

【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29年3月7日
【計算期間】	第12期（自平成28年6月9日 至平成28年12月8日）
【ファンド名】	MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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）
【提出書類】	募集事項等記載書面
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年3月7日
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

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

【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託です。

当初元本は1口当たり1,000円です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

ホームページアドレス <http://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <http://maxis.muam.jp/>

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

なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。

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

（５）【申込手数料】

販売会社が定める額

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

申込手数料は販売会社にご確認ください。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（６）【申込単位】

5万口の整数倍で販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（７）【申込期間】

平成29年3月8日から平成30年3月7日までです。

（注）上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

（9）【払込期日】

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

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

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

（10）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社とします。

（11）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

（12）【その他】

該当事項はありません。

【有価証券報告書】

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、1兆円です。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	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
大型株	年2回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株	年4回					
債券	年6回	北米			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
一般	(隔月)	欧州				
公債	年12回	アジア				
社債	(毎月)	オセアニア				
その他債券	日々	中南米				その他 ()
クレジット 属性 ()	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) 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。

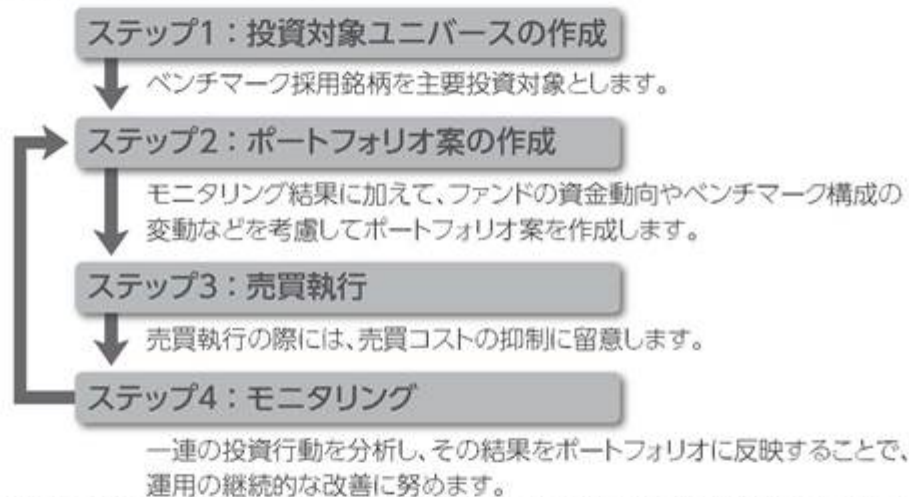
ファンドの特色

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

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(マクシス)」の由来

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

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

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラッキングしている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力しますが、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。

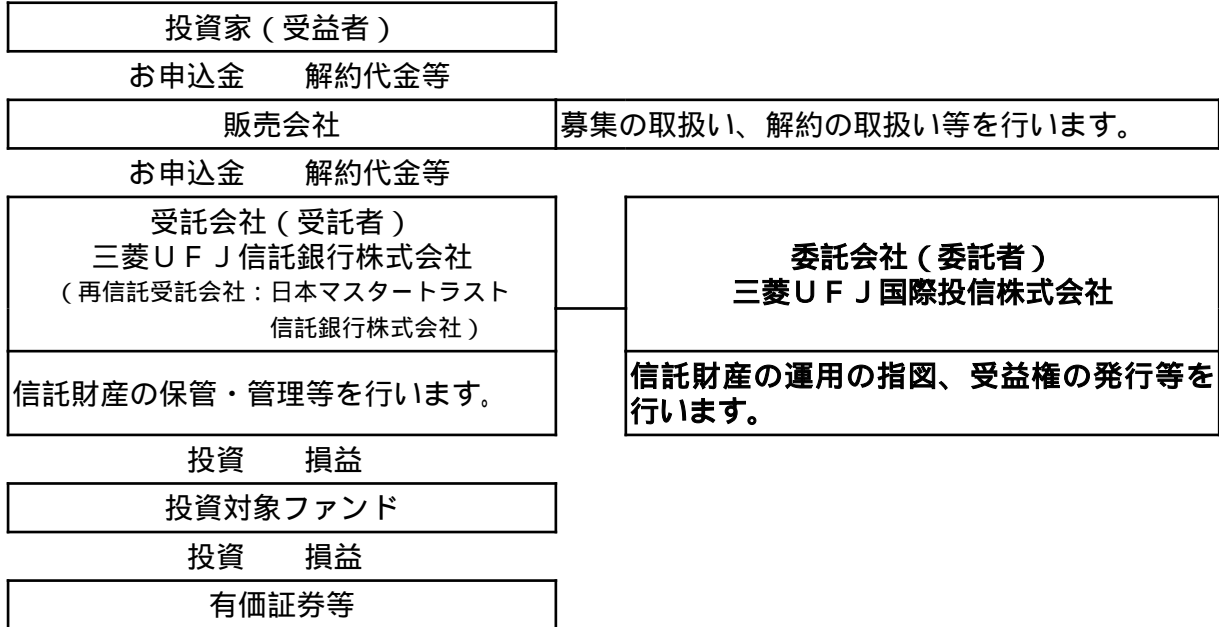
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(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12月末現在）
- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成28年12月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

信託財産の成長をめざすため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視し、「MSCIコクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」を選定しました。

円の余裕資金を効率よく運用するため、投資対象ファンドの具体的な投資先を重視し、「マネーパブルファンド（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 >

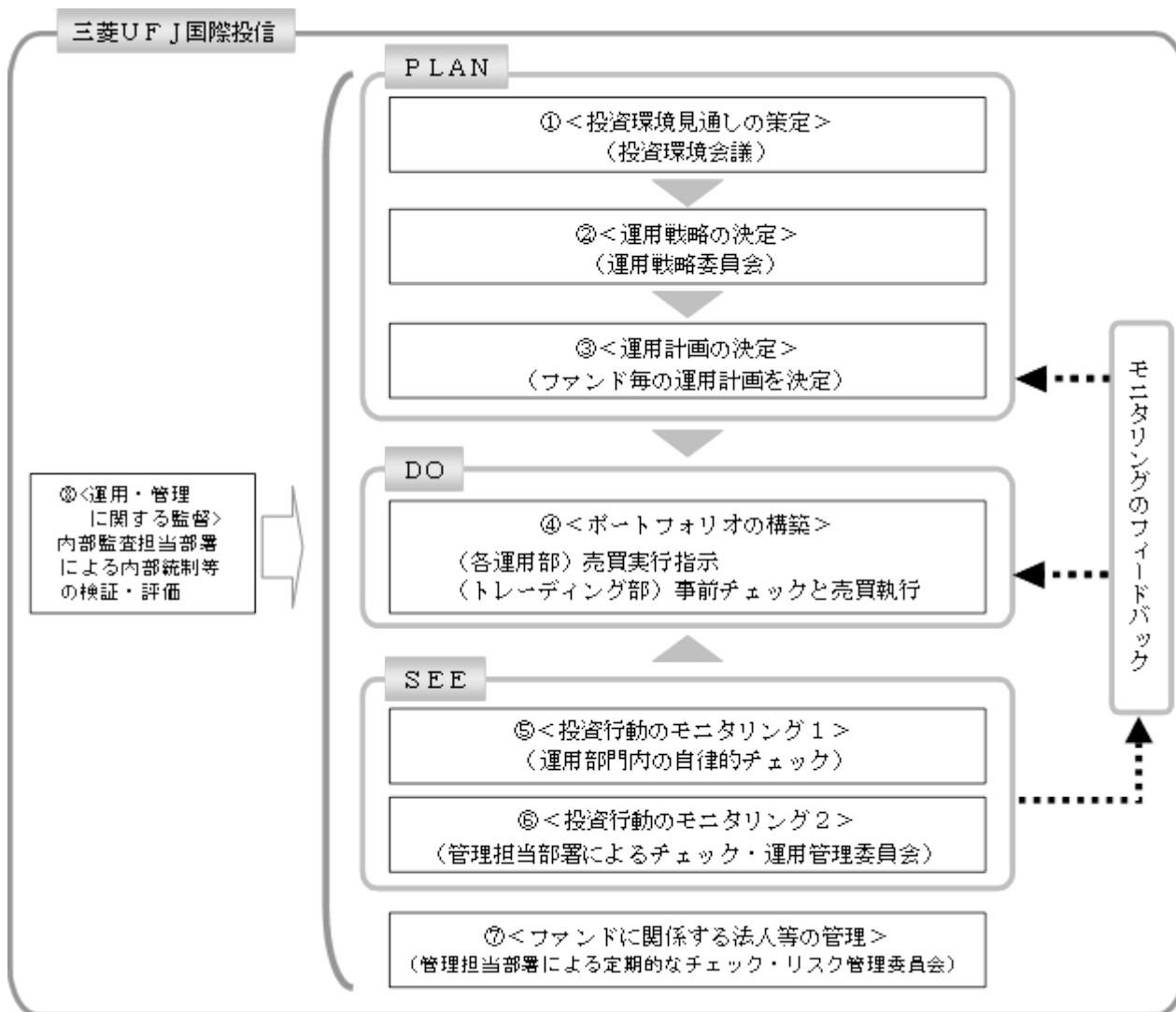
ファンド名	MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資対象	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
投資態度	外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式に実質的な投資を行い、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの連動を維持するため、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

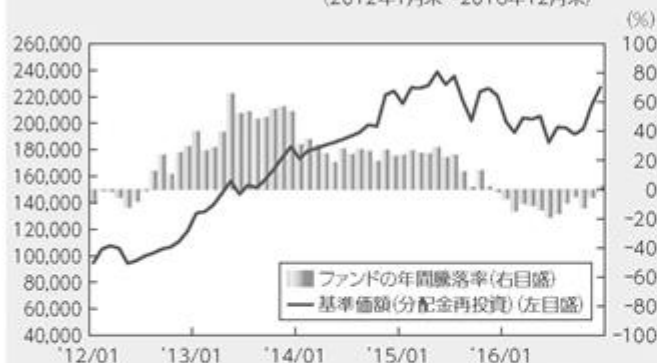
流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

■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。

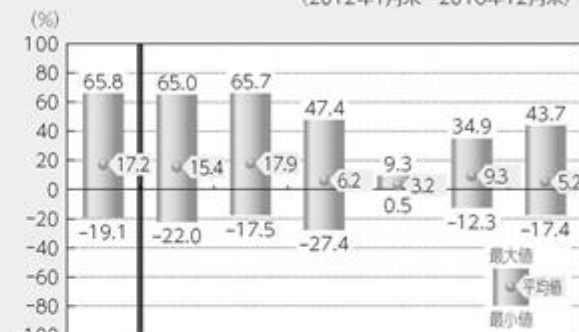
● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

(2012年1月末～2016年12月末)



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2012年1月末～2016年12月末)



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(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。

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、野村証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)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定める額

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

申込手数料は販売会社にご確認ください。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJ国際投信株式会社

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

(2)【換金（解約）手数料】

解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1%）が差し引かれます。

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

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

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

信託財産の純資産総額 × 年0.162%（税抜 年0.15%）以内の率

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

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

信託報酬の配分は以下の通りです。

委託会社	受託会社
年0.1188% （税抜 年0.11%）	年0.0432% （税抜 年0.04%）

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税等相当額を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

受益者が負担する実質的な信託報酬率は、次の通りとなります。

年0.27%（税込）程度

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

< ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬率 >

投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
M S C I コクサイインデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	年0.108%
マネープールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	年0.0324%

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.0081%（税抜0.0075%））、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.0081%（税抜0.0075%）））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

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

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

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

費用または費用を対価とする役務の内容について

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

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

1. 受益権の売却時

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

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

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

2. 収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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

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

3. 受益権の解約時および償還時

上記1.と同様の取扱いとなります。

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

上場証券投資信託は税法上、「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12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年12月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	7,515,546,942	99.81
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		14,425,467	0.19
純資産総額		7,529,972,409	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12月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	MSCIコクサイインデックス ファンド(FOFs用)(適格機 関投資家限定)	投資信託 受益証券		3,687,122,914	1.9805 2.0383	7,302,346,931 7,515,462,635		99.81
日本	マネーパールファンド(FOFs 用)(適格機関投資家限定)	投資信託 受益証券		84,039	1.0032 1.0032	84,307 84,307		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12月30日現在

種類/業種別	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.81
合計	99.81

(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12月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1口当たりの純資産価額)	東京証券取引所 取引価格
第1計算期間末日 (平成23年6月8日)	1,662,613,235 (分配付) 1,642,613,235 (分配落)	1,039.13 (分配付) 1,026.63 (分配落)	1,056
第2計算期間末日 (平成23年12月8日)	1,920,828,922 (分配付) 1,904,868,922 (分配落)	914.68 (分配付) 907.08 (分配落)	917
第3計算期間末日 (平成24年6月8日)	1,882,024,944 (分配付) 1,859,424,944 (分配落)	941.01 (分配付) 929.71 (分配落)	928
第4計算期間末日 (平成24年12月8日)	1,948,672,999 (分配付) 1,932,472,999 (分配落)	1,082.60 (分配付) 1,073.60 (分配落)	1,075
第5計算期間末日 (平成25年6月8日)	2,685,028,333 (分配付) 2,656,148,333 (分配落)	1,413.17 (分配付) 1,397.97 (分配落)	1,392
第6計算期間末日 (平成25年12月8日)	3,237,005,769 (分配付) 3,213,205,769 (分配落)	1,618.50 (分配付) 1,606.60 (分配落)	1,618
第7計算期間末日 (平成26年6月8日)	4,259,183,413 (分配付) 4,214,783,413 (分配落)	1,774.66 (分配付) 1,756.16 (分配落)	1,751
第8計算期間末日 (平成26年12月8日)	5,290,793,779 (分配付) 5,257,293,779 (分配落)	2,116.32 (分配付) 2,102.92 (分配落)	2,156

第9計算期間末日 (平成27年 6月 8日)	6,172,194,583 (分配付) 6,116,194,583 (分配落)	2,204.36 (分配付) 2,184.36 (分配落)	2,218
第10計算期間末日 (平成27年12月 8日)	6,629,014,869 (分配付) 6,580,374,869 (分配落)	2,071.57 (分配付) 2,056.37 (分配落)	2,078
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
第12計算期間末日 (平成28年12月 8日)	7,567,349,458 (分配付) 7,515,669,458 (分配落)	1,991.41 (分配付) 1,977.81 (分配落)	1,960
平成27年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
7月末日	6,404,903,926	1,779.14	1,770
8月末日	6,382,769,848	1,772.99	1,772
9月末日	6,229,583,525	1,730.44	1,729
10月末日	6,533,388,066	1,765.78	1,772
11月末日	7,327,075,414	1,928.18	1,929
12月末日	7,529,972,409	2,035.13	2,023

【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
第12計算期間	13円60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
第12計算期間	10.22

(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
第12計算期間	300,000		3,800,000

<参考>

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

(1) 投資状況

平成28年12月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,515,274,308	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		354,785	0.00
純資産総額		7,515,629,093	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12月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	外国株式インデックスマザー ファンド	親投資信託 受益証券		3,294,872,335	2.1675 2.2809	7,141,635,787 7,515,274,308		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12月30日現在

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年12月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	アメリカ	219,049,454,251	61.62
	イギリス	24,235,174,003	6.82
	カナダ	13,491,662,276	3.80
	ドイツ	12,388,755,868	3.48

