

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年3月7日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町2番1号）

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信（「ファンド」といいます。）  
「MAXIS（マクス）」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の受益権です。  
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：営業日の9:00～17:00）  
ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>  
MAXIS専用サイト <https://maxis.mukam.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。

### （５）【申込手数料】

販売会社が定める額  
申込手数料は販売会社にご確認ください。

### （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。

### （７）【申込期間】

平成30年 3月 8日から平成31年 3月 7日まで  
申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

( 8 ) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJ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：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。

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です。

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

信託金の限度額は、1兆円です。

\* 委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

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	年1回	グローバル (日本を除く)	ファミリー ファンド	あり ( )	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回					
大型株	年4回	日本			TOPIX	条件付運用型
中小型株	年6回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコク サイ インデ ックス(円換 算ベース))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
債券	(隔月)	欧州				
一般	年12回	アジア				
公債	(毎月)	オセアニア				
社債	日々	中南米				
その他債券	その他	アフリカ				
クレジット	( )	中近東 (中東)				その他 ( )
属性 ( )		エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))						
資産複合 ( )						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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

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

#### 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
--------	----	----	---------------------------------

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

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

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

## [ 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

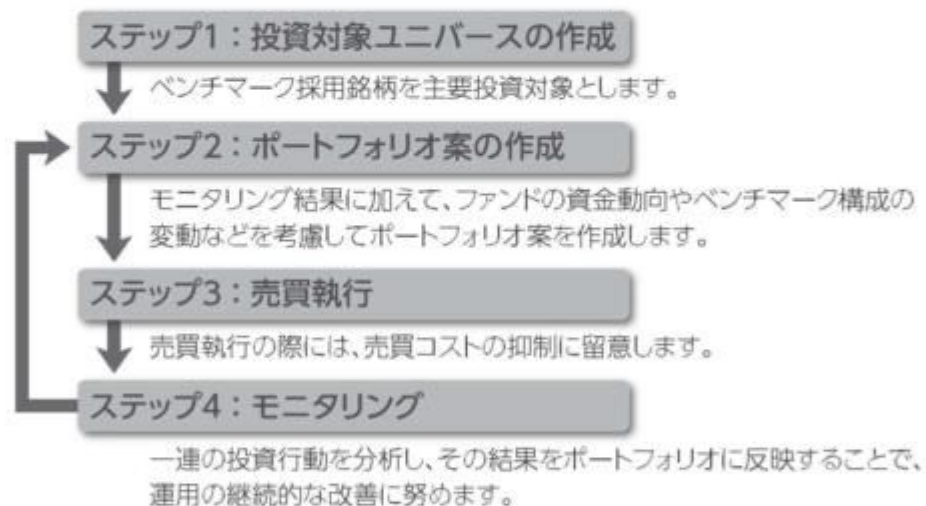
### 投資方針

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、主として対象指数に採用されている銘柄の株式に実質的に投資を行います。

※実際の運用は外国株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

### <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 (<https://www.am.mufig.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。
- ・デリバティブ取引および外国為替予約取引は行いません。投資対象とする投資信託証券におけるデリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## 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「お客さまの投資の中心軸(Axis)」をめざすという三菱UFJ国際投信の思いが込められています。

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

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的の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プしている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遅延、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

投資家（受益者）		
お申込金	解約代金等	
販売会社		募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。
お申込金	解約代金等	
受託会社（受託者） 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）		委託会社（委託者） 三菱UFJ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。		
投資	損益	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資対象ファンド		

## 投資 損益

## 有価証券等

## 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（平成29年12月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号  
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・設立年月日  
昭和60年8月1日
- ・資本金  
2,000百万円
- ・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

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。）への投資を通じて、主として対象指数に採用されている銘柄の株式に対する投資として運用を行います。

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

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

別に定める投資信託証券については、見直しを行う場合があります。この際、新たな投資信託証

券(ファンド設定以降に新設された投資信託および投資法人にかかる投資信託証券を含みます。)を追加することや、既に指定されていた投資信託証券を除外することがあります。

投資信託証券の合計組入比率は高位を保つことを原則とします。

実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

## (2)【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

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

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

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

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

2. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

## <投資信託証券の概要>

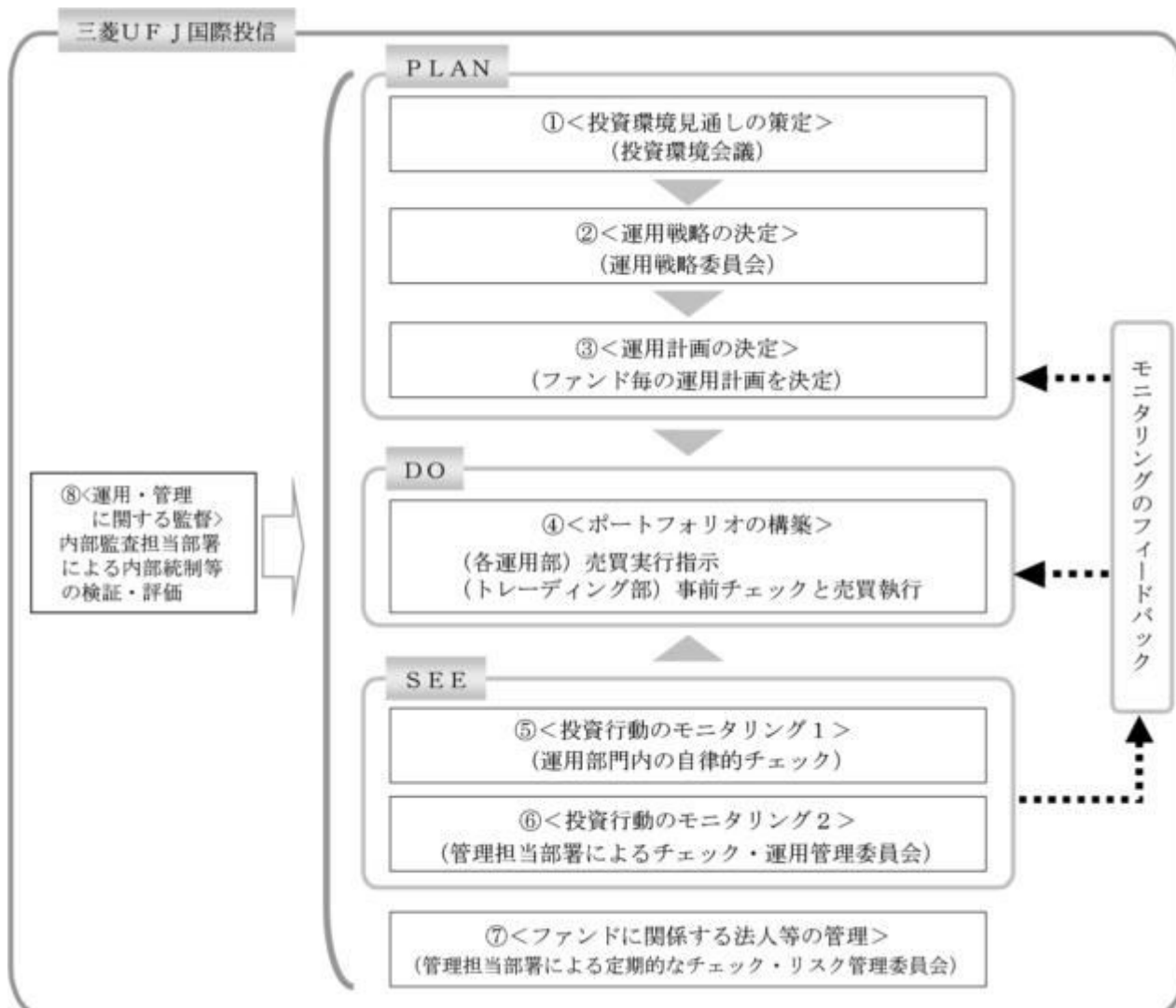
ファンド名	MSCIコクサイインデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)
形態	証券投資信託
投資対象	外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界各国の株式に直接投資することがあります。
投資態度	外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として対象インデックスに採用されている日本を除く世界各国の株式に実質的な投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 対象インデックスとの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スワップ取引を行うことができます。 ⑧外国為替予約取引を行うことができます。 ⑨デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
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	<p>主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。</p> <p>投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。</p> <p>・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。</p> <p>・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <p>なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。</p>
投資制限	<p>①株式への投資割合に制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>⑥有価証券先物取引等を行うことができます。</p> <p>⑦スワップ取引を行うことができます。</p> <p>⑧外国為替予約取引を行うことができます。</p> <p>⑨デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p>
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（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

## ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、



リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されま

す。

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(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。

なお、委託会社に関する「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でご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

#### (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

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。

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。

(主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。)

#### 価格変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 留意事項

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

- ・コンピューター関係の不慮の出来事に起因する取引上のリスクやシステム上のリスクが生じる可能性があります。

## (2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、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とともに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います。また、定期的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。この内容は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。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

### トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

### コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

### リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

### 内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

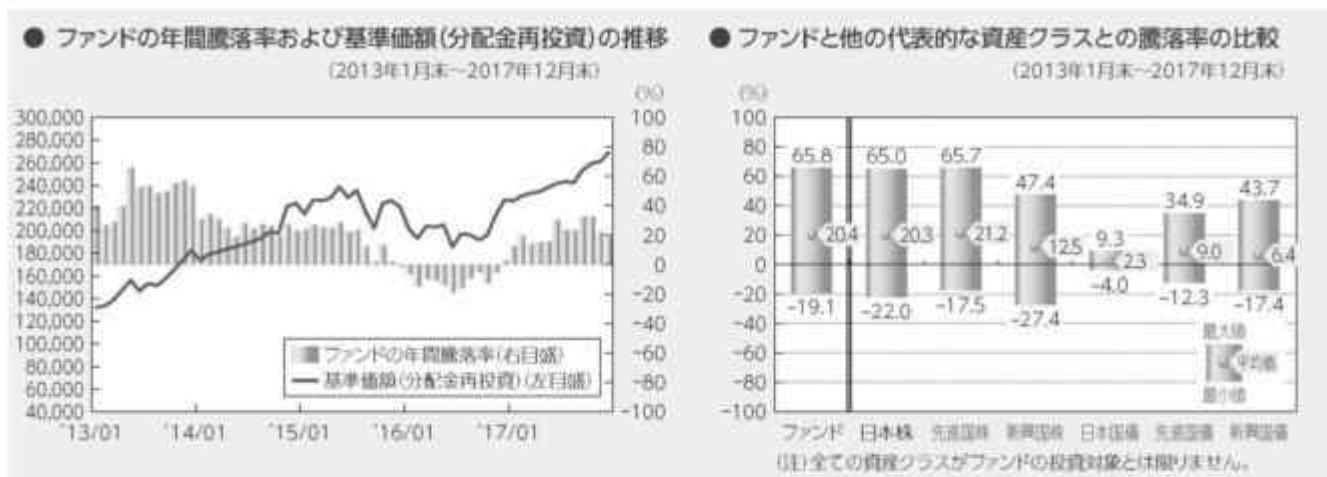
## <流動性リスクに対する管理体制>

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であるトレーディング担当部署およびリスク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、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

\* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

## ■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。



- 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	FTSE世界国債インデックス(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
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

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンド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です。

## (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（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

## (3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.162%（税抜0.15%）以内の率を乗じて得た額とします。

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。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.11%	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
受託会社	0.04%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

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。

## &lt;ファンドが投資対象とする投資信託証券の信託報酬率&gt;

投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
M S C I コクサイインデックスファンド（F O F s 用）（適格機関投資家限定）	年0.108%
マネープールファンド（F O F s 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、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ・信託財産に係る監査費用(消費税等相当額を含みます。)は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産(投資している投資信託を含みます。)の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等(消費税等相当額を含みます。)、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

- ・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0.054%(税抜年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。

(注)手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 1. 受益権の売却時

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

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29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】

### 【MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信】

#### （1）【投資状況】

平成29年12月29日現在  
（単位：円）

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	8,291,061,811	99.82
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		15,157,987	0.18
純資産総額		8,306,219,798	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29年12月29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		3,487,120,428	2.3311 2.3776	8,128,826,429 8,290,977,529		99.82
日本	マネーパブルファンド（FO Fs用）（適格機関投資家限 定）	投資信託受 益証券		84,039	1.0029 1.0029	84,282 84,282		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29年12月29日現在

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

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

##### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

##### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成29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。

	純資産総額	基準価額 (1口当たりの純資産価額)	(単位：円) 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
第13計算期間末日 (平成29年 6月 8日)	7,453,036,193 (分配付) 7,387,236,193 (分配落)	2,129.44 (分配付) 2,110.64 (分配落)	2,113
第14計算期間末日 (平成29年12月 8日)	8,201,852,662 (分配付) 8,145,152,662 (分配落)	2,343.39 (分配付) 2,327.19 (分配落)	2,327
平成28年12月末日	7,529,972,409	2,035.13	2,023
平成29年 1月末日	7,504,206,556	2,028.16	2,013
2月末日	7,234,665,550	2,067.05	2,064
3月末日	7,303,391,993	2,086.68	2,070
4月末日	7,353,449,875	2,100.99	2,089
5月末日	7,463,243,911	2,132.36	2,137
6月末日	7,510,710,221	2,145.92	2,135
7月末日	7,565,457,867	2,161.56	2,161
8月末日	7,534,687,810	2,152.77	2,149
9月末日	7,882,672,371	2,252.19	2,237
10月末日	8,062,740,256	2,303.64	2,300
11月末日	8,115,498,611	2,318.71	2,308
12月末日	8,306,219,798	2,373.21	2,365

## 【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
第13計算期間	18円80銭
第14計算期間	16円20銭

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	3.91
第2計算期間	10.90
第3計算期間	3.74
第4計算期間	16.44
第5計算期間	31.62
第6計算期間	15.77
第7計算期間	10.46
第8計算期間	20.50
第9計算期間	4.82
第10計算期間	5.16
第11計算期間	11.22
第12計算期間	10.22
第13計算期間	7.66
第14計算期間	11.02

（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
第13計算期間		300,000	3,500,000
第14計算期間			3,500,000

## &lt; 参考 &gt;

「MSCIコクサ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29年12月29日現在  
（単位：円）

資産の種類	国／地域名	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	8,290,682,477	99.99

コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		419,353	0.01
純資産総額		8,291,101,830	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29年12月29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		3,056,585,488	2.6102	7,978,299,441		99.99
					2.7124	8,290,682,477		

（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29年12月29日現在

種類 / 業種別	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（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29年12月29日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	254,670,486,117	61.41
	イギリス	28,262,160,980	6.81
	ドイツ	15,857,634,491	3.82
	フランス	15,673,834,954	3.78
	カナダ	15,470,841,495	3.73
	スイス	13,101,809,621	3.16
	オーストラリア	10,360,895,090	2.50
	オランダ	6,651,949,262	1.60
	スペイン	5,241,944,447	1.26
	香港	5,143,949,289	1.24
	スウェーデン	4,376,685,447	1.06
	イタリア	3,191,314,407	0.77
	デンマーク	2,969,528,965	0.72
	シンガポール	1,979,822,917	0.48
	ベルギー	1,788,915,361	0.43
	フィンランド	1,511,752,992	0.36
	ノルウェー	1,075,339,313	0.26
	アイルランド	773,112,754	0.19
	ルクセンブルグ	485,524,359	0.12
	オーストリア	422,297,940	0.10
	イスラエル	422,112,396	0.10
	ニュージーランド	283,443,025	0.07
	投資証券	ポルトガル	249,834,009
アメリカ		7,449,486,816	1.80
オーストラリア		911,513,177	0.22
フランス		551,673,194	0.13
イギリス		364,472,079	0.09

	香港	224,003,475	0.05
	シンガポール	191,064,841	0.05
	カナダ	69,670,232	0.02
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		14,986,336,692	3.61
純資産総額		414,713,410,137	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29年12月29日現在

(単位:円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
株価指数先物取引 (買建)	15,377,604,531	3.71

(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29年12月29日現在

国/ 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段: 帳簿価額 下段: 評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ ハードウェアおよ び機器	495,028	17,431.38 19,332.04	8,629,021,178 9,569,901,097		2.31
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・ サービス	701,146	7,855.76 9,686.36	5,508,776,278 6,791,552,568		1.64
アメリカ	AMAZON.COM INC	株式	小売	39,136	108,178.29 134,029.30	4,233,679,355 5,245,370,684		1.26
アメリカ	FACEBOOK INC-A	株式	ソフトウェア・ サービス	227,093	17,354.54 20,104.96	3,941,127,036 4,565,695,681		1.10
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	銀行	337,140	9,977.90 12,180.27	3,363,949,206 4,106,456,227		0.99
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	257,033	14,132.91 15,883.28	3,632,624,256 4,082,527,108		0.98
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	406,380	9,276.17 9,494.26	3,769,934,230 3,858,277,378		0.93
アメリカ	ALPHABET INC-CL C	株式	ソフトウェア・ サービス	29,991	105,596.24 118,439.82	3,166,941,857 3,552,128,641		0.86
アメリカ	ALPHABET INC-CL A	株式	ソフトウェア・ サービス	28,558	108,246.09 119,322.35	3,091,294,781 3,407,607,671		0.82
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	銀行	960,342	2,736.86 3,367.40	2,628,901,795 3,233,855,650		0.78
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	450,987	6,066.97 6,926.90	2,736,124,599 3,123,941,850		0.75
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバ コ	298,099	9,346.48 9,687.09	2,786,290,905 2,887,713,034		0.70
アメリカ	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	株式	各種金融	121,345	18,858.57 22,550.28	2,288,483,261 2,736,363,726		0.66
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	589,457	4,316.60 4,427.34	2,544,500,305 2,609,726,554		0.63
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	181,720	12,131.68 14,190.54	2,204,728,234 2,578,704,928		0.62
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソ ナル用品	243,778	9,840.04 10,403.91	2,398,785,271 2,536,244,371		0.61
アメリカ	HOME DEPOT INC	株式	小売	113,008	17,699.19 21,445.14	2,000,150,063 2,423,472,381		0.58
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	391,419	5,226.25 6,037.59	2,045,911,467 2,363,227,440		0.57
アメリカ	INTEL CORP	株式	半導体・半導体製 造装置	449,110	4,057.83 5,222.86	1,822,412,031 2,345,638,654		0.57
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	569,245	3,768.55 4,109.81	2,145,228,244 2,339,488,793		0.56
アメリカ	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	ヘルスケア機器・ サービス	92,649	20,104.96 25,173.01	1,862,769,802 2,332,254,203		0.56
アメリカ	VISA INC-CLASS A SHARES	株式	ソフトウェア・ サービス	175,025	10,618.61 12,921.55	1,858,522,215 2,261,594,288		0.55
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,924,468	1,046.93 1,158.46	2,015,708,508 2,229,432,285		0.54
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	銀行	261,026	7,045.55 8,484.04	1,839,071,734 2,214,555,025		0.53

国	銘柄	株式	業種	数量	簿価	評価額	投資比率
アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	479,910	3,775.33 4,360.67	1,811,972,828 2,092,729,139	0.50
アメリカ	COMCAST CORP-CLASS A	株式	メディア	451,501	4,427.34 4,552.77	1,998,948,437 2,055,580,207	0.50
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	213,528	9,166.36 9,548.54	1,957,464,719 2,038,881,076	0.49
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	387,051	4,973.13 5,166.36	1,924,854,939 1,999,644,804	0.48
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	67,485	30,344.04 28,564.80	2,047,770,061 1,927,695,797	0.46
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	136,239	12,798.38 13,486.55	1,743,638,492 1,837,394,085	0.44

