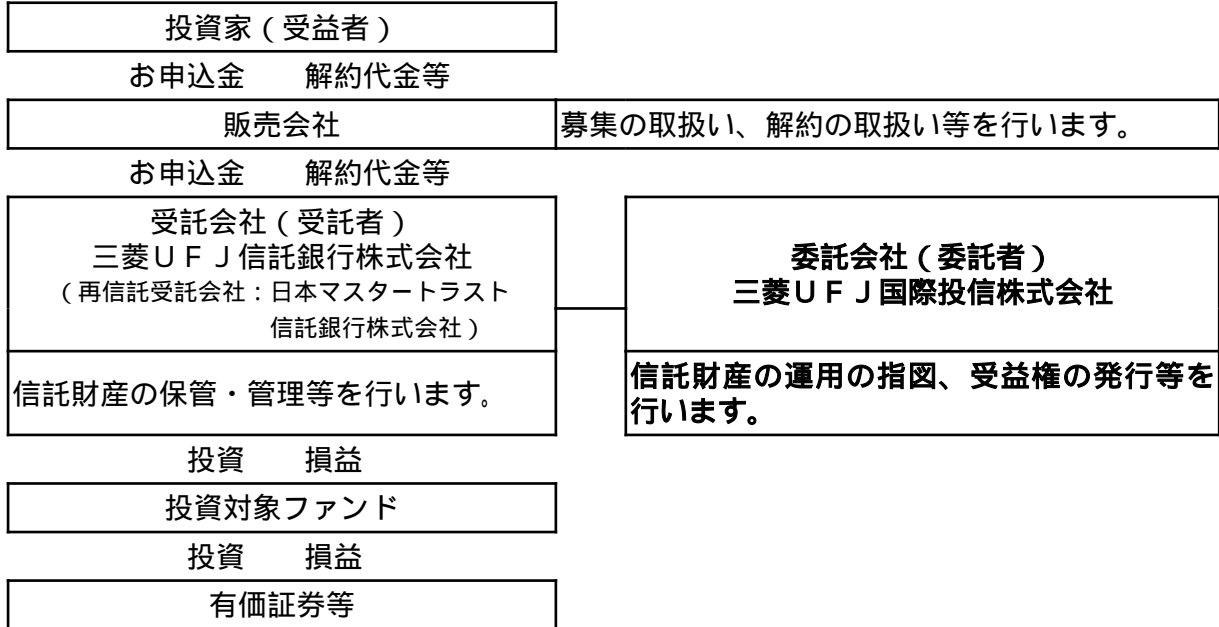
(2) 【ファンドの沿革】

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28年6月末現在）
- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成28年6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、「マネーパブルファンド（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 >

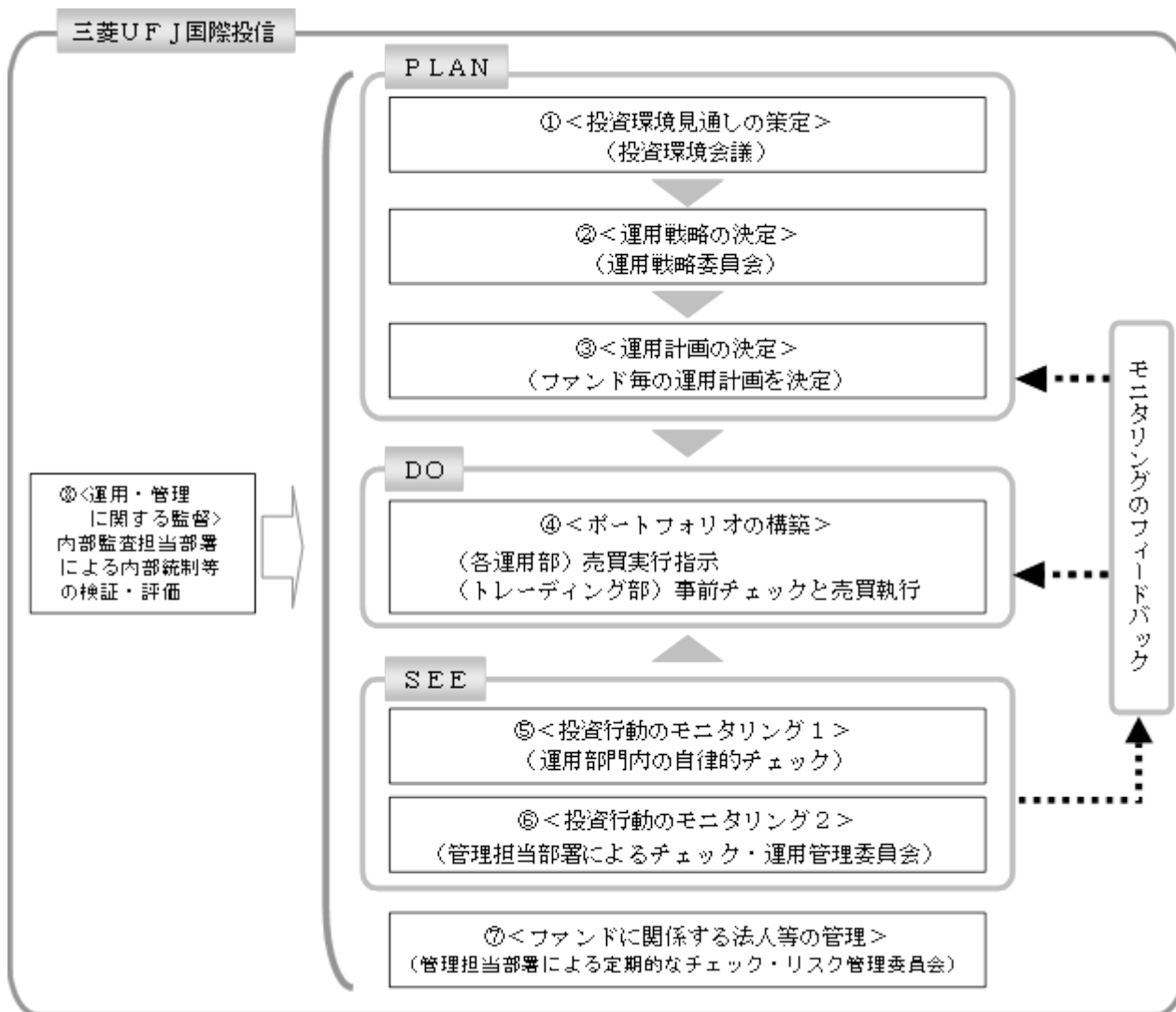
ファンド名	MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資対象	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
投資態度	外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式に実質的な投資を行い、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、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、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。

信用リスクの分散規制

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

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乖離を生じることがあります。
- 当ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格は当ファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、当ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。
- コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

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

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

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。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

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

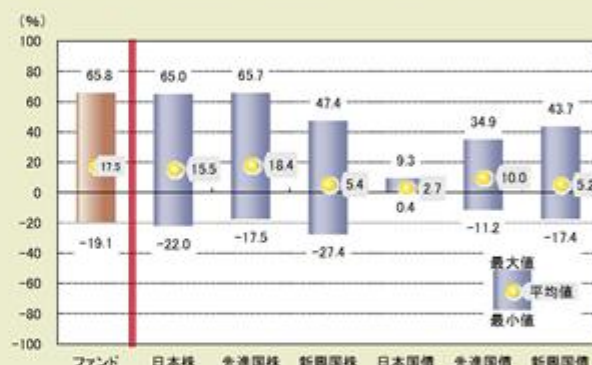
●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率は、2011年11月～2016年6月です。
ベンチマークの年間騰落率は、2011年7月～2011年10月です。
基準価額(分配金再投資)は、2011年7月末～2016年6月末です。



●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2011年7月末～2016年6月末)
ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2011年10月以前)の年間騰落率を含みます。



(注) 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。

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

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	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 （カストディフィー）	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、「NISA(少額投資非課税制度)およびジュニアNISA(未成年者少額投資非課税制度)」の適用対象です。NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託や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(EETF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、益金不算入制度の適用はありません。

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28年6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28年6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	6,014,387,681	99.80
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		11,984,237	0.20
純資産総額		6,026,371,918	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成28年6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		3,588,058,321	1.8073 1.6762	6,484,913,512 6,014,303,357		99.80
日本	マネーボールファンド(FOF s用)(適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券		84,039	1.0034 1.0034	84,324 84,324		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28年6月30日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.80
合計	99.80

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成28年6月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1口当たりの純資産価額)	東京証券取引所 取引価格
第1計算期間末日 (平成23年6月8日)	1,662,613,235 (分配付) 1,642,613,235 (分配落)	1,039.13 (分配付) 1,026.63 (分配落)	1,056
第2計算期間末日 (平成23年12月8日)	1,920,828,922 (分配付) 1,904,868,922 (分配落)	914.68 (分配付) 907.08 (分配落)	917
第3計算期間末日 (平成24年6月8日)	1,882,024,944 (分配付) 1,859,424,944 (分配落)	941.01 (分配付) 929.71 (分配落)	928
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
第11計算期間末日 (平成28年 6月 8日)	6,389,605,595 (分配付) 6,323,455,595 (分配落)	1,825.60 (分配付) 1,806.70 (分配落)	1,809
平成27年 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
平成28年 1月末日	6,426,742,682	1,836.21	1,854
2月末日	6,159,088,965	1,759.74	1,761
3月末日	6,513,297,903	1,860.94	1,852
4月末日	6,481,906,452	1,851.97	1,841
5月末日	6,551,039,195	1,871.73	1,875
6月末日	6,026,371,918	1,673.99	1,686

【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
第11計算期間	18円90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
第11計算期間	11.22

(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
第11計算期間	300,000		3,500,000

<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28年6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	6,014,122,966	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		275,576	0.00
純資産総額		6,014,398,542	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年6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(%)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
日本	外国株式インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		3,234,790,752	2.0118 1.8592	6,507,752,035 6,014,122,966		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28年6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28年6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	150,555,958,021	61.19
	イギリス	18,376,202,272	7.47
	カナダ	9,253,004,944	3.76
	スイス	8,836,503,786	3.59
	フランス	8,343,082,171	3.39
	ドイツ	8,202,377,956	3.33
	オーストラリア	6,199,538,206	2.52
	オランダ	3,198,498,136	1.30
	スペイン	2,821,393,342	1.15
	香港	2,816,096,607	1.14
	スウェーデン	2,630,949,054	1.07
	デンマーク	1,885,265,056	0.77
	イタリア	1,660,463,719	0.67
	ベルギー	1,409,033,940	0.57
	シンガポール	1,169,402,551	0.48
	フィンランド	922,838,835	0.38
	ノルウェー	614,793,997	0.25
	イスラエル	573,426,968	0.23
	アイルランド	428,241,624	0.17
	ルクセンブルグ	215,572,332	0.09
ニュージーランド	181,789,650	0.07	
オーストリア	155,200,228	0.06	
ポルトガル	142,387,573	0.06	
投資証券	アメリカ	5,289,272,021	2.15
	オーストラリア	670,784,791	0.27
	フランス	381,040,380	0.15
	イギリス	262,046,945	0.11
	香港	128,410,171	0.05
	シンガポール	112,098,474	0.05
	カナダ	64,411,596	0.03
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		8,537,034,138	3.48
純資産総額		246,037,119,484	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成28年6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)	12,070,369,050	4.91

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年6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	442,856	9,545.93 9,714.70	4,227,473,084 4,302,214,954		1.75
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	331,737	9,143.55 9,515.05	3,033,255,007 3,156,496,994		1.28
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	600,104	5,254.58 5,201.07	3,153,297,236 3,121,183,751		1.27

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	220,345	11,771.87 12,280.25	2,593,873,774 2,705,891,752	1.10
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	31,963	73,409.81 73,642.39	2,346,398,057 2,353,831,903	0.96
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	745,220	3,119.20 3,143.90	2,324,491,788 2,342,897,530	0.95
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・サービス	183,259	12,280.25 11,748.20	2,250,466,389 2,152,964,410	0.88
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	491,192	4,036.13 4,377.79	1,982,514,865 2,150,336,113	0.87
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	254,625	7,642.79 7,853.98	1,946,045,862 1,999,820,294	0.81
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	215,936	8,453.02 8,635.17	1,825,312,924 1,864,645,818	0.76
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	385,149	5,045.67 4,833.68	1,943,337,566 1,861,688,058	0.76
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	293,064	6,371.15 6,298.09	1,867,157,077 1,845,744,033	0.75
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	325,450	5,266.93 5,666.22	1,714,123,605 1,844,072,796	0.75
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	492,988	3,419.69 3,602.87	1,685,870,718 1,776,176,161	0.72
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	24,842	73,584.76 70,401.76	1,827,992,766 1,748,920,524	0.71
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	23,363	75,142.82 71,542.00	1,755,561,792 1,671,435,813	0.68
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	150,441	10,407.28 10,642.95	1,565,682,859 1,601,136,371	0.65
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	181,748	7,726.84 8,379.33	1,404,339,133 1,522,926,923	0.62
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	328,437	4,673.14 4,573.32	1,534,833,100 1,502,047,632	0.61
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	56,120	25,692.76 26,708.79	1,441,878,089 1,498,897,519	0.61
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	95,058	14,697.60 14,625.56	1,397,125,050 1,390,277,357	0.57
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	101,240	13,791.99 13,107.64	1,396,301,897 1,327,018,151	0.54
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	221,631	5,602.42 5,871.01	1,241,670,035 1,301,199,036	0.53
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	194,312	6,391.74 6,580.06	1,241,991,802 1,278,585,668	0.52
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	123,764	10,464.91 10,148.98	1,295,180,098 1,256,078,880	0.51
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	377,223	3,102.73 3,285.91	1,170,423,570 1,239,523,204	0.50
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	123,786	10,499.90 9,980.21	1,299,741,525 1,235,410,497	0.50
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	115,441	10,854.94 10,612.07	1,253,105,913 1,225,069,034	0.50
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・サービス	153,219	7,959.05 7,897.31	1,219,479,122 1,210,018,461	0.49
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	401,959	2,759.01 2,908.23	1,109,011,754 1,168,991,875	0.48

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年6月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	7.31
	素材	4.52
	資本財	6.94
	商業・専門サービス	0.90
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	1.39
	耐久消費財・アパレル	1.67
	消費者サービス	1.78
	メディア	2.73
	小売	3.85
	食品・生活必需品小売り	2.13
	食品・飲料・タバコ	6.56
	家庭用品・パーソナル用品	2.32
	ヘルスケア機器・サービス	3.86
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.41
	銀行	7.71
	各種金融	3.55
	保険	3.83
	不動産	0.64
	ソフトウェア・サービス	8.40
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.38
電気通信サービス	3.32	
公益事業	3.65	
半導体・半導体製造装置	2.10	
小計	93.72	
投資証券		2.81
合計		96.53

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成28年6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9月限)	シカゴ商業取引所	買建	764	アメリカドル	78,987,542.64	78,949,850.00	8,124,729,063	3.30
FTSE100 (2016年9月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	106	イギリスポンド	6,601,790.00	6,659,450.00	921,734,474	0.37
SP/TSE60 (2016年9月限)	モントリオール取引所	買建	36	カナダドル	5,838,355.00	5,850,000.00	465,484,500	0.19
SPI 200 (2016年9月限)	シドニー先物取引所	買建	40	オーストラリアドル	5,191,085.00	5,093,000.00	390,836,820	0.16
EURO ST (2016年9月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	538	ユーロ	15,418,519.50	15,166,220.00	1,734,863,905	0.71
SWISS IX (2016年9月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	52	スイスフラン	4,101,705.00	4,118,400.00	432,720,288	0.18