	フランス	12,378,380,271	3.48
	スイス	11,677,315,460	3.28
	オーストラリア	9,202,555,908	2.59
	オランダ	4,875,668,199	1.37
	スペイン	4,208,378,998	1.18
	香港	3,912,257,973	1.10
	スウェーデン	3,826,014,439	1.08
	イタリア	2,383,095,341	0.67
	デンマーク	2,222,910,214	0.63
	ベルギー	1,582,609,463	0.45
	シンガポール	1,538,775,026	0.43
	フィンランド	1,300,417,094	0.37
	ノルウェー	898,692,830	0.25
	アイルランド	621,494,184	0.17
	ルクセンブルグ	417,131,218	0.12
	イスラエル	338,006,238	0.10
	オーストリア	273,389,224	0.08
	ニュージーランド	246,899,937	0.07
	ポルトガル	205,398,484	0.06
投資証券	アメリカ	6,696,791,087	1.88
	オーストラリア	833,942,132	0.23
	フランス	477,181,782	0.13
	イギリス	341,377,586	0.10
	香港	158,575,152	0.04
	シンガポール	133,064,898	0.04
	カナダ	76,731,002	0.02
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		15,496,819,064	4.36
純資産総額		355,488,919,602	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12月30日現在

（単位：円）

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	3,900,537,252	1.10

（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12月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ ハードウェア および機器	510,755	11,227.30 13,597.87	5,734,789,055 6,945,184,024		1.95
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	701,678	6,146.01 7,327.22	4,312,584,660 5,141,349,776		1.45
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	393,093	10,361.78 10,524.87	4,073,537,434 4,137,253,312		1.16
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	259,275	13,374.21 13,453.43	3,467,714,150 3,488,138,089		0.98
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	342,338	7,554.37 10,005.32	2,586,402,121 3,425,203,326		0.96
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	38,196	84,553.10 89,132.32	3,229,625,576 3,404,498,228		0.96
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	849,552	3,555.27 3,693.89	3,020,424,854 3,138,158,348		0.88
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	220,143	13,928.70 13,553.61	3,066,442,241 2,983,732,696		0.84
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	454,299	5,796.54 6,388.31	2,633,604,373 2,902,203,571		0.82

アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	582,944	4,609.50 4,969.46	2,687,158,045 2,896,918,872	0.81
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・サービス	29,319	84,625.32 91,187.20	2,481,159,318 2,673,517,724	0.75
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	27,934	86,540.42 93,527.49	2,417,448,349 2,612,596,939	0.73
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	967,204	1,768.31 2,562.78	1,711,391,301 2,478,731,067	0.70
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	294,911	8,317.91 8,365.88	2,453,079,180 2,467,190,773	0.69
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	178,848	11,999.63 13,724.85	2,146,207,497 2,454,662,294	0.69
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	386,482	5,985.25 6,260.17	2,313,201,444 2,419,444,026	0.68
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	242,243	9,646.53 9,825.93	2,336,823,451 2,380,263,124	0.67
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	115,423	16,998.22 18,993.69	1,962,094,392 2,192,309,200	0.62
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	574,799	3,866.30 3,784.76	2,222,616,624 2,175,476,320	0.61
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製造装置	447,476	3,648.46 4,270.52	1,632,915,723 1,910,956,728	0.54
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	275,337	5,392.32 6,917.17	1,484,735,275 1,904,554,543	0.54
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	388,590	5,214.09 4,845.98	2,026,364,928 1,883,100,922	0.53
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	227,652	7,385.46 8,164.78	1,681,379,165 1,858,729,429	0.52
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	117,136	15,589.85 15,737.79	1,826,249,453 1,843,462,823	0.52
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	262,045	6,503.63 6,877.56	1,704,309,019 1,802,232,725	0.51
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	211,591	8,410.42 8,502.93	1,779,807,044 1,799,144,413	0.51
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	66,592	27,699.35 26,725.14	1,844,573,436 1,779,680,522	0.50
アメリカ	WALT DISNEY CO/THE	株式	メディア	144,634	11,834.21 12,180.19	1,711,705,881 1,761,670,236	0.50
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,884,738	670.67 929.78	1,265,739,823 1,752,403,005	0.49
アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・サービス	90,250	15,742.45 18,759.54	1,420,768,517 1,693,049,351	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12月30日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	7.55
	素材	4.72
	資本財	7.08
	商業・専門サービス	0.94
	運輸	1.87
	自動車・自動車部品	1.43
	耐久消費財・アパレル	1.60
	消費者サービス	1.71
	メディア	2.55
	小売	3.73
	食品・生活必需品小売り	1.91
	食品・飲料・タバコ	5.60
	家庭用品・パーソナル用品	2.02
	ヘルスケア機器・サービス	3.68
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.26
	銀行	9.23
	各種金融	4.18
	保険	4.06
	不動産	0.50
	ソフトウェア・サービス	8.58
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.47	
電気通信サービス	2.98	
公益事業	3.15	
半導体・半導体製造装置	2.39	

	小計	93.19
投資証券		2.45
合計		95.64

（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12月30日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
SP EMINI (2017年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	191	アメリカドル	21,440,229.41	21,439,750.00	2,497,516,477	0.70
FTSE100 (2017年3月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	26	イギリスポンド	1,831,065.00	1,833,650.00	262,211,950	0.07
SP/TSE60 (2017年3月限)	モントリオール取引所	買建	10	カナダドル	1,807,017.50	1,811,800.00	156,648,228	0.04
SPI 200 (2017年3月限)	シドニー先物取引所	買建	26	オーストラリアドル	3,620,104.00	3,685,500.00	310,908,780	0.09
EURO ST (2017年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	138	ユーロ	4,511,599.50	4,500,180.00	552,172,086	0.16
SWISS IX (2017年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	13	スイスフラン	1,061,728.75	1,060,150.00	121,079,731	0.03

（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>

「マネーパールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」

（1）投資状況

平成28年12月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,078,615	99.75
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		25,244	0.25
純資産総額		10,103,859	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12月30日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	マネー・マーケット・マザー ファンド	親投資信託 受益証券		9,896,520	1.0184 1.0184	10,078,616 10,078,615		99.75

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成28年12月30日現在

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

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考>

「マネー・マーケット・マザーファンド」

(1) 投資状況

平成28年12月30日現在
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
社債券	日本	200,778,000	11.86
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,492,238,606	88.14
純資産総額		1,693,016,606	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12月30日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
日本	第113回オリックス	社債券		100,000	100.88 100.6610	100,882,000 100,661,000	2.190000 2017/04/18	5.95
日本	第459回東北電力	社債券		100,000	100.20 100.1170	100,200,000 100,117,000	0.869000 2017/02/24	5.91

(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12月30日現在

種類 / 業種別	投資比率(%)
社債券	11.86
合計	11.86

(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。

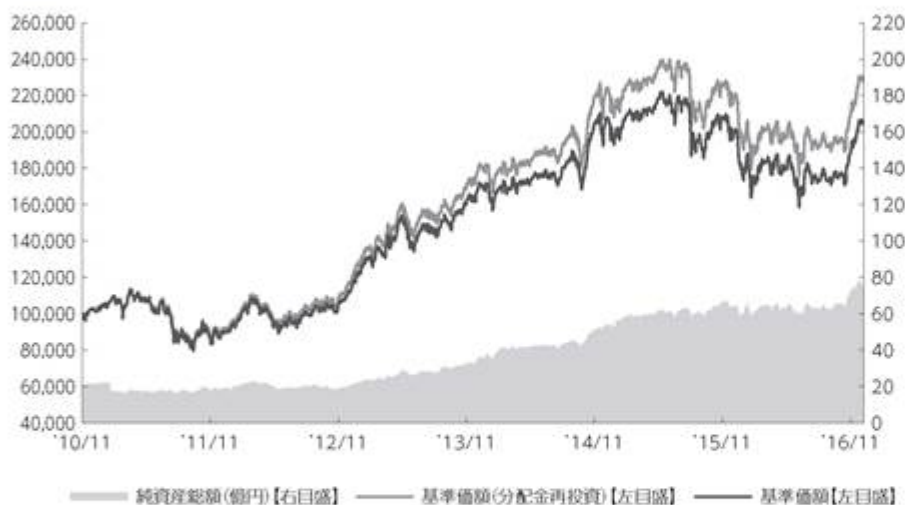
[参考情報]



運用実績

2016年12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12月30日



- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は100,000(当初元本100口当たり)を起点として表示
- 基準価額、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	203,513円
純資産総額	75.2億円

■ 分配の推移

2016年12月	1,360円
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
設定来累計	16,710円

● 分配金は100口当たり、税引前

■ 主要な資産の状況

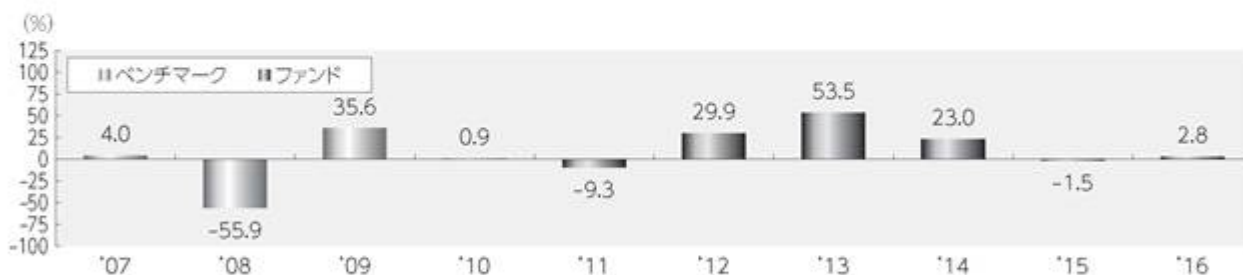
通貨別構成	比率
アメリカドル	64.2%
ユーロ	11.7%
イギリスポンド	7.0%
カナダドル	3.9%
スイスフラン	3.3%
円	3.1%
オーストラリアドル	2.9%
香港ドル	1.2%
その他	2.7%
合計	100.0%

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	2.0%
2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.4%
3 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	1.2%
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	1.0%
5 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	1.0%
6 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.0%
7 GENERAL ELECTRIC CO	資本財	アメリカ	0.9%
8 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
9 WELLS FARGO & CO	銀行	アメリカ	0.8%
10 AT&T INC	電気通信サービス	アメリカ	0.8%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	1.1%

- 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	5万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	5万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28年6月9日から平成28年12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 11 期 [平成28年6月8日現在]	第 12 期 [平成28年12月8日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,831,788	21,861,757
投資信託受益証券	6,378,599,749	7,552,496,238
流動資産合計	6,396,431,537	7,574,357,995
資産合計	6,396,431,537	7,574,357,995
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	66,150,000	51,680,000
未払受託者報酬	1,357,111	1,392,593
未払委託者報酬	3,731,989	3,829,594
未払利息	28	33
その他未払費用	1,736,814	1,786,317
流動負債合計	72,975,942	58,688,537
負債合計	72,975,942	58,688,537
純資産の部		
元本等		
元本	1,350,000,000	1,380,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,823,455,595	3,715,669,458
(分配準備積立金)	284,175	173,446
元本等合計	6,323,455,595	7,515,669,458
純資産合計	6,323,455,595	7,515,669,458
負債純資産合計	6,396,431,537	7,574,357,995

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 11 期 自 平成27年12月 9日 至 平成28年 6月 8日	第 12 期 自 平成28年 6月 9日 至 平成28年12月 8日
営業収益		
受取配当金	73,558,190	59,030,035
受取利息	3,208	90
有価証券売買等損益	789,601,861	659,094,592
営業収益合計	716,040,463	718,124,717
営業費用		
支払利息	2,001	6,045
受託者報酬	1,357,111	1,392,593
委託者報酬	3,731,989	3,829,594
その他費用	1 2,130,710	1 2,232,622
営業費用合計	7,221,811	7,460,854
営業利益又は営業損失()	723,262,274	710,663,863
経常利益又は経常損失()	723,262,274	710,663,863
当期純利益又は当期純損失()	723,262,274	710,663,863
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()	3,380,374,869	2,823,455,595
剰余金増加額又は欠損金減少額	232,493,000	233,230,000
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	232,493,000	233,230,000
分配金	2 66,150,000	2 51,680,000
期末剰余金又は期末欠損金()	2,823,455,595	3,715,669,458

(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 11 期 [平成28年6月8日現在]	第 12 期 [平成28年12月8日現在]
1 期首元本額	3,200,000,000円	3,500,000,000円
期中追加設定元本額	300,000,000円	300,000,000円
期中一部解約元本額		
2 受益権の総数	3,500,000口	3,800,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,806.70円 (180,670円)	1,977.81円 (197,781円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第 12 期 (自 平成28年6月9日 至 平成28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	59,024,080円
分配準備積立金額	B	284,175円
配当等収益合計額	C=A+B	59,308,255円
経費	D	7,454,809円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	51,853,446円
収益分配金金額	F	51,680,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	173,446円
当ファンドの期末残存口数	H	3,800,000口
100口当たり分配金額	I=F/H*100	1,360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 11 期 (自 平成27年12月 9日 至 平成28年 6月 8日)	第 12 期 (自 平成28年 6月 9日 至 平成28年12月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当社運用の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。 当社運用の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、当社運用の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 11 期 [平成28年6月8日現在]	第 12 期 [平成28年12月8日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	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 11 期 [平成28年6月8日現在]	第 12 期 [平成28年12月8日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	789,206,193	659,222,582
合計	789,206,193	659,222,582

（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）	3,813,386,484	7,552,411,931	
	マネーブルファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	84,039	84,307	
	投資信託受益証券 小計	3,813,470,523	7,552,496,238	
	合計	3,813,470,523	7,552,496,238	

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 11 期	第 12 期
	[平成28年5月25日現在]	[平成28年11月25日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,589,035	3,728,805
親投資信託受益証券	6,330,370,243	7,331,206,011
未収入金	73,786,589	59,274,583
流動資産合計	6,407,745,867	7,394,209,399
資産合計	6,407,745,867	7,394,209,399
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	73,558,189	59,030,035
未払受託者報酬	978,608	1,002,514
未払委託者報酬	2,395,829	2,454,349
未払利息	5	5
その他未払費用	3	
流動負債合計	76,932,634	62,486,903
負債合計	76,932,634	62,486,903
純資産の部		
元本等		
元本	3,486,170,122	3,783,976,605
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2,844,643,111	3,547,745,891
(分配準備積立金)	(2,490,346,378)	(2,469,997,565)
元本等合計	6,330,813,233	7,331,722,496
純資産合計	6,330,813,233	7,331,722,496
負債純資産合計	6,407,745,867	7,394,209,399

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期	第 12 期
	自 平成27年11月26日 至 平成28年 5月25日	自 平成28年 5月26日 至 平成28年11月25日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	108	5
有価証券売買等損益	671,102,843	532,096,634
営業収益合計	671,102,735	532,096,639
営業費用		
支払利息	229	386
受託者報酬	978,608	1,002,514
委託者報酬	2,395,829	2,454,349
その他費用	3	
営業費用合計	3,374,669	3,457,249
営業利益又は営業損失 ()	674,477,404	528,639,390
経常利益又は経常損失 ()	674,477,404	528,639,390
当期純利益又は当期純損失 ()	674,477,404	528,639,390
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 ()	214,264	332,244
期首剰余金又は期首欠損金 ()	3,358,278,030	2,844,643,111
剰余金増加額又は欠損金減少額	260,657,983	264,915,217
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	260,657,983	264,915,217
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,471,573	31,754,036
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	26,471,573	31,754,036
分配金	73,558,189	59,030,035
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2,844,643,111	3,547,745,891

(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 11 期 [平成28年5月25日現在]	第 12 期 [平成28年11月25日現在]
1 期首元本額	3,186,062,153円	3,486,170,122円
期中追加設定元本額	325,305,737円	336,803,619円
期中一部解約元本額	25,197,768円	38,997,136円
2 受益権の総数	3,486,170,122口	3,783,976,605口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8160円 (18,160円)	1.9376円 (19,376円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

第 12 期 (自 平成28年5月26日 至 平成28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	66,120,183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	2,058,587,160円
分配準備積立金額	D	2,462,907,417円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,587,614,760円
当ファンドの期末残存口数	F	3,783,976,605口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,123円
1万口当たり分配金額	H	156円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	59,030,035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 11 期 (自 平成27年11月26日 至 平成28年 5月25日)	第 12 期 (自 平成28年 5月26日 至 平成28年11月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 親投資信託受益証券は、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 親投資信託受益証券は、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。	同 左 同 左 同 左