(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29年12月29日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
エネルギー	6.58
素材	4.91
資本財	7.24
商業・専門サービス	0.98
運輸	2.01
自動車・自動車部品	1.52
耐久消費財・アパレル	1.72
消費者サービス	1.81
メディア	2.23
小売	3.82
食品・生活必需品小売り	1.66
食品・飲料・タバコ	5.17
家庭用品・パーソナル用品	1.98
ヘルスケア機器・サービス	4.01
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.80
銀行	9.44
各種金融	4.49
保険	3.96
不動産	0.62
ソフトウェア・サービス	9.90
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.94
電気通信サービス	2.48
公益事業	2.98
半導体・半導体製造装置	2.80
小計	94.03
投資証券	2.35
合計	96.39

(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29年12月29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 (2018年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	665	アメリカドル	88,814,611.65	89,301,187.50	10,091,034,187	2.43
FTSE100 (2018年3月限)	インターコンチネンタル取引所	買建	95	イギリスポンド	7,088,492.50	7,187,700.00	1,092,171,015	0.26
SP/TSE60 (2018年3月限)	モントリオール取引所	買建	34	カナダドル	6,503,311.50	6,508,960.00	585,480,952	0.14
SPI 200 (2018年3月限)	シドニー先物取引所	買建	57	オーストラリアドル	8,545,928.00	8,615,550.00	759,633,043	0.18
EURO ST (2018年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	502	ユーロ	17,941,180.50	17,610,160.00	2,376,314,990	0.57
SWISS IX (2018年3月限)	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	44	スイスフラン	4,079,005.00	4,096,400.00	472,970,344	0.11

(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。

## &lt; 参考 &gt;

## 「マネー・プールファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）」

## (1) 投資状況

平成29年12月29日現在  
(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	10,175,117	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		25,485	0.25
純資産総額		10,200,602	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。

## (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29年12月29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		9,991,278	1.0184 1.0184	10,175,118 10,175,117		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29年12月29日現在

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

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## &lt; 参考 &gt;

## 「マネー・マーケット・マザーファンド」

## (1) 投資状況

平成29年12月29日現在

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,280,676,960	100.00
純資産総額		1,280,676,960	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

該当事項はありません。

## 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。

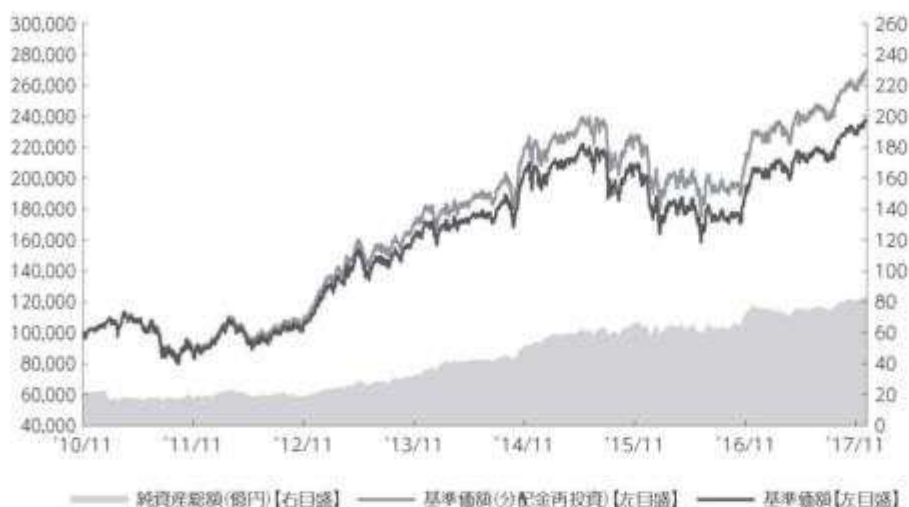
## 参考情報



## 運用実績

2017年12月29日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2010年11月22日(設定日)～2017年12月29日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は100,000(当初元本100口当たり)を起点として表示
- ・基準価額、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	237,321円
純資産総額	83.0億円

### ■分配の推移

2017年12月	1,620円
2017年6月	1,880円
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
設定来累計	20,210円

・分配金は100口当たり、税引前

### ■主要な資産の状況

資産構成	比率
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)	99.8%
マネーボールファンド(FOF s用)(適格機関投資家限定)	0.0%
コールローン他 (負債控除後)	0.2%
合計	100.0%

- ・比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- ・コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

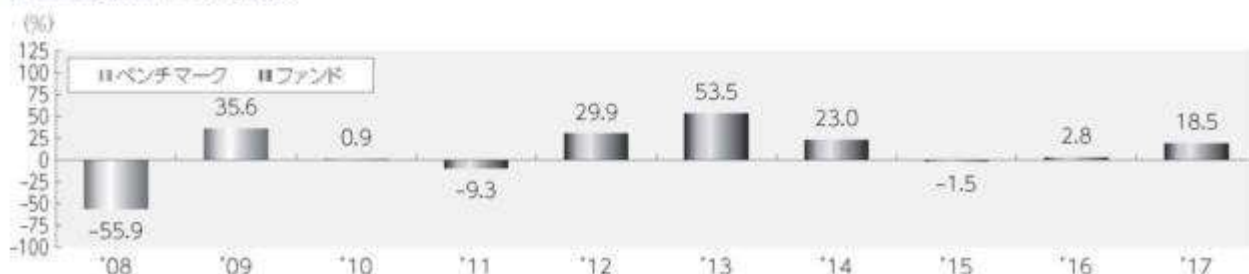
通貨別構成	比率
アメリカドル	65.7%
ユーロ	13.1%
イギリスポンド	7.2%
カナダドル	3.9%
スイスフラン	3.3%
オーストラリアドル	2.8%
香港ドル	1.3%
スウェーデンクローネ	1.1%
その他	1.6%
合計	100.0%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引(買建)	3.7%

- ・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。

紹介上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 APPLE INC	テフ/ロジハードウェアおよび機器	アメリカ	2.3%
2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.6%
3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	1.3%
4 FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	1.1%
5 JPMORGAN CHASE & CO	銀行	アメリカ	1.0%
6 JOHNSON & JOHNSON	医薬品/バイオテフ/ロジライフサイエンス	アメリカ	1.0%
7 EXXON MOBIL CORP	エネルギー	アメリカ	0.9%
8 ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.9%
9 ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.8%
10 BANK OF AMERICA CORP	銀行	アメリカ	0.8%

### ■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

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。

ただし、以下の日は申込みができません。

- 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たととき

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。

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。

#### 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、委託会社の営業日に計算されます。

#### 申込単位・申込価額の照会方法

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。

また、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：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.mukam.jp/>

#### 申込手数料

販売会社が定める額

申込手数料は販売会社にご確認ください。

#### 申込方法

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。

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。

#### 取得申込みの受付の中止および取消し

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の受付を取り消すことがあります。

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。

申込(販売)手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金(解約)手続等】

### 解約の受付

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。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

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

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。

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せん。

### 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から信託財産留保額を差引いた価額

### 信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%をかけた額

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

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：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

### 支払開始日



解約代金は、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。

#### 解約請求受付の中止および取消し

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。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。

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。

換金（解約）手続等の詳細に関し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

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、当ファンドでは100口当たりの価額で表示されます。

「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。

##### （資産の評価方法）

##### ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

##### ・転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

##### ・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

##### ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

##### ・投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

- ・外貨建資産  
原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。
- ・外国為替予約取引  
原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。
- ・市場デリバティブ取引  
原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

#### 基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 基準価額の照会方法

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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.mukam.jp/>

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

#### （３）【信託期間】

無期限（平成22年11月22日設定）

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。

#### （４）【計算期間】

毎年6月9日から12月8日および12月9日から翌年6月8日まで

ただし、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

##### ファンドの償還条件等

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）

- ・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

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。

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。

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。

### 信託約款の変更等

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。

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。

### ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合を除きます。）、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、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の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。

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。

### 金融商品取引所への上場

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、

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、

### 反対者の買取請求権

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。

### 関係法人との契約の更改

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」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

### 運用報告書

投資信託及び投資法人に関する法律により、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、販売会社または委託会社の照会先にてご確認いただけます。

### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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。

### 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。

#### 信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、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。

<https://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】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者(計算期間終了日において受益者名簿に名義登録<sup>(注)</sup>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に応じて請求する権利を有します。

- ・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。

(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。

受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限ります。)を経由して受益者名簿に名義登録することを請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社(受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者)に対して直接に行うことができます。

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。

### (2) 償還金に対する請求権

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、持分にに応じて償還金を請求する権利を有します。

- ・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。

(3) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金(解約)請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」を参照してください。

### 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29年6月9日から平成29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13期 [平成29年 6月 8日現在]	第14期 [平成29年12月 8日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	23,072,539	23,847,415
投資信託受益証券	7,437,966,854	8,186,442,112
流動資産合計	7,461,039,393	8,210,289,527
資産合計	7,461,039,393	8,210,289,527
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	65,800,000	56,700,000
未払受託者報酬	1,599,175	1,679,818
未払委託者報酬	4,397,664	4,619,444
未払利息	40	34
その他未払費用	2,006,321	2,137,569
流動負債合計	73,803,200	65,136,865
負債合計	73,803,200	65,136,865
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,500,000,000	3,500,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,887,236,193	4,645,152,662
（分配準備積立金）	123,437	39,308
元本等合計	7,387,236,193	8,145,152,662
純資産合計	7,387,236,193	8,145,152,662
負債純資産合計	7,461,039,393	8,210,289,527