(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28年6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	10,081,150	99.75
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		25,251	0.25
純資産総額		10,106,401	100.00

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年6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	

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年6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28年6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	183,793,500	3.03
特殊債券	日本	300,168,000	4.95
社債券	日本	1,283,594,750	21.16
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		4,299,376,719	70.86
純資産総額		6,066,932,969	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成28年6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	い第735号商工債券	特殊債券		300,000	100.10 100.0560	300,312,000 300,168,000	0.400000 2016/08/26	4.95
日本	第459回東北電力	社債券		200,000	100.59 100.5850	201,192,000 201,170,000	0.869000 2017/02/24	3.32
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	100.32 100.3060	200,640,000 200,612,000	0.610000 2016/12/02	3.31
日本	第355回中国電力	社債券		200,000	100.38 100.2340	200,774,000 200,468,000	1.520000 2016/08/25	3.30
日本	第282回四国電力	社債券		200,000	100.16 100.2140	200,320,000 200,428,000	0.350000 2016/12/22	3.30
日本	第300回北陸電力	社債券		177,900	100.26 100.2500	178,362,540 178,344,750	0.500000 2016/11/30	2.94
日本	第113回オリックス	社債券		100,000	101.90 101.7340	101,906,000 101,734,000	2.190000 2017/04/18	1.68
日本	第156回オリックス	社債券		100,000	100.70 100.6770	100,705,000 100,677,000	1.140000 2017/01/27	1.66
日本	第3回興銀リース	社債券		100,000	100.13 100.1610	100,135,000 100,161,000	0.267000 2016/12/02	1.65
日本	第342回利付国債(2年)	国債証券		100,000	100.03 100.0100	100,037,000 100,010,000	0.100000 2016/07/15	1.65
日本	第343回利付国債(2年)	国債証券		83,750	100.06 100.0400	83,801,087 83,783,500	0.100000 2016/08/15	1.38

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年6月30日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
国債証券	3.03
特殊債券	4.95
社債券	21.16
合計	29.13

(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。

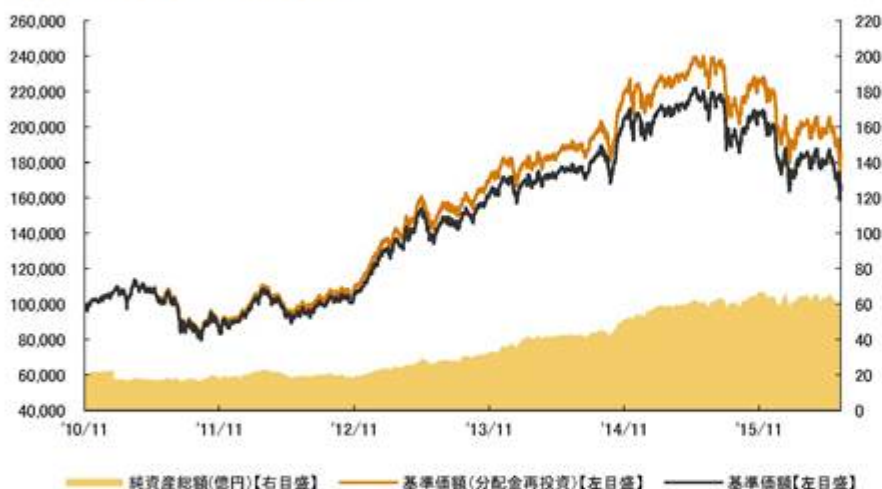
[参考情報]



運用実績

2016年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2010年11月22日(設定日)～2016年6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、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	167,399円
純資産総額	60.2億円

■分配の推移

2016年6月	1,890円
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
設定来累計	15,350円

・分配金は100口当たり、税引前

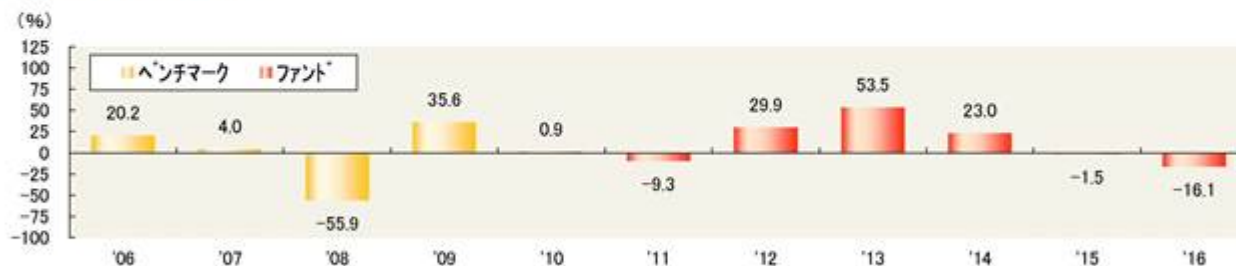
■主要な資産の状況

通貨別構成	比率	組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
アメリカドル	66.6%	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	1.7%
ユーロ	11.9%	2 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.3%
イギリスポンド	7.9%	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.3%
カナダドル	4.0%	4 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	1.1%
スイスフラン	3.8%	5 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.0%
オーストラリアドル	2.9%	6 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	1.0%
香港ドル	1.3%	7 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
スウェーデンクローネ	1.1%	8 AT&T INC	電気通信サービス	アメリカ	0.9%
その他	0.5%	9 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.8%
合計	100.0%	10 PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	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)	4.9%

- ・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)
- ・外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&P(Standard & Poor's)が開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2010年は設定日から年末までの、2016年は年初から6月30日までの収益率を表示
- ・2009年以前は対象指数を円換算した値(ベンチマーク)の年間収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	<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12月9日から平成28年6月8日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 10 期 [平成27年12月8日現在]	第 11 期 [平成28年6月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,659,160	17,831,788
投資信託受益証券	6,616,060,068	6,378,599,749
未収利息	31	-
流動資産合計	6,635,719,259	6,396,431,537
資産合計	6,635,719,259	6,396,431,537
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	48,640,000	66,150,000
未払受託者報酬	1,331,878	1,357,111
未払委託者報酬	3,662,593	3,731,989
未払利息	-	28
その他未払費用	1,709,919	1,736,814
流動負債合計	55,344,390	72,975,942
負債合計	55,344,390	72,975,942
純資産の部		
元本等		
元本	1,320,000,000	1,350,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,380,374,869	2,823,455,595
（分配準備積立金）	94,588	284,175
元本等合計	6,580,374,869	6,323,455,595
純資産合計	6,580,374,869	6,323,455,595
負債純資産合計	6,635,719,259	6,396,431,537

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 10 期 自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8日	第 11 期 自 平成27年12月 9日 至 平成28年 6月 8日
営業収益		
受取配当金	55,756,088	73,558,190
受取利息	7,463	3,208
有価証券売買等損益	334,751,056	789,601,861
営業収益合計	278,987,505	716,040,463
営業費用		
支払利息	-	2,001
受託者報酬	1,331,878	1,357,111
委託者報酬	3,662,593	3,731,989
その他費用	₁ 2,050,738	₁ 2,130,710
営業費用合計	7,045,209	7,221,811
営業利益又は営業損失()	286,032,714	723,262,274
経常利益又は経常損失()	286,032,714	723,262,274
当期純利益又は当期純損失()	286,032,714	723,262,274
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()	3,316,194,583	3,380,374,869
剰余金増加額又は欠損金減少額	398,853,000	232,493,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	398,853,000	232,493,000
分配金	₂ 48,640,000	₂ 66,150,000
期末剰余金又は期末欠損金()	3,380,374,869	2,823,455,595

(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 10 期 [平成27年12月8日現在]	第 11 期 [平成28年6月8日現在]
1 期首元本額	2,800,000,000円	3,200,000,000円
期中追加設定元本額	400,000,000円	300,000,000円
期中一部解約元本額		
2 受益権の総数	3,200,000口	3,500,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	2,056.37円 (205,637円)	1,806.70円 (180,670円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第 11 期 (自 平成27年12月9日 至 平成28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	73,559,397円
分配準備積立金額	B	94,588円
配当等収益合計額	C=A+B	73,653,985円
経費	D	7,219,810円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	66,434,175円
収益分配金金額	F	66,150,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	284,175円
当ファンドの期末残存口数	H	3,500,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,890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 10 期 (自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8日)	第 11 期 (自 平成27年12月 9日 至 平成28年 6月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	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 10 期 [平成27年12月8日現在]	第 11 期 [平成28年6月8日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	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 10 期 [平成27年12月8日現在]	第 11 期 [平成28年6月8日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	334,697,559	789,206,193
合計	334,697,559	789,206,193

(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)	3,525,794,829	6,378,515,425	
	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	3,525,878,868	6,378,599,749	
	合計	3,525,878,868	6,378,599,749	

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 10 期	第 11 期
	[平成27年11月25日現在]	[平成28年5月25日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,524,253	3,589,035
親投資信託受益証券	6,543,870,676	6,330,370,243
未収入金	56,024,639	73,786,589
未収利息	5	
流動資産合計	6,603,419,573	6,407,745,867
資産合計	6,603,419,573	6,407,745,867
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	55,756,087	73,558,189
未払受託者報酬	963,777	978,608
未払委託者報酬	2,359,526	2,395,829
未払利息		5
その他未払費用		3
流動負債合計	59,079,390	76,932,634
負債合計	59,079,390	76,932,634
純資産の部		
元本等		
元本	3,186,062,153	3,486,170,122
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	3,358,278,030	2,844,643,111
(分配準備積立金)	(2,502,980,551)	(2,490,346,378)
元本等合計	6,544,340,183	6,330,813,233
純資産合計	6,544,340,183	6,330,813,233
負債純資産合計	6,603,419,573	6,407,745,867

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 10 期	第 11 期
	自 平成27年 5月26日 至 平成27年11月25日	自 平成27年11月26日 至 平成28年 5月25日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	523	108
有価証券売買等損益	242,806,516	671,102,843
営業収益合計	242,805,993	671,102,735
営業費用		
支払利息		229
受託者報酬	963,777	978,608
委託者報酬	2,359,526	2,395,829
その他費用		3
営業費用合計	3,323,303	3,374,669
営業利益又は営業損失 ()	246,129,296	674,477,404
経常利益又は経常損失 ()	246,129,296	674,477,404
当期純利益又は当期純損失 ()	246,129,296	674,477,404
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 ()	448,109	214,264
期首剰余金又は期首欠損金 ()	3,262,615,848	3,358,278,030
剰余金増加額又は欠損金減少額	427,747,934	260,657,983
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	427,747,934	260,657,983
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,752,260	26,471,573
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	29,752,260	26,471,573
分配金	55,756,087	73,558,189
期末剰余金又は期末欠損金 ()	3,358,278,030	2,844,643,111

(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 10 期 [平成27年11月25日現在]	第 11 期 [平成28年5月25日現在]
1 期首元本額	2,788,528,429円	3,186,062,153円
期中追加設定元本額	423,008,519円	325,305,737円
期中一部解約元本額	25,474,795円	25,197,768円
2 受益権の総数	3,186,062,153口	3,486,170,122口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0541円 (20,541円)	1.8160円 (18,160円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第 11 期 (自 平成27年11月26日 至 平成28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	80,387,876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	1,674,378,184円
分配準備積立金額	D	2,483,516,691円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,238,282,751円
当ファンドの期末残存口数	F	3,486,170,122口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,157円
1万口当たり分配金額	H	211円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	73,558,189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 10 期 (自 平成27年 5月26日 至 平成27年11月25日)	第 11 期 (自 平成27年11月26日 至 平成28年 5月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券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	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。	同 左
	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 10 期 [平成27年11月25日現在]	第 11 期 [平成28年5月25日現在]
	1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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	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 10 期 [平成27年11月25日現在]	第 11 期 [平成28年5月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	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	240,491,084	660,696,166
合計	240,491,084	660,696,166

(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	3,143,182,842	6,330,370,243	
	親投資信託受益証券 小計	3,143,182,842	6,330,370,243	
合計		3,143,182,842	6,330,370,243	

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11月25日現在]	[平成28年5月25日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,010,183,385	1,409,344,529
コール・ローン	272,017,187	434,387,966
株式	231,504,345,647	266,371,281,203
投資証券	5,909,500,387	7,449,372,575
派生商品評価勘定	81,064,321	37,485,132
未収入金	1,068,925	57,702,927
未収配当金	447,919,421	656,549,224
未収利息	438	
差入委託証拠金	1,190,445,176	1,248,887,137
流動資産合計	242,416,544,887	277,665,010,693
資産合計	242,416,544,887	277,665,010,693
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,660,000	963,601
未払金	89,396,774	
未払解約金	357,411,058	310,607,881
未払利息		681
その他未払費用		5,842
流動負債合計	463,467,832	311,578,005
負債合計	463,467,832	311,578,005
純資産の部		
元本等		
元本	107,519,329,500	137,712,485,649
剰余金		
剰余金又は欠損金()	134,433,747,555	139,640,947,039
元本等合計	241,953,077,055	277,353,432,688
純資産合計	241,953,077,055	277,353,432,688
負債純資産合計	242,416,544,887	277,665,010,693

(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11月25日現在]	[平成28年5月25日現在]
1 期首		
期首元本額	平成27年5月26日 97,898,018,926円	平成27年11月26日 107,519,329,500円
期首からの追加設定元本額	37,145,373,136円	71,658,660,406円
期首からの一部解約元本額	27,524,062,562円	41,465,504,257円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	501,884,814円	3,010,924,946円
e M A X I S 先進国株式インデックス	14,696,826,498円	16,423,105,896円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	917,051,981円	1,125,920,751円
e M A X I S バランス（波乗り型）	86,259,980円	120,737,093円
コアバランス	389,145円	218,454円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定 拠出年金）		59,233円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定 拠出年金）		85,784円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定 拠出年金）		102,423円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,185,650,842円	5,899,276,173円
e M A X I S 全世界株式インデックス	2,271,319,407円	2,412,532,276円

三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	441,364,700円	278,923,185円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)		1,895,272,306円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)		85,399,388円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	1,324,095円	4,610,236円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)		343,505,231円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	1,413,717円	16,422,911円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)		533,152円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)		3,569,579円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)		2,222,402円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)		5,217,282円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)		2,074,997円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,271,624,466円	16,036,871,961円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,286,926,157円	16,655,680,752円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	326,615,420円	347,095,316円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,812,136,875円	2,899,283,648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)	23,504,127,251円	47,457,587,588円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	279,654,659円	269,185,855円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	118,565,748円	119,785,936円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,909,155,622円	2,045,514,293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)	2,907,999,234円	3,143,182,842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)	61,269,221円	52,878,764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)	9,031,733,985円	6,862,769,411円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	55,163,309円	103,060,446円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	364,293,063円	595,973,398円
MUKAM バランス・イノベーション(株式抑制型)(適格機関投資家転売制限付)		30,258,001円
MUKAM バランス・イノベーション(リスク抑制型)(適格機関投資家転売制限付)		8,684円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,964,430,441円	1,915,611,799円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	8,734,258円	7,106,232円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	27,514,040円	22,261,680円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	60,187,511円	48,687,018円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	53,922,570円	43,377,502円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	267,920,747円	164,385,981円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	36,327,650円	35,803,772円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	332,818,345円	292,754,554円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	78,291,301円	65,216,092円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	592,994,991円	521,057,792円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	3,996,564,200円	4,107,164,698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)	169,234,732円	195,912,633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)	703,641,480円	766,699,184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)	647,443,324円	694,783,126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)	546,553,721円	581,812,993円
(合計)	107,519,329,500円	137,712,485,649円
2 受益権の総数	107,519,329,500口	137,712,485,649口