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

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 11 期 [平成28年5月25日現在]	第 12 期 [平成28年11月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<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 11 期 [平成28年5月25日現在]	第 12 期 [平成28年11月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	660,696,166	531,266,416
合計	660,696,166	531,266,416

(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	3,381,708,571	7,331,206,011	
	親投資信託受益証券 小計	3,381,708,571	7,331,206,011	
合計		3,381,708,571	7,331,206,011	

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28年5月25日現在]	[平成28年11月25日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,409,344,529	2,102,139,955
コール・ローン	434,387,966	1,188,024,470
株式	266,371,281,203	283,031,184,310
投資証券	7,449,372,575	7,320,627,423
派生商品評価勘定	37,485,132	45,852,416
未収入金	57,702,927	36,140,700
未収配当金	656,549,224	529,595,359
差入委託証拠金	1,248,887,137	1,695,925,338
流動資産合計	277,665,010,693	295,949,489,971
資産合計	277,665,010,693	295,949,489,971
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	963,601	8,173,723
未払金		21,979,820
未払解約金	310,607,881	1,531,017,846
未払利息	681	1,649
その他未払費用	5,842	
流動負債合計	311,578,005	1,561,173,038
負債合計	311,578,005	1,561,173,038
純資産の部		
元本等		
元本	1 137,712,485,649	135,794,168,349
剰余金		
剰余金又は欠損金()	139,640,947,039	158,594,148,584
元本等合計	277,353,432,688	294,388,316,933
純資産合計	277,353,432,688	294,388,316,933
負債純資産合計	277,665,010,693	295,949,489,971

(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28年5月25日現在]	[平成28年11月25日現在]
1 期首	平成27年11月26日	平成28年5月26日
期首元本額	107,519,329,500円	137,712,485,649円
期首からの追加設定元本額	71,658,660,406円	55,288,791,003円
期首からの一部解約元本額	41,465,504,257円	57,207,108,303円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	3,010,924,946円	4,867,664,515円
eMAXIS 先進国株式インデックス	16,423,105,896円	16,706,580,099円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,125,920,751円	1,243,901,698円
eMAXIS バランス（波乗り型）	120,737,093円	114,643,611円
コアバランス	218,454円	486,797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	208,013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	511,674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	583,289円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	5,899,276,173円	6,892,481,883円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,412,532,276円	2,527,286,479円
三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）	278,923,185円	1,495,106,764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	3,623,982,940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	156,376,289円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	4,610,236円	41,188,455円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	343,505,231円	225,322,017円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	16,422,911円	22,416,857円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	533,152円	1,481,057円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	3,569,579円	2,786,663円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	2,222,402円	9,871,186円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	5,217,282円	12,283,260円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	2,074,997円	7,609,786円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	16,036,871,961円	8,881,036,616円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,655,680,752円	15,541,999,449円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	347,095,316円	324,353,750円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,899,283,648円	2,683,667,832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)	47,457,587,588円	45,721,685,016円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	269,185,855円	257,210,391円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	119,785,936円	104,892,007円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,045,514,293円	1,934,372,031円
MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,143,182,842円	3,381,708,571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)	52,878,764円	10,064,439円
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	6,862,769,411円	7,202,427,596円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	103,060,446円	84,651,044円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	595,973,398円	489,920,675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	386,689,813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	20,920,732円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)		1,017,191円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド(適格機関投資家限定)		1,575,132,399円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,915,611,799円	1,866,956,503円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	7,106,232円	3,479,568円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	22,261,680円	14,812,479円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	48,687,018円	35,344,947円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	43,377,502円	26,038,768円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	164,385,981円	114,596,552円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	35,803,772円	31,740,636円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	292,754,554円	246,998,105円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	65,216,092円	58,793,212円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	521,057,792円	415,552,432円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,107,164,698円	4,198,074,493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)	195,912,633円	190,746,967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)	766,699,184円	752,301,352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)	694,783,126円	694,847,219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)	581,812,993円	589,362,232円

(合計)	137,712,485,649円	135,794,168,349円
2 受益権の総数	137,712,485,649口	135,794,168,349口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0140円 (20,140円)	2.1679円 (21,679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11月26日 至平成28年5月25日)	(自平成28年5月26日 至平成28年11月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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
3 金融商品に係るリスク管理体制	デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。 当ファンドに投資する証券投資信託の注記表(金融商品に関する注記)に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成28年5月25日現在]	[平成28年11月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	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
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28年5月25日現在]	[平成28年11月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,263,913,776	16,323,907,586
投資証券	87,188,093	590,025,100
合計	2,176,725,683	15,733,882,486

(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28年5月25日現在]		
		契約額等(円)		評価損益(円)
		うち1年超	時価(円)	
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

区分	種類	[平成28年11月25日現在]		
		契約額等(円)		評価損益(円)
		うち1年超	時価(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,863,920,848	3,906,712,871	42,792,023
合計		3,863,920,848	3,906,712,871	42,792,023

（注）時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

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

区分	種類	[平成28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 カナダドル イギリスポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	275,419,200 20,797,250 27,953,300 22,091,440 10,148,880 59,244,600		278,712,000 21,060,000 28,334,000 22,370,000 10,262,000 60,030,000	3,292,800 262,750 380,700 278,560 113,120 785,400
	合計	415,654,670		420,768,000	5,113,330

（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ではありません。

（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	51,572	172.250000	8,883,277.00	
	ABBOTT LABORATORIES	124,966	38.980000	4,871,174.68	
	ABBVIE INC	137,681	60.180000	8,285,642.58	
	ACCENTURE PLC-CL A	53,404	119.820000	6,398,867.28	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	50,289	37.260000	1,873,768.14	
	ACUITY BRANDS INC	3,781	254.780000	963,323.18	
	ADOBE SYSTEMS INC	42,576	104.210000	4,436,844.96	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	6,340	171.040000	1,084,393.60	
	AERCAP HOLDINGS NV	14,000	43.900000	614,600.00	
	AES CORP	56,260	11.340000	637,988.40	
	AETNA INC	29,812	129.330000	3,855,585.96	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,480	147.200000	659,456.00	
	AFLAC INC	35,080	71.620000	2,512,429.60	
	AGCO CORP	5,487	56.160000	308,149.92	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,171	44.650000	1,257,835.15	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,450	140.750000	2,456,087.50	

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,146	66.480000	1,006,906.08
ALBEMARLE CORP	9,759	83.880000	818,584.92
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,079	118.920000	2,268,874.68
ALKERMES PLC	13,122	59.000000	774,198.00
ALLEGHANY CORP	1,291	574.710000	741,950.61
ALLERGAN PLC	33,684	193.090000	6,504,043.56
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,960	235.050000	1,165,848.00
ALLIANT ENERGY CORP	19,335	35.750000	691,226.25
ALLSTATE CORP	31,758	72.400000	2,299,279.20
ALLY FINANCIAL INC	36,404	19.950000	726,259.80
ALPHABET INC-CL A	24,990	779.000000	19,467,210.00
ALPHABET INC-CL C	26,331	760.990000	20,037,627.69
ALTRIA GROUP INC	166,510	64.020000	10,659,970.20
AMAZON.COM INC	34,136	780.120000	26,630,176.32
AMERCO	594	342.590000	203,498.46
AMEREN CORPORATION	20,687	49.070000	1,015,111.09
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,279	46.340000	569,008.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,241	58.820000	2,484,615.62
AMERICAN EXPRESS CO	68,828	72.880000	5,016,184.64
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	95,061	64.330000	6,115,274.13
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	72.490000	1,101,195.59
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,190	113.690000	1,613,261.10
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,794	78.700000	1,242,987.80
AMETEK INC	20,145	47.470000	956,283.15
AMGEN INC	63,912	145.030000	9,269,157.36
AMPHENOL CORP-CL A	26,326	68.040000	1,791,221.04
ANADARKO PETROLEUM CORP	47,269	65.000000	3,072,485.00
ANALOG DEVICES INC	26,218	73.590000	1,929,382.62
ANSYS INC	7,643	94.010000	718,518.43
ANTERO RESOURCES CORP	12,639	25.040000	316,480.56
ANTHEM INC	22,389	143.620000	3,215,508.18
AON PLC	22,510	113.510000	2,555,110.10
APACHE CORP	32,356	63.650000	2,059,459.40
APPLE INC	466,391	111.230000	51,876,670.93
APPLIED MATERIALS INC	92,641	31.880000	2,953,395.08
ARAMARK	19,302	35.160000	678,658.32
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,555	81.610000	861,393.55
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	50,068	43.250000	2,165,441.00
ARCONIC INC	37,835	20.280000	767,293.80
ARROW ELECTRONICS INC	7,712	67.790000	522,796.48
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,314	51.660000	791,121.24
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	5,224	114.770000	599,558.48
ASSURANT INC	5,171	86.190000	445,688.49
AT&T INC	523,569	38.730000	20,277,827.37
ATMOS ENERGY CORP	8,900	71.550000	636,795.00
AUTODESK INC	17,393	75.150000	1,307,083.95
AUTOLIV INC	7,360	100.650000	740,784.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	38,806	96.650000	3,750,599.90
AUTONATION INC	5,956	44.920000	267,543.52
AUTOZONE INC	2,522	798.050000	2,012,682.10
AVERY DENNISON CORP	7,522	71.220000	535,716.84
AVNET INC	10,665	46.190000	492,616.35
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	18,422	26.410000	486,525.02
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,073	61.150000	493,663.95
B/E AEROSPACE INC	8,638	59.540000	514,306.52
BAKER HUGHES INC	35,523	62.000000	2,202,426.00
BALL CORP	14,279	77.660000	1,108,907.14
BANK OF AMERICA CORP	874,067	20.560000	17,970,817.52
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	91,613	47.470000	4,348,869.11
BAXTER INTERNATIONAL INC	41,960	46.560000	1,953,657.60
BB&T CORP	70,098	44.610000	3,127,071.78
BECTON DICKINSON AND CO	18,058	168.480000	3,042,411.84
BED BATH & BEYOND INC	13,000	45.410000	590,330.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,438	158.110000	16,038,362.18
BEST BUY CO INC	25,138	46.960000	1,180,480.48
BIOGEN INC	18,640	305.930000	5,702,535.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,949	88.100000	1,228,906.90

BLACKROCK INC	10,406	372.990000	3,881,333.94
BOEING CO/THE	51,495	149.740000	7,710,861.30
BORGWARNER INC	18,207	35.390000	644,345.73
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,323	20.980000	2,419,476.54
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,143	56.750000	8,066,615.25
BROADCOM LTD	33,224	177.080000	5,883,305.92
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,000	65.900000	659,000.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,331	45.820000	839,926.42
BUNGE LTD	11,744	67.110000	788,139.84
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,310	74.120000	912,417.20
CA INC	26,931	31.600000	851,019.60
CABOT OIL & GAS CORP	40,259	23.300000	938,034.70
CADENCE DESIGN SYS INC	26,197	26.490000	693,958.53
CALPINE CORP	28,745	11.610000	333,729.45
CAMPBELL SOUP CO	17,349	56.820000	985,770.18
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,631	84.620000	3,692,055.22
CARDINAL HEALTH INC	27,767	70.550000	1,958,961.85
CARMAX INC	16,813	58.400000	981,879.20
CARNIVAL CORP	31,174	52.300000	1,630,400.20
CATERPILLAR INC	49,719	96.180000	4,781,973.42
CBRE GROUP INC - A	26,182	29.570000	774,201.74
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	35,452	60.010000	2,127,474.52
CDK GLOBAL INC	11,068	58.680000	649,470.24
CDW CORP/DE	12,600	51.360000	647,136.00
CELANESE CORP-SERIES A	12,732	78.690000	1,001,881.08
CELGENE CORP	65,937	120.850000	7,968,486.45
CENTENE CORP	14,235	56.410000	802,996.35
CENTERPOINT ENERGY INC	34,996	23.610000	826,255.56
CENTURYLINK INC	47,066	24.400000	1,148,410.40
CERNER CORP	26,125	50.510000	1,319,573.75
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,451	28.380000	552,019.38
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18,147	272.310000	4,941,609.57
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,800	83.030000	896,724.00
CHENIERE ENERGY INC	16,840	40.610000	683,872.40
CHEVRON CORP	160,515	111.000000	17,817,165.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,512	410.410000	1,030,949.92
CHUBB LTD	39,409	126.690000	4,992,726.21
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,434	44.660000	957,242.44
CIGNA CORP	21,836	139.530000	3,046,777.08
CIMAREX ENERGY CO	7,951	129.710000	1,031,324.21
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,435	75.900000	1,019,716.50
CINTAS CORP	7,178	115.320000	827,766.96
CISCO SYSTEMS INC	427,784	29.710000	12,709,462.64
CIT GROUP INC	16,802	41.050000	689,722.10
CITIGROUP INC	249,671	56.690000	14,153,848.99
CITIZENS FINANCIAL GROUP	45,238	32.400000	1,465,711.20
CITRIX SYSTEMS INC	13,329	87.680000	1,168,686.72
CLOROX COMPANY	11,160	115.480000	1,288,756.80
CME GROUP INC	28,725	112.590000	3,234,147.75
CMS ENERGY CORP	23,994	39.720000	953,041.68
COACH INC	23,949	38.380000	919,162.62
COCA-COLA CO/THE	349,693	41.120000	14,379,376.16
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	51,653	51.860000	2,678,724.58
COLGATE-PALMOLIVE CO	72,236	65.990000	4,766,853.64
COMCAST CORP-CLASS A	205,766	68.960000	14,189,623.36
COMERICA INC	15,051	62.170000	935,720.67
CONAGRA BRANDS INC	35,114	37.170000	1,305,187.38
CONCHO RESOURCES INC	12,048	138.390000	1,667,322.72
CONOCOPHILLIPS	105,593	46.300000	4,888,955.90
CONSOLIDATED EDISON INC	26,146	69.550000	1,818,454.30
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15,014	154.570000	2,320,713.98
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,979	53.370000	425,839.23
COOPER COS INC/THE	4,195	168.670000	707,570.65
CORE LABORATORIES N.V.	3,703	109.130000	404,108.39
CORNING INC	91,586	24.190000	2,215,465.34
COSTCO WHOLESALE CORP	37,290	151.600000	5,653,164.00
COTY INC-CL A	40,602	19.820000	804,731.64