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成28年12月9日 至 平成29年6月8日	自	平成29年6月9日 至 平成29年12月8日
営業収益				
受取配当金		74,216,117		65,505,700
受取利息		105		104
有価証券売買等損益		485,612,744		758,000,598
営業収益合計		559,828,966		823,506,402
営業費用				
支払利息		5,784		7,750
受託者報酬		1,599,175		1,679,818
委託者報酬		4,397,664		4,619,444
その他費用		2,463,608		2,582,921
営業費用合計		8,466,231		8,889,933
営業利益又は営業損失（ ）		551,362,735		814,616,469
経常利益又は経常損失（ ）		551,362,735		814,616,469
当期純利益又は当期純損失（ ）		551,362,735		814,616,469
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（ ）		3,715,669,458		3,887,236,193
剰余金減少額又は欠損金増加額		313,996,000		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		313,996,000		-
分配金		65,800,000		56,700,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,887,236,193		4,645,152,662



## （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 13 期 [ 平成29年6月8日現在 ]	第 14 期 [ 平成29年12月8日現在 ]
1 期首元本額	3,800,000,000円	3,500,000,000円
期中追加設定元本額		
期中一部解約元本額	300,000,000円	
2 受益権の総数	3,500,000口	3,500,000口
3 1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	2,110.64円 (211,064円)	2,327.19円 (232,719円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 13 期（自 平成28年12月9日 至 平成29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	74,210,438円
分配準備積立金額	B	173,446円
配当等収益合計額	C=A+B	74,383,884円
経費	D	8,460,447円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	65,923,437円
収益分配金金額	F	65,800,000円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	123,437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	1,880円

第 14 期（自 平成29年6月9日 至 平成29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	65,498,054円
分配準備積立金額	B	123,437円
配当等収益合計額	C=A+B	65,621,491円
経費	D	8,882,183円
当ファンドの分配対象収益額	E=C-D	56,739,308円
収益分配金金額	F	56,700,000円
次期繰越金（分配準備積立金）	G=E-F	39,308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	1,620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 13 期 ( 自 平成28年12月 9日 至 平成29年 6月 8日 )	第 14 期 ( 自 平成29年 6月 9日 至 平成29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。	同 左  同 左

3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>	同 左
	<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>	同 左
	<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

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 13 期 [ 平成29年6月8日現在 ]	第 14 期 [ 平成29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。
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	<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 13 期 [ 平成29年6月8日現在 ]	第 14 期 [ 平成29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	464,353,596	757,670,194
合計	464,353,596	757,670,194

## (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)	3,511,800,365	8,186,357,830	
	マネーブルファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	84,039	84,282	
	投資信託受益証券 小計	3,511,884,404	8,186,442,112	

合計	3,511,884,404	8,186,442,112
----	---------------	---------------

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>

当ファンドの主要投資対象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13期	第14期
	[平成29年5月25日現在]	[平成29年11月27日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,267,970	4,759,775
親投資信託受益証券	7,424,641,099	7,972,610,493
未収入金	74,440,529	65,804,431
流動資産合計	7,503,349,598	8,043,174,699
資産合計	7,503,349,598	8,043,174,699
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	74,216,117	65,505,700
未払受託者報酬	1,149,261	1,228,923
未払委託者報酬	2,813,652	3,008,667
未払利息	7	8
流動負債合計	78,179,037	69,743,298
負債合計	78,179,037	69,743,298
純資産の部		
元本等		
元本	3,484,324,764	3,484,345,765
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,940,845,797	4,489,085,636
(分配準備積立金)	(2,398,044,060)	(2,923,071,946)
元本等合計	7,425,170,561	7,973,431,401
純資産合計	7,425,170,561	7,973,431,401
負債純資産合計	7,503,349,598	8,043,174,699

(2) 損益及び剰余金計算書

	第13期	第14期
	自平成28年11月26日 至平成29年5月25日	自平成29年5月26日 至平成29年11月27日
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	11	10
有価証券売買等損益	788,594,102	617,835,444
営業収益合計	788,594,113	617,835,454
営業費用		
支払利息	487	635
受託者報酬	1,149,261	1,228,923
委託者報酬	2,813,652	3,008,667
営業費用合計	3,963,400	4,238,225
営業利益又は営業損失( )	784,630,713	613,597,229
経常利益又は経常損失( )	784,630,713	613,597,229
当期純利益又は当期純損失( )	784,630,713	613,597,229
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 ( )	36,011,881	183,594
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,547,745,891	3,940,845,797
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,589,471	38,589,196
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損 金減少額	26,589,471	38,589,196
剰余金減少額又は欠損金増加額	307,892,280	38,624,480
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損 金増加額	307,892,280	38,624,480
分配金	74,216,117	65,505,700
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,940,845,797	4,489,085,636

## (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25日および11月25日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成29年5月26日から平成29年11月27日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [ 平成29年5月25日現在 ]	第 14 期 [ 平成29年11月27日現在 ]
1 期首元本額	3,783,976,605円	3,484,324,764円
期中追加設定元本額	29,409,879円	34,234,560円
期中一部解約元本額	329,061,720円	34,213,559円
2 受益権の総数	3,484,324,764口	3,484,345,765口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1310円 (21,310円)	2.2884円 (22,884円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

## 第 13 期 (自 平成28年11月26日 至 平成29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	84,633,870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	130,226,344円
収益調整金額	C	1,913,123,778円
分配準備積立金額	D	2,257,399,963円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,385,383,955円
当ファンドの期末残存口数	F	3,484,324,764口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	12,586円
1万口当たり分配金額	H	213円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	74,216,117円

## 第 14 期 (自 平成29年5月26日 至 平成29年11月27日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	73,761,354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	540,019,469円
収益調整金額	C	1,936,499,605円
分配準備積立金額	D	2,374,796,823円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,925,077,251円
当ファンドの期末残存口数	F	3,484,345,765口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	14,134円
1万口当たり分配金額	H	188円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	65,505,700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 13 期 (自 平成28年11月26日 至 平成29年 5月25日 )	第 14 期 (自 平成29年 5月26日 至 平成29年11月27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>	同 左  同 左
------------------	--	----------------

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 13 期 [ 平成29年5月25日現在 ]	第 14 期 [ 平成29年11月27日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同 左  同 左  同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第 13 期 [ 平成29年5月25日現在 ]	第 14 期 [ 平成29年11月27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	746,253,906	613,296,217
合計	746,253,906	613,296,217

## (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	3,054,288,968	7,972,610,493	
	親投資信託受益証券 小計	3,054,288,968	7,972,610,493	
	合計	3,054,288,968	7,972,610,493	

## 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。

## 「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29年5月25日現在 ]	[ 平成29年11月27日現在 ]
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,753,468,554	5,279,275,199
コール・ローン	1,656,306,249	580,102,022
株式	301,633,370,115	373,139,729,551
投資証券	7,813,548,980	9,667,160,117
派生商品評価勘定	54,669,995	62,144,912
未収入金	90,071,969	1,675,682
未収配当金	703,371,826	602,728,931
差入委託証拠金	3,242,149,913	2,401,863,281
流動資産合計	318,946,957,601	391,734,679,695
資産合計	318,946,957,601	391,734,679,695
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,981,517	28,243,741
未払解約金	630,791,445	94,437,046
未払利息	2,780	1,056
流動負債合計	647,775,742	122,681,843
負債合計	647,775,742	122,681,843
純資産の部		
元本等		
元本	132,092,370,548	150,027,147,060
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	186,206,811,311	241,584,850,792
元本等合計	318,299,181,859	391,611,997,852
純資産合計	318,299,181,859	391,611,997,852
負債純資産合計	318,946,957,601	391,734,679,695

（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29年5月25日現在 ]	[ 平成29年11月27日現在 ]
1 期首	平成28年11月26日	平成29年5月26日
期首元本額	135,794,168,349円	132,092,370,548円
期首からの追加設定元本額	96,248,973,841円	47,442,312,046円
期首からの一部解約元本額	99,950,771,642円	29,507,535,534円
元本の内訳*		
ファンド・マネジャー（海外株式）	9,845,281,018円	13,459,418,230円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,692,090,194円	13,607,202,809円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,133,734,453円	1,166,724,858円
eMAXIS バランス（波乗り型）	194,857,273円	62,532,548円
コアバランス	461,750円	348,595円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定 拠出年金）	724,163円	6,385,083円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定 拠出年金）	597,836円	8,693,299円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定 拠出年金）	1,528,517円	6,590,909円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	224,942,320円	876,980,676円
海外株式セレクション（ラップ向け）	598,716,647円	834,254,735円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	50,362,300円	266,825,874円
つみたて先進国株式		818,805円
つみたて8資産均等バランス		765,901円
つみたて4資産均等バランス		1,073,253円
eMAXIS マイマネージャー 1970s		826,096円
eMAXIS マイマネージャー 1980s		990,090円
eMAXIS マイマネージャー 1990s		1,320,447円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	7,696,859,688円	8,901,277,739円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,363,847,280円	2,448,882,274円