3	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2503円 (22,503円)	2.0140円 (20,140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27年5月26日 至平成27年11月25日）	（自平成27年11月26日 至平成28年5月25日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成27年11月25日現在]	[平成28年5月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成27年11月25日現在]	[平成28年5月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,611,759,860	2,263,913,776
投資証券	64,458,164	87,188,093
合計	5,547,301,696	2,176,725,683

（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	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

区分	種類	[平成28年5月25日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,409,004,814	3,445,266,745	36,261,931
	合計	3,409,004,814	3,445,266,745	36,261,931

（注）時価の算定方法

- 先物取引については、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

区 分	種 類	[平成28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 買建				
	アメリカドル	87,860,400		88,120,000	259,600
	合 計	87,860,400		88,120,000	259,600

(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	52,315	168.630000	8,821,878.45	
	ABBOTT LABORATORIES	126,690	37.980000	4,811,686.20	
	ABBVIE INC	138,858	60.700000	8,428,680.60	
	ACCENTURE PLC-CL A	53,050	119.120000	6,319,316.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	43,362	39.020000	1,691,985.24	
	ACUITY BRANDS INC	3,705	256.180000	949,146.90	
	ADOBE SYSTEMS INC	42,345	99.630000	4,218,832.35	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	6,200	149.340000	925,908.00	
	AERCAP HOLDINGS NV	7,600	38.350000	291,460.00	
	AES CORP	58,211	10.910000	635,082.01	
	AETNA INC	29,607	111.630000	3,305,029.41	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,579	170.660000	781,452.14	
	AFLAC INC	36,211	69.550000	2,518,475.05	
	AGCO CORP	5,836	51.160000	298,569.76	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,051	45.030000	1,263,136.53	
	AGL RESOURCES INC	10,472	65.600000	686,963.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,362	143.300000	2,487,974.60	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,077	52.700000	794,557.90	
	ALBEMARLE CORP	9,561	76.340000	729,886.74	
	ALCOA INC	110,927	9.420000	1,044,932.34	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,113	146.670000	2,803,303.71	
	ALKERMES PLC	12,863	43.420000	558,511.46	
	ALLEGHANY CORP	1,322	535.450000	707,864.90	

ALLERGAN PLC	33,493	228.890000	7,666,212.77	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,194	209.680000	1,089,077.92	
ALLIANT ENERGY CORP	19,286	36.390000	701,817.54	
ALLSTATE CORP	32,888	67.440000	2,217,966.72	
ALLY FINANCIAL INC	37,001	17.090000	632,347.09	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,584	57.810000	380,621.04	
ALPHABET INC-CL A	24,750	733.030000	18,142,492.50	
ALPHABET INC-CL C	26,421	720.090000	19,025,497.89	
ALTRIA GROUP INC	166,676	63.790000	10,632,262.04	
AMAZON.COM INC	33,853	704.200000	23,839,282.60	
AMERCO	667	376.320000	251,005.44	
AMEREN CORPORATION	20,958	47.240000	990,055.92	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	13,807	32.150000	443,895.05	
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,044	63.630000	2,675,259.72	
AMERICAN EXPRESS CO	71,082	64.870000	4,611,089.34	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	105,079	57.700000	6,063,058.30	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,505	73.980000	1,147,059.90	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,733	99.770000	1,469,911.41	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,597	74.340000	1,233,820.98	
AMETEK INC	20,108	47.730000	959,754.84	
AMGEN INC	64,054	152.720000	9,782,326.88	
AMPHENOL CORP-CL A	26,160	57.620000	1,507,339.20	
ANADARKO PETROLEUM CORP	43,120	50.240000	2,166,348.80	
ANALOG DEVICES INC	26,457	58.220000	1,540,326.54	
ANSYS INC	7,574	88.630000	671,283.62	
ANTERO RESOURCES CORP	7,343	27.260000	200,170.18	
ANTHEM INC	22,170	128.480000	2,848,401.60	
AON PLC	23,292	106.930000	2,490,613.56	
APACHE CORP	32,053	58.250000	1,867,087.25	
APPLE INC	473,717	97.900000	46,376,894.30	
APPLIED MATERIALS INC	101,850	23.490000	2,392,456.50	
ARAMARK	19,395	32.840000	636,931.80	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,395	71.810000	746,464.95	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	50,609	42.050000	2,128,108.45	
ARROW ELECTRONICS INC	8,038	63.230000	508,242.74	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,029	48.130000	723,345.77	
ASHLAND INC	5,425	113.460000	615,520.50	
ASSURANT INC	5,652	88.670000	501,162.84	
AT&T INC	522,734	38.500000	20,125,259.00	
ATMOS ENERGY CORP	8,900	72.420000	644,538.00	
AUTODESK INC	19,169	58.460000	1,120,619.74	
AUTOLIV INC	7,461	123.530000	921,657.33	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	39,142	87.460000	3,423,359.32	
AUTONATION INC	6,220	47.990000	298,497.80	
AUTOZONE INC	2,590	760.420000	1,969,487.80	
AVERY DENNISON CORP	7,765	74.500000	578,492.50	
AVNET INC	11,355	40.010000	454,313.55	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,926	28.110000	335,239.86	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,206	54.840000	450,017.04	
B/E AEROSPACE INC	9,073	46.890000	425,432.97	
BAKER HUGHES INC	36,927	43.960000	1,623,310.92	
BALL CORP	11,115	71.760000	797,612.40	
BANK OF AMERICA CORP	884,678	14.680000	12,987,073.04	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	92,746	41.680000	3,865,653.28	
BAXALTA INC	58,804	45.000000	2,646,180.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,211	43.660000	2,061,232.26	
BB&T CORP	68,884	35.540000	2,448,137.36	
BECTON DICKINSON AND CO	17,910	166.070000	2,974,313.70	
BED BATH & BEYOND INC	14,148	43.070000	609,354.36	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100,772	143.710000	14,481,944.12	
BEST BUY CO INC	26,227	30.550000	801,234.85	
BIOGEN INC	18,925	272.940000	5,165,389.50	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,654	87.950000	1,200,869.30	
BLACKROCK INC	10,431	361.180000	3,767,468.58	
BOEING CO/THE	54,068	127.500000	6,893,670.00	
BORGWARNER INC	19,062	33.130000	631,524.06	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114,210	22.530000	2,573,151.30	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	141,748	71.230000	10,096,710.04
BROADCOM LTD	32,986	151.420000	4,994,740.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,808	96.090000	942,450.72
BUNGE LTD	12,069	64.450000	777,847.05
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,206	74.690000	911,666.14
CA INC	27,766	31.460000	873,518.36
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	17,173	34.610000	594,357.53
CABOT OIL & GAS CORP	38,799	23.300000	904,016.70
CALPINE CORP	29,671	14.950000	443,581.45
CAMPBELL SOUP CO	15,753	60.910000	959,515.23
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,166	71.620000	3,234,788.92
CARDINAL HEALTH INC	27,905	77.460000	2,161,521.30
CARMAX INC	17,181	52.890000	908,703.09
CARNIVAL CORP	34,959	50.830000	1,776,965.97
CATERPILLAR INC	49,436	71.090000	3,514,405.24
CBRE GROUP INC - A	25,523	29.180000	744,761.14
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	36,787	53.370000	1,963,322.19
CDK GLOBAL INC	11,638	54.460000	633,805.48
CDW CORP/DE	12,374	41.860000	517,975.64
CELANESE CORP-SERIES A	12,400	70.540000	874,696.00
CELGENE CORP	66,717	103.700000	6,918,552.90
CENTENE CORP	14,381	58.760000	845,027.56
CENTERPOINT ENERGY INC	35,392	22.030000	779,685.76
CENTURYLINK INC	46,529	27.200000	1,265,588.80
CERNER CORP	26,115	55.040000	1,437,369.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,840	27.610000	547,782.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18,251	228.380000	4,168,163.38
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,700	86.060000	490,542.00
CHENIERE ENERGY INC	19,119	32.890000	628,823.91
CHEVRON CORP	159,930	100.190000	16,023,386.70
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	8,064	36.130000	291,352.32
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,644	457.330000	1,209,180.52
CHUBB LTD	39,159	127.060000	4,975,542.54
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,065	97.890000	1,083,152.85
CIGNA CORP	21,872	124.810000	2,729,844.32
CIMAREX ENERGY CO	8,017	117.520000	942,157.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,166	68.910000	907,269.06
CINTAS CORP	7,788	94.090000	732,772.92
CISCO SYSTEMS INC	431,276	28.470000	12,278,427.72
CIT GROUP INC	14,630	33.290000	487,032.70
CITIGROUP INC	253,090	45.860000	11,606,707.40
CITIZENS FINANCIAL GROUP	44,624	23.250000	1,037,508.00
CITRIX SYSTEMS INC	13,006	85.890000	1,117,085.34
CLOROX COMPANY	10,961	130.070000	1,425,697.27
CME GROUP INC	27,234	97.950000	2,667,570.30
CMS ENERGY CORP	24,095	41.210000	992,954.95
COACH INC	23,486	39.480000	927,227.28
COCA-COLA CO/THE	351,116	44.370000	15,579,016.92
COCA-COLA ENTERPRISES	18,292	50.990000	932,709.08
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,601	62.910000	3,246,218.91
COLGATE-PALMOLIVE CO	72,432	70.870000	5,133,255.84
COLUMBIA PIPELINE GROUP	33,021	25.520000	842,695.92
COMCAST CORP-CLASS A	210,987	62.440000	13,174,028.28
COMERICA INC	14,979	45.920000	687,835.68
CONAGRA FOODS INC	36,746	44.590000	1,638,504.14
CONCHO RESOURCES INC	10,934	117.680000	1,286,713.12
CONOCOPHILLIPS	104,832	43.460000	4,555,998.72
CONSOLIDATED EDISON INC	25,198	72.140000	1,817,783.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,698	157.700000	2,317,874.60
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,082	40.740000	329,260.68
COOPER COS INC/THE	4,141	163.010000	675,024.41
CORE LABORATORIES N.V.	3,620	119.190000	431,467.80
CORNING INC	100,334	20.090000	2,015,710.06
COSTCO WHOLESALE CORP	37,162	142.570000	5,298,186.34
CR BARD INC	6,265	221.280000	1,386,319.20
CROWN HOLDINGS INC	11,967	52.420000	627,310.14
CSX CORP	82,833	25.460000	2,108,928.18

CUMMINS INC	14,297	109.710000	1,568,523.87	
CVS HEALTH CORP	94,100	97.380000	9,163,458.00	
DANAHER CORP	52,394	99.970000	5,237,828.18	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,778	65.800000	643,392.40	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	14,338	77.350000	1,109,044.30	
DEERE & CO	26,495	79.640000	2,110,061.80	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,755	68.060000	1,616,765.30	
DELTA AIR LINES INC	17,020	43.630000	742,582.60	
DENTSPLY SIRONA INC	20,442	61.730000	1,261,884.66	
DEVON ENERGY CORP	38,943	34.490000	1,343,144.07	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,807	42.610000	332,656.27	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	36,291	55.730000	2,022,497.43	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,290	26.530000	326,053.70	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	23,644	25.380000	600,084.72	
DISH NETWORK CORP-A	19,094	46.710000	891,880.74	
DOLLAR GENERAL CORP	24,992	83.420000	2,084,832.64	
DOLLAR TREE INC	18,919	77.530000	1,466,790.07	
DOMINION RESOURCES INC/VA	50,938	70.780000	3,605,391.64	
DOVER CORP	13,099	65.750000	861,259.25	
DOW CHEMICAL CO/THE	95,481	52.820000	5,043,306.42	
DR HORTON INC	28,631	30.480000	872,672.88	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,011	92.690000	1,484,059.59	
DTE ENERGY COMPANY	15,473	89.220000	1,380,501.06	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	74,441	67.920000	5,056,032.72	
DUKE ENERGY CORP	58,801	76.990000	4,527,088.99	
DUN & BRADSTREET CORP	3,120	122.960000	383,635.20	
E*TRADE FINANCIAL CORP	24,920	27.360000	681,811.20	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,565	73.290000	920,888.85	
EATON CORP PLC	39,249	60.400000	2,370,639.60	
EATON VANCE CORP	9,571	36.080000	345,321.68	
EBAY INC	91,700	24.050000	2,205,385.00	
ECOLAB INC	22,552	118.560000	2,673,765.12	
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	5,194	79.220000	411,468.68	
EDISON INTERNATIONAL	27,958	69.910000	1,954,543.78	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,303	101.490000	1,857,571.47	
ELECTRONIC ARTS INC	26,357	75.350000	1,985,999.95	
ELI LILLY & CO	84,733	74.990000	6,354,127.67	
EMC CORP/MA	164,699	27.870000	4,590,161.13	
EMERSON ELECTRIC CO	55,528	51.170000	2,841,367.76	
ENDO INTERNATIONAL PLC	18,457	15.440000	284,976.08	
ENTERGY CORP	15,398	74.080000	1,140,683.84	
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	15,879	24.140000	383,319.06	
EOG RESOURCES INC	46,652	82.490000	3,848,323.48	
EQT CORP	14,492	70.240000	1,017,918.08	
EQUIFAX INC	10,014	125.160000	1,253,352.24	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,864	92.140000	1,738,128.96	
EVEREST RE GROUP LTD	3,629	179.600000	651,768.40	
EVERSOURCE ENERGY	27,301	54.670000	1,492,545.67	
EXELON CORP	78,450	33.990000	2,666,515.50	
EXPEDIA INC	10,450	113.170000	1,182,626.50	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,825	49.180000	778,273.50	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	57,440	74.350000	4,270,664.00	
EXXON MOBIL CORP	353,780	89.670000	31,723,452.60	
F5 NETWORKS INC	6,008	108.640000	652,709.12	
FACEBOOK INC-A	192,891	117.700000	22,703,270.70	
FASTENAL CO	23,259	45.700000	1,062,936.30	
FEDEX CORP	22,795	164.380000	3,747,042.10	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23,956	73.910000	1,770,587.96	
FIFTH THIRD BANCORP	67,258	18.370000	1,235,529.46	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,362	71.270000	881,039.74	
FIRSTENERGY CORP	36,276	32.090000	1,164,096.84	
FISERV INC	19,387	104.370000	2,023,421.19	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,631	148.880000	987,223.28	
FLEXTRONICS INTL LTD	47,654	12.480000	594,721.92	
FLIR SYSTEMS INC	12,038	30.630000	368,723.94	
FLOWSERVE CORP	11,219	46.800000	525,049.20	
FLUOR CORP	12,039	51.030000	614,350.17	