CR BARD INC	6,287	210.000000	1,320,270.00
CROWN HOLDINGS INC	11,767	54.830000	645,184.61
CSX CORP	81,478	34.930000	2,846,026.54
CUMMINS INC	13,773	140.800000	1,939,238.40
CVS HEALTH CORP	91,417	73.670000	6,734,690.39
DANAHER CORP	52,667	79.160000	4,169,119.72
DARDEN RESTAURANTS INC	10,020	74.490000	746,389.80
DAVITA INC	13,849	63.360000	877,472.64
DEERE & CO	22,802	102.170000	2,329,680.34
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	19,258	51.540000	992,557.32
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,384	67.060000	1,568,131.04
DELTA AIR LINES INC	16,947	49.210000	833,961.87
DENTSPLY SIRONA INC	20,101	60.510000	1,216,311.51
DEVON ENERGY CORP	40,331	45.040000	1,816,508.24
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,439	59.910000	445,670.49
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35,200	68.280000	2,403,456.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,400	27.350000	339,140.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	20,059	26.500000	531,563.50
DISH NETWORK CORP-A	19,556	55.690000	1,089,073.64
DOLLAR GENERAL CORP	24,182	79.710000	1,927,547.22
DOLLAR TREE INC	20,160	88.860000	1,791,417.60
DOMINION RESOURCES INC/VA	52,827	72.870000	3,849,503.49
DOMINO'S PIZZA INC	4,200	170.560000	716,352.00
DOVER CORP	13,401	72.240000	968,088.24
DOW CHEMICAL CO/THE	95,484	54.070000	5,162,819.88
DR HORTON INC	30,432	28.810000	876,745.92
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,949	87.260000	1,391,709.74
DTE ENERGY COMPANY	15,621	92.660000	1,447,441.86
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	74,292	70.320000	5,224,213.44
DUKE ENERGY CORP	58,921	73.540000	4,333,050.34
DUN & BRADSTREET CORP	3,114	123.890000	385,793.46
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,259	34.570000	804,063.63
EASTMAN CHEMICAL CO	12,848	76.570000	983,771.36
EATON CORP PLC	38,996	66.490000	2,592,844.04
EATON VANCE CORP	9,389	40.350000	378,846.15
EBAY INC	93,027	28.900000	2,688,480.30
ECOLAB INC	22,456	116.790000	2,622,636.24
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,952	80.930000	400,765.36
EDISON INTERNATIONAL	28,122	68.990000	1,940,136.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,087	86.860000	1,571,036.82
ELECTRONIC ARTS INC	25,675	79.350000	2,037,311.25
ELI LILLY & CO	84,525	68.000000	5,747,700.00
EMERSON ELECTRIC CO	54,781	55.060000	3,016,241.86
ENDO INTERNATIONAL PLC	18,063	16.700000	301,652.10
ENERGY CORP	15,243	68.120000	1,038,353.16
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	15,651	21.920000	343,069.92
EOG RESOURCES INC	46,927	97.000000	4,551,919.00
EQT CORP	14,920	71.190000	1,062,154.80
EQUIFAX INC	10,251	120.070000	1,230,837.57
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,014	77.780000	1,478,908.92
EVEREST RE GROUP LTD	3,651	209.670000	765,505.17
EVERSOURCE ENERGY	27,598	51.740000	1,427,920.52
EXELON CORP	79,063	32.310000	2,554,525.53
EXPEDIA INC	10,533	126.370000	1,331,055.21
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,752	52.790000	831,548.08
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	53,847	76.810000	4,135,988.07
EXXON MOBIL CORP	353,127	86.920000	30,693,798.84
F5 NETWORKS INC	5,778	143.900000	831,454.20
FACEBOOK INC-A	196,799	120.840000	23,781,191.16
FASTENAL CO	24,748	46.240000	1,144,347.52
FEDEX CORP	21,721	190.120000	4,129,596.52
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,498	79.000000	2,093,342.00
FIFTH THIRD BANCORP	65,620	26.290000	1,725,149.80
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,637	82.370000	1,040,909.69
FIRSTENERGY CORP	36,102	31.490000	1,136,851.98
FISERV INC	19,039	107.600000	2,048,596.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,783	153.250000	1,192,744.75

FLEX LTD	45,589	14.500000	661,040.50
FLIR SYSTEMS INC	11,472	35.520000	407,485.44
FLOWSERVE CORP	11,081	46.840000	519,034.04
FLUOR CORP	11,535	54.220000	625,427.70
FMC CORP	11,683	55.290000	645,953.07
FMC TECHNOLOGIES INC	18,857	34.710000	654,526.47
FNF GROUP	20,579	32.950000	678,078.05
FOOT LOCKER INC	11,742	74.190000	871,138.98
FORD MOTOR CO	315,735	11.900000	3,757,246.50
FORTINET INC	12,178	30.840000	375,569.52
FORTIVE CORP	26,468	55.800000	1,476,914.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	13,305	57.080000	759,449.40
FRANKLIN RESOURCES INC	32,543	39.270000	1,277,963.61
FREEPORT-MCMORAN INC	101,967	16.210000	1,652,885.07
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	100,698	3.620000	364,526.76
GAP INC/THE	20,029	26.180000	524,359.22
GARMIN LTD	9,405	52.530000	494,044.65
GARTNER INC	6,961	103.610000	721,229.21
GENERAL DYNAMICS CORP	22,064	170.550000	3,763,015.20
GENERAL ELECTRIC CO	782,771	31.340000	24,532,043.14
GENERAL MILLS INC	50,614	61.480000	3,111,748.72
GENERAL MOTORS CO	117,789	33.860000	3,988,335.54
GENUINE PARTS CO	12,821	97.310000	1,247,611.51
GILEAD SCIENCES INC	113,329	75.300000	8,533,673.70
GLOBAL PAYMENTS INC	13,352	72.090000	962,545.68
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31,859	212.310000	6,763,984.29
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	23,156	30.920000	715,983.52
H&R BLOCK INC	18,812	23.680000	445,468.16
HALLIBURTON CO	73,349	49.470000	3,628,575.03
HANESBRANDS INC	32,706	24.480000	800,642.88
HARLEY-DAVIDSON INC	15,672	59.950000	939,536.40
HARMAN INTERNATIONAL	5,873	109.500000	643,093.50
HARRIS CORP	10,782	104.170000	1,123,160.94
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	33,608	48.000000	1,613,184.00
HASBRO INC	9,686	86.890000	841,616.54
HCA HOLDINGS INC	26,764	71.000000	1,900,244.00
HELMERICH & PAYNE	8,980	70.230000	630,665.40
HENRY SCHEIN INC	7,051	152.960000	1,078,520.96
HERSHEY CO/THE	12,473	97.160000	1,211,876.68
HESS CORP	24,536	53.200000	1,305,315.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	146,742	23.550000	3,455,774.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	50,800	25.030000	1,271,524.00
HOLLYFRONTIER CORP	14,030	28.450000	399,153.50
HOLOGIC INC	21,756	38.970000	847,831.32
HOME DEPOT INC	105,823	131.210000	13,885,035.83
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	61,536	113.830000	7,004,642.88
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	102,000	6.300000	642,600.00
HORMEL FOODS CORP	25,160	35.230000	886,386.80
HP INC	148,052	14.870000	2,201,533.24
HUMANA INC	12,690	207.930000	2,638,631.70
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,568	92.920000	703,218.56
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,104	12.610000	1,174,041.44
IDEXX LABORATORIES INC	7,600	120.160000	913,216.00
IHS MARKIT LTD	30,132	35.470000	1,068,782.04
ILLINOIS TOOL WORKS	27,509	124.940000	3,436,974.46
ILLUMINA INC	12,557	134.430000	1,688,037.51
INCYTE CORP	14,467	106.800000	1,545,075.60
INGERSOLL-RAND PLC	22,001	75.580000	1,662,835.58
INGREDION INC	6,000	118.890000	713,340.00
INTEL CORP	401,701	35.200000	14,139,875.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	50,844	54.330000	2,762,354.52
INTERNATIONAL PAPER CO	33,480	48.720000	1,631,145.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	34,845	24.370000	849,172.65
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,617	161.980000	12,572,401.66
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,660	120.330000	801,397.80
INTUIT INC	20,726	115.820000	2,400,485.32
INTUITIVE SURGICAL INC	3,233	645.280000	2,086,190.24

INVESCO LTD	35,876	31.670000	1,136,192.92	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,621	61.690000	655,209.49	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	21,500	54.370000	1,168,955.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,067	111.650000	565,730.55	
JM SMUCKER CO/THE	10,278	125.580000	1,290,711.24	
JOHNSON & JOHNSON	234,068	113.070000	26,466,068.76	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	79,734	45.610000	3,636,667.74	
JONES LANG LASALLE INC	3,699	100.040000	370,047.96	
JPMORGAN CHASE & CO	311,084	78.860000	24,532,084.24	
JUNIPER NETWORKS INC	29,985	26.390000	791,304.15	
KANSAS CITY SOUTHERN	9,028	88.120000	795,547.36	
KELLOGG CO	22,494	73.390000	1,650,834.66	
KEYCORP	92,381	17.520000	1,618,515.12	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,705	114.560000	3,517,564.80	
KINDER MORGAN INC	161,800	21.800000	3,527,240.00	
KLA-TENCOR CORP	13,082	81.830000	1,070,500.06	
KOHL'S CORP	15,955	55.530000	885,981.15	
KRAFT HEINZ CO/THE	51,740	82.440000	4,265,445.60	
KROGER CO	77,236	33.700000	2,602,853.20	
L BRANDS INC	20,936	72.080000	1,509,066.88	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,626	154.990000	1,026,963.74	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,832	126.010000	1,112,920.32	
LAM RESEARCH CORP	13,691	106.950000	1,464,252.45	
LAS VEGAS SANDS CORP	37,238	62.420000	2,324,395.96	
LEAR CORP	6,400	128.690000	823,616.00	
LEGGETT & PLATT INC	11,218	49.080000	550,579.44	
LENNAR CORP-A	15,519	43.870000	680,818.53	
LEUCADIA NATIONAL CORP	27,203	21.300000	579,423.90	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	26,170	56.570000	1,480,436.90	
LIBERTY BROADBAND-C	8,900	70.530000	627,717.00	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	9,140	21.510000	196,601.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	23,734	32.310000	766,845.54	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	53,859	31.250000	1,683,093.75	
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	36,094	22.130000	798,760.22	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	7,949	36.490000	290,059.01	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	16,909	35.990000	608,554.91	
LINCOLN NATIONAL CORP	20,496	64.150000	1,314,818.40	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	20,562	62.200000	1,278,956.40	
LINKEDIN CORP - A	10,054	194.920000	1,959,725.68	
LKQ CORP	26,529	33.290000	883,150.41	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,471	264.400000	5,941,332.40	
LOEWS CORP	24,250	44.760000	1,085,430.00	
LOWE'S COS INC	75,379	71.770000	5,409,950.83	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,211	57.910000	533,409.01	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	30,870	86.640000	2,674,576.80	
M & T BANK CORP	12,225	143.570000	1,755,143.25	
MACY'S INC	26,526	44.910000	1,191,282.66	
MALLINCKRODT PLC	9,526	56.870000	541,743.62	
MANPOWERGROUP INC	5,926	87.250000	517,043.50	
MARATHON OIL CORP	73,002	16.780000	1,224,973.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	45,232	47.710000	2,158,018.72	
MARKEL CORP	1,177	903.160000	1,063,019.32	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	28,251	78.080000	2,205,838.08	
MARSH & MCLENNAN COS	44,268	69.460000	3,074,855.28	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,176	224.220000	1,160,562.72	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	36,745	14.690000	539,784.05	
MASCO CORP	28,878	32.390000	935,358.42	
MASTERCARD INC - A	82,567	104.560000	8,633,205.52	
MATTEL INC	29,368	32.020000	940,363.36	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,865	39.960000	953,645.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,953	91.080000	906,519.24	
MCDONALD'S CORP	74,735	120.140000	8,978,662.90	
MCKESSON CORP	19,170	141.270000	2,708,145.90	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,711	72.390000	1,137,319.29	
MEDNAX INC	7,800	64.670000	504,426.00	
MEDTRONIC PLC	119,098	75.780000	9,025,246.44	
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	16,000	19.220000	307,520.00	

MERCK & CO. INC.	235,504	61.640000	14,516,466.56	
METLIFE INC	79,415	55.350000	4,395,620.25	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,312	419.850000	970,693.20	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	39,047	28.470000	1,111,668.09	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	15,278	48.590000	742,358.02	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,513	66.110000	1,223,894.43	
MICRON TECHNOLOGY INC	88,657	19.910000	1,765,160.87	
MICROSOFT CORP	635,727	60.400000	38,397,910.80	
MOBILEYE NV	14,600	38.860000	567,356.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,404	200.700000	1,084,582.80	
MOLSON COORS BREWING CO -B	16,095	98.890000	1,591,634.55	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	132,062	42.500000	5,612,635.00	
MONSANTO CO	37,157	102.420000	3,805,619.94	
MONSTER BEVERAGE CORP	33,816	44.740000	1,512,927.84	
MOODY'S CORP	15,051	100.860000	1,518,043.86	
MORGAN STANLEY	123,729	41.040000	5,077,838.16	
MOSAIC CO/THE	27,740	27.450000	761,463.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,619	80.260000	1,093,060.94	
MSCI INC	7,979	80.190000	639,836.01	
MURPHY OIL CORP	13,914	31.270000	435,090.78	
MYLAN NV	39,015	36.850000	1,437,702.75	
NASDAQ INC	9,913	65.340000	647,715.42	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	32,501	36.350000	1,181,411.35	
NAVIENT CORP	28,229	17.850000	503,887.65	
NETAPP INC	24,265	36.350000	882,032.75	
NETFLIX INC	36,469	117.690000	4,292,036.61	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	40,683	15.930000	648,080.19	
NEWELL BRANDS INC	37,782	48.170000	1,819,958.94	
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,570	42.020000	696,271.40	
NEWMONT MINING CORP	45,496	31.500000	1,433,124.00	
NEWS CORP - CLASS A	31,250	11.800000	368,750.00	
NEXTERA ENERGY INC	39,462	113.420000	4,475,780.04	
NIelsen HOLDINGS PLC	31,030	43.110000	1,337,703.30	
NIKE INC -CL B	113,292	51.340000	5,816,411.28	
NISOURCE INC	27,566	21.640000	596,528.24	
NOBLE ENERGY INC	36,869	36.220000	1,335,395.18	
NORDSTROM INC	10,838	58.530000	634,348.14	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,212	104.040000	2,623,056.48	
NORTHERN TRUST CORP	18,498	82.020000	1,517,205.96	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,574	247.590000	3,608,376.66	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	13,230	39.980000	528,935.40	
NRG ENERGY INC	27,473	11.030000	303,027.19	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	20,755	16.860000	349,929.30	
NUCOR CORP	27,116	62.510000	1,695,021.16	
NVIDIA CORP	45,411	93.970000	4,267,271.67	
NXP SEMICONDUCTORS NV	25,068	99.330000	2,490,004.44	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,157	69.850000	4,551,216.45	
OGE ENERGY CORP	16,994	31.200000	530,212.80	
OMNICOM GROUP	20,363	87.750000	1,786,853.25	
ONEOK INC	17,662	53.950000	952,864.90	
ORACLE CORP	264,877	40.100000	10,621,567.70	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,197	275.470000	2,258,027.59	
P G & E CORP	42,630	58.710000	2,502,807.30	
PACCAR INC	29,941	61.980000	1,855,743.18	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,861	84.720000	665,983.92	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,710	139.690000	1,077,009.90	
PARKER HANNIFIN CORP	11,526	138.290000	1,593,930.54	
PATTERSON COS INC	7,104	39.260000	278,903.04	
PAYCHEX INC	27,658	58.050000	1,605,546.90	
PAYPAL HOLDINGS INC	92,877	40.050000	3,719,723.85	
PENTAIR PLC	14,874	57.830000	860,163.42	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	26,803	18.520000	496,391.56	
PEPSICO INC	122,896	101.530000	12,477,630.88	
PERRIGO CO PLC	12,333	89.330000	1,101,706.89	
PFIZER INC	515,907	31.420000	16,209,797.94	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,057	88.890000	11,738,546.73	
PHILLIPS 66	40,369	85.060000	3,433,787.14	