三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	2,491,621,172円	2,494,885,518円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,981,323,342円	4,371,564,980円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	103,451,588円	412,807,219円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	91,474,540円	188,887,820円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	722,811,752円	759,519,522円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	35,217,324円	59,069,265円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	3,415,092円	8,261,760円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	8,344,883円	18,954,175円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	40,123,817円	75,423,455円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	38,743,776円	66,114,167円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	52,553,915円	155,688,069円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	741,195,621円	54,354,433円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	13,386,871,244円	12,277,679,502円
三菱UFJ バランスファンドVA20型(適格機関投資家限定)	259,978,453円	214,618,018円
三菱UFJ バランスファンドVA40型(適格機関投資家限定)	2,316,478,277円	2,108,140,132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)	45,978,711,980円	57,087,014,639円
三菱UFJ バランスファンドVA45型(適格機関投資家限定)	230,329,011円	197,493,368円
三菱UFJ バランスファンドVA30型(適格機関投資家限定)	89,475,962円	78,474,467円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,699,932,811円	1,551,160,184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)	3,081,147,487円	3,054,288,968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)	4,032,836円	
MUAM 全世界株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	7,081,940,686円	6,952,218,366円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	57,646,944円	42,594,477円
アドバンスト・バランス(FOFs用)(適格機関投資家限定)	349,364,274円	228,449,240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)	1,280,819,467円	2,237,856,704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)	315,350,637円	868,999,290円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	123,882,140円	95,889,232円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	15,240,332円	16,184,923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)	949,629,866円	3,728,837,015円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	1,879,245,903円	2,166,463,312円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定型)VA	2,567,751円	2,421,176円
インデックス・ライフ・バランスファンド(安定成長型)VA	12,011,006円	9,023,744円
インデックス・ライフ・バランスファンド(成長型)VA	18,141,065円	13,997,499円
インデックス・ライフ・バランスファンド(積極型)VA	19,697,529円	15,713,156円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	85,460,212円	76,523,384円
三菱UFJ バランスVA30D(適格機関投資家限定)	24,634,423円	20,158,250円
三菱UFJ バランスVA60D(適格機関投資家限定)	177,349,896円	138,373,873円
三菱UFJ バランスVA30G(適格機関投資家限定)	39,339,544円	25,279,702円
三菱UFJ バランスVA60G(適格機関投資家限定)	266,053,689円	203,818,755円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,188,705,822円	4,294,779,036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)	170,397,075円	164,655,289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)	685,386,548円	660,731,178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)	640,258,180円	628,126,415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） （合計）	548,009,237円	549,741,162円
2 受益権の総数	132,092,370,548円	150,027,147,060円
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4097円 （24,097円）	2.6103円 （26,103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28年11月26日 至平成29年5月25日）	（自平成29年5月26日 至平成29年11月27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。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左 同 左 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29年5月25日現在]	[平成29年11月27日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[平成29年5月25日現在]	[平成29年11月27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	526,336,864	20,037,157,017
投資証券	97,039,456	367,789,972
合計	623,376,320	20,404,946,989

（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29年5月25日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,178,074,089	9,216,152,172	38,078,083
	合計	9,178,074,089	9,216,152,172	38,078,083

区分	種類	[平成29年11月27日現在]		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,305,989,523	13,338,908,954	32,919,431



合 計	13,305,989,523	13,338,908,954	32,919,431
-----	----------------	----------------	------------

## (注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

区 分	種 類	[ 平成29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	994,646,600		993,627,000	1,019,600
	カナダドル	62,179,830		62,415,000	235,170
	オーストラリアドル	29,242,995		29,285,000	42,005
	イギリスポンド	79,720,825		79,678,500	42,325
	スイスフラン	68,719,600		68,842,000	122,400
	香港ドル	21,540,000		21,495,000	45,000
	シンガポールドル	12,094,500		12,093,000	1,500
	スウェーデンクローネ	25,631,900		25,760,000	128,100
	デンマーククローネ	10,080,480		10,104,000	23,520
	ユーロ	150,216,375		150,384,000	167,625
	合 計	1,454,073,105		1,453,683,500	389,605

区 分	種 類	[ 平成29年11月27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	3,326,767,820		3,327,170,000	402,180
	カナダドル	195,828,560		195,860,900	32,340
	オーストラリアドル	147,846,020		147,847,800	1,780
	イギリスポンド	342,076,800		342,171,000	94,200
	スイスフラン	170,819,000		170,850,000	31,000
	香港ドル	57,169,700		57,160,000	9,700
	シンガポールドル	24,872,100		24,870,000	2,100
	スウェーデンクローネ	67,305,000		67,300,000	5,000
	ノルウェークローネ	20,535,000		20,520,000	15,000
	デンマーククローネ	35,762,000		35,760,000	2,000
	ユーロ	683,422,960		683,877,000	454,040
合 計	5,072,404,960		5,073,386,700	981,740	

## (注) 時価の算定方法

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

通 貨	銘 柄	株 式 数	評 価 額		備 考
			単 価	金 額	
アメリカドル					
	3M CO	56,949	231.380000	13,176,859.62	
	ABBOTT LABORATORIES	165,579	56.130000	9,293,949.27	
	ABBVIE INC	151,880	94.720000	14,386,073.60	

ACCENTURE PLC-CL A	59,062	147.630000	8,719,323.06
ACTIVISION BLIZZARD INC	68,250	66.030000	4,506,547.50
ACUITY BRANDS INC	4,549	157.990000	718,696.51
ADOBE SYSTEMS INC	47,165	184.460000	8,700,055.90
ADVANCE AUTO PARTS INC	7,720	89.230000	688,855.60
ADVANCED MICRO DEVICES	79,972	11.380000	910,081.36
AERCAP HOLDINGS NV	15,000	51.310000	769,650.00
AES CORP	69,409	10.690000	741,982.21
AETNA INC	31,647	176.460000	5,584,429.62
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,616	190.370000	1,069,117.92
AFLAC INC	37,666	85.000000	3,201,610.00
AGCO CORP	5,701	69.990000	399,012.99
AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,469	69.360000	2,113,329.84
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,786	161.560000	3,358,186.16
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	17,549	55.790000	979,058.71
ALBEMARLE CORP	10,689	137.060000	1,465,034.34
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,699	108.610000	2,356,728.39
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,355	254.760000	1,873,759.80
ALKERMES PLC	13,764	51.050000	702,652.20
ALLEGHANY CORP	1,557	556.020000	865,723.14
ALLEGION PLC	9,800	82.920000	812,616.00
ALLERGAN PLC	32,072	173.530000	5,565,454.16
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,970	222.020000	1,103,439.40
ALLIANT ENERGY CORP	20,871	44.220000	922,915.62
ALLSTATE CORP	34,585	99.080000	3,426,681.80
ALLY FINANCIAL INC	45,470	26.520000	1,205,864.40
ALPHABET INC-CL A	28,380	1,056.520000	29,984,037.60
ALPHABET INC-CL C	29,802	1,040.610000	31,012,259.22
ALTRIA GROUP INC	184,219	65.480000	12,062,660.12
AMAZON.COM INC	38,768	1,186.000000	45,978,848.00
AMERCO	625	354.060000	221,287.50
AMEREN CORPORATION	23,630	62.980000	1,488,217.40
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,503	48.560000	558,585.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,112	76.470000	3,602,654.64
AMERICAN EXPRESS CO	72,417	93.480000	6,769,541.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,629	101.580000	673,373.82
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	87,848	59.030000	5,185,667.44
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,357	88.740000	1,540,260.18
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,416	159.560000	2,300,216.96
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,913	81.230000	1,292,612.99
AMETEK INC	22,138	70.240000	1,554,973.12
AMGEN INC	70,172	170.120000	11,937,660.64
AMPHENOL CORP-CL A	28,671	90.910000	2,606,480.61
ANADARKO PETROLEUM CORP	54,731	48.110000	2,633,108.41
ANALOG DEVICES INC	34,957	89.150000	3,116,416.55
ANDEAVOR	14,628	104.000000	1,521,312.00
ANSYS INC	8,476	151.910000	1,287,589.16
ANTERO RESOURCES CORP	19,804	18.590000	368,156.36
ANTHEM INC	25,279	220.390000	5,571,238.81
AON PLC	24,906	138.630000	3,452,718.78
APACHE CORP	36,500	41.140000	1,501,610.00
APPLE INC	497,563	174.970000	87,058,598.11
APPLIED MATERIALS INC	102,392	57.910000	5,929,520.72
ARAMARK	24,355	41.320000	1,006,348.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,667	95.660000	1,211,725.22
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,057	39.140000	2,076,650.98
ARCONIC INC	39,488	23.990000	947,317.12
ARISTA NETWORKS INC	4,227	242.060000	1,023,187.62
ARROW ELECTRONICS INC	7,923	78.870000	624,887.01
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,725	65.390000	1,159,037.75
ASSURANT INC	4,931	97.860000	482,547.66
AT&T INC	586,477	34.810000	20,415,264.37
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	9,500	48.950000	465,025.00
ATMOS ENERGY CORP	10,791	88.720000	957,377.52
AUTODESK INC	18,741	129.500000	2,426,959.50
AUTOLIV INC	8,735	124.220000	1,085,061.70
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42,623	110.020000	4,689,382.46
AUTONATION INC	5,912	52.580000	310,852.96
AUTOZONE INC	2,706	632.980000	1,712,843.88
AVERY DENNISON CORP	7,989	111.700000	892,371.30