FMC CORP	11,500	47.330000	544,295.00
FMC TECHNOLOGIES INC	19,495	26.960000	525,585.20
FNF GROUP	21,271	34.410000	731,935.11
FOOT LOCKER INC	11,784	54.110000	637,632.24
FORD MOTOR CO	314,651	13.290000	4,181,711.79
FORTINET INC	12,710	34.170000	434,300.70
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	13,545	58.800000	796,446.00
FRANKLIN RESOURCES INC	33,008	36.570000	1,207,102.56
FREEPORT-MCMORAN INC	98,082	11.110000	1,089,691.02
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	100,252	5.090000	510,282.68
GAMESTOP CORP-CLASS A	9,039	28.700000	259,419.30
GAP INC/THE	20,771	18.090000	375,747.39
GARMIN LTD	9,846	41.130000	404,965.98
GARTNER INC	7,146	101.240000	723,461.04
GENERAL DYNAMICS CORP	22,804	142.960000	3,260,059.84
GENERAL ELECTRIC CO	801,977	29.850000	23,939,013.45
GENERAL MILLS INC	50,774	62.400000	3,168,297.60
GENERAL MOTORS CO	120,074	31.050000	3,728,297.70
GENUINE PARTS CO	12,736	95.310000	1,213,868.16
GILEAD SCIENCES INC	122,392	86.220000	10,552,638.24
GLOBAL PAYMENTS INC	13,113	77.220000	1,012,585.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,622	157.590000	5,140,900.98
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22,863	27.890000	637,649.07
H&R BLOCK INC	20,297	20.380000	413,652.86
HALLIBURTON CO	72,566	41.420000	3,005,683.72
HANESBRANDS INC	33,231	26.790000	890,258.49
HARLEY-DAVIDSON INC	16,286	44.540000	725,378.44
HARMAN INTERNATIONAL	6,124	76.250000	466,955.00
HARRIS CORP	10,561	78.980000	834,107.78
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,695	45.470000	1,577,581.65
HASBRO INC	9,493	86.720000	823,232.96
HCA HOLDINGS INC	27,732	77.560000	2,150,893.92
HELMERICH & PAYNE	9,220	58.530000	539,646.60
HENRY SCHEIN INC	7,012	172.740000	1,211,252.88
HERSHEY CO/THE	12,597	91.340000	1,150,609.98
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	32,179	8.530000	274,486.87
HESS CORP	23,714	58.200000	1,380,154.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	153,125	16.250000	2,488,281.25
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	41,777	20.840000	870,632.68
HOLLYFRONTIER CORP	14,917	27.860000	415,587.62
HOLOGIC INC	20,436	33.450000	683,584.20
HOME DEPOT INC	107,738	133.360000	14,367,939.68
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62,181	114.370000	7,111,640.97
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	51,000	6.090000	310,590.00
HORMEL FOODS CORP	24,583	34.800000	855,488.40
HP INC	152,568	11.910000	1,817,084.88
HUMANA INC	12,584	170.780000	2,149,095.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,839	80.740000	632,920.86
HUNTINGTON BANCSHARES INC	67,651	10.380000	702,217.38
IHS INC-CLASS A	5,803	121.800000	706,805.40
ILLINOIS TOOL WORKS	27,769	104.910000	2,913,245.79
ILLUMINA INC	12,426	143.480000	1,782,882.48
IMS HEALTH HOLDINGS INC	14,362	25.640000	368,241.68
INCYTE CORP	14,193	81.270000	1,153,465.11
INGERSOLL-RAND PLC	22,106	65.550000	1,449,048.30
INTEL CORP	400,957	31.060000	12,453,724.42
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	10,073	270.690000	2,726,660.37
INTERNATIONAL PAPER CO	33,385	41.420000	1,382,806.70
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	34,379	23.680000	814,094.72
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,310	148.310000	11,614,156.10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,789	128.250000	870,689.25
INTUIT INC	21,266	107.310000	2,282,054.46
INTUITIVE SURGICAL INC	3,170	638.670000	2,024,583.90
INVESCO LTD	35,791	30.730000	1,099,857.43
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,405	33.370000	347,214.85
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,526	49.000000	515,774.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	21,000	53.400000	1,121,400.00

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,215	151.690000	791,063.35
JM SMUCKER CO/THE	9,947	127.930000	1,272,519.71
JOHNSON & JOHNSON	235,102	112.690000	26,493,644.38
JOHNSON CONTROLS INC	54,941	43.880000	2,410,811.08
JONES LANG LASALLE INC	3,883	115.030000	446,661.49
JPMORGAN CHASE & CO	312,804	64.540000	20,188,370.16
JUNIPER NETWORKS INC	29,551	22.900000	676,717.90
KANSAS CITY SOUTHERN	9,263	91.010000	843,025.63
KELLOGG CO	22,586	74.650000	1,686,044.90
KEYCORP	70,650	12.750000	900,787.50
KIMBERLY-CLARK CORP	30,843	126.760000	3,909,658.68
KINDER MORGAN INC	161,184	17.320000	2,791,706.88
KLA-TENCOR CORP	13,251	70.990000	940,688.49
KOHL'S CORP	16,474	35.390000	583,014.86
KRAFT HEINZ CO/THE	51,552	84.220000	4,341,709.44
KROGER CO	78,541	35.520000	2,789,776.32
L BRANDS INC	20,957	64.260000	1,346,696.82
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,632	138.340000	917,470.88
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,576	128.160000	1,099,100.16
LAM RESEARCH CORP	13,401	79.270000	1,062,297.27
LAS VEGAS SANDS CORP	33,734	45.550000	1,536,583.70
LEAR CORP	6,384	116.060000	740,927.04
LEGG MASON INC	8,208	33.110000	271,766.88
LEGGETT & PLATT INC	11,644	49.890000	580,919.16
LENNAR CORP-A	15,230	45.690000	695,858.70
LEUCADIA NATIONAL CORP	28,213	17.780000	501,627.14
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	25,660	53.050000	1,361,263.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	21,395	36.300000	776,638.50
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	50,829	35.370000	1,797,821.73
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	37,615	26.130000	982,879.95
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,321	31.510000	545,784.71
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	7,440	31.840000	236,889.60
LINCOLN NATIONAL CORP	20,913	45.010000	941,294.13
LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,236	46.990000	950,889.64
LINKEDIN CORP - A	9,796	128.580000	1,259,569.68
LKQ CORP	25,846	32.260000	833,791.96
LOCKHEED MARTIN CORP	23,521	240.970000	5,667,855.37
LOEWS CORP	24,072	40.250000	968,898.00
LOWE'S COS INC	77,882	79.600000	6,199,407.20
LULULEMON ATHLETICA INC	9,574	63.160000	604,693.84
LYONDELLBASELL INDU-CL A	32,413	80.450000	2,607,625.85
M & T BANK CORP	12,198	117.800000	1,436,924.40
MACY'S INC	26,647	31.190000	831,119.93
MALLINCKRODT PLC	9,885	60.870000	601,699.95
MANPOWERGROUP INC	6,320	79.450000	502,124.00
MARATHON OIL CORP	69,652	13.020000	906,869.04
MARATHON PETROLEUM CORP	45,256	35.810000	1,620,617.36
MARKEL CORP	1,186	975.660000	1,157,132.76
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	17,408	65.370000	1,137,960.96
MARSH & MCLENNAN COS	44,349	65.530000	2,906,189.97
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	190.620000	907,160.58
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	36,048	10.010000	360,840.48
MASCO CORP	28,528	32.390000	924,021.92
MASTERCARD INC-CLASS A	84,126	96.480000	8,116,476.48
MATTEL INC	28,736	31.370000	901,448.32
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,096	37.480000	903,118.08
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	9,831	96.710000	950,756.01
MCDONALD'S CORP	78,003	123.950000	9,668,471.85
MCKESSON CORP	19,540	182.770000	3,571,325.80
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	16,738	82.460000	1,380,215.48
MEDIVATION INC	14,066	61.910000	870,826.06
MEDNAX INC	8,041	68.250000	548,798.25
MEDTRONIC PLC	120,116	80.940000	9,722,189.04
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	8,000	14.620000	116,960.00
MERCK & CO. INC.	237,361	55.600000	13,197,271.60
METLIFE INC	80,190	45.270000	3,630,201.30
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,318	371.160000	860,348.88

MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,202	22.670000	866,039.34
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	15,596	41.560000	648,169.76
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,100	49.960000	904,276.00
MICRON TECHNOLOGY INC	92,096	11.490000	1,058,183.04
MICROSOFT CORP	644,742	51.590000	33,262,239.78
MOBILEYE NV	7,000	37.670000	263,690.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,318	196.830000	1,046,741.94
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,745	99.170000	1,561,431.65
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	134,979	44.150000	5,959,322.85
MONSANTO CO	37,354	109.300000	4,082,792.20
MONSTER BEVERAGE CORP	12,047	150.110000	1,808,375.17
MOODY'S CORP	15,097	97.800000	1,476,486.60
MORGAN STANLEY	123,322	27.410000	3,380,256.02
MOSAIC CO/THE	26,968	25.960000	700,089.28
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,515	69.680000	941,725.20
MSCI INC	8,300	78.940000	655,202.00
MURPHY OIL CORP	14,003	30.260000	423,730.78
MYLAN NV	35,463	42.440000	1,505,049.72
NASDAQ INC	9,725	65.620000	638,154.50
NATIONAL OILWELL VARCO INC	31,796	31.490000	1,001,256.04
NAVIENT CORP	31,372	12.980000	407,208.56
NETAPP INC	24,967	25.210000	629,418.07
NETFLIX INC	34,480	97.890000	3,375,247.20
NETSUITE INC	3,508	79.110000	277,517.88
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	41,461	15.350000	636,426.35
NEWELL BRANDS INC	37,522	47.890000	1,796,928.58
NEWMONT MINING CORP	44,855	31.740000	1,423,697.70
NEWS CORP - CLASS A	32,909	11.810000	388,655.29
NEXTERA ENERGY INC	39,331	119.890000	4,715,393.59
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,337	53.010000	1,555,154.37
NIKE INC -CL B	115,178	56.590000	6,517,923.02
NOBLE ENERGY INC	36,315	35.330000	1,283,008.95
NORDSTROM INC	11,755	38.010000	446,807.55
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,371	82.230000	2,086,257.33
NORTHERN TRUST CORP	18,563	72.630000	1,348,230.69
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,707	214.680000	3,157,298.76
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	13,666	47.810000	653,371.46
NRG ENERGY INC	27,462	16.020000	439,941.24
NUANCE COMMUNICATIONS INC	21,556	16.540000	356,536.24
NUCOR CORP	27,035	47.160000	1,274,970.60
NVIDIA CORP	45,616	45.360000	2,069,141.76
NXP SEMICONDUCTORS NV	11,500	91.580000	1,053,170.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	64,925	76.120000	4,942,091.00
OCEANEERING INTL INC	8,495	32.090000	272,604.55
OGE ENERGY CORP	17,504	30.450000	532,996.80
OMNICOM GROUP	20,526	82.880000	1,701,194.88
ONEOK INC	17,877	41.700000	745,470.90
ORACLE CORP	271,787	39.900000	10,844,301.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,362	257.500000	2,153,215.00
P G & E CORP	42,039	58.540000	2,460,963.06
PACCAR INC	29,968	54.170000	1,623,366.56
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,303	65.810000	546,420.43
PALO ALTO NETWORKS INC	6,921	146.110000	1,011,227.31
PARKER HANNIFIN CORP	11,504	110.800000	1,274,643.20
PATTERSON COS INC	7,258	45.980000	333,722.84
PAYCHEX INC	27,443	53.080000	1,456,674.44
PAYPAL HOLDINGS INC	93,343	38.920000	3,632,909.56
PENTAIR PLC	15,253	60.080000	916,400.24
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26,462	15.630000	413,601.06
PEPSICO INC	123,833	101.090000	12,518,277.97
PERRIGO CO PLC	12,420	96.260000	1,195,549.20
PFIZER INC	524,540	34.100000	17,886,814.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	131,705	98.840000	13,017,722.20
PHILLIPS 66	45,317	79.700000	3,611,764.90
PINNACLE WEST CAPITAL	9,664	72.070000	696,484.48
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,698	162.970000	2,232,363.06
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	43,135	89.030000	3,840,309.05

POLARIS INDUSTRIES INC	5,341	84.090000	449,124.69
PPG INDUSTRIES INC	22,831	107.760000	2,460,268.56
PPL CORP	57,655	38.060000	2,194,349.30
PRAXAIR INC	24,189	110.770000	2,679,415.53
PRICELINE GROUP INC/THE	4,228	1,256.630000	5,313,031.64
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,753	44.130000	1,092,349.89
PROCTER & GAMBLE CO/THE	231,148	80.970000	18,716,053.56
PROGRESSIVE CORP	49,596	33.490000	1,660,970.04
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,090	78.720000	2,998,444.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,348	45.000000	1,950,660.00
PULTEGROUP INC	26,958	18.730000	504,923.34
PVH CORP	7,024	89.020000	625,276.48
QORVO INC	12,089	50.980000	616,297.22
QUALCOMM INC	127,696	55.590000	7,098,620.64
QUANTA SERVICES INC	13,667	22.650000	309,557.55
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,118	77.620000	940,599.16
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	7,958	66.920000	532,549.36
RALPH LAUREN CORP	5,053	93.390000	471,899.67
RANGE RESOURCES CORP	14,460	41.320000	597,487.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,982	53.560000	588,195.92
RAYTHEON COMPANY	25,561	130.050000	3,324,208.05
REALOGY HOLDINGS CORP	12,717	31.670000	402,747.39
RED HAT INC	15,485	76.410000	1,183,208.85
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,496	397.700000	2,583,459.20
REGIONS FINANCIAL CORP	110,388	9.650000	1,065,244.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,767	115.800000	436,218.60
REPUBLIC SERVICES INC	20,599	48.250000	993,901.75
RESMED INC	11,858	58.130000	689,305.54
REYNOLDS AMERICAN INC	72,906	50.700000	3,696,334.20
RITE AID CORP	88,905	7.630000	678,345.15
ROBERT HALF INTL INC	11,446	40.800000	466,996.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,171	113.670000	1,269,807.57
ROCKWELL COLLINS INC	11,117	88.860000	987,856.62
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,539	173.970000	1,485,529.83
ROSS STORES INC	34,581	53.360000	1,845,242.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,903	79.810000	1,189,408.43
S&P GLOBAL INC	22,956	111.660000	2,563,266.96
SABRE CORP	17,889	28.100000	502,680.90
SALESFORCE.COM INC	53,565	82.750000	4,432,503.75
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	10,722	98.480000	1,055,902.56
SCANA CORP	11,780	68.740000	809,757.20
SCHLUMBERGER LTD	118,180	75.620000	8,936,771.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	100,512	30.220000	3,037,472.64
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,570	63.040000	414,172.80
SEAGATE TECHNOLOGY	25,582	20.880000	534,152.16
SEALED AIR CORP	16,767	46.770000	784,192.59
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,934	51.050000	609,230.70
SEMPRA ENERGY	20,224	104.330000	2,109,969.92
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,629	36.710000	537,030.59
SERVICENOW INC	12,804	70.980000	908,827.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,715	291.920000	1,960,242.80
SIGNATURE BANK	4,331	137.060000	593,606.86
SIGNET JEWELERS LTD	6,412	105.780000	678,261.36
SIRIUS XM HOLDINGS INC	178,957	3.960000	708,669.72
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,192	66.460000	1,076,120.32
SNAP-ON INC	4,914	164.390000	807,812.46
SOUTHERN CO/THE	77,716	48.460000	3,766,117.36
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,134	42.800000	604,935.20
SOUTHWESTERN ENERGY CO	32,866	12.290000	403,923.14
SPECTRA ENERGY CORP	57,092	30.950000	1,766,997.40
SPLUNK INC	11,006	54.340000	598,066.04
SPRINT CORP	69,566	3.510000	244,176.66
ST JUDE MEDICAL INC	23,998	77.010000	1,848,085.98
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,667	114.470000	1,449,991.49
STAPLES INC	53,824	8.480000	456,427.52
STARBUCKS CORP	126,053	55.440000	6,988,378.32
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,542	72.930000	1,060,548.06