PINNACLE WEST CAPITAL	9,488	73.960000	701,732.48
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,955	185.510000	2,588,792.05
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	42,417	111.140000	4,714,225.38
POLARIS INDUSTRIES INC	5,076	88.720000	450,342.72
PPG INDUSTRIES INC	22,659	97.590000	2,211,291.81
PPL CORP	58,478	32.810000	1,918,663.18
PRAXAIR INC	24,287	118.710000	2,883,109.77
PRICELINE GROUP INC/THE	4,223	1,520.990000	6,423,140.77
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,849	58.410000	1,451,430.09
PROCTER & GAMBLE CO/THE	217,452	82.680000	17,978,931.36
PROGRESSIVE CORP	49,789	33.400000	1,662,952.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,560	100.640000	3,780,038.40
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,648	40.740000	1,778,219.52
PULTEGROUP INC	26,006	18.990000	493,853.94
PVH CORP	6,806	109.020000	741,990.12
QORVO INC	10,593	54.610000	578,483.73
QUALCOMM INC	124,980	68.130000	8,514,887.40
QUEST DIAGNOSTICS INC	12,181	87.820000	1,069,735.42
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	12,489	79.870000	997,496.43
RALPH LAUREN CORP	4,749	112.520000	534,357.48
RANGE RESOURCES CORP	15,347	36.780000	564,462.66
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,015	72.830000	802,222.45
RAYTHEON COMPANY	25,235	147.880000	3,731,751.80
REALOGY HOLDINGS CORP	12,307	24.180000	297,583.26
RED HAT INC	15,616	78.750000	1,229,760.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,583	402.410000	2,649,065.03
REGIONS FINANCIAL CORP	108,207	13.300000	1,439,153.10
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,777	130.600000	493,276.20
REPUBLIC SERVICES INC	20,728	55.180000	1,143,771.04
RESMED INC	12,188	58.230000	709,707.24
REYNOLDS AMERICAN INC	72,876	54.350000	3,960,810.60
RITE AID CORP	87,548	7.800000	682,874.40
ROBERT HALF INTL INC	10,936	44.800000	489,932.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,171	131.860000	1,473,008.06
ROCKWELL COLLINS INC	11,229	90.900000	1,020,716.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	184.200000	1,597,382.40
ROSS STORES INC	34,121	69.250000	2,362,879.25
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,795	82.590000	1,221,919.05
S&P GLOBAL INC	22,561	120.210000	2,712,057.81
SABRE CORP	17,903	26.020000	465,836.06
SALESFORCE.COM INC	54,840	73.950000	4,055,418.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	10,587	100.490000	1,063,887.63
SCANA CORP	11,625	69.870000	812,238.75
SCHLUMBERGER LTD	118,574	81.400000	9,651,923.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,221	39.110000	3,958,753.31
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,861	70.140000	481,230.54
SEAGATE TECHNOLOGY	25,760	38.820000	1,000,003.20
SEALED AIR CORP	16,546	47.430000	784,776.78
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,422	48.230000	550,883.06
SEMPRA ENERGY	20,466	98.680000	2,019,584.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	14,233	38.090000	542,134.97
SERVICENOW INC	14,056	87.050000	1,223,574.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,711	272.410000	1,828,143.51
SIGNATURE BANK	4,480	150.350000	673,568.00
SIGNET JEWELERS LTD	6,255	93.860000	587,094.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	168,930	4.590000	775,388.70
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,352	78.310000	1,280,525.12
SMITH (A.O.) CORP	12,831	48.570000	623,201.67
SNAP-ON INC	5,019	169.180000	849,114.42
SOUTHERN CO/THE	80,316	47.230000	3,793,324.68
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,501	47.370000	639,542.37
SOUTHWESTERN ENERGY CO	40,654	11.500000	467,521.00
SPECTRA ENERGY CORP	59,689	41.900000	2,500,969.10
SPLUNK INC	11,085	57.650000	639,050.25
SPRINT CORP	66,748	7.690000	513,292.12
ST JUDE MEDICAL INC	24,210	80.020000	1,937,284.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,825	120.400000	1,544,130.00

STAPLES INC	54,680	9.940000	543,519.20
STARBUCKS CORP	124,675	57.590000	7,180,033.25
STATE STREET CORP	33,700	78.280000	2,638,036.00
STERICYCLE INC	7,101	75.590000	536,764.59
STRYKER CORP	28,593	111.750000	3,195,267.75
SUNTRUST BANKS INC	42,555	52.360000	2,228,179.80
SYMANTEC CORP	52,550	24.850000	1,305,867.50
SYNCHRONY FINANCIAL	71,098	34.960000	2,485,586.08
SYNOPSYS INC	13,105	61.080000	800,453.40
SYSCO CORP	45,624	53.560000	2,443,621.44
T ROWE PRICE GROUP INC	21,134	74.280000	1,569,833.52
TARGET CORP	47,602	78.480000	3,735,804.96
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,300	103.820000	134,966.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,121	41.040000	907,845.84
TE CONNECTIVITY LTD	30,500	67.350000	2,054,175.00
TEGNA INC	17,449	22.160000	386,669.84
TESLA MOTORS INC	10,955	193.140000	2,115,848.70
TESORO CORP	10,395	86.040000	894,385.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,450	38.110000	2,913,509.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	85,343	74.060000	6,320,502.58
TEXTRON INC	23,163	45.780000	1,060,402.14
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,485	143.510000	4,805,432.35
TIFFANY & CO	10,861	79.180000	859,973.98
TIME WARNER INC	66,966	92.780000	6,213,105.48
TJX COMPANIES INC	56,166	79.430000	4,461,265.38
T-MOBILE US INC	24,774	54.340000	1,346,219.16
TOLL BROTHERS INC	13,565	30.050000	407,628.25
TORCHMARK CORP	9,583	70.920000	679,626.36
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	13,775	51.540000	709,963.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,526	75.040000	864,911.04
TRANSDIGM GROUP INC	4,478	259.030000	1,159,936.34
TRAVELERS COS INC/THE	24,791	113.070000	2,803,118.37
TRIMBLE INC	21,938	28.290000	620,626.02
TRIPADVISOR INC	9,928	50.790000	504,243.12
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	38,077	28.280000	1,076,817.56
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	92,884	28.400000	2,637,905.60
TWITTER INC	48,545	18.220000	884,489.90
TYSON FOODS INC-CL A	25,650	58.660000	1,504,629.00
UGI CORP	14,800	44.700000	661,560.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	5,097	262.020000	1,335,515.94
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,055	30.710000	462,339.05
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,000	23.930000	382,880.00
UNION PACIFIC CORP	71,595	101.390000	7,259,017.05
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	7,175	69.880000	501,389.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	58,791	115.680000	6,800,942.88
UNITED RENTALS INC	7,474	97.350000	727,593.90
UNITED TECHNOLOGIES CORP	67,615	108.110000	7,309,857.65
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,695	131.390000	485,486.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,863	153.540000	12,415,705.02
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,758	122.080000	947,096.64
UNUM GROUP	20,508	43.040000	882,664.32
US BANCORP	146,630	49.350000	7,236,190.50
VALERO ENERGY CORP	40,084	64.720000	2,594,236.48
VALSPAR CORP/THE	6,300	102.520000	645,876.00
VANTIV INC - CL A	13,109	58.780000	770,547.02
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,252	91.620000	756,048.24
VERISIGN INC	8,259	79.790000	658,985.61
VERISK ANALYTICS INC	13,780	83.890000	1,156,004.20
VERIZON COMMUNICATIONS INC	346,844	50.230000	17,421,974.12
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,078	87.340000	1,840,952.52
VF CORP	28,469	57.160000	1,627,288.04
VIACOM INC-CLASS B	29,850	37.250000	1,111,912.50
VISA INC-CLASS A SHARES	161,997	79.570000	12,890,101.29
VMWARE INC-CLASS A	6,147	79.350000	487,764.45
VOYA FINANCIAL INC	16,974	38.110000	646,879.14
VULCAN MATERIALS CO	11,392	129.660000	1,477,086.72
WABCO HOLDINGS INC	4,456	102.000000	454,512.00

WABTEC CORP	7,533	86.960000	655,069.68	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	78,124	84.050000	6,566,322.20	
WAL-MART STORES INC	133,473	70.830000	9,453,892.59	
WALT DISNEY CO/THE	131,180	98.260000	12,889,746.80	
WASTE CONNECTIONS INC	15,010	77.500000	1,163,275.00	
WASTE MANAGEMENT INC	37,879	69.540000	2,634,105.66	
WATERS CORP	6,995	138.350000	967,758.25	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	75,491	4.980000	375,945.18	
WEC ENERGY GROUP INC	27,411	55.720000	1,527,340.92	
WELLS FARGO & CO	410,365	52.160000	21,404,638.40	
WESTAR ENERGY INC	12,100	56.980000	689,458.00	
WESTERN DIGITAL CORP	24,060	61.040000	1,468,622.40	
WESTERN UNION CO	42,512	21.470000	912,732.64	
WESTROCK CO	21,861	50.860000	1,111,850.46	
WHIRLPOOL CORP	6,531	165.320000	1,079,704.92	
WHITEWAVE FOODS CO	14,806	55.120000	816,106.72	
WHOLE FOODS MARKET INC	26,897	31.130000	837,303.61	
WILLIAMS COS INC	60,892	30.620000	1,864,513.04	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,290	124.560000	1,406,282.40	
WORKDAY INC-CLASS A	9,882	83.130000	821,490.66	
WR BERKLEY CORP	8,207	61.550000	505,140.85	
WR GRACE & CO	6,000	67.570000	405,420.00	
WW GRAINGER INC	5,004	224.620000	1,123,998.48	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,398	74.510000	700,244.98	
WYNN RESORTS LTD	6,807	101.320000	689,685.24	
XCEL ENERGY INC	43,989	38.770000	1,705,453.53	
XEROX CORP	71,730	9.270000	664,937.10	
XILINX INC	21,822	53.120000	1,159,184.64	
XL GROUP LTD	24,368	37.010000	901,859.68	
XYLEM INC	15,465	52.860000	817,479.90	
YAHOO! INC	76,897	40.960000	3,149,701.12	
YUM! BRANDS INC	34,505	63.150000	2,178,990.75	
ZILLOW GROUP INC - C	9,352	36.940000	345,462.88	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,080	101.000000	1,725,080.00	
ZOETIS INC	40,259	50.180000	2,020,196.62	
アメリカドル 小計	26,518,583		1,657,719,150.23 (188,615,284,913)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,500	54.370000	1,005,845.00	
AGRIUM INC	11,400	132.200000	1,507,080.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	35,900	63.160000	2,267,444.00	
ALTAGAS LTD	14,100	32.680000	460,788.00	
ARC RESOURCES LTD	29,400	24.000000	705,600.00	
ATCO LTD -CLASS I	6,800	43.240000	294,032.00	
BANK OF MONTREAL	54,700	88.800000	4,857,360.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	102,200	72.620000	7,421,764.00	
BARRICK GOLD CORP	99,800	19.650000	1,961,070.00	
BCE INC	12,400	57.950000	718,580.00	
BLACKBERRY LTD	42,100	10.060000	423,526.00	
BOMBARDIER INC-B	162,300	1.920000	311,616.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	74,200	44.990000	3,338,258.00	
CAE INC	22,700	19.650000	446,055.00	
CAMECO CORP	33,700	12.620000	425,294.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,600	105.300000	3,538,080.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,500	89.160000	5,929,140.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,800	44.010000	4,128,138.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,500	201.430000	2,517,875.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	142.360000	839,924.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10,900	36.070000	393,163.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,300	230.870000	531,001.00	
CENOVUS ENERGY INC	70,100	20.270000	1,420,927.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	18,700	64.870000	1,213,069.00	
CI FINANCIAL CORP	20,600	26.350000	542,810.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,600	618.590000	989,744.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	44,900	16.400000	736,360.00	
DOLLARAMA INC	9,600	101.410000	973,536.00	
ELDORADO GOLD CORP	59,600	3.540000	210,984.00	

ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,900	11.360000	373,744.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	14,300	18.370000	262,691.00	
ENBRIDGE INC	79,600	57.470000	4,574,612.00	
ENCANA CORP	82,900	16.630000	1,378,627.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,000	621.000000	1,242,000.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	14,400	26.430000	380,592.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	10,600	19.830000	210,198.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	57,300	16.670000	955,191.00	
FORTIS INC	35,100	40.520000	1,422,252.00	
FRANCO-NEVADA CORP	15,300	76.250000	1,166,625.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,700	36.630000	684,981.00	
GOLDCORP INC	71,900	17.400000	1,251,060.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	24,800	35.310000	875,688.00	
HUSKY ENERGY INC	30,278	14.970000	453,261.66	
HYDRO ONE LTD	15,800	22.880000	361,504.00	
IGM FINANCIAL INC	8,600	37.600000	323,360.00	
IMPERIAL OIL LTD	25,000	45.770000	1,144,250.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,500	57.040000	484,840.00	
INTACT FINANCIAL CORP	11,100	93.070000	1,033,077.00	
INTER PIPELINE LTD	28,300	27.470000	777,401.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,100	20.120000	142,852.00	
KEYERA CORP	15,700	38.450000	603,665.00	
KINROSS GOLD CORP	104,600	4.270000	446,642.00	
LINAMAR CORP	4,200	51.000000	214,200.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	19,700	68.880000	1,356,936.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,000	55.290000	1,879,860.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	168,400	23.510000	3,959,084.00	
METHANEX CORP	7,500	54.000000	405,000.00	
METRO INC	19,800	41.510000	821,898.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,900	49.810000	1,439,509.00	
ONEX CORPORATION	7,200	93.340000	672,048.00	
OPEN TEXT CORP	10,300	84.260000	867,878.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	32,700	38.920000	1,272,684.00	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	13,700	35.160000	481,692.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	72,100	23.820000	1,717,422.00	
POWER CORP OF CANADA	31,800	29.920000	951,456.00	
POWER FINANCIAL CORP	21,100	33.540000	707,694.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	17,088	31.270000	534,341.76	
RESTAURANT BRANDS INTERN	18,610	64.080000	1,192,528.80	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	30,700	52.030000	1,597,321.00	
ROYAL BANK OF CANADA	126,600	89.650000	11,349,690.00	
SAPUTO INC	21,400	46.220000	989,108.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	18,000	31.610000	568,980.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	34,500	26.270000	906,315.00	
SILVER WHEATON CORP	36,800	24.270000	893,136.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,500	56.840000	710,500.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,500	53.380000	2,802,450.00	
SUNCOR ENERGY INC	142,300	42.500000	6,047,750.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	48,700	35.020000	1,705,474.00	
TELUS CORP	11,600	42.340000	491,144.00	
THOMSON REUTERS CORP	29,200	57.760000	1,686,592.00	
TORONTO-DOMINION BANK	157,800	64.130000	10,119,714.00	
TOURMALINE OIL CORP	17,400	36.570000	636,318.00	
TRANSCANADA CORP	73,000	61.410000	4,482,930.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	84,200	4.920000	414,264.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	26,900	23.500000	632,150.00	
VERESEN INC	25,800	12.250000	316,050.00	
VERMILION ENERGY INC	9,500	54.690000	519,555.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,700	48.880000	278,616.00	
WESTON (GEORGE) LTD	4,400	110.160000	484,704.00	
YAMANA GOLD INC	78,300	3.940000	308,502.00	
YAMANA GOLD INC-RTS	4,893	0.290000	1,418.97	
カナダドル 小計	3,445,369		137,075,090.19 (11,548,576,348)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	58,179	20.620000	1,199,650.98	
ALUMINA LTD	207,814	1.700000	353,283.80	