AVNET INC	11,219	40.160000	450,555.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,759	36.210000	715,473.39
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,548	51.600000	389,476.80
BAKER HUGHES A GE CO	38,944	30.800000	1,199,475.20
BALL CORP	32,398	39.940000	1,293,976.12
BANK OF AMERICA CORP	949,430	26.590000	25,245,343.70
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99,136	52.230000	5,177,873.28
BAXTER INTERNATIONAL INC	46,587	64.120000	2,987,158.44
BB&T CORP	77,385	46.340000	3,586,020.90
BECTON DICKINSON AND CO	21,691	226.280000	4,908,239.48
BED BATH & BEYOND INC	12,733	20.660000	263,063.78
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,947	182.360000	21,691,174.92
BEST BUY CO INC	26,523	57.000000	1,511,811.00
BIOGEN INC	20,388	308.970000	6,299,280.36
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,748	82.710000	1,385,227.08
BLACKROCK INC	11,543	479.740000	5,537,638.82
BOEING CO/THE	54,694	265.880000	14,542,040.72
BORGWARNER INC	20,995	52.880000	1,110,215.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	130,664	28.660000	3,744,830.24
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	7,882	57.290000	451,559.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	157,226	61.430000	9,658,393.18
BROADCOM LTD	38,279	282.380000	10,809,224.02
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,637	89.340000	950,309.58
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,738	58.840000	1,102,543.92
BUNGE LTD	14,099	65.250000	919,959.75
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,005	79.670000	1,115,778.35
CA INC	28,480	32.630000	929,302.40
CABOT OIL & GAS CORP	45,728	29.250000	1,337,544.00
CADENCE DESIGN SYS INC	27,620	45.600000	1,259,472.00
CAMPBELL SOUP CO	18,607	46.040000	856,666.28
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,866	87.380000	4,007,771.08
CARDINAL HEALTH INC	29,696	56.370000	1,673,963.52
CARMAX INC	18,116	68.050000	1,232,793.80
CARNIVAL CORP	32,680	66.710000	2,180,082.80
CATERPILLAR INC	56,172	137.390000	7,717,471.08
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,933	120.130000	1,193,251.29
CBRE GROUP INC - A	29,914	42.830000	1,281,216.62
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	34,691	56.540000	1,961,429.14
CDK GLOBAL INC	12,166	68.460000	832,884.36
CDW CORP/DE	15,673	66.370000	1,040,217.01
CELANESE CORP-SERIES A	13,482	106.720000	1,438,799.04
CELGENE CORP	74,521	104.500000	7,787,444.50
CENTENE CORP	16,498	97.170000	1,603,110.66
CENTERPOINT ENERGY INC	40,546	29.030000	1,177,050.38
CENTURYLINK INC	90,262	13.840000	1,249,226.08
CERNER CORP	28,132	70.570000	1,985,275.24
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,358	35.940000	767,606.52
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	20,565	328.980000	6,765,473.70
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12,600	104.020000	1,310,652.00
CHENIERE ENERGY INC	20,540	47.960000	985,098.40
CHEVRON CORP	180,667	116.510000	21,049,512.17
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,645	279.310000	738,774.95
CHUBB LTD	44,443	148.930000	6,618,895.99
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,223	44.820000	1,085,674.86
CIGNA CORP	24,414	200.600000	4,897,448.40
CIMAREX ENERGY CO	9,592	116.520000	1,117,659.84
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,317	72.510000	1,110,635.67
CINTAS CORP	8,754	147.710000	1,293,053.34
CISCO SYSTEMS INC	477,107	36.490000	17,409,634.43
CIT GROUP INC	12,949	47.770000	618,573.73
CITIGROUP INC	262,606	72.020000	18,912,884.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	48,274	37.750000	1,822,343.50
CITRIX SYSTEMS INC	14,817	86.250000	1,277,966.25
CLOROX COMPANY	12,308	135.390000	1,666,380.12
CME GROUP INC	32,306	141.860000	4,582,929.16
CMS ENERGY CORP	27,601	49.440000	1,364,593.44
COCA-COLA CO/THE	387,051	45.880000	17,757,899.88
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	56,090	72.270000	4,053,624.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	80,026	72.010000	5,762,672.26
COMCAST CORP-CLASS A	451,501	35.870000	16,195,340.87

COMERICA INC	17,286	78.670000	1,359,889.62
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17,665	35.430000	625,870.95
CONAGRA BRANDS INC	41,006	35.460000	1,454,072.76
CONCHO RESOURCES INC	14,089	140.580000	1,980,631.62
CONOCOPHILLIPS	117,890	50.470000	5,949,908.30
CONSOLIDATED EDISON INC	28,815	86.900000	2,504,023.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,333	221.880000	3,623,966.04
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,468	46.730000	395,709.64
COOPER COS INC/THE	4,777	242.290000	1,157,419.33
CORE LABORATORIES N.V.	3,986	101.570000	404,858.02
CORNING INC	89,276	31.850000	2,843,440.60
COSTAR GROUP INC	3,312	310.190000	1,027,349.28
COSTCO WHOLESALE CORP	41,840	171.620000	7,180,580.80
COTY INC-CL A	49,778	17.000000	846,226.00
CR BARD INC	6,815	336.110000	2,290,589.65
CROWN HOLDINGS INC	12,342	58.970000	727,807.74
CSX CORP	88,040	50.900000	4,481,236.00
CUMMINS INC	15,482	160.660000	2,487,338.12
CVS HEALTH CORP	97,208	70.550000	6,858,024.40
DANAHER CORP	59,623	94.020000	5,605,754.46
DARDEN RESTAURANTS INC	12,238	80.240000	981,977.12
DAVITA INC	15,756	57.150000	900,455.40
DEERE & CO	25,803	145.500000	3,754,336.50
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	19,553	80.950000	1,582,815.35
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	25,013	100.860000	2,522,811.18
DELTA AIR LINES INC	19,050	50.110000	954,595.50
DENTSPLY SIRONA INC	22,208	67.510000	1,499,262.08
DEVON ENERGY CORP	47,665	38.030000	1,812,699.95
DEXCOM INC	7,766	55.550000	431,401.30
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,923	110.300000	984,206.90
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,825	27.860000	218,004.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35,865	65.400000	2,345,571.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15,325	17.500000	268,187.50
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,335	16.460000	318,254.10
DISH NETWORK CORP-A	22,311	49.870000	1,112,649.57
DOLLAR GENERAL CORP	25,888	86.280000	2,233,616.64
DOLLAR TREE INC	22,466	98.380000	2,210,205.08
DOMINION ENERGY INC	60,239	82.210000	4,952,248.19
DOMINO'S PIZZA INC	4,822	177.340000	855,133.48
DOVER CORP	15,055	94.550000	1,423,450.25
DOWDUPONT INC	222,518	71.160000	15,834,380.88
DR HORTON INC	34,594	50.000000	1,729,700.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,569	86.560000	1,520,772.64
DTE ENERGY COMPANY	17,136	112.650000	1,930,370.40
DUKE ENERGY CORP	66,920	88.780000	5,941,157.60
DXC TECHNOLOGY CO	26,616	97.760000	2,601,980.16
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,003	44.870000	1,211,624.61
EAST WEST BANCORP INC	14,628	57.640000	843,157.92
EASTMAN CHEMICAL CO	14,237	91.140000	1,297,560.18
EATON CORP PLC	42,655	75.920000	3,238,367.60
EATON VANCE CORP	10,305	52.610000	542,146.05
EBAY INC	97,328	35.840000	3,488,235.52
ECOLAB INC	24,952	132.860000	3,315,122.72
EDISON INTERNATIONAL	30,656	80.550000	2,469,340.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,627	109.340000	2,146,016.18
ELECTRONIC ARTS INC	29,522	107.940000	3,186,604.68
ELI LILLY & CO	94,785	84.030000	7,964,783.55
EMERSON ELECTRIC CO	61,075	61.630000	3,764,052.25
ENTERGY CORP	17,635	85.370000	1,505,499.95
ENVISION HEALTHCARE CORP	12,987	29.900000	388,311.30
EOG RESOURCES INC	54,880	101.660000	5,579,100.80
EQT CORP	24,122	57.650000	1,390,633.30
EQUIFAX INC	11,828	109.900000	1,299,897.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	21,054	126.190000	2,656,804.26
EVEREST RE GROUP LTD	4,105	217.670000	893,535.35
EVERSOURCE ENERGY	30,287	64.330000	1,948,362.71
EXELON CORP	88,670	41.630000	3,691,332.10
EXPEDIA INC	11,842	126.810000	1,501,684.02
EXPEDITORS INTL WASH INC	16,485	59.880000	987,121.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	56,371	61.180000	3,448,777.78

EXXON MOBIL CORP	404,288	81.420000	32,917,128.96	
F5 NETWORKS INC	5,809	123.190000	715,610.71	
FACEBOOK INC-A	225,552	182.780000	41,226,394.56	
FASTENAL CO	28,135	49.070000	1,380,584.45	
FEDEX CORP	24,247	217.000000	5,261,599.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	31,452	92.110000	2,897,043.72	
FIFTH THIRD BANCORP	71,088	28.200000	2,004,681.60	
FIRST DATA CORP- CLASS A	45,138	16.800000	758,318.40	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,134	92.940000	1,406,553.96	
FIRSTENERGY CORP	43,314	33.940000	1,470,077.16	
FISERV INC	19,871	128.130000	2,546,071.23	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,937	180.180000	1,610,268.66	
FLEX LTD	53,538	19.090000	1,022,040.42	
FLIR SYSTEMS INC	12,291	47.070000	578,537.37	
FLOWSERVE CORP	11,755	39.070000	459,267.85	
FLUOR CORP	12,821	46.890000	601,176.69	
FMC CORP	13,104	94.610000	1,239,769.44	
FNF GROUP	23,522	40.540000	953,581.88	
FOOT LOCKER INC	11,748	40.100000	471,094.80	
FORD MOTOR CO	351,579	12.100000	4,254,105.90	
FORTINET INC	13,493	41.910000	565,491.63	
FORTIVE CORP	29,437	72.130000	2,123,290.81	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15,300	64.680000	989,604.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,456	41.210000	1,337,511.76	
FREEMPORT-MCMORAN INC	130,593	14.350000	1,874,009.55	
GAP INC/THE	21,353	29.640000	632,902.92	
GARMIN LTD	10,947	61.790000	676,415.13	
GARTNER INC	8,949	116.390000	1,041,574.11	
GENERAL DYNAMICS CORP	24,440	200.000000	4,888,000.00	
GENERAL ELECTRIC CO	828,860	18.190000	15,076,963.40	
GENERAL MILLS INC	55,081	53.650000	2,955,095.65	
GENERAL MOTORS CO	129,438	44.460000	5,754,813.48	
GENUINE PARTS CO	14,340	86.840000	1,245,285.60	
GILEAD SCIENCES INC	124,704	72.460000	9,036,051.84	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,718	103.470000	1,522,871.46	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,808	235.950000	7,976,997.60	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,708	30.670000	788,464.36	
H&R BLOCK INC	18,609	25.660000	477,506.94	
HALLIBURTON CO	82,436	41.580000	3,427,688.88	
HANESBRANDS INC	37,085	19.820000	735,024.70	
HARLEY-DAVIDSON INC	15,803	47.400000	749,062.20	
HARRIS CORP	11,716	143.940000	1,686,401.04	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,804	55.640000	1,936,494.56	
HASBRO INC	11,161	94.650000	1,056,388.65	
HCA HEALTHCARE INC	27,700	77.190000	2,138,163.00	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18,177	35.030000	636,740.31	
HELMERICH & PAYNE	9,896	56.020000	554,373.92	
HENRY SCHEIN INC	15,435	69.970000	1,079,986.95	
HERSHEY CO/THE	13,877	107.450000	1,491,083.65	
HESS CORP	28,040	44.400000	1,244,976.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	154,385	13.320000	2,056,408.20	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,239	75.760000	1,457,546.64	
HOLLYFRONTIER CORP	15,538	44.050000	684,448.90	
HOLOGIC INC	27,757	40.870000	1,134,428.59	
HOME DEPOT INC	114,031	172.330000	19,650,962.23	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69,039	149.660000	10,332,376.74	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	119,000	7.200000	856,800.00	
HORMEL FOODS CORP	29,267	34.410000	1,007,077.47	
HP INC	161,552	21.240000	3,431,364.48	
HUMANA INC	13,766	240.510000	3,310,860.66	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8,881	104.160000	925,044.96	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,019	13.460000	1,413,555.74	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,563	234.450000	1,069,795.35	
IDEX CORP	7,629	130.690000	997,034.01	
IDEX LABORATORIES INC	8,530	154.810000	1,320,529.30	
IHS MARKIT LTD	38,549	43.770000	1,687,289.73	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,671	159.840000	4,742,612.64	
ILLUMINA INC	13,942	214.860000	2,995,578.12	
INCYTE CORP	16,393	98.780000	1,619,300.54	
INGERSOLL-RAND PLC	23,964	84.230000	2,018,487.72	