STATE STREET CORP	34,195	62.550000	2,138,897.25
STERICYCLE INC	7,230	97.980000	708,395.40
STRYKER CORP	28,736	111.670000	3,208,949.12
SUNTRUST BANKS INC	43,143	43.110000	1,859,894.73
SYMANTEC CORP	57,091	17.070000	974,543.37
SYNCHRONY FINANCIAL	70,783	30.300000	2,144,724.90
SYNOPSYS INC	13,283	51.180000	679,823.94
SYSCO CORP	47,918	48.710000	2,334,085.78
T ROWE PRICE GROUP INC	21,200	76.570000	1,623,284.00
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	4,568	48.890000	223,329.52
TARGET CORP	49,683	68.690000	3,412,725.27
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	600	137.530000	82,518.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,759	31.830000	724,418.97
TE CONNECTIVITY LTD	32,764	59.050000	1,934,714.20
TECO ENERGY INC	20,401	27.540000	561,843.54
TEGNA INC	18,245	22.580000	411,972.10
TERADATA CORP	11,384	26.550000	302,245.20
TESLA MOTORS INC	8,340	217.910000	1,817,369.40
TESORO CORP	10,211	78.580000	802,380.38
TEXAS INSTRUMENTS INC	86,170	60.090000	5,177,955.30
TEXTRON INC	23,165	38.280000	886,756.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,900	150.680000	5,108,052.00
TIFFANY & CO	10,846	63.850000	692,517.10
TIME WARNER INC	67,917	73.130000	4,966,770.21
TJX COMPANIES INC	56,845	75.240000	4,277,017.80
T-MOBILE US INC	24,252	41.870000	1,015,431.24
TOLL BROTHERS INC	14,572	29.460000	429,291.12
TORCHMARK CORP	10,492	60.530000	635,080.76
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,086	54.810000	772,053.66
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,366	94.970000	1,079,429.02
TRANSDIGM GROUP INC	4,564	254.650000	1,162,222.60
TRAVELERS COS INC/THE	25,826	113.440000	2,929,701.44
TRIMBLE NAVIGATION LTD	21,507	24.270000	521,974.89
TRIPADVISOR INC	10,061	66.070000	664,730.27
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	37,531	28.840000	1,082,394.04
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	99,239	28.570000	2,835,258.23
TWITTER INC	49,327	14.030000	692,057.81
TYCO INTERNATIONAL PLC	35,799	42.350000	1,516,087.65
TYSON FOODS INC-CL A	25,069	65.100000	1,631,991.90
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,140	206.590000	1,061,872.60
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,337	38.220000	586,180.14
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,203	35.580000	540,922.74
UNION PACIFIC CORP	72,590	81.290000	5,900,841.10
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	8,283	44.990000	372,652.17
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,264	101.980000	6,043,742.72
UNITED RENTALS INC	7,978	65.750000	524,553.50
UNITED TECHNOLOGIES CORP	71,582	99.910000	7,151,757.62
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,937	116.620000	459,132.94
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,985	132.590000	10,737,801.15
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,725	134.850000	1,041,716.25
UNUM GROUP	20,622	36.140000	745,279.08
US BANCORP	148,605	42.280000	6,283,019.40
VALERO ENERGY CORP	40,886	55.350000	2,263,040.10
VANTIV INC - CL A	13,329	54.530000	726,830.37
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,221	83.370000	685,384.77
VERISIGN INC	8,548	84.560000	722,818.88
VERISK ANALYTICS INC	13,648	78.790000	1,075,325.92
VERIZON COMMUNICATIONS INC	345,816	49.580000	17,145,557.28
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,845	88.420000	1,843,114.90
VF CORP	28,937	62.080000	1,796,408.96
VIACOM INC-CLASS B	29,520	41.300000	1,219,176.00
VISA INC-CLASS A SHARES	165,371	79.380000	13,127,149.98
VMWARE INC-CLASS A	6,824	60.150000	410,463.60
VOYA FINANCIAL INC	18,317	32.750000	599,881.75
VULCAN MATERIALS CO	11,290	119.130000	1,344,977.70
WABCO HOLDINGS INC	4,681	102.670000	480,598.27
WABTEC CORP	8,211	77.840000	639,144.24

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,007	77.150000	5,709,640.05	
WAL-MART STORES INC	136,232	70.240000	9,568,935.68	
WALT DISNEY CO/THE	133,435	99.510000	13,278,116.85	
WASTE CONNECTIONS INC	10,400	69.970000	727,688.00	
WASTE MANAGEMENT INC	37,920	61.040000	2,314,636.80	
WATERS CORP	6,915	137.560000	951,227.40	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	75,280	5.270000	396,725.60	
WEC ENERGY GROUP INC	27,177	58.870000	1,599,909.99	
WELLS FARGO & CO	412,370	49.200000	20,288,604.00	
WESTERN DIGITAL CORP	22,954	42.280000	970,495.12	
WESTERN UNION CO	42,726	19.260000	822,902.76	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,037	43.210000	174,438.77	
WESTROCK CO	22,335	38.690000	864,141.15	
WHIRLPOOL CORP	6,624	174.250000	1,154,232.00	
WHITEWAVE FOODS CO	15,073	44.520000	671,049.96	
WHOLE FOODS MARKET INC	28,928	31.680000	916,439.04	
WILLIAMS COS INC	60,505	22.130000	1,338,975.65	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,085	126.620000	1,403,582.70	
WORKDAY INC-CLASS A	9,537	76.940000	733,776.78	
WR BERKLEY CORP	8,463	56.470000	477,905.61	
WR GRACE & CO	6,100	76.400000	466,040.00	
WW GRAINGER INC	4,785	226.260000	1,082,654.10	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,884	66.720000	659,460.48	
WYNN RESORTS LTD	6,935	93.220000	646,480.70	
XCEL ENERGY INC	43,660	40.560000	1,770,849.60	
XEROX CORP	77,274	9.280000	717,102.72	
XILINX INC	21,775	47.450000	1,033,223.75	
XL GROUP PLC	25,123	34.590000	869,004.57	
XYLEM INC	15,255	44.460000	678,237.30	
YAHOO! INC	76,077	37.530000	2,855,169.81	
YUM! BRANDS INC	36,606	82.130000	3,006,450.78	
ZILLOW GROUP INC - C	8,310	28.530000	237,084.30	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,038	120.760000	1,936,748.88	
ZOETIS INC	40,185	47.290000	1,900,348.65	
アメリカドル 小計	26,717,314		1,567,242,178.88 (172,647,398,425)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,400	58.030000	1,067,752.00	
AGRIUM INC	11,100	116.570000	1,293,927.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	35,600	57.890000	2,060,884.00	
ALTAGAS LTD	12,600	30.600000	385,560.00	
ARC RESOURCES LTD	29,800	20.990000	625,502.00	
ATCO LTD -CLASS I	6,600	42.850000	282,810.00	
BANK OF MONTREAL	54,500	83.230000	4,536,035.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	102,100	63.760000	6,509,896.00	
BARRICK GOLD CORP	98,800	22.240000	2,197,312.00	
BCE INC	12,000	60.850000	730,200.00	
BLACKBERRY LTD	42,400	9.130000	387,112.00	
BOMBARDIER INC-B	159,600	2.020000	322,392.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	75,000	46.170000	3,462,750.00	
CAE INC	23,300	16.000000	372,800.00	
CAMECO CORP	34,400	15.260000	524,944.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,700	102.750000	3,462,675.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	67,600	76.650000	5,181,540.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	92,900	38.120000	3,541,348.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,300	168.340000	2,070,582.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6,100	140.970000	859,917.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10,700	36.200000	387,340.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,400	223.780000	537,072.00	
CENOVUS ENERGY INC	70,800	19.360000	1,370,688.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	18,700	60.050000	1,122,935.00	
CI FINANCIAL CORP	20,300	27.920000	566,776.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,600	509.190000	814,704.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	42,900	21.560000	924,924.00	
DOLLARAMA INC	10,100	90.950000	918,595.00	
ELDORADO GOLD CORP	62,200	5.610000	348,942.00	
ELEMENT FINANCIAL CORP	32,300	15.520000	501,296.00	

EMPIRE CO LTD 'A'	14,400	22.420000	322,848.00	
ENBRIDGE INC	77,900	53.100000	4,136,490.00	
ENCANA CORP	72,200	9.560000	690,232.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,900	674.240000	1,281,056.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	14,500	21.160000	306,820.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	9,700	21.050000	204,185.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,200	8.230000	487,216.00	
FORTIS INC	24,200	40.860000	988,812.00	
FRANCO-NEVADA CORP	14,800	81.270000	1,202,796.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	19,800	38.620000	764,676.00	
GOLDCORP INC	70,400	21.550000	1,517,120.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	25,300	35.290000	892,837.00	
HUSKY ENERGY INC	30,678	14.650000	449,432.70	
IGM FINANCIAL INC	8,600	37.190000	319,834.00	
IMPERIAL OIL LTD	25,200	41.540000	1,046,808.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,700	42.200000	367,140.00	
INTACT FINANCIAL CORP	11,100	91.880000	1,019,868.00	
INTER PIPELINE LTD	28,800	26.630000	766,944.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,000	19.740000	138,180.00	
KEYERA CORP	14,800	38.000000	562,400.00	
KINROSS GOLD CORP	105,000	5.710000	599,550.00	
LINAMAR CORP	4,300	52.060000	223,858.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	19,200	71.030000	1,363,776.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,300	52.300000	1,793,890.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	167,200	19.370000	3,238,664.00	
METHANEX CORP	7,800	40.780000	318,084.00	
METRO INC	20,400	44.290000	903,516.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,000	43.090000	1,249,610.00	
ONEX CORPORATION	7,400	77.360000	572,464.00	
OPEN TEXT CORP	10,400	74.040000	770,016.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	31,500	37.830000	1,191,645.00	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	13,100	32.740000	428,894.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	70,700	21.380000	1,511,566.00	
POWER CORP OF CANADA	31,700	29.350000	930,395.00	
POWER FINANCIAL CORP	21,500	31.700000	681,550.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	15,100	25.500000	385,050.00	
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	9,200	44.300000	407,560.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	17,210	55.440000	954,122.40	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	30,700	50.430000	1,548,201.00	
ROYAL BANK OF CANADA	126,100	78.520000	9,901,372.00	
SAPUTO INC	21,700	39.880000	865,396.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	14,300	25.190000	360,217.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	34,600	24.980000	864,308.00	
SILVER WHEATON CORP	36,900	24.140000	890,766.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,900	52.240000	673,896.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	51,800	45.500000	2,356,900.00	
SUNCOR ENERGY INC	134,400	35.390000	4,756,416.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	48,400	12.190000	589,996.00	
TELUS CORP	11,600	41.140000	477,224.00	
THOMSON REUTERS CORP	29,300	54.490000	1,596,557.00	
TORONTO-DOMINION BANK	157,500	57.000000	8,977,500.00	
TOURMALINE OIL CORP	16,000	30.340000	485,440.00	
TRANSCANADA CORP	60,300	53.650000	3,235,095.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	84,900	3.610000	306,489.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	27,500	34.290000	942,975.00	
VERESEN INC	25,800	9.840000	253,872.00	
VERMILION ENERGY INC	9,300	42.540000	395,622.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,700	40.720000	232,104.00	
WESTON (GEORGE) LTD	4,300	113.800000	489,340.00	
YAMANA GOLD INC	82,000	5.620000	460,840.00	
カナダドル 小計	3,380,988		123,019,641.10 (10,329,959,263)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	59,566	18.760000	1,117,458.16	
ALUMINA LTD	230,063	1.415000	325,539.14	
AMCOR LIMITED	99,321	16.110000	1,600,061.31	
AMP LTD	254,720	5.560000	1,416,243.20	

ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,429	12.220000	567,362.38	
ASCIANO LTD	54,783	8.820000	483,186.06	
ASX LTD	17,057	43.500000	741,979.50	
AURIZON HOLDINGS LTD	181,869	4.400000	800,223.60	
AUSNET SERVICES	171,878	1.555000	267,270.29	
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,734	24.780000	6,138,848.52	
BANK OF QUEENSLAND LTD	32,841	11.400000	374,387.40	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	40,010	9.980000	399,299.80	
BHP BILLITON LIMITED	273,031	18.380000	5,018,309.78	
BORAL LTD	65,783	6.660000	438,114.78	
BRAMBLES LTD	135,566	12.730000	1,725,755.18	
CALTEX AUSTRALIA LTD	23,472	33.500000	786,312.00	
CHALLENGER LTD	51,095	9.060000	462,920.70	
CIMIC GROUP LTD	9,138	37.800000	345,416.40	
COCA-COLA AMATIL LTD	50,194	8.800000	441,707.20	
COCHLEAR LTD	5,072	119.280000	604,988.16	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	145,512	77.560000	11,285,910.72	
COMPUTERSHARE LTD	40,378	10.490000	423,565.22	
CROWN RESORTS LTD	32,032	11.860000	379,899.52	
CSL LTD	39,563	113.260000	4,480,905.38	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	4,749	31.880000	151,398.12	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,376	2.850000	382,971.60	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	51,929	4.540000	235,757.66	
HEALTHSCOPE LTD	154,202	2.920000	450,269.84	
ILUKA RESOURCES LTD	35,402	5.850000	207,101.70	
INCITEC PIVOT LTD	149,883	3.280000	491,616.24	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	209,655	5.890000	1,234,867.95	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	38,980	20.150000	785,447.00	
LENDLEASE GROUP	48,683	13.020000	633,852.66	
MACQUARIE GROUP LTD	26,216	70.530000	1,849,014.48	
MEDIBANK PRIVATE LTD	238,327	3.060000	729,280.62	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	223,921	26.970000	6,039,149.37	
NEWCREST MINING LTD	65,256	20.050000	1,308,382.80	
OIL SEARCH LTD	118,149	6.510000	769,149.99	
ORICA LTD	32,784	13.610000	446,190.24	
ORIGIN ENERGY LTD	150,471	5.390000	811,038.69	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	23,363	6.230000	145,551.49	
QANTAS AIRWAYS LTD	49,456	3.100000	153,313.60	
QBE INSURANCE GROUP LTD	117,370	11.900000	1,396,703.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,383	71.200000	881,669.60	
REA GROUP LTD	4,801	54.840000	263,286.84	
RIO TINTO LTD	36,125	44.200000	1,596,725.00	
SANTOS LTD	144,864	4.170000	604,082.88	
SEEK LTD	28,449	15.680000	446,080.32	
SONIC HEALTHCARE LTD	34,436	21.550000	742,095.80	
SOUTH32 LTD	456,926	1.565000	715,089.19	
SUNCORP GROUP LTD	110,645	13.050000	1,443,917.25	
SYDNEY AIRPORT	98,331	7.140000	702,083.34	
TABCORP HOLDINGS LTD	74,455	4.210000	313,455.55	
TATTS GROUP LTD	130,554	3.890000	507,855.06	
TELSTRA CORP LTD	367,697	5.590000	2,055,426.23	
TPG TELECOM LTD	26,919	12.040000	324,104.76	
TRANSURBAN GROUP	175,885	11.940000	2,100,066.90	
TREASURY WINE ESTATES LTD	64,430	10.340000	666,206.20	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	39,000	9.210000	359,190.00	
WESFARMERS LTD	96,152	41.970000	4,035,499.44	
WESTPAC BANKING CORP	283,134	29.780000	8,431,730.52	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	63,119	26.450000	1,669,497.55	
WOOLWORTHS LTD	108,451	21.990000	2,384,837.49	
オーストラリアドル 小計	6,537,035		89,089,621.37 (7,059,461,597)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	81,883	5.260000	430,704.58	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	79,915	2.878000	229,995.37	
ADMIRAL GROUP PLC	18,064	19.320000	348,996.48	
AGGREKO PLC	21,851	11.630000	254,127.13	
ANGLO AMERICAN PLC	118,903	6.085000	723,524.75	