AMCOR LIMITED	101,116	14.910000	1,507,639.56	
AMP LTD	251,120	4.750000	1,192,820.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,894	14.630000	686,059.22	
ASX LTD	16,513	47.850000	790,147.05	
AURIZON HOLDINGS LTD	174,661	4.990000	871,558.39	
AUSNET SERVICES	177,345	1.470000	260,697.15	
AUST AND NZ BANKING GROUP	249,555	28.330000	7,069,893.15	
BANK OF QUEENSLAND LTD	33,034	11.270000	372,293.18	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	39,068	11.840000	462,565.12	
BHP BILLITON LIMITED	273,944	25.910000	7,097,889.04	
BORAL LTD	64,394	4.990000	321,326.06	
BORAL LTD-RTS	29,006	0.210000	6,091.26	
BRAMBLES LTD	138,955	12.130000	1,685,524.15	
CALTEX AUSTRALIA LTD	22,226	30.690000	682,115.94	
CHALLENGER LTD	48,737	10.660000	519,536.42	
CIMIC GROUP LTD	8,678	31.580000	274,051.24	
COCA-COLA AMATIL LTD	50,402	9.500000	478,819.00	
COCHLEAR LTD	4,973	119.170000	592,632.41	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	146,550	78.430000	11,493,916.50	
COMPUTERSHARE LTD	40,980	11.600000	475,368.00	
CROWN RESORTS LTD	31,292	11.890000	372,061.88	
CSL LTD	39,159	99.210000	3,884,964.39	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,200	70.130000	364,676.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	4,889	32.070000	156,790.23	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	130,717	6.220000	813,059.74	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	50,214	4.780000	240,022.92	
HEALTHSCOPE LTD	153,302	2.290000	351,061.58	
INCITEC PIVOT LTD	143,186	3.200000	458,195.20	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	207,272	5.650000	1,171,086.80	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	38,062	20.110000	765,426.82	
LENDLEASE GROUP	47,571	13.520000	643,159.92	
MACQUARIE GROUP LTD	26,548	84.900000	2,253,925.20	
MEDIBANK PRIVATE LTD	231,554	2.560000	592,778.24	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,556	28.870000	6,540,671.72	
NEWCREST MINING LTD	66,345	19.950000	1,323,582.75	
OIL SEARCH LTD	115,174	7.100000	817,735.40	
ORICA LTD	32,108	17.630000	566,064.04	
ORIGIN ENERGY LTD	147,550	6.020000	888,251.00	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	22,463	5.600000	125,792.80	
QANTAS AIRWAYS LTD	49,456	3.210000	158,753.76	
QBE INSURANCE GROUP LTD	119,699	11.190000	1,339,431.81	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,116	71.810000	870,049.96	
REA GROUP LTD	4,706	52.020000	244,806.12	
RIO TINTO LTD	36,526	60.300000	2,202,517.80	
SANTOS LTD	136,442	4.180000	570,327.56	
SEEK LTD	28,172	14.900000	419,762.80	
SONIC HEALTHCARE LTD	34,261	21.900000	750,315.90	
SOUTH32 LTD	461,459	2.850000	1,315,158.15	
SUNCORP GROUP LTD	113,011	12.430000	1,404,726.73	
SYDNEY AIRPORT	98,876	6.250000	617,975.00	
TABCORP HOLDINGS LTD	73,493	4.580000	336,597.94	
TATTS GROUP LTD	125,711	3.930000	494,044.23	
TELSTRA CORP LTD	372,123	4.980000	1,853,172.54	
TPG TELECOM LTD	29,647	7.230000	214,347.81	
TRANSURBAN GROUP	179,664	10.380000	1,864,912.32	
TREASURY WINE ESTATES LTD	62,405	10.700000	667,733.50	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	43,100	5.500000	237,050.00	
WESFARMERS LTD	96,601	42.150000	4,071,732.15	
WESTPAC BANKING CORP	285,160	31.610000	9,013,907.60	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	65,606	30.750000	2,017,384.50	
WOOLWORTHS LTD	109,962	23.500000	2,584,107.00	
オーストラリアドル 小計	6,441,502		93,971,999.43 (7,924,658,711)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	83,883	6.740000	565,371.42	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	75,848	2.884000	218,745.63	
ADMIRAL GROUP PLC	17,892	19.280000	344,957.76	

AGGREKO PLC	21,405	8.060000	172,524.30
ANGLO AMERICAN PLC	119,607	12.540000	1,499,871.78
ANTOFAGASTA PLC	33,362	7.190000	239,872.78
ASHTREAD GROUP PLC	43,602	14.960000	652,285.92
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,739	25.950000	797,677.05
ASTRAZENECA PLC	107,627	42.100000	4,531,096.70
AUTO TRADER GROUP PLC	83,352	4.034000	336,241.96
AVIVA PLC	346,064	4.597000	1,590,856.20
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,015	9.435000	198,276.52
BAE SYSTEMS PLC	270,888	6.085000	1,648,353.48
BARCLAYS PLC	1,441,101	2.154500	3,104,852.10
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	84,546	4.734000	400,240.76
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,800	24.420000	263,736.00
BHP BILLITON PLC	179,733	13.610000	2,446,166.13
BP PLC	1,588,967	4.588500	7,290,975.07
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	158,795	43.720000	6,942,517.40
BT GROUP PLC	718,433	3.581000	2,572,708.57
BUNZL PLC	28,030	20.370000	570,971.10
BURBERRY GROUP PLC	38,598	14.300000	551,951.40
CAPITA PLC	55,833	5.720000	319,364.76
CARNIVAL PLC	16,443	40.980000	673,834.14
CENTRICA PLC	470,301	2.022000	950,948.62
COBHAM PLC	146,591	1.680000	246,272.88
COCA-COLA HBC AG-DI	15,159	16.770000	254,216.43
COMPASS GROUP PLC	140,300	13.660000	1,916,498.00
CRODA INTERNATIONAL PLC	11,135	32.560000	362,555.60
DCC PLC	7,500	62.000000	465,000.00
DIAGEO PLC	214,369	19.960000	4,278,805.24
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	119,741	3.583000	429,032.00
DIXONS CARPHONE PLC	80,598	3.321000	267,665.95
EASYJET PLC	14,108	10.220000	144,183.76
EXPERIAN PLC	82,452	14.620000	1,205,448.24
FRESNILLO PLC	18,319	12.440000	227,888.36
G4S PLC	129,796	2.465000	319,947.14
GKN PLC	142,243	3.105000	441,664.51
GLAXOSMITHKLINE PLC	414,882	15.230000	6,318,652.86
GLENCORE PLC	1,041,139	2.886000	3,004,727.15
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,455	12.180000	261,321.90
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,000	16.800000	201,600.00
HSBC HOLDINGS PLC	1,684,956	6.402000	10,787,088.31
ICAP PLC	46,001	4.905000	225,634.90
IMI PLC	22,591	9.755000	220,375.20
IMPERIAL BRANDS PLC	81,794	34.880000	2,852,974.72
INMARSAT PLC	37,686	7.220000	272,092.92
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	15,616	33.080000	516,577.28
INTERTEK GROUP PLC	13,517	32.210000	435,382.57
INVESTEC PLC	51,588	5.210000	268,773.48
ITV PLC	314,578	1.668000	524,716.10
JOHNSON MATTHEY PLC	16,827	31.850000	535,939.95
KINGFISHER PLC	195,220	3.583000	699,473.26
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	509,447	2.368000	1,206,370.49
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,473,179	0.596800	3,266,393.22
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,045	28.400000	768,078.00
MARKS & SPENCER GROUP PLC	141,602	3.360000	475,782.72
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,700	7.240000	222,268.00
MEGGITT PLC	64,433	4.674000	301,159.84
MERLIN ENTERTAINMENT	59,181	4.379000	259,153.59
MONDI PLC	31,916	16.330000	521,188.28
NATIONAL GRID PLC	321,742	9.099000	2,927,530.45
NEXT PLC	11,900	49.500000	589,050.00
OLD MUTUAL PLC	425,895	1.914000	815,163.03
PEARSON PLC	71,317	7.835000	558,768.69
PERSIMMON PLC	26,770	17.290000	462,853.30
PETROFAC LTD	22,076	8.005000	176,718.38
PROVIDENT FINANCIAL PLC	12,595	29.980000	377,598.10
PRUDENTIAL PLC	219,139	15.595000	3,417,472.70
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,773	56.800000	441,506.40

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,955	67.560000	3,645,199.80	
RELX PLC	94,022	13.740000	1,291,862.28	
RIO TINTO PLC	105,100	31.030000	3,261,253.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	157,440	6.725000	1,058,784.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-PRF C	7,166,662	0.001000	7,166.66	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	295,718	2.032000	600,898.97	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	364,416	20.210000	7,364,847.36	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	318,818	21.175000	6,750,971.15	
ROYAL MAIL PLC	74,288	4.542000	337,416.09	
RSA INSURANCE GROUP PLC	89,040	5.395000	480,370.80	
SAGE GROUP PLC/THE	90,154	6.900000	622,062.60	
SAINSBURY (J) PLC	138,344	2.360000	326,491.84	
SCHRODERS PLC	11,195	28.450000	318,497.75	
SEVERN TRENT PLC	20,885	22.090000	461,349.65	
SHIRE PLC	76,423	46.505000	3,554,051.61	
SKY PLC	86,608	7.575000	656,055.60	
SMITH & NEPHEW PLC	77,012	11.050000	850,982.60	
SMITHS GROUP PLC	32,792	14.030000	460,071.76	
SSE PLC	87,244	14.510000	1,265,910.44	
ST JAMES'S PLACE PLC	43,731	9.425000	412,164.67	
STANDARD CHARTERED PLC	279,857	6.368000	1,782,129.37	
STANDARD LIFE PLC	171,047	3.536000	604,822.19	
TATE & LYLE PLC	38,825	6.745000	261,874.62	
TAYLOR WIMPEY PLC	275,248	1.479000	407,091.79	
TESCO PLC	698,142	2.115000	1,476,570.33	
TRAVIS PERKINS PLC	20,536	14.010000	287,709.36	
TUI AG-DI	41,209	10.570000	435,579.13	
UNILEVER PLC	109,218	31.200000	3,407,601.60	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,822	8.935000	525,574.57	
VODAFONE GROUP PLC	2,260,152	1.994000	4,506,743.08	
WEIR GROUP PLC/THE	17,870	18.140000	324,161.80	
WHITBREAD PLC	15,839	35.110000	556,107.29	
WILLIAM HILL PLC	73,096	2.992000	218,703.23	
WM MORRISON SUPERMARKETS	188,025	2.186000	411,022.65	
WOLSELEY PLC	21,614	47.060000	1,017,154.84	
WORLDPAY GROUP PLC	152,600	2.694000	411,104.40	
WPP PLC	110,325	17.120000	1,888,764.00	
イギリス債券 小計	32,512,007		145,605,084.33 (20,629,328,347)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	167,926	20.850000	3,501,257.10	
ACTELION LTD-REG	8,829	158.000000	1,394,982.00	
ADECCO GROUP AG-REG	14,353	62.300000	894,191.90	
ARYZTA AG	7,336	42.040000	308,405.44	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,410	123.000000	542,430.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	188	1,205.000000	226,540.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	84	4,969.000000	417,396.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	57,825.000000	520,425.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	44,529	64.750000	2,883,252.75	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	159,078	14.050000	2,235,045.90	
DUFREY AG-REG	3,923	126.000000	494,298.00	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	694	508.000000	352,552.00	
GALENICA AG-REG	333	1,020.000000	339,660.00	
GEBERIT AG-REG	3,264	405.000000	1,321,920.00	
GIVAUDAN-REG	793	1,814.000000	1,438,502.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,775	45.520000	854,638.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,528	129.100000	584,564.80	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	38,913	53.850000	2,095,465.05	
LONZA GROUP AG-REG	4,445	180.000000	800,100.00	
NESTLE SA-REG	271,450	67.750000	18,390,737.50	
NOVARTIS AG-REG	190,129	69.750000	13,261,497.75	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,079	63.550000	195,670.45	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,445	494.750000	714,913.75	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	59,833	223.800000	13,390,625.40	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,797	178.200000	320,225.40	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,792	181.200000	687,110.40	
SGS SA-REG	462	2,008.000000	927,696.00	

SIKA AG-BR	186	4,870.000000	905,820.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	4,657	124.000000	577,468.00	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,571	289.500000	744,304.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4,230	56.750000	240,052.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,777	277.400000	770,339.80	
SWISS PRIME SITE-REG	5,922	82.000000	485,604.00	
SWISS RE AG	28,396	93.300000	2,649,346.80	
SWISSCOM AG-REG	2,199	432.600000	951,287.40	
SYNGENTA AG-REG	7,920	393.900000	3,119,688.00	
UBS GROUP AG-REG	312,255	15.980000	4,989,834.90	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,817	269.100000	3,449,054.70	
スイスフラン 小計	1,398,327		87,976,903.19 (9,840,216,621)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	1,025,800	47.100000	48,315,180.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,900	74.550000	1,558,095.00	
BANK OF EAST ASIA LTD	101,620	32.250000	3,277,245.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	318,000	28.650000	9,110,700.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	113,000	10.500000	1,186,500.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	57,000	64.650000	3,685,050.00	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	229,368	51.500000	11,812,452.00	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	230,868	95.600000	22,070,980.80	
CLP HOLDINGS LTD	144,000	74.050000	10,663,200.00	
FIRST PACIFIC CO	184,000	5.330000	980,720.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	202,000	37.400000	7,554,800.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	187,000	17.220000	3,220,140.00	
HANG SENG BANK LTD	66,000	147.000000	9,702,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	91,354	42.450000	3,877,977.30	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	225,000	9.770000	2,198,250.00	
HONG KONG & CHINA GAS	655,335	14.360000	9,410,610.60	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	98,800	203.800000	20,135,440.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	53,000	33.750000	1,788,750.00	
KERRY PROPERTIES LTD	56,500	20.900000	1,180,850.00	
LI & FUNG LTD	514,000	3.360000	1,727,040.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	78,800	16.780000	1,322,264.00	
MTR CORP	125,000	38.650000	4,831,250.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	479,000	8.510000	4,076,290.00	
NWS HOLDINGS LTD	130,500	13.800000	1,800,900.00	
PCCW LTD	365,000	4.400000	1,606,000.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	122,000	72.900000	8,893,800.00	
SANDS CHINA LTD	209,200	38.650000	8,085,580.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	108,000	8.600000	928,800.00	
SINO LAND CO	259,400	11.540000	2,993,476.00	
SJM HOLDINGS LTD	166,000	6.230000	1,034,180.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	123,000	101.200000	12,447,600.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	46,000	76.950000	3,539,700.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	98,600	22.500000	2,218,500.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	117,500	29.600000	3,478,000.00	
WH GROUP LTD	674,500	6.210000	4,188,645.00	
WHARF HOLDINGS LTD	118,000	54.900000	6,478,200.00	
WHEELLOCK & CO LTD	69,000	42.350000	2,922,150.00	
WYNN MACAU LTD	132,400	13.600000	1,800,640.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	62,500	27.500000	1,718,750.00	
香港ドル 小計	8,057,945		247,820,705.70 (3,635,529,752)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	216,500	3.010000	651,665.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,000	8.350000	300,600.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	187,200	2.430000	454,896.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	150,800	16.800000	2,533,440.00	
GENTING SINGAPORE PLC	524,900	0.955000	501,279.50	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	226,800	2.040000	462,672.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	614,960	0.430000	264,432.80	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,400	39.510000	331,884.00	
KEPPEL CORP LTD	121,500	5.370000	652,455.00	
NOBLE GROUP LTD	742,490	0.181000	134,390.69	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	266,800	8.780000	2,342,504.00	