INGREDION INC	7,253	135.450000	982,418.85
INTEL CORP	449,110	44.750000	20,097,672.50
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	56,342	67.830000	3,821,677.86
INTERNATIONAL PAPER CO	36,963	54.920000	2,030,007.96
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	40,234	18.730000	753,582.82
INTL BUSINESS MACHINES CORP	85,142	151.840000	12,927,961.28
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,764	152.380000	1,183,078.32
INTUIT INC	23,156	153.910000	3,563,939.96
INTUITIVE SURGICAL INC	10,518	398.150000	4,187,741.70
INVESCO LTD	39,530	35.090000	1,387,107.70
IQVIA HOLDINGS INC	13,636	104.270000	1,421,825.72
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,253	114.570000	830,976.21
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,788	63.290000	682,772.52
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,400	64.940000	1,324,776.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,000	43.200000	950,400.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,095	138.700000	845,376.50
JM SMUCKER CO/THE	11,313	111.370000	1,259,928.81
JOHNSON & JOHNSON	257,033	138.010000	35,473,124.33
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89,081	36.910000	3,287,979.71
JONES LANG LASALLE INC	4,112	150.170000	617,499.04
JPMORGAN CHASE & CO	338,888	98.320000	33,319,468.16
JUNIPER NETWORKS INC	37,836	27.340000	1,034,436.24
KANSAS CITY SOUTHERN	10,450	106.420000	1,112,089.00
KELLOGG CO	25,074	64.930000	1,628,054.82
KEYCORP	103,966	18.140000	1,885,943.24
KIMBERLY-CLARK CORP	33,522	116.480000	3,904,642.56
KINDER MORGAN INC	190,441	17.190000	3,273,680.79
KLA-TENCOR CORP	15,078	105.040000	1,583,793.12
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,001	39.830000	477,999.83
KOHL'S CORP	15,405	45.090000	694,611.45
KRAFT HEINZ CO/THE	58,085	79.760000	4,632,859.60
KROGER CO	86,920	22.980000	1,997,421.60
L BRANDS INC	24,184	48.360000	1,169,538.24
L3 TECHNOLOGIES INC	7,503	190.020000	1,425,720.06
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,835	151.090000	1,485,970.15
LAM RESEARCH CORP	15,585	216.830000	3,379,295.55
LAS VEGAS SANDS CORP	37,148	67.650000	2,513,062.20
LEAR CORP	6,754	177.150000	1,196,471.10
LEGGETT & PLATT INC	11,889	46.490000	552,719.61
LEIDOS HOLDINGS INC	12,936	61.310000	793,106.16
LENNAR CORP - B SHS	403	50.620000	20,399.86
LENNAR CORP-A	20,161	61.020000	1,230,224.22
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,479	196.400000	683,275.60
LEUCADIA NATIONAL CORP	33,322	25.680000	855,708.96
LIBERTY BROADBAND-C	10,649	87.920000	936,260.08
LIBERTY GLOBAL PLC- C	55,289	29.690000	1,641,530.41
LIBERTY GLOBAL PLC-A	22,132	30.700000	679,452.40
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	42,342	24.820000	1,050,928.44
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,152	40.750000	372,944.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	17,803	40.750000	725,472.25
LINCOLN NATIONAL CORP	21,512	73.140000	1,573,387.68
LKQ CORP	30,462	38.050000	1,159,079.10
LOCKHEED MARTIN CORP	24,843	315.820000	7,845,916.26
LOEWS CORP	27,819	49.350000	1,372,867.65
LOWE'S COS INC	81,355	79.240000	6,446,570.20
LULULEMON ATHLETICA INC	9,233	66.790000	616,672.07
LYONDELLBASELL INDU-CL A	32,705	104.340000	3,412,439.70
M & T BANK CORP	13,078	159.140000	2,081,232.92
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7,087	65.500000	464,198.50
MACY'S INC	27,113	21.070000	571,270.91
MALLINCKRODT PLC	8,864	21.220000	188,094.08
MANPOWERGROUP INC	6,038	128.140000	773,709.32
MARATHON OIL CORP	83,800	15.130000	1,267,894.00
MARATHON PETROLEUM CORP	50,294	62.030000	3,119,736.82
MARKEL CORP	1,349	1,076.140000	1,451,712.86
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	30,694	126.500000	3,882,791.00
MARSH & MCLENNAN COS	48,992	82.340000	4,034,001.28
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,101	205.900000	1,256,195.90
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	36,096	23.800000	859,084.80
MASCO CORP	31,429	39.580000	1,243,959.82

MASTERCARD INC - A	90,367	152.740000	13,802,655.58
MATTEL INC	30,802	18.510000	570,145.02
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,436	53.850000	1,477,428.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,127	99.130000	1,103,019.51
MCDONALD'S CORP	77,687	169.110000	13,137,648.57
MCKESSON CORP	20,150	144.660000	2,914,899.00
MEDNAX INC	8,369	49.100000	410,917.90
MEDTRONIC PLC	130,591	83.250000	10,871,700.75
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	22,000	26.500000	583,000.00
MERCADOLIBRE INC	4,154	271.380000	1,127,312.52
MERCK & CO. INC.	260,985	54.350000	14,184,534.75
METLIFE INC	87,155	51.830000	4,517,243.65
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,475	635.020000	1,571,674.50
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,372	33.890000	1,503,767.08
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,995	56.610000	792,256.95
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,693	90.970000	1,973,412.21
MICRON TECHNOLOGY INC	100,208	49.680000	4,978,333.44
MICROSOFT CORP	699,743	83.260000	58,260,602.18
MIDDLEBY CORP	5,968	118.040000	704,462.72
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,087	275.550000	1,677,272.85
MOLSON COORS BREWING CO -B	18,094	79.670000	1,441,548.98
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	144,821	42.150000	6,104,205.15
MONSANTO CO	41,856	118.130000	4,944,449.28
MONSTER BEVERAGE CORP	37,480	61.750000	2,314,390.00
MOODY'S CORP	16,237	150.230000	2,439,284.51
MORGAN STANLEY	132,370	49.060000	6,494,072.20
MOSAIC CO/THE	30,291	23.850000	722,440.35
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,891	92.360000	1,467,692.76
MSCI INC	9,012	128.900000	1,161,646.80
MURPHY OIL CORP	14,705	28.670000	421,592.35
MYLAN NV	44,026	37.370000	1,645,251.62
NASDAQ INC	11,716	77.250000	905,061.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,990	31.850000	1,178,131.50
NAVIENT CORP	25,770	12.340000	318,001.80
NETAPP INC	26,554	56.410000	1,497,911.14
NETFLIX INC	41,118	195.750000	8,048,848.50
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	44,196	12.750000	563,499.00
NEWELL BRANDS INC	44,973	28.370000	1,275,884.01
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,967	30.740000	552,305.58
NEWMONT MINING CORP	50,566	36.680000	1,854,760.88
NEWS CORP - CLASS A	34,402	15.770000	542,519.54
NEXTERA ENERGY INC	44,718	156.030000	6,977,349.54
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,576	36.510000	1,262,369.76
NIKE INC -CL B	126,042	59.320000	7,476,811.44
NISOURCE INC	29,792	27.040000	805,575.68
NOBLE ENERGY INC	45,693	25.990000	1,187,561.07
NORDSTROM INC	11,209	40.960000	459,120.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,565	130.010000	3,583,725.65
NORTHERN TRUST CORP	20,688	94.260000	1,950,050.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,796	302.720000	4,781,765.12
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	18,132	55.500000	1,006,326.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,962	14.740000	382,679.88
NUCOR CORP	30,361	55.930000	1,698,090.73
NVIDIA CORP	56,765	216.960000	12,315,734.40
NVR INC	353	3,401.380000	1,200,687.14
NXP SEMICONDUCTORS NV	32,965	114.650000	3,779,437.25
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,138	68.420000	5,004,101.96
OGE ENERGY CORP	18,186	34.900000	634,691.40
OMNICOM GROUP	22,390	68.970000	1,544,238.30
ONEOK INC	35,928	51.040000	1,833,765.12
ORACLE CORP	294,248	49.010000	14,421,094.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,639	216.260000	1,868,270.14
P G & E CORP	48,947	54.060000	2,646,074.82
PACCAR INC	32,864	66.940000	2,199,916.16
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,301	111.470000	1,036,782.47
PALO ALTO NETWORKS INC	8,933	150.640000	1,345,667.12
PARKER HANNIFIN CORP	12,534	183.280000	2,297,231.52
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,264	26.970000	546,520.08
PATTERSON COS INC	7,395	35.270000	260,821.65
PAYCHEX INC	30,673	64.690000	1,984,236.37