ANTOFAGASTA PLC	34,272	4.344000	148,877.56
ARM HOLDINGS PLC	119,230	9.670000	1,152,954.10
ASHTED GROUP PLC	43,013	9.640000	414,645.32
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,209	29.450000	889,655.05
ASTRAZENECA PLC	107,353	39.585000	4,249,568.50
AUTO TRADER GROUP PLC	82,445	4.026000	331,923.57
AVIVA PLC	343,049	4.498000	1,543,034.40
BABCOCK INTL GROUP PLC	20,853	10.140000	211,449.42
BAE SYSTEMS PLC	268,271	4.829000	1,295,480.65
BARCLAYS PLC	1,425,648	1.814000	2,586,125.47
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	84,863	5.995000	508,753.68
BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,100	33.250000	369,075.00
BHP BILLITON PLC	179,099	8.167000	1,462,701.53
BP PLC	1,556,525	3.578000	5,569,246.45
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	158,445	41.705000	6,607,948.72
BT GROUP PLC	719,354	4.485000	3,226,302.69
BUNZL PLC	28,352	20.420000	578,947.84
BURBERRY GROUP PLC	37,786	10.990000	415,268.14
CAPITA PLC	56,401	10.970000	618,718.97
CARNIVAL PLC	15,962	35.840000	572,078.08
CENTRICA PLC	463,028	2.031000	940,409.86
COBHAM PLC	97,626	1.638000	159,911.38
COCA-COLA HBC AG-DI	17,377	13.240000	230,071.48
COMPASS GROUP PLC	139,393	12.950000	1,805,139.35
CRODA INTERNATIONAL PLC	11,350	29.540000	335,279.00
DIAGEO PLC	213,719	18.580000	3,970,899.02
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	116,079	3.740000	434,135.46
DIXONS CARPHONE PLC	83,425	4.481000	373,827.42
EASYJET PLC	14,185	15.180000	215,328.30
EXPERIAN PLC	81,918	12.880000	1,055,103.84
FRESNILLO PLC	18,902	10.410000	196,769.82
G4S PLC	135,748	1.837000	249,369.07
GKN PLC	145,838	2.742000	399,887.79
GLAXOSMITHKLINE PLC	413,621	14.445000	5,974,755.34
GLENCORE PLC	1,038,078	1.297000	1,346,387.16
HARGREAVES LANSDOWN PLC	22,529	13.210000	297,608.09
HSBC HOLDINGS PLC	1,663,341	4.342500	7,223,058.29
ICAP PLC	48,068	4.222000	202,943.09
IMI PLC	23,797	10.050000	239,159.85
IMPERIAL BRANDS PLC	81,456	37.690000	3,070,076.64
INMARSAT PLC	38,747	7.285000	282,271.89
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	17,112	26.180000	447,992.16
INTERTEK GROUP PLC	13,776	32.970000	454,194.72
INVESTEC PLC	47,058	4.836000	227,572.48
ITV PLC	323,827	2.167000	701,733.10
JOHNSON MATTHEY PLC	16,413	28.580000	469,083.54
KINGFISHER PLC	193,906	3.730000	723,269.38
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	503,848	2.365000	1,191,600.52
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,852,176	0.724200	3,513,945.85
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,500	26.770000	709,405.00
MARKS & SPENCER GROUP PLC	138,114	4.447000	614,192.95
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	31,700	8.570000	271,669.00
MEGGITT PLC	67,019	3.851000	258,090.16
MERLIN ENTERTAINMENT	58,703	4.202000	246,670.00
MONDI PLC	31,213	13.480000	420,751.24
NATIONAL GRID PLC	319,935	9.916000	3,172,475.46
NEXT PLC	12,293	55.100000	677,344.30
OLD MUTUAL PLC	417,327	1.771000	739,086.11
PEARSON PLC	69,455	8.145000	565,710.97
PERSIMMON PLC	25,849	21.440000	554,202.56
PETROFAC LTD	22,324	7.850000	175,243.40
PROVIDENT FINANCIAL PLC	12,595	29.210000	367,899.95
PRUDENTIAL PLC	218,329	13.860000	3,026,039.94
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,872	58.850000	463,267.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,078	68.610000	3,710,291.58
RELX PLC	94,275	12.480000	1,176,552.00
REXAM PLC	59,051	6.260000	369,659.26

RIO TINTO PLC	105,208	19.630000	2,065,233.04	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	155,964	6.385000	995,830.14	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	11,264,789	0.001000	11,264.78	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	294,844	2.453000	723,252.33	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	335,081	16.550000	5,545,590.55	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	336,606	16.615000	5,592,708.69	
ROYAL MAIL PLC	76,784	5.210000	400,044.64	
RSA INSURANCE GROUP PLC	86,768	4.870000	422,560.16	
SABMILLER PLC	82,561	42.625000	3,519,162.62	
SAGE GROUP PLC/THE	91,423	6.040000	552,194.92	
SAINSBURY (J) PLC	115,130	2.641000	304,058.33	
SCHRODERS PLC	10,680	26.790000	286,117.20	
SEVERN TRENT PLC	20,878	22.650000	472,886.70	
SHIRE PLC	50,293	42.810000	2,153,043.33	
SKY PLC	87,714	9.655000	846,878.67	
SMITH & NEPHEW PLC	75,853	11.730000	889,755.69	
SMITHS GROUP PLC	33,742	10.990000	370,824.58	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	23,667	3.609000	85,414.20	
SSE PLC	86,198	15.300000	1,318,829.40	
ST JAMES'S PLACE PLC	44,848	9.435000	423,140.88	
STANDARD CHARTERED PLC	277,937	5.360000	1,489,742.32	
STANDARD LIFE PLC	166,569	3.386000	564,002.63	
TATE & LYLE PLC	39,448	6.080000	239,843.84	
TAYLOR WIMPEY PLC	275,102	2.103000	578,539.50	
TESCO PLC	691,489	1.710000	1,182,446.19	
TRAVIS PERKINS PLC	21,155	19.640000	415,484.20	
TUI AG-DI	42,299	10.580000	447,523.42	
UNILEVER PLC	108,942	31.135000	3,391,909.17	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	59,419	9.695000	576,067.20	
VODAFONE GROUP PLC	2,254,879	2.267000	5,111,810.69	
WEIR GROUP PLC/THE	18,133	12.340000	223,761.22	
WHITBREAD PLC	15,360	43.280000	664,780.80	
WILLIAM HILL PLC	76,368	3.080000	235,213.44	
WM MORRISON SUPERMARKETS	189,810	1.962000	372,407.22	
WOLSELEY PLC	21,583	40.770000	879,938.91	
WORLDPAY GROUP PLC	121,500	2.656000	322,704.00	
WPP PLC	109,713	16.140000	1,770,767.82	
イギリス債券 小計	36,014,556		134,436,171.84 (21,646,912,389)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	186,704	20.430000	3,814,362.72	
ACTELION LTD-REG	8,689	160.300000	1,392,846.70	
ADECCO GROUP AG-REG	14,008	60.150000	842,581.20	
ARYZTA AG	7,446	40.470000	301,339.62	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,238	121.200000	513,645.60	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	182	1,194.000000	217,308.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	81	6,200.000000	502,200.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	73,755.000000	663,795.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	44,306	57.200000	2,534,303.20	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	152,513	13.960000	2,129,081.48	
DUFREY AG-REG	3,506	135.100000	473,660.60	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	698	486.500000	339,577.00	
GALENICA AG-REG	336	1,250.000000	420,000.00	
GEBERIT AG-REG	3,206	380.500000	1,219,883.00	
GIVAUDAN-REG	782	1,953.000000	1,527,246.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,976	42.960000	815,208.96	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,617	138.300000	638,531.10	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	38,633	44.870000	1,733,462.71	
LONZA GROUP AG-REG	4,502	169.700000	763,989.40	
NESTLE SA-REG	270,956	73.600000	19,942,361.60	
NOVARTIS AG-REG	193,354	77.850000	15,052,608.90	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,734	65.000000	177,710.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,366	415.750000	567,914.50	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	59,714	251.100000	14,994,185.40	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,803	182.800000	329,588.40	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,668	183.400000	672,711.20	
SGS SA-REG	465	2,178.000000	1,012,770.00	

SIKA AG-BR	182	4,301.000000	782,782.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	4,539	131.200000	595,516.80	
SULZER AG-REG	1,189	86.200000	102,491.80	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,604	293.800000	765,055.20	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,331	57.700000	249,898.70	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,714	250.600000	680,128.40	
SWISS PRIME SITE-REG	5,739	85.200000	488,962.80	
SWISS RE AG	29,889	87.750000	2,622,759.75	
SWISSCOM AG-REG	2,201	465.600000	1,024,785.60	
SYNGENTA AG-REG	7,895	394.000000	3,110,630.00	
UBS GROUP AG-REG	310,751	14.950000	4,645,727.45	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,764	242.100000	3,090,164.40	
スイスフラン 小計	1,412,290		91,751,775.19 (10,178,024,421)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	1,023,600	42.850000	43,861,260.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,900	54.550000	1,140,095.00	
BANK OF EAST ASIA LTD	103,820	27.850000	2,891,387.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	312,000	23.050000	7,191,600.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	113,000	12.240000	1,383,120.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	59,000	72.000000	4,248,000.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	228,868	46.300000	10,596,588.40	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,368	88.750000	20,356,410.00	
CLP HOLDINGS LTD	163,000	71.650000	11,678,950.00	
FIRST PACIFIC CO	208,000	4.790000	996,320.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	199,000	25.000000	4,975,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	196,000	14.120000	2,767,520.00	
HANG SENG BANK LTD	64,600	133.600000	8,630,560.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	98,868	44.300000	4,379,852.40	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	228,000	11.060000	2,521,680.00	
HONG KONG & CHINA GAS	597,578	14.480000	8,652,929.44	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	97,400	176.400000	17,181,360.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	54,000	32.150000	1,736,100.00	
KERRY PROPERTIES LTD	58,500	19.100000	1,117,350.00	
LI & FUNG LTD	518,000	3.990000	2,066,820.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	85,200	10.400000	886,080.00	
MTR CORP	126,000	35.850000	4,517,100.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	468,000	7.050000	3,299,400.00	
NWS HOLDINGS LTD	128,500	12.060000	1,549,710.00	
PCCW LTD	353,000	4.950000	1,747,350.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	119,000	76.100000	9,055,900.00	
SANDS CHINA LTD	205,600	27.900000	5,736,240.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	108,000	8.600000	928,800.00	
SINO LAND CO	263,400	11.500000	3,029,100.00	
SJM HOLDINGS LTD	166,000	4.880000	810,080.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	147,000	86.450000	12,708,150.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	50,500	80.400000	4,060,200.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	100,400	19.880000	1,995,952.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	119,500	30.350000	3,626,825.00	
WH GROUP LTD	509,000	5.980000	3,043,820.00	
WHARF HOLDINGS LTD	116,000	41.150000	4,773,400.00	
WHEELOCK & CO LTD	79,000	32.350000	2,555,650.00	
WYNN MACAU LTD	139,600	11.300000	1,577,480.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	66,000	28.950000	1,910,700.00	
香港ドル 小計	7,923,202		226,184,839.24 (3,207,301,020)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	223,200	2.940000	656,208.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,000	8.140000	293,040.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	189,200	2.730000	516,516.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,300	15.160000	2,263,388.00	
GENTING SINGAPORE PLC	527,800	0.710000	374,738.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	276,300	1.770000	489,051.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	611,060	0.365000	223,036.90	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,300	32.100000	330,630.00	
KEPPEL CORP LTD	125,200	5.230000	654,796.00	
NOBLE GROUP LTD	418,590	0.305000	127,669.95	

OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	262,600	8.400000	2,205,840.00	
SEBICORP INDUSTRIES LTD	88,300	2.740000	241,942.00	
SEBICORP MARINE LTD	80,100	1.540000	123,354.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	50,040	10.500000	525,420.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	70,200	7.580000	532,116.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	140,250	3.920000	549,780.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	135,700	3.100000	420,670.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,960	3.810000	2,579,217.60	
STARHUB LTD	56,500	3.480000	196,620.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	109,700	17.910000	1,964,727.00	
UOL GROUP LTD	42,900	5.600000	240,240.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	167,000	3.270000	546,090.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	172,600	0.910000	157,066.00	
シンガポールドル 小計	4,619,800		16,212,156.45 (1,292,919,476)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,369	6.215000	499,493.33	
CONTACT ENERGY LTD	63,088	5.460000	344,460.48	
FLETCHER BUILDING LTD	57,310	8.490000	486,561.90	
MERIDIAN ENERGY LTD	111,895	2.610000	292,045.95	
MIGHTY RIVER POWER	64,417	3.000000	193,251.00	
RYMAN HEALTHCARE LTD	32,162	9.450000	303,930.90	
SPARK NEW ZEALAND LTD	151,850	3.645000	553,493.25	
ニュージーランドドル 小計	561,091		2,673,236.81 (198,728,424)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	25,398	125.800000	3,195,068.40	
ASSA ABLOY AB-B	84,970	171.200000	14,546,864.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	56,921	213.800000	12,169,709.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	33,115	197.000000	6,523,655.00	
BOLIDEN AB	23,559	144.700000	3,408,987.30	
ELECTROLUX AB-SER B	20,516	222.400000	4,562,758.40	
ERICSSON LM-B SHS	258,215	64.250000	16,590,313.75	
GETINGE AB-B SHS	16,627	176.400000	2,933,002.80	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	80,596	257.900000	20,785,708.40	
HEXAGON AB-B SHS	21,928	319.900000	7,014,767.20	
HUSQVARNA AB-B SHS	35,570	67.300000	2,393,861.00	
ICA GRUPPEN AB	6,802	282.400000	1,920,884.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13,914	139.300000	1,938,220.20	
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	20,053	220.800000	4,427,702.40	
INVESTOR AB-B SHS	38,459	285.700000	10,987,736.30	
LUNDIN PETROLEUM AB	18,857	150.700000	2,841,749.90	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,516	449.100000	2,477,235.60	
NORDEA BANK AB	258,200	79.250000	20,462,350.00	
SANDVIK AB	90,222	83.250000	7,510,981.50	
SECURITAS AB-B SHS	27,065	129.100000	3,494,091.50	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,980	78.000000	10,060,440.00	
SKANSKA AB-B SHS	32,105	179.100000	5,750,005.50	
SKF AB-B SHARES	33,855	149.000000	5,044,395.00	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	51,326	264.500000	13,575,727.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	127,443	104.600000	13,330,537.80	
SWEDBANK AB - A SHARES	77,029	178.400000	13,741,973.60	
SWEDISH MATCH AB	16,880	281.500000	4,751,720.00	
TELE2 AB-B SHS	27,421	78.900000	2,163,516.90	
TELIA CO AB	219,779	38.760000	8,518,634.04	
VOLVO AB-B SHS	130,769	90.900000	11,886,902.10	
スウェーデンクローネ 小計	1,982,090		239,009,500.19 (3,166,875,877)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	82,896	101.400000	8,405,654.40	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,038	139.600000	2,378,504.80	
NORSK HYDRO ASA	114,609	33.080000	3,791,265.72	
ORKLA ASA	68,971	75.950000	5,238,347.45	
SCHIBSTED ASA-B SHS	7,650	249.400000	1,907,910.00	
SCHIBSTED ASA-CL A	6,411	260.000000	1,666,860.00	
STATOIL ASA	94,784	135.400000	12,833,753.60	
TELENOR ASA	63,576	138.600000	8,811,633.60	
YARA INTERNATIONAL ASA	15,163	299.200000	4,536,769.60	