SEBACORP INDUSTRIES LTD	86,400	2.720000	235,008.00	
SEBACORP MARINE LTD	78,800	1.425000	112,290.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	48,740	9.750000	475,215.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,600	7.140000	489,804.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	136,150	3.650000	496,947.50	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	134,000	3.270000	438,180.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	683,160	3.730000	2,548,186.80	
STARHUB LTD	56,000	2.870000	160,720.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	111,800	19.900000	2,224,820.00	
UOL GROUP LTD	41,400	5.770000	238,878.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	164,200	3.460000	568,132.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	152,100	0.805000	122,440.50	
シンガポールドル 小計	4,857,700		16,740,840.79 (1,329,055,350)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,050	6.285000	503,114.25	
CONTACT ENERGY LTD	63,167	4.670000	294,989.89	
FLETCHER BUILDING LTD	56,137	10.610000	595,613.57	
MERCURY NZ LTD	64,387	2.970000	191,229.39	
MERIDIAN ENERGY LTD	110,048	2.530000	278,421.44	
RYMAN HEALTHCARE LTD	31,781	8.460000	268,867.26	
SPARK NEW ZEALAND LTD	148,562	3.480000	516,995.76	
ニュージーランドドル 小計	554,132		2,649,231.56 (211,090,770)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	24,561	139.500000	3,426,259.50	
ASSA ABLOY AB-B	85,572	166.700000	14,264,852.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	57,350	282.800000	16,218,580.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	32,771	250.800000	8,218,966.80	
BOLIDEN AB	23,759	244.100000	5,799,571.90	
ELECTROLUX AB-SER B	19,869	214.000000	4,251,966.00	
ERICSSON LM-B SHS	262,713	47.790000	12,555,054.27	
GETINGE AB-B SHS	16,945	144.800000	2,453,636.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	80,581	270.300000	21,781,044.30	
HEXAGON AB-B SHS	21,742	311.000000	6,761,762.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	34,745	67.550000	2,347,024.75	
ICA GRUPPEN AB	6,699	273.900000	1,834,856.10	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13,420	160.900000	2,159,278.00	
INVESTOR AB-B SHS	38,820	311.400000	12,088,548.00	
KINNEVIK AB - B	19,673	223.500000	4,396,915.50	
LUNDIN PETROLEUM AB	15,789	170.900000	2,698,340.10	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,596	402.000000	2,249,592.00	
NORDEA BANK AB	258,380	97.250000	25,127,455.00	
SANDVIK AB	91,851	111.600000	10,250,571.60	
SECURITAS AB-B SHS	26,666	132.300000	3,527,911.80	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,781	92.750000	12,129,937.75	
SKANSKA AB-B SHS	29,451	208.200000	6,131,698.20	
SKF AB-B SHARES	33,628	165.400000	5,562,071.20	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	51,921	244.100000	12,673,916.10	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	129,665	127.400000	16,519,321.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	77,586	213.900000	16,595,645.40	
SWEDISH MATCH AB	16,176	287.500000	4,650,600.00	
TELE2 AB-B SHS	31,267	70.250000	2,196,506.75	
TELIA CO AB	223,823	34.680000	7,762,181.64	
VOLVO AB-B SHS	131,868	99.050000	13,061,525.40	
スウェーデンクローネ 小計	1,993,668		259,695,589.46 (3,194,255,750)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	84,076	124.100000	10,433,831.60	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,745	139.100000	2,329,229.50	
MARINE HARVEST	32,200	150.800000	4,855,760.00	
NORSK HYDRO ASA	113,101	40.750000	4,608,865.75	
ORKLA ASA	67,480	75.900000	5,121,732.00	
SCHIBSTED ASA-B SHS	7,743	176.600000	1,367,413.80	
SCHIBSTED ASA-CL A	6,419	183.500000	1,177,886.50	
STATOIL ASA	96,240	146.400000	14,089,536.00	
TELENOR ASA	64,708	124.600000	8,062,616.80	
YARA INTERNATIONAL ASA	14,780	320.000000	4,729,600.00	

ノルウェークローネ 小計	503,492		56,776,471.95 (751,152,723)
デンマーククローネ			
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	326	8,635.000000	2,815,010.00
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	530	9,085.000000	4,815,050.00
CARLSBERG AS-B	9,359	584.500000	5,470,335.50
CHR HANSEN HOLDING A/S	8,471	399.800000	3,386,705.80
COLOPLAST-B	9,952	443.400000	4,412,716.80
DANSKE BANK A/S	59,491	204.300000	12,154,011.30
DSV A/S	15,974	308.800000	4,932,771.20
GENMAB A/S	4,873	1,227.000000	5,979,171.00
ISS A/S	14,188	243.500000	3,454,778.00
NOVO NORDISK A/S-B	163,028	221.000000	36,029,188.00
NOVOZYMES A/S-B SHARES	19,319	243.200000	4,698,380.80
PANDORA A/S	9,547	822.500000	7,852,407.50
TDC A/S	67,599	35.070000	2,370,696.93
TRYG A/S	10,013	128.400000	1,285,669.20
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	19,049	463.100000	8,821,591.90
WILLIAM DEMANT HOLDING	9,844	116.000000	1,141,904.00
デンマーククローネ 小計	421,563		109,620,387.93 (1,769,273,061)
イスラエルシェケル			
AZRIELI GROUP LTD	3,618	161.000000	582,498.00
BANK HAPOALIM BM	87,790	23.330000	2,048,140.70
BANK LEUMI LE-ISRAEL	119,697	15.560000	1,862,485.32
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	173,721	6.950000	1,207,360.95
ISRAEL CHEMICALS LTD	43,897	14.270000	626,410.19
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,258	54.000000	607,932.00
NICE LTD	4,991	254.500000	1,270,209.50
イスラエルシェケル 小計	444,972		8,205,036.66 (241,146,027)
ユーロ			
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	53,946	12.470000	672,706.62
ABN AMRO GROUP NV-CVA	19,900	20.280000	403,572.00
ACCOR SA	14,309	33.725000	482,571.02
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	16,393	27.165000	445,315.84
ADIDAS AG	16,012	138.650000	2,220,063.80
ADP	2,582	91.920000	237,337.44
AEGON NV	157,734	4.824000	760,908.81
AENA SA	5,641	126.000000	710,766.00
AGEAS	16,342	35.645000	582,510.59
AIR LIQUIDE SA	33,017	94.590000	3,123,078.03
AIRBUS GROUP SE	49,913	60.040000	2,996,776.52
AKZO NOBEL	21,213	58.880000	1,249,021.44
ALLIANZ SE-REG	38,856	150.800000	5,859,484.80
ALSTOM	12,893	26.435000	340,826.45
ALTICE NV - A	31,129	16.075000	500,398.67
ALTICE NV - B	9,666	16.045000	155,090.97
AMADEUS IT GROUP SA	37,837	42.315000	1,601,072.65
ANDRITZ AG	6,102	48.135000	293,719.77
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,598	96.540000	6,622,450.92
ARCELORMITTAL	158,583	7.175000	1,137,833.02
ARKEMA	5,698	89.200000	508,261.60
ASML HOLDING NV	31,399	99.370000	3,120,118.63
ASSICURAZIONI GENERALI	100,224	11.250000	1,127,520.00
ATLANTIA SPA	36,098	19.610000	707,881.78
ATOS SE	7,337	97.970000	718,805.89
AXA SA	165,210	22.270000	3,679,226.70
AXEL SPRINGER SE	3,681	41.620000	153,203.22
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	561,274	5.822000	3,267,737.22
BANCO DE SABADELL SA	440,218	1.200000	528,261.60
BANCO POPULAR ESPANOL	286,905	0.844000	242,147.82
BANCO SANTANDER SA	1,245,033	4.305000	5,359,867.06
BANK OF IRELAND	2,361,870	0.211000	498,354.57
BANKIA SA	377,881	0.855000	323,088.25
BANKINTER SA	55,570	6.968000	387,211.76
BASF SE	78,139	80.610000	6,298,784.79
BAYER AG-REG	70,445	88.750000	6,251,993.75

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,335	82.510000	2,337,920.85	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,483	69.270000	310,537.41	
BEIERSDORF AG	8,361	76.970000	643,546.17	
BNP PARIBAS	90,222	55.290000	4,988,374.38	
BOLLORE	74,721	2.986000	223,116.90	
BOSKALIS WESTMINSTER	7,291	29.210000	212,970.11	
BOUYGUES SA	17,184	32.385000	556,503.84	
BRENNTAG AG	12,913	48.500000	626,280.50	
BUREAU VERITAS SA	22,993	17.275000	397,204.07	
CAIXABANK S.A	271,431	2.802000	760,549.66	
CAIXABANK-RTS	271,431	0.038000	10,314.37	
CAPGEMINI	14,087	75.490000	1,063,427.63	
CARREFOUR SA	47,735	22.275000	1,063,297.12	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,786	44.350000	212,259.10	
CHRISTIAN DIOR SE	4,567	179.450000	819,548.15	
CNH INDUSTRIAL NV	88,951	8.140000	724,061.14	
CNP ASSURANCES	14,477	16.495000	238,798.11	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	18,300	31.850000	582,855.00	
COLRUYT SA	5,561	48.130000	267,650.93	
COMMERZBANK AG	92,342	6.721000	620,630.58	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	42,321	41.040000	1,736,853.84	
CONTINENTAL AG	9,363	163.350000	1,529,446.05	
COVESTRO AG	5,900	59.880000	353,292.00	
CREDIT AGRICOLE SA	91,176	10.880000	991,994.88	
CRH PLC	71,885	31.900000	2,293,131.50	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	81,993	64.590000	5,295,927.87	
DANONE	50,377	58.960000	2,970,227.92	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,758	72.070000	775,329.06	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	117,861	14.850000	1,750,235.85	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	16,523	75.500000	1,247,486.50	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	20,268	12.645000	256,288.86	
DEUTSCHE POST AG-REG	82,775	29.240000	2,420,341.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	274,722	14.710000	4,041,160.62	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	28,205	28.390000	800,739.95	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	51,736	4.436000	229,500.89	
E.ON SE	173,250	6.035000	1,045,563.75	
EDENRED	17,386	19.520000	339,374.72	
EDF	21,422	10.095000	216,255.09	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	199,124	2.692000	536,041.80	
EIFFAGE	5,100	62.560000	319,056.00	
ELISA OYJ	12,193	29.600000	360,912.80	
ENAGAS SA	19,229	23.125000	444,670.62	
ENDESA SA	26,644	19.140000	509,966.16	
ENEL SPA	657,259	3.728000	2,450,261.55	
ENGIE	126,199	11.420000	1,441,192.58	
ENI SPA	217,859	12.750000	2,777,702.25	
ERSTE GROUP BANK AG	25,394	26.600000	675,480.40	
ESSILOR INTERNATIONAL	17,571	98.540000	1,731,446.34	
EURAZEO	3,447	52.400000	180,622.80	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,695	16.585000	243,716.57	
EVONIK INDUSTRIES AG	13,610	26.120000	355,493.20	
EXOR SPA	9,511	39.380000	374,543.18	
FERRARI NV	10,300	52.100000	536,630.00	
FERROVIAL SA	43,142	16.470000	710,548.74	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,276	7.325000	558,721.70	
FORTUM OYJ	37,577	13.630000	512,174.51	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,596	53.640000	192,889.44	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	18,742	73.430000	1,376,225.06	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,949	66.800000	2,334,593.20	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,825	37.755000	219,922.87	
GALP ENERGIA SGPS SA	39,341	12.750000	501,597.75	
GAS NATURAL SDG SA	29,439	16.100000	473,967.90	
GEA GROUP AG	15,150	34.370000	520,705.50	
GEMALTO	6,637	48.525000	322,060.42	
GRIFOLS SA	24,758	18.155000	449,481.49	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,778	76.650000	519,533.70	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	39,998	8.255000	330,183.49	

HANNOVER RUECK SE	4,980	100.300000	499,494.00
HEIDELBERGCEMENT AG	12,074	84.000000	1,014,216.00
HEINEKEN HOLDING NV	8,530	65.670000	560,165.10
HEINEKEN NV	19,746	70.950000	1,400,978.70
HENKEL AG & CO KGAA	8,743	93.160000	814,497.88
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,189	107.650000	1,635,095.85
HERMES INTERNATIONAL	2,280	379.400000	865,032.00
HOCHTIEF AG	1,765	132.550000	233,950.75
HUGO BOSS AG -ORD	5,580	55.090000	307,402.20
IBERDROLA SA	467,510	5.598000	2,617,120.98
ILIAD SA	2,203	177.750000	391,583.25
IMERYS SA	2,991	66.280000	198,243.48
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	92,861	32.050000	2,976,195.05
INFINEON TECHNOLOGIES AG	96,701	16.370000	1,582,995.37
ING GROEP NV	330,279	12.800000	4,227,571.20
INGENICO GROUP	4,551	73.170000	332,996.67
INNOGY SE	11,760	32.675000	384,258.00
INTESA SANPAOLO	1,085,237	2.040000	2,213,883.48
INTESA SANPAOLO-RSP	76,858	1.900000	146,030.20
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	68,467	5.194000	355,617.59
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248		
JCDECAUX SA	6,227	24.475000	152,405.82
JERONIMO MARTINS	20,695	14.705000	304,319.97
K+S AG-REG	16,120	18.955000	305,554.60
KBC GROEP NV	21,546	56.940000	1,226,829.24
KERING	6,495	200.700000	1,303,546.50
KERRY GROUP PLC-A	14,191	66.000000	936,606.00
KONE OYJ-B	28,894	41.770000	1,206,902.38
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	109,266	19.460000	2,126,316.36
KONINKLIJKE DSM NV	15,634	57.740000	902,707.16
KONINKLIJKE KPN NV	286,118	2.685000	768,226.83
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79,492	27.630000	2,196,363.96
LAGARDERE SCA	10,000	22.850000	228,500.00
LANXESS AG	7,650	58.470000	447,295.50
LEGRAND SA	22,940	52.200000	1,197,468.00
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	33,384	12.110000	404,280.24
LINDE AG	15,835	153.500000	2,430,672.50
L'OREAL	21,533	160.200000	3,449,586.60
LUXOTTICA GROUP SPA	14,610	48.520000	708,877.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,744	168.250000	3,994,928.00
MAN SE	2,945	93.170000	274,385.65
MAPFRE SA	87,663	2.790000	244,579.77
MEDIOBANCA SPA	47,688	6.285000	299,719.08
MERCK KGAA	11,116	94.440000	1,049,795.04
METRO AG	15,157	27.615000	418,560.55
METSO OYJ	9,518	27.000000	256,986.00
MICHELIN (CGDE)	15,530	101.400000	1,574,742.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,686	174.250000	2,384,785.50
NATIXIS	78,682	4.720000	371,379.04
NESTE OYJ	10,713	38.450000	411,914.85
NN GROUP NV	27,208	30.370000	826,306.96
NOKIA OYJ	497,773	4.036000	2,009,011.82
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,440	33.620000	317,372.80
OCI NV	8,186	13.695000	112,107.27
OMV AG	12,438	30.565000	380,167.47
ORANGE	169,327	13.710000	2,321,473.17
ORION OYJ-CLASS B	8,539	40.190000	343,182.41
OSRAM LICHT AG	7,529	47.695000	359,095.65
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,000	103.350000	723,450.00
PERNOD RICARD SA	18,169	98.000000	1,780,562.00
PEUGEOT SA	42,154	14.115000	595,003.71
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	13,276	48.590000	645,080.84
POSTE ITALIANE SPA	42,600	5.630000	239,838.00
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18,361	32.265000	592,417.66
PROXIMUS	12,884	26.465000	340,975.06
PRYSMIAN SPA	16,076	22.160000	356,244.16
PUBLICIS GROUPE	16,320	61.220000	999,110.40

QIAGEN N.V.	18,863	25.760000	485,910.88	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	10,412	16.980000	176,795.76	
RANDSTAD HOLDING NV	9,826	49.000000	481,474.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	36,739	16.725000	614,459.77	
RELX NV	85,947	15.160000	1,302,956.52	
REMY COINTREAU	1,861	75.400000	140,319.40	
RENAULT SA	16,466	73.340000	1,207,616.44	
REPSOL SA	95,625	12.300000	1,176,187.50	
REXEL SA	25,170	14.270000	359,175.90	
RTL GROUP	3,173	65.110000	206,594.03	
RWE AG	41,076	11.720000	481,410.72	
SAFRAN SA	26,711	63.870000	1,706,031.57	
SAIPEM SPA	517,023	0.411700	212,858.36	
SAMPO OYJ-A SHS	38,092	41.860000	1,594,531.12	
SANOFI	98,619	74.580000	7,355,005.02	
SAP SE	83,663	80.780000	6,758,297.14	
SCHAEFFLER AG	14,100	12.320000	173,712.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	47,669	62.000000	2,955,478.00	
SCOR SE	13,715	30.175000	413,850.12	
SES	30,408	20.510000	623,668.08	
SFR GROUP SA	9,176	23.400000	214,718.40	
SIEMENS AG-REG	65,122	107.250000	6,984,334.50	
SNAM SPA	209,201	3.456000	722,998.65	
SOCIETE BIC SA	2,376	122.600000	291,297.60	
SOCIETE GENERALE SA	65,371	40.045000	2,617,781.69	
SODEXO	7,869	100.550000	791,227.95	
SOLVAY SA	6,293	104.950000	660,450.35	
STMICROELECTRONICS NV	53,369	9.349000	498,946.78	
STORA ENSO OYJ-R SHS	45,511	9.110000	414,605.21	
SUEZ	28,312	13.200000	373,718.40	
SYMRISE AG	10,316	56.050000	578,211.80	
TECHNIP SA	9,241	66.060000	610,460.46	
TELECOM ITALIA SPA	850,988	0.705000	599,946.54	
TELECOM ITALIA-RSP	498,425	0.572500	285,348.31	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62,780	3.587000	225,191.86	
TELEFONICA SA	375,083	7.914000	2,968,406.86	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,702	49.135000	231,032.77	
TENARIS SA	41,329	14.660000	605,883.14	
TERNA SPA	130,650	3.880000	506,922.00	
THALES SA	9,068	91.290000	827,817.72	
THYSSENKRUPP AG	30,741	21.930000	674,150.13	
TOTAL SA	190,209	44.095000	8,387,265.85	
UBI BANCA SPA	77,234	2.070000	159,874.38	
UCB SA	10,698	61.560000	658,568.88	
UMICORE	7,957	56.030000	445,830.71	
UNICREDIT SPA	451,849	1.988000	898,275.81	
UNILEVER NV-CVA	138,673	36.695000	5,088,605.73	
UNIPOLSAI SPA	92,669	1.760000	163,097.44	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	10,254	36.590000	375,193.86	
UPM-KYMMENE OYJ	45,883	21.740000	997,496.42	
VALEO SA	20,536	53.380000	1,096,211.68	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,487	16.335000	628,685.14	
VINCI SA	43,086	60.110000	2,589,899.46	
VIVENDI	99,554	17.775000	1,769,572.35	
VOESTALPINE AG	10,091	36.490000	368,220.59	
VOLKSWAGEN AG	2,738	133.250000	364,838.50	
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,819	124.700000	1,972,629.30	
VONOVIA SE	40,062	30.530000	1,223,092.86	
VOPAK	5,939	44.215000	262,592.88	
WARTSILA OYJ ABP	12,283	40.870000	502,006.21	
WENDEL	2,512	108.250000	271,924.00	
WOLTERS KLUWER	26,237	33.800000	886,810.60	
ZALANDO SE	7,362	35.345000	260,209.89	
ZARDOYA OTIS SA	15,450	7.450000	115,102.50	
ZODIAC AEROSPACE	17,267	20.495000	353,887.16	
グループ小計	20,059,918		277,707,945.51 (33,341,615,937)	

合計	107,209,178		283,031,184,310 (283,031,184,310)	
----	-------------	--	--------------------------------------	--

(注1) 通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

通貨種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカドル				
投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	27,125.00	513,205.00	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,200.00	685,844.00	
	AMERICAN TOWER CORP	36,149.00	3,859,990.22	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	87,112.00	878,088.96	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,662.00	1,871,051.28	
	BOSTON PROPERTIES INC	13,130.00	1,607,505.90	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	25,319.00	617,277.22	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,300.00	567,356.00	
	CROWN CASTLE INTL CORP	28,710.00	2,416,233.60	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,697.00	1,228,620.90	
	DUKE REALTY CORP	29,967.00	741,083.91	
	EQUINIX INC	5,908.00	1,998,144.68	
	EQUITY RESIDENTIAL	31,110.00	1,842,023.10	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,621.00	1,189,403.60	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,822.00	753,644.08	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,123.00	858,138.45	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	49,374.00	1,254,593.34	
	HCP INC	39,532.00	1,166,589.32	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	64,072.00	1,082,176.08	
	IRON MOUNTAIN INC	21,060.00	697,086.00	
	KIMCO REALTY CORP	36,181.00	943,238.67	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,312.00	478,936.80	
	MACERICH CO/THE	10,943.00	756,708.45	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,300.00	572,355.00	
	PROLOGIS INC	44,645.00	2,219,302.95	
	PUBLIC STORAGE	12,527.00	2,565,028.52	
	REALTY INCOME CORP	22,074.00	1,238,792.88	
	REGENCY CENTERS CORP	8,505.00	567,113.40	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	26,354.00	4,763,749.04	
	SL GREEN REALTY CORP	8,404.00	885,613.52	
	UDR INC	23,121.00	772,010.19	
	VENTAS INC	28,825.00	1,728,058.75	
	VEREIT INC	80,434.00	667,602.20	
	VORNADO REALTY TRUST	14,628.00	1,411,455.72	
	WELLTOWER INC	30,390.00	1,889,650.20	
	WEYERHAEUSER CO	63,631.00	2,024,102.11	
	投資証券 小計	949,267.00	49,311,774.04 (5,610,693,650)	
アメリカドル 小計		949,267.00	49,311,774.04 (5,610,693,650)	
カナダドル				
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	11,200.00	236,432.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,100.00	344,137.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	5,400.00	163,674.00	
	投資証券 小計	29,700.00	744,243.00 (62,702,472)	
カナダドル 小計		29,700.00	744,243.00 (62,702,472)	
オーストラリアドル				
投資証券	DEXUS PROPERTY GROUP	82,410.00	740,865.90	
	GOODMAN GROUP	157,758.00	1,034,892.48	
	GPT GROUP	153,251.00	720,279.70	
	MIRVAC GROUP	314,352.00	638,134.56	
	SCENTRE GROUP	463,338.00	1,927,486.08	
	STOCKLAND	214,626.00	910,014.24	
	VICINITY CENTRES	285,545.00	810,947.80	
	WESTFIELD CORP	172,989.00	1,596,688.47	

投資証券 小計		1,844,269.00	8,379,309.23 (706,627,147)
オーストラリアドル 小計		1,844,269.00	8,379,309.23 (706,627,147)
イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	84,904.00	502,207.16
	HAMMERSON PLC	66,570.00	365,469.30
	INTU PROPERTIES PLC	78,880.00	211,713.92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	68,027.00	659,521.76
	SEGRO PLC	70,007.00	287,518.74
投資証券 小計		368,388.00	2,026,430.88 (287,104,727)
イギリスポンド 小計		368,388.00	2,026,430.88 (287,104,727)
香港ドル			
投資証券	LINK REIT	192,000.00	10,070,400.00
	投資証券 小計	192,000.00	10,070,400.00 (147,732,768)
香港ドル 小計		192,000.00	10,070,400.00 (147,732,768)
シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	196,000.00	450,800.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	176,500.00	260,337.50
	CAPITALAND MALL TRUST	210,100.00	403,392.00
	SUNTEC REIT	210,600.00	343,278.00
投資証券 小計		793,200.00	1,457,807.50 (115,735,337)
シンガポールドル 小計		793,200.00	1,457,807.50 (115,735,337)
ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	2,877.00	213,329.55
	GECINA SA	3,379.00	410,548.50
	ICADE	3,129.00	196,501.20
	KLEPIERRE	18,390.00	648,707.25
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,468.00	1,779,550.20
投資証券 小計		36,243.00	3,248,636.70 (390,031,322)
ユーロ 小計		36,243.00	3,248,636.70 (390,031,322)
合計			7,320,627,423 (7,320,627,423)

(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 587銘柄	97.11%		64.96%
	投資証券 36銘柄		2.89%	1.93%
カナダドル	株式 91銘柄	99.46%		3.98%
	投資証券 3銘柄		0.54%	0.02%
オーストラリアドル	株式 63銘柄	91.81%		2.73%
	投資証券 8銘柄		8.19%	0.24%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.63%		7.10%
	投資証券 5銘柄		1.37%	0.10%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.00%		3.39%
香港ドル	株式 39銘柄	96.10%		1.25%
	投資証券 1銘柄		3.90%	0.05%
シンガポールドル	株式 23銘柄	91.99%		0.46%
	投資証券 4銘柄		8.01%	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%		1.10%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%		0.26%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.00%		0.61%
イスラエルシェケル	株式 7銘柄	100.00%		0.08%
ユーロ	株式 235銘柄	98.84%		11.48%
	投資証券 5銘柄		1.16%	0.13%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「マネーパブルファンド（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 11 期	第 12 期
	[平成28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,432	26,760
親投資信託受益証券	10,079,521	10,078,963
未収入金	9	7
流動資産合計	10,104,962	10,105,730
資産合計	10,104,962	10,105,730
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	69	555
未払委託者報酬	125	985
流動負債合計	194	1,540
負債合計	194	1,540
純資産の部		
元本等		
元本	10,071,726	10,071,726
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	33,042	32,464
(分配準備積立金)	(2,302)	(10,531)
元本等合計	10,104,768	10,104,190
純資産合計	10,104,768	10,104,190
負債純資産合計	10,104,962	10,105,730

(2) 損益及び剰余金計算書

	第 11 期	第 12 期
	自 平成27年11月21日 至 平成28年 5月20日	自 平成28年 5月21日 至 平成28年11月21日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
有価証券売買等損益	24	962
営業収益合計	24	962
営業費用		
受託者報酬	69	555
委託者報酬	125	985
営業費用合計	194	1,540
営業利益又は営業損失 ()	218	578
経常利益又は経常損失 ()	218	578
当期純利益又は当期純損失 ()	218	578
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 ()	369	33,042
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	
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	33,042	32,464

(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。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年5月20日および11月20日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成28年5月21日から平成28年11月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 11 期 [平成28年5月20日現在]	第 12 期 [平成28年11月21日現在]
1 期首元本額	104,617円	10,071,726円
期中追加設定元本額	9,967,109円	
期中一部解約元本額		
2 受益権の総数	10,071,726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)	1.0033円 (10,033円)	1.0032円 (10,032円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	

第 12 期 (自 平成28年5月21日 至 平成28年11月21日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	8,229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	2,302円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,031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	44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 11 期 (自 平成27年11月21日 至 平成28年 5月20日)	第 12 期 (自 平成28年 5月21日 至 平成28年11月21日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券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 11 期	第 12 期
	[平成28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同 左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 11 期	第 12 期
	[平成28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1	989
合計	1	989

(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	9,896,861	10,078,963	
	親投資信託受益証券 小計	9,896,861	10,078,963	
合計		9,896,861	10,078,963	

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28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	389,098,836	976,375,992
国債証券	183,838,087	
特殊債券	400,320,000	
社債券	1,584,386,540	1,079,434,116
現先取引勘定	2,999,995,107	3,099,994,388
未収利息	3,637,299	2,400,117
前払費用	1,866,813	
流動資産合計	5,563,142,682	5,158,204,613
資産合計	5,563,142,682	5,158,204,613
負債の部		
流動負債		
未払解約金	670,530	737,656,790
未払利息	633	1,401
その他未払費用	955	
流動負債合計	672,118	737,658,191
負債合計	672,118	737,658,191
純資産の部		
元本等		
元本	5,462,308,836	4,340,785,954
剰余金		
剰余金又は欠損金()	100,161,728	79,760,468
元本等合計	5,562,470,564	4,420,546,422
純資産合計	5,562,470,564	4,420,546,422
負債純資産合計	5,563,142,682	5,158,204,613

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	[平成28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
1 期首		
期首元本額	平成27年11月21日 27,329,169,583円	平成28年5月21日 5,462,308,836円
期首からの追加設定元本額	1,544,863,883円	1,301,104,721円
期首からの一部解約元本額	23,411,724,630円	2,422,627,603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	249,380,519円	260,403,123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)	8,898,354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	62,265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	3,078,471円
三菱UFJ 新興国債券ファンド 通貨選択シリーズ<マ ネーブルファンド>	334,011,007円	309,607,834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)	89,620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・マネーボール・ファンド	2,017,042円	2,016,989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	26,506,400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	2,272,200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	15,211,722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	393,503円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	6,363,253円	6,333,539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)	217,654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<マネーボールファンド>	24,781,723円	25,034,575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	1,364,852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)	945,824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<マネーボールファンド>	3,491,872円	3,491,685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)	47,026,508円	31,208,972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	756,099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	684,529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	
新興国ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	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)	20,181,510円	12,561,714円
PIMCO ニューワールド円インカムファンド(年2回分配型)	109,209円	69,931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)	158,381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)	40,278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)	955,887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)	1,559,264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)	442,974円	442,974円

ビクテ・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
ビクテ・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
ビクテ・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	12,234,366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
パリュール・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
パリュール・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
パリュール・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
パリュール・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)	9,834,580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	13,128,307円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(毎月分配型)	3,730,759円	3,730,759円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(毎月分配型)	5,059,469円	5,059,469円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	2,347,787円	1,395,312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)	163,666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	4,117,720円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<豪ドルコース>(年2回分配型)	686,803円	686,803円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>(年2回分配型)	627,788円	961,645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	27,087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	365,661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>	978,045円	977,814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>	979,977円	979,545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	3,730,849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)	8,859,081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	
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 / ピムコ 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)	357,495円	1,084,126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)	3,874,252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/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	4,824,746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	40,262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	564,702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	89,371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
マクロ・トータル・リターン・ファンド		9,820円
Naviio インド債券ファンド	885,566円	885,566円
Naviio マネーボールファンド	1,561,630円	2,298,520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2013-09(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)	3,276,286,700円	2,559,476,016円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	42,678,508円	42,678,508円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	365,273,064円	365,273,064円
三菱UFJ/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
マネーボールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,898,381円	9,896,861円
MUAMトピックスリスクコントロール(5%)インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	8,107,178円	6,999,249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)	255,538,832円	133,410,509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)	10,766,608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) (合計)	21,620,196円	21,620,196円
2 受益権の総数	5,462,308,836円	4,340,785,954円
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0183円 (10,183円)	1.0184円 (10,184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11月21日 至平成28年5月20日)	(自平成28年5月21日 至平成28年11月21日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	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28年5月20日現在]	[平成28年11月21日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	66,288	
特殊債券	542,000	
社債券	2,592,900	3,826,424
合計	3,201,188	3,826,424

(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
社債券	第3回コニカミノルタホールディングス	200,000,000	200,020,000	
	第3回興銀リース	100,000,000	100,000,000	
	第113回オリックス	100,000,000	100,882,000	
	第156回オリックス	100,000,000	100,193,000	
	第300回北陸電力	177,900,000	177,907,116	
	第459回東北電力	200,000,000	200,408,000	

第282回四国電力	200,000,000	200,024,000	
社債券 小計	1,077,900,000	1,079,434,116	
合計	1,077,900,000	1,079,434,116	

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12月30日現在
(単位：円)

資産総額	7,530,969,074
負債総額	996,665
純資産総額(-)	7,529,972,409
発行済口数	3,700,000 口
1口当たり純資産価額(/)	2,035.13 (100口当たり 203,513)

<参考>

「MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)」の現況
純資産額計算書

平成28年12月30日現在
(単位：円)

資産総額	7,516,409,447
負債総額	780,354
純資産総額(-)	7,515,629,093
発行済口数	3,687,122,914 口
1口当たり純資産価額(/)	2.0383 (1万口当たり 20,383)

<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12月30日現在
(単位：円)

資産総額	356,292,541,835
負債総額	803,622,233
純資産総額(-)	355,488,919,602
発行済口数	155,853,270,378 口
1口当たり純資産価額(/)	2.2809 (1万口当たり 22,809)

<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12月30日現在
(単位：円)

資産総額	10,104,183
負債総額	324
純資産総額(-)	10,103,859
発行済口数	10,071,726 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0032 (1万口当たり 10,032)

<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12月30日現在
(単位：円)

資産総額	1,698,173,646
負債総額	5,157,040
純資産総額(-)	1,693,016,606
発行済口数	1,662,430,381 口
1口当たり純資産価額(/)	1.0184 (1万口当たり 10,184)

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9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成28年9月末現在)	事業の内容
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
クレディ・スイス証券株式会社	78,100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	4,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
モルガン・スタンレーMUFJ証券株式会社	62,149 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。

3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成28年12月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%（107,855株）を所有しています。

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

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成28年9月7日 有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書

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29年1月5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28年6月9日から平成28年12月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信の平成28年12月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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