ノルウェークローネ 小計	471,098		49,570,699.17 (653,837,522)
デンマーククローネ			
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	325	8,425.000000	2,738,125.00
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	587	8,740.000000	5,130,380.00
CARLSBERG AS-B	9,062	633.000000	5,736,246.00
CHR HANSEN HOLDING A/S	8,541	410.400000	3,505,226.40
COLOPLAST-B	9,434	505.000000	4,764,170.00
DANSKE BANK A/S	60,019	185.600000	11,139,526.40
DSV A/S	16,447	305.500000	5,024,558.50
GENMAB A/S	4,500	1,229.000000	5,530,500.00
ISS A/S	12,819	265.000000	3,397,035.00
NOVO NORDISK A/S-B	166,456	364.400000	60,656,566.40
NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,749	321.200000	6,343,378.80
PANDORA A/S	9,325	999.500000	9,320,337.50
TDC A/S	71,000	33.380000	2,369,980.00
TRYG A/S	10,293	127.500000	1,312,357.50
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18,971	450.000000	8,536,950.00
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,114	698.000000	1,475,572.00
デンマーククローネ 小計	419,642		136,980,909.50 (2,260,185,006)
イスラエルシェケル			
AZRIELI GROUP	3,165	162.000000	512,730.00
BANK HAPOALIM BM	87,790	19.150000	1,681,178.50
BANK LEUMI LE-ISRAEL	116,157	13.610000	1,580,896.77
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	160,728	7.590000	1,219,925.52
DELEK GROUP LTD	399	700.000000	279,300.00
ISRAEL CHEMICALS LTD	44,179	16.150000	713,490.85
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,088	44.100000	533,080.80
NICE SYSTEMS LTD	4,815	251.600000	1,211,454.00
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	77,722	200.500000	15,583,261.00
イスラエルシェケル 小計	507,043		23,315,317.44 (666,584,925)
ユーロ			
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	44,016	14.675000	645,934.80
ACCOR SA	17,926	39.560000	709,152.56
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	16,355	28.555000	467,017.02
ADIDAS AG	17,741	114.800000	2,036,666.80
ADP	2,590	108.600000	281,274.00
AEGON NV	154,628	4.518000	698,609.30
AENA SA	5,729	124.600000	713,833.40
AGEAS	17,096	35.385000	604,941.96
AIR LIQUIDE SA	29,211	96.520000	2,819,445.72
AIRBUS GROUP SE	50,202	56.000000	2,811,312.00
AKZO NOBEL	20,970	62.850000	1,317,964.50
ALLIANZ SE-REG	38,798	141.900000	5,505,436.20
ALSTOM	12,808	22.100000	283,056.80
ALTICE NV - A	31,053	14.935000	463,776.55
ALTICE NV - B	9,864	14.995000	147,910.68
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	37,054	40.515000	1,501,242.81
ANDRITZ AG	6,797	45.500000	309,263.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,310	111.650000	7,626,811.50
ARCELORMITTAL	144,000	3.964000	570,816.00
ARKEMA	5,769	72.330000	417,271.77
ASML HOLDING NV	29,461	86.760000	2,556,036.36
ASSICURAZIONI GENERALI	98,547	12.840000	1,265,343.48
ATLANTIA SPA	34,988	24.340000	851,607.92
ATOS SE	7,455	81.750000	609,446.25
AXA SA	167,261	22.050000	3,688,105.05
AXEL SPRINGER SE	3,783	50.500000	191,041.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	551,530	5.788000	3,192,255.64
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	3,584,976	0.030400	108,983.27
BANCO DE SABADELL SA	440,629	1.628000	717,344.01
BANCO POPOLARE SC	30,841	4.378000	135,021.89
BANCO POPULAR ESPANOL	149,661	2.191000	327,907.25
BANCO SANTANDER SA	1,225,427	4.186000	5,129,637.42
BANK OF IRELAND	2,394,919	0.250000	598,729.75
BANKIA SA	397,148	0.787000	312,555.47

BANKINTER SA	57,687	6.672000	384,887.66
BASF SE	77,969	69.110000	5,388,437.59
BAYER AG-REG	70,243	87.150000	6,121,677.45
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,050	72.140000	2,023,527.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,699	63.280000	297,352.72
BEIERSDORF AG	8,477	79.430000	673,328.11
BNP PARIBAS	89,984	47.630000	4,285,937.92
BOLLORE	75,542	3.251000	245,587.04
BOSKALIS WESTMINSTER	7,676	33.315000	255,725.94
BOUYGUES SA	17,286	29.125000	503,454.75
BRENNTAG AG	13,086	47.875000	626,492.25
BUREAU VERITAS SA	22,862	19.260000	440,322.12
CAIXABANK S.A	225,298	2.489000	560,766.72
CAPGEMINI	13,843	85.000000	1,176,655.00
CARREFOUR SA	46,983	24.210000	1,137,458.43
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,808	51.800000	249,054.40
CHRISTIAN DIOR SE	4,621	147.950000	683,676.95
CNH INDUSTRIAL NV	80,979	6.170000	499,640.43
CNP ASSURANCES	14,259	14.790000	210,890.61
COLRUYT SA	6,106	52.250000	319,038.50
COMMERZBANK AG	90,115	7.499000	675,772.38
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	40,410	39.370000	1,590,941.70
CONTINENTAL AG	9,322	186.350000	1,737,154.70
CREDIT AGRICOLE SA	89,540	9.092000	814,097.68
CRH PLC	70,766	26.890000	1,902,897.74
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	81,752	58.170000	4,755,513.84
DANONE	50,062	61.750000	3,091,328.50
DASSAULT SYSTEMES SA	10,872	70.590000	767,454.48
DELHAIZE GROUP	8,771	93.150000	817,018.65
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	117,054	15.560000	1,821,360.24
DEUTSCHE BOERSE AG	16,321	77.770000	1,269,284.17
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	20,414	12.495000	255,072.93
DEUTSCHE POST AG-REG	82,288	26.125000	2,149,774.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	273,898	16.100000	4,409,757.80
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	28,532	28.430000	811,164.76
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	48,686	5.301000	258,084.48
E.ON SE	170,269	8.473000	1,442,689.23
EDENRED	17,292	16.685000	288,517.02
EDF	21,413	11.795000	252,566.33
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	198,354	2.879000	571,061.16
ELISA OYJ	11,834	32.640000	386,261.76
ENAGAS SA	18,777	27.125000	509,326.12
ENDESA SA	27,432	18.150000	497,890.80
ENEL SPA	649,496	4.062000	2,638,252.75
ENGIE	124,767	13.520000	1,686,849.84
ENI SPA	215,880	13.350000	2,881,998.00
ERSTE GROUP BANK AG	23,852	23.885000	569,705.02
ESSILOR INTERNATIONAL	17,431	116.100000	2,023,739.10
EURAZEO	3,444	58.090000	200,061.96
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,697	18.240000	268,073.28
EVONIK INDUSTRIES AG	12,036	26.000000	312,936.00
EXOR SPA	9,372	32.360000	303,277.92
FERRARI NV	10,900	36.870000	401,883.00
FERROVIAL SA	39,991	18.920000	756,629.72
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,578	6.215000	475,932.27
FORTUM OYJ	38,349	13.210000	506,590.29
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,733	50.820000	189,711.06
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	18,558	75.730000	1,405,397.34
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,408	66.790000	2,164,530.32
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,721	36.955000	211,419.55
GALP ENERGIA SGPS SA	39,622	11.825000	468,530.15
GAS NATURAL SDG SA	30,213	17.365000	524,648.74
GEA GROUP AG	15,468	41.285000	638,596.38
GEMALTO	6,914	54.660000	377,919.24
GRIFOLS SA	25,380	19.200000	487,296.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,812	74.620000	508,311.44
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	40,697	11.590000	471,678.23

HANNOVER RUECK SE	5,087	99.200000	504,630.40
HEIDELBERGCEMENT AG	11,881	76.930000	914,005.33
HEINEKEN HOLDING NV	8,607	72.450000	623,577.15
HEINEKEN NV	19,605	83.080000	1,628,783.40
HENKEL AG & CO KGAA	8,831	91.380000	806,976.78
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,075	102.500000	1,545,187.50
HERMES INTERNATIONAL	2,240	322.150000	721,616.00
HUGO BOSS AG -ORD	5,808	56.090000	325,770.72
IBERDROLA SA	468,489	6.100000	2,857,782.90
ILIAD SA	2,270	196.850000	446,849.50
IMERYS SA	2,991	62.610000	187,266.51
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	92,332	29.505000	2,724,255.66
INFINEON TECHNOLOGIES AG	95,674	12.870000	1,231,324.38
ING GROEP NV-CVA	328,845	10.880000	3,577,833.60
INGENICO GROUP	4,703	107.000000	503,221.00
INTESA SANPAOLO	1,078,134	2.304000	2,484,020.73
INTESA SANPAOLO-RSP	76,251	2.164000	165,007.16
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	70,478	6.940000	489,117.32
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JC DECAUX SA	6,167	35.935000	221,611.14
JERONIMO MARTINS	21,810	14.195000	309,592.95
K+S AG-REG	16,505	21.895000	361,376.97
KBC GROEP NV	21,252	52.500000	1,115,730.00
KERING	6,421	144.350000	926,871.35
KERRY GROUP PLC-A	13,819	80.760000	1,116,022.44
KONE OYJ-B	28,565	40.370000	1,153,169.05
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,829	19.430000	1,376,207.47
KONINKLIJKE DSM NV	15,357	53.350000	819,295.95
KONINKLIJKE KPN NV	272,249	3.481000	947,698.76
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,800	23.460000	1,895,568.00
LAGARDERE SCA	10,243	21.605000	221,300.01
LANXESS AG	7,917	42.640000	337,580.88
LEGRAND SA	22,605	49.770000	1,125,050.85
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	35,021	10.850000	379,977.85
LINDE AG	15,759	129.950000	2,047,882.05
L'OREAL	21,380	164.200000	3,510,596.00
LUXOTTICA GROUP SPA	14,281	49.660000	709,194.46
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,731	144.700000	3,433,875.70
MAN SE	2,917	95.190000	277,669.23
MAPFRE SA	89,205	2.286000	203,922.63
MEDIOBANCA SPA	48,807	6.980000	340,672.86
MERCK KGAA	10,952	89.110000	975,932.72
METRO AG	15,295	28.775000	440,113.62
METSO OYJ	9,322	20.650000	192,499.30
MICHELIN (CGDE)	15,806	89.740000	1,418,430.44
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,133	165.000000	2,331,945.00
NATIXIS	81,133	4.577000	371,345.74
NESTE OYJ	10,659	29.330000	312,628.47
NN GROUP NV	26,839	30.175000	809,866.82
NOKIA OYJ	490,229	4.804000	2,355,060.11
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,925	31.400000	311,645.00
NUMERICABLE-SFR	9,124	27.700000	252,734.80
OCI NV	7,323	12.885000	94,356.85
OMV AG	12,894	25.505000	328,861.47
ORANGE	168,639	15.210000	2,564,999.19
ORION OYJ-CLASS B	8,453	32.180000	272,017.54
OSRAM LICHT AG	7,678	46.345000	355,836.91
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,000	116.450000	815,150.00
PERNOD RICARD SA	18,015	96.450000	1,737,546.75
PEUGEOT SA	37,742	13.475000	508,573.45
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12,928	48.605000	628,365.44
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18,545	45.285000	839,810.32
PROXIMUS	13,136	28.540000	374,901.44
PRYSMIAN SPA	16,808	22.090000	371,288.72
PUBLICIS GROUPE	16,017	65.220000	1,044,628.74
QIAGEN N.V.	19,140	18.770000	359,257.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	10,347	11.775000	121,835.92

RANDSTAD HOLDING NV	10,894	47.095000	513,052.93	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9,319	78.680000	733,218.92	
RELX NV	84,570	15.445000	1,306,183.65	
REMY COINTREAU	2,160	72.840000	157,334.40	
RENAULT SA	16,270	81.620000	1,327,957.40	
REPSOL SA	92,941	11.510000	1,069,750.91	
REXEL SA	25,560	13.470000	344,293.20	
RTL GROUP	3,366	80.750000	271,804.50	
RWE AG	41,969	11.405000	478,656.44	
SAFRAN SA	26,523	61.530000	1,631,960.19	
SAIPEM SPA	532,322	0.364200	193,871.67	
SAMPO OYJ-A SHS	38,071	40.110000	1,527,027.81	
SANOFI	99,809	71.800000	7,166,286.20	
SAP SE	83,464	71.330000	5,953,487.12	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,360	57.150000	2,706,624.00	
SCOR SE	13,127	30.025000	394,138.17	
SES	27,696	21.750000	602,388.00	
SIEMENS AG-REG	67,324	95.090000	6,401,839.16	
SNAM SPA	180,012	5.105000	918,961.26	
SOCIETE BIC SA	2,502	122.850000	307,370.70	
SOCIETE GENERALE SA	61,545	36.665000	2,256,547.42	
SODEXO	7,955	92.980000	739,655.90	
SOLVAY SA	6,323	88.950000	562,430.85	
STMICROELECTRONICS NV	54,072	5.315000	287,392.68	
STORA ENSO OYJ-R SHS	47,237	7.405000	349,789.98	
SUEZ	26,495	15.035000	398,352.32	
SYMRISE AG	10,479	56.600000	593,111.40	
TECHNIP SA	9,051	48.385000	437,932.63	
TELECOM ITALIA SPA	968,839	0.810000	784,759.59	
TELECOM ITALIA-RSP	519,508	0.652000	338,719.21	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62,502	4.092000	255,758.18	
TELEFONICA SA	382,199	9.228000	3,526,932.37	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,685	42.135000	197,402.47	
TENARIS SA	39,920	11.670000	465,866.40	
TERNA SPA	131,243	4.980000	653,590.14	
THALES SA	8,897	77.770000	691,919.69	
THYSSENKRUPP AG	31,314	18.680000	584,945.52	
TOTAL SA	186,512	43.115000	8,041,464.88	
UBI BANCA SPA	77,604	3.462000	268,665.04	
UCB SA	10,727	62.790000	673,548.33	
UMICORE	8,213	45.185000	371,104.40	
UNICREDIT SPA	404,584	3.056000	1,236,408.70	
UNILEVER NV-CVA	138,399	39.850000	5,515,200.15	
UNIPOLSAI SPA	90,827	1.734000	157,494.01	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	10,596	43.610000	462,091.56	
UPM-KYMMENE OYJ	45,166	16.840000	760,595.44	
VALEO SA	6,721	134.500000	903,974.50	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,823	19.860000	771,024.78	
VINCI SA	40,752	67.740000	2,760,540.48	
VIVENDI	98,555	17.605000	1,735,060.77	
VOESTALPINE AG	9,790	29.260000	286,455.40	
VOLKSWAGEN AG	3,064	137.050000	419,921.20	
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,712	133.400000	2,095,980.80	
VONOVIA SE	39,530	30.720000	1,214,361.60	
VOPAK	6,125	47.385000	290,233.12	
WARTSILA OYJ ABP	12,606	36.870000	464,783.22	
WENDEL	2,530	103.650000	262,234.50	
WOLTERS KLUWER	25,570	35.380000	904,666.60	
ZALANDO SE	7,515	26.725000	200,838.37	
ZARDOYA OTIS SA	15,369	9.390000	144,314.91	
ZODIAC AEROSPACE	17,549	21.895000	384,235.35	
ユーロ小計	23,033,127		269,462,859.48 (33,063,092,858)	
合計	113,579,276		266,371,281,203 (266,371,281,203)	

(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	29,064.00	554,541.12	
	AMERICAN TOWER CORP	35,983.00	3,789,009.90	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	79,744.00	857,248.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,601.00	2,089,224.09	
	BOSTON PROPERTIES INC	13,023.00	1,639,074.78	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,696.00	443,992.64	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,399.00	629,210.96	
	CROWN CASTLE INTL CORP	28,341.00	2,587,249.89	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,390.00	1,166,766.30	
	DUKE REALTY CORP	29,489.00	697,414.85	
	EQUINIX INC	5,654.00	2,005,643.42	
	EQUITY RESIDENTIAL	30,880.00	2,099,222.40	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,590.00	1,249,309.10	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,931.00	913,354.07	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,866.00	898,964.50	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	48,655.00	1,307,846.40	
	HCP INC	39,442.00	1,284,231.52	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,503.00	956,990.21	
	IRON MOUNTAIN INC	21,390.00	783,301.80	
	KIMCO REALTY CORP	34,850.00	968,133.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,786.00	469,629.78	
	MACERICH CO/THE	11,386.00	860,781.60	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,300.00	639,639.00	
	PROLOGIS INC	44,408.00	2,098,722.08	
	PUBLIC STORAGE	12,484.00	3,175,804.76	
	REALTY INCOME CORP	21,114.00	1,254,805.02	
	REGENCY CENTERS CORP	8,056.00	619,425.84	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,311.00	5,199,842.93	
	SL GREEN REALTY CORP	8,449.00	845,660.41	
	UDR INC	22,267.00	801,834.67	
	VENTAS INC	28,242.00	1,864,254.42	
	VEREIT INC	77,025.00	725,575.50	
	VORNADO REALTY TRUST	14,391.00	1,367,288.91	
	WELLTOWER INC	30,033.00	2,062,966.77	
	WEYERHAEUSER CO	66,874.00	2,081,787.62	
	投資証券 小計	920,617.00	50,988,748.26 (5,616,920,508)	
アメリカドル 小計		920,617.00	50,988,748.26 (5,616,920,508)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,000.00	260,040.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,100.00	367,586.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5,200.00	180,908.00	
	投資証券 小計	30,300.00	808,534.00 (67,892,599)	
カナダドル 小計		30,300.00	808,534.00 (67,892,599)	
オーストラリアドル				
投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	83,662.00	727,022.78	
	GOODMAN GROUP	153,008.00	1,083,296.64	
	GPT GROUP	157,990.00	840,506.80	
	MIRVAC GROUP	329,656.00	629,642.96	
	SCENTRE GROUP	457,181.00	2,107,604.41	
	STOCKLAND	207,367.00	935,225.17	
	VICINITY CENTRES	292,383.00	938,549.43	
	WESTFIELD CORP	169,610.00	1,757,159.60	
	投資証券 小計	1,850,857.00	9,019,007.79 (714,666,177)	
オーストラリアドル 小計		1,850,857.00	9,019,007.79 (714,666,177)	
イギリスポンド				

投資証券	BRITISH LAND CO PLC	82,468.00	627,993.82
	HAMMERSON PLC	67,116.00	387,930.48
	INTU PROPERTIES PLC	78,670.00	232,155.17
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,677.00	801,457.54
	SEGRO PLC	62,026.00	268,200.42
投資証券 小計		356,957.00	2,317,737.43 (373,202,080)
イギリスポンド 小計		356,957.00	2,317,737.43 (373,202,080)
香港ドル			
投資証券	LINK REIT	190,000.00	8,825,500.00
	投資証券 小計	190,000.00	8,825,500.00 (125,145,590)
香港ドル 小計		190,000.00	8,825,500.00 (125,145,590)
シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	183,900.00	424,809.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	172,700.00	239,189.50
	CAPITALAND MALL TRUST	215,700.00	442,185.00
	SUNTEC REIT	211,700.00	340,837.00
投資証券 小計		784,000.00	1,447,020.50 (115,399,884)
シンガポールドル 小計		784,000.00	1,447,020.50 (115,399,884)
ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	2,489.00	200,339.61
	GECINA SA	2,976.00	380,035.20
	ICADE	2,768.00	190,576.80
	KLEPIERRE	18,622.00	766,109.08
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,361.00	2,017,509.30
投資証券 小計		35,216.00	3,554,569.99 (436,145,737)
ユーロ 小計		35,216.00	3,554,569.99 (436,145,737)
合計			7,449,372,575 (7,449,372,575)

(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 593銘柄	96.85%		63.05%
	投資証券 35銘柄		3.15%	2.05%
カナダドル	株式 90銘柄	99.35%		3.77%
	投資証券 3銘柄		0.65%	0.02%
オーストラリアドル	株式 63銘柄	90.81%		2.58%
	投資証券 8銘柄		9.19%	0.26%
イギリスポンド	株式 109銘柄	98.31%		7.91%
	投資証券 5銘柄		1.69%	0.14%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.00%		3.72%
香港ドル	株式 39銘柄	96.24%		1.17%
	投資証券 1銘柄		3.76%	0.05%
シンガポールドル	株式 23銘柄	91.81%		0.47%
	投資証券 4銘柄		8.19%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%		0.07%
スウェーデンクローネ	株式 30銘柄	100.00%		1.16%
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 16銘柄	100.00%		0.83%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.00%		0.24%
ユーロ	株式 229銘柄	98.70%		12.07%
	投資証券 5銘柄		1.30%	0.16%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「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10期	第11期
	[平成27年11月20日現在]	[平成28年5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	263	25,432
親投資信託受益証券	104,723	10,079,521
未収入金		9
流動資産合計	104,986	10,104,962
資産合計	104,986	10,104,962
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		69
未払委託者報酬		125
流動負債合計		194
負債合計		194
純資産の部		
元本等		
元本	1 104,617	10,071,726
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	369	33,042
(分配準備積立金)	(312)	(2,302)
元本等合計	104,986	10,104,768
純資産合計	104,986	10,104,768
負債純資産合計	104,986	10,104,962

(2) 損益及び剰余金計算書

	第10期	第11期
	自平成27年5月21日 至平成27年11月20日	自平成27年11月21日 至平成28年5月20日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益	20	24
営業収益合計	20	24
営業費用		
受託者報酬		69
委託者報酬		125
営業費用合計		194
営業利益又は営業損失()	20	218
経常利益又は経常損失()	20	218
当期純利益又は当期純損失()	20	218
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	369
剰余金増加額又は欠損金減少額		32,891
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額		32,891
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()	369	33,042

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第 10 期 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第 11 期 (自平成27年11月21日 至平成28年5月20日)
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。	同 左

(貸借対照表に関する注記)

	第 10 期 [平成27年11月20日現在]	第 11 期 [平成28年5月20日現在]
1 期首元本額	118,509円	104,617円
期中追加設定元本額		9,967,109円
期中一部解約元本額	13,892円	
2 受益権の総数	104,617口	10,071,726口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0035円 (10,035円)	1.0033円 (10,033円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	

第 11 期 (自平成27年11月21日 至平成28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	1,990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	34,500円
分配準備積立金額	D	312円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	36,802円
当ファンドの期末残存口数	F	10,071,726口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	36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 10 期 (自平成27年5月21日 至平成27年11月20日)	第 11 期 (自平成27年11月21日 至平成28年5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 10 期	第 11 期
	[平成27年11月20日現在]	[平成28年5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	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 10 期	第 11 期
	[平成27年11月20日現在]	[平成28年5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	1
合計	20	1

(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	9,898,381	10,079,521	
	親投資信託受益証券 小計	9,898,381	10,079,521	
合計		9,898,381	10,079,521	

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11月20日現在]	[平成28年5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	2,446,046,790	389,098,836
国債証券	25,387,817,093	183,838,087
特殊債券		400,320,000
社債券		1,584,386,540
現先取引勘定		2,999,995,107
未収利息	58,164	3,637,299
前払費用	109,093	1,866,813
流動資産合計	27,834,031,140	5,563,142,682
資産合計	27,834,031,140	5,563,142,682
負債の部		
流動負債		
未払解約金	562	670,530
未払利息		633
その他未払費用		955
流動負債合計	562	672,118
負債合計	562	672,118
純資産の部		
元本等		
元本	1 27,329,169,583	5,462,308,836
剰余金		
剰余金又は欠損金()	504,860,995	100,161,728
元本等合計	27,834,030,578	5,562,470,564
純資産合計	27,834,030,578	5,562,470,564
負債純資産合計	27,834,031,140	5,563,142,682

(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)

区 分	(自 平成27年 5月21日 至 平成27年11月20日)	(自 平成27年11月21日 至 平成28年 5月20日)
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。	同 左

(貸借対照表に関する注記)

	[平成27年11月20日現在]	[平成28年5月20日現在]
1 期首	平成27年5月21日	平成27年11月21日
期首元本額	1,924,361,734円	27,329,169,583円
期首からの追加設定元本額	26,414,042,501円	1,544,863,883円
期首からの一部解約元本額	1,009,234,652円	23,411,724,630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	297,790,994円	249,380,519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	8,898,354円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	1,628,029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)	47,179,877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)	94,134,350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)	233,263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)	4,757,576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>	414,316,230円	334,011,007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	89,620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)	1,033,322円	1,033,322円
ブラデスコ ブラジル成長株オープン・マネープール・ファンド	2,017,196円	2,017,042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)	212,322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)	23,960,741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)	457,302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)	383,682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<マネープールファンド>	8,771,978円	6,363,253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)	13,745,897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)	3,037,917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)	1,970,066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	217,654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)	407,171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<マネープールファンド>	38,911,455円	24,781,723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	945,824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<マネープールファンド>	3,492,263円	3,491,872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	47,026,508円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジあり)	1,285,463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)	1,147,224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	10,884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
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)	31,229,335円	20,181,510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	109,209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)	276,237円	158,381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)	89,380円	40,278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)	1,554,984円	955,887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)	2,668,957円	1,559,264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	442,974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	9,834,580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<ブラジルレアルコース>(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)	3,653,886円	2,347,787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	163,666円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ロシアルーブルコース>(毎月分配型)	3,908,079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<ブラジルレアルコース>(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)	581,687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>	112,318,894円	978,045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>	980,017円	979,977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	8,859,081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・エマージング・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・エマージング・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	357,495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	3,874,252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)	918,198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)	138,468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UFJ J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UFJ J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
Navigo インド債券ファンド	885,566円	885,566円
Navigo マネープールファンド	1,883,381円	1,561,630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 グローバル好利回りCBファンド2013-09 (円ヘッジ)(限定追加型)		196,405,776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	3,276,286,700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UFJ DCバランス・イノベーション(KAKU SHIN)	112,195,605円	42,678,508円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	1,242,825,788円	365,273,064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)	102,821円	9,898,381円
MUAMトピック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)	7,644,146円	8,107,178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	255,538,832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	10,766,608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)	21,620,196円	21,620,196円
(合計)	27,329,169,583円	5,462,308,836円
2 受益権の総数	27,329,169,583口	5,462,308,836口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0185円 (10,185円)	1.0183円 (10,183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27年5月21日 至平成27年11月20日)	(自平成27年11月21日 至平成28年5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、公社債等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11月20日現在]	[平成28年5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	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11月20日現在]	[平成28年5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	1,230,260	66,288
特殊債券		542,000
社債券		2,592,900
合計	1,230,260	3,201,188

(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342回利付国債(2年)	100,000,000	100,037,000	
	第343回利付国債(2年)	83,750,000	83,801,087	
	国債証券 小計	183,750,000	183,838,087	
特殊債券	い第735号商工債券	300,000,000	300,312,000	
	い第732号農林債券	100,000,000	100,008,000	
	特殊債券 小計	400,000,000	400,320,000	
社債券	第3回コニカミノルタホールディングス	200,000,000	200,640,000	
	第17回ニコン	100,000,000	100,139,000	
	第3回興銀リース	100,000,000	100,135,000	
	第113回オリックス	100,000,000	101,906,000	
	第156回オリックス	100,000,000	100,705,000	
	第490回関西電力	100,000,000	100,049,000	
	第355回中国電力	200,000,000	200,774,000	
	第300回北陸電力	177,900,000	178,362,540	
	第459回東北電力	200,000,000	201,192,000	
	第282回四国電力	200,000,000	200,320,000	
	第17回電源開発	100,000,000	100,164,000	
	社債券 小計	1,577,900,000	1,584,386,540	
合計	2,161,650,000	2,168,544,627		

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28年6月30日現在
(単位：円)

資産総額	6,093,319,330
負債総額	66,947,412
純資産総額(-)	6,026,371,918
発行済口数	3,600,000 口
1口当たり純資産価額(/)	1,673.99 (100口当たり 167,399)

<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28年6月30日現在
(単位：円)

資産総額	6,015,058,241
負債総額	659,699
純資産総額(-)	6,014,398,542
発行済口数	3,588,058,321 口
1口当たり純資産価額(/)	1.6762 (1万口当たり 16,762)

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成28年6月30日現在
(単位：円)

資産総額	266,093,889,484
負債総額	20,056,770,000
純資産総額(-)	246,037,119,484
発行済口数	132,335,271,690 口
1口当たり純資産価額(/)	1.8592 (1万口当たり 18,592)

<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28年6月30日現在
(単位：円)

資産総額	10,106,741
負債総額	340
純資産総額(-)	10,106,401
発行済口数	10,071,726 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0034 (1万口当たり 10,034)

<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28年6月30日現在
(単位：円)

資産総額	6,067,469,188
負債総額	536,219
純資産総額(-)	6,066,932,969
発行済口数	5,956,871,678 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0185 (1万口当たり 10,185)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の譲渡の対抗要件

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

（6）受益権の再分割

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

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

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

2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

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

（1）【貸借対照表】

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

（2）【損益計算書】

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

（3）【株主資本等変動計算書】

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成28年3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28年3月末現在)	事業の内容
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
クレディ・スイス証券株式会社	78,100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	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28年6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28年3月7日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化、為替市場の相場変動等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・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7月6日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成27年12月9日から平成28年6月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成28年6月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ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。