PAYPAL HOLDINGS INC	108,768	78.570000	8,545,901.76
PENTAIR PLC	17,233	69.160000	1,191,834.28
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	30,850	18.120000	559,002.00
PEPSICO INC	136,239	115.900000	15,790,100.10
PERRIGO CO PLC	12,801	86.570000	1,108,182.57
PFIZER INC	569,245	35.490000	20,202,505.05
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,175	103.180000	15,288,696.50
PHILLIPS 66	41,662	93.640000	3,901,229.68
PINNACLE WEST CAPITAL	11,336	89.520000	1,014,798.72
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,640	154.100000	2,564,224.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,094	132.560000	6,110,220.64
POLARIS INDUSTRIES INC	5,389	123.140000	663,601.46
PPG INDUSTRIES INC	24,832	116.100000	2,882,995.20
PPL CORP	64,226	36.310000	2,332,046.06
PRAXAIR INC	27,301	152.880000	4,173,776.88
PRICELINE GROUP INC/THE	4,688	1,758.420000	8,243,472.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,470	68.650000	1,885,815.50
PROCTER & GAMBLE CO/THE	243,778	88.450000	21,562,164.10
PROGRESSIVE CORP	54,270	51.850000	2,813,899.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40,866	108.920000	4,451,124.72
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,931	51.560000	2,471,322.36
PULTEGROUP INC	25,803	33.150000	855,369.45
PVH CORP	7,809	135.470000	1,057,885.23
QORVO INC	11,442	80.620000	922,454.04
QUALCOMM INC	140,947	68.910000	9,712,657.77
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,303	91.620000	1,218,820.86
RALPH LAUREN CORP	4,951	91.420000	452,620.42
RANGE RESOURCES CORP	22,261	17.370000	386,673.57
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,822	84.950000	1,004,278.90
RAYTHEON COMPANY	27,722	186.060000	5,157,955.32
RED HAT INC	16,940	128.360000	2,174,418.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,571	384.850000	2,913,699.35
REGIONS FINANCIAL CORP	114,690	15.570000	1,785,723.30
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,825	158.590000	923,786.75
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,620	133.740000	484,138.80
REPUBLIC SERVICES INC	22,704	62.330000	1,415,140.32
RESMED INC	13,930	85.110000	1,185,582.30
ROBERT HALF INTL INC	11,431	54.690000	625,161.39
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,165	191.480000	2,329,354.20
ROCKWELL COLLINS INC	15,308	132.580000	2,029,534.64
ROLLINS INC	8,805	45.220000	398,162.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,586	260.360000	2,495,810.96
ROSS STORES INC	36,726	71.320000	2,619,298.32
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,272	125.210000	2,037,417.12
S&P GLOBAL INC	24,456	164.140000	4,014,207.84
SABRE CORP	18,948	19.340000	366,454.32
SALESFORCE.COM INC	64,482	107.150000	6,909,246.30
SBA COMMUNICATIONS CORP	11,539	169.720000	1,958,399.08
SCANA CORP	12,154	41.860000	508,766.44
SCHLUMBERGER LTD	132,885	61.930000	8,229,568.05
SCHWAB (CHARLES) CORP	114,789	45.780000	5,255,040.42
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,651	80.370000	614,910.87
SEAGATE TECHNOLOGY	29,719	40.290000	1,197,378.51
SEALED AIR CORP	17,712	45.570000	807,135.84
SEATTLE GENETICS INC	9,002	58.940000	530,577.88
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,143	68.480000	831,552.64
SEMPRA ENERGY	22,405	118.700000	2,659,473.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	17,473	48.840000	853,381.32
SERVICENOW INC	16,115	128.300000	2,067,554.50
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,997	394.030000	3,151,057.91
SIGNATURE BANK	4,963	129.570000	643,055.91
SIGNET JEWELERS LTD	5,531	49.800000	275,443.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	165,503	5.440000	900,336.32
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,545	109.750000	1,925,563.75
SMITH (A.O.) CORP	14,799	60.580000	896,523.42
SNAP-ON INC	5,853	159.700000	934,724.10
SOUTHERN CO/THE	95,245	51.390000	4,894,640.55
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,731	55.140000	867,407.34
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,399	113.490000	272,262.51
SPLUNK INC	13,971	84.100000	1,174,961.10



SPRINT CORP	71,605	6.150000	440,370.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,592	40.880000	637,400.96
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,397	165.990000	2,389,758.03
STARBUCKS CORP	138,087	56.800000	7,843,341.60
STATE STREET CORP	35,879	92.460000	3,317,372.34
STEEL DYNAMICS INC	24,439	37.490000	916,218.11
STERICYCLE INC	7,624	63.050000	480,693.20
STRYKER CORP	32,096	154.670000	4,964,288.32
SUNTRUST BANKS INC	46,798	57.210000	2,677,313.58
SVB FINANCIAL GROUP	5,251	213.100000	1,118,988.10
SYMANTEC CORP	57,384	28.560000	1,638,887.04
SYNCHRONY FINANCIAL	76,369	33.490000	2,557,597.81
SYNOPSIS INC	14,659	90.150000	1,321,508.85
SYSCO CORP	49,403	54.920000	2,713,212.76
T ROWE PRICE GROUP INC	22,934	97.880000	2,244,779.92
TAPESTRY INC	27,688	40.860000	1,131,331.68
TARGA RESOURCES CORP	21,552	43.390000	935,141.28
TARGET CORP	50,002	55.880000	2,794,111.76
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,100	115.450000	126,995.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,827	49.120000	1,268,622.24
TE CONNECTIVITY LTD	33,893	95.260000	3,228,647.18
TECHNIPFMC PLC	43,400	26.920000	1,168,328.00
TELEFLEX INC	4,438	267.710000	1,188,096.98
TESARO INC	3,392	83.410000	282,926.72
TESLA INC	12,535	315.550000	3,955,419.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	87,900	13.700000	1,204,230.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	94,885	99.300000	9,422,080.50
TEXTRON INC	25,896	53.300000	1,380,256.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,339	193.510000	7,225,469.89
TIFFANY & CO	12,266	93.040000	1,141,228.64
TIME WARNER INC	73,910	89.500000	6,614,945.00
TJX COMPANIES INC	61,299	70.870000	4,344,260.13
T-MOBILE US INC	27,617	61.680000	1,703,416.56
TOLL BROTHERS INC	13,859	48.400000	670,775.60
TORCHMARK CORP	11,240	85.160000	957,198.40
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,392	74.510000	1,221,367.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,482	64.290000	738,177.78
TRANSDIGM GROUP INC	5,056	275.650000	1,393,686.40
TRAVELERS COS INC/THE	26,575	129.830000	3,450,232.25
TRIMBLE INC	25,256	42.110000	1,063,530.16
TRIPADVISOR INC	10,389	34.170000	354,992.13
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	43,568	29.780000	1,297,455.04
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	97,545	30.470000	2,972,196.15
TWITTER INC	61,572	22.420000	1,380,444.24
TYSON FOODS INC-CL A	27,357	80.470000	2,201,417.79
UGI CORP	15,824	47.450000	750,848.80
ULTA BEAUTY INC	5,712	210.370000	1,201,633.44
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	16,507	12.990000	214,425.93
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,041	11.590000	197,505.19
UNION PACIFIC CORP	77,026	118.250000	9,108,324.50
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	7,192	59.430000	427,420.56
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	65,733	113.140000	7,437,031.62
UNITED RENTALS INC	8,328	153.160000	1,275,516.48
UNITED TECHNOLOGIES CORP	72,615	116.910000	8,489,419.65
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,067	125.010000	508,415.67
UNITEDHEALTH GROUP INC	91,906	212.510000	19,530,944.06
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,958	100.480000	900,099.84
UNUM GROUP	22,457	54.090000	1,214,699.13
US BANCORP	160,595	51.830000	8,323,638.85
VAIL RESORTS INC	3,609	232.040000	837,432.36
VALERO ENERGY CORP	42,687	82.250000	3,511,005.75
VANTIV INC - CL A	16,026	72.400000	1,160,282.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,136	108.870000	994,636.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,740	62.810000	611,769.40
VERISIGN INC	9,175	117.240000	1,075,677.00
VERISK ANALYTICS INC	15,321	93.880000	1,438,335.48
VERIZON COMMUNICATIONS INC	389,250	47.010000	18,298,642.50
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,776	146.550000	3,484,372.80
VF CORP	32,144	73.890000	2,375,120.16
VIACOM INC-CLASS B	35,440	26.290000	931,717.60

VISA INC-CLASS A SHARES	175,945	111.970000	19,700,561.65	
VMWARE INC-CLASS A	6,356	124.220000	789,542.32	
VOYA FINANCIAL INC	16,758	42.060000	704,841.48	
VULCAN MATERIALS CO	12,700	122.320000	1,553,464.00	
WABCO HOLDINGS INC	4,624	145.790000	674,132.96	
WABTEC CORP	7,807	73.150000	571,082.05	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	87,683	70.280000	6,162,361.24	
WAL-MART STORES INC	144,515	96.620000	13,963,039.30	
WALT DISNEY CO/THE	149,273	102.640000	15,321,380.72	
WASTE CONNECTIONS INC	25,082	68.890000	1,727,898.98	
WASTE MANAGEMENT INC	42,154	80.380000	3,388,338.52	
WATERS CORP	7,706	195.950000	1,509,990.70	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	84,855	3.480000	295,295.40	
WEC ENERGY GROUP INC	30,060	68.530000	2,060,011.80	
WELLS FARGO & CO	452,903	54.090000	24,497,523.27	
WESTAR ENERGY INC	13,089	56.160000	735,078.24	
WESTERN DIGITAL CORP	27,303	92.780000	2,533,172.34	
WESTERN UNION CO	47,692	19.650000	937,147.80	
WESTROCK CO	24,233	58.860000	1,426,354.38	
WHIRLPOOL CORP	7,211	167.820000	1,210,150.02	
WILLIAMS COS INC	80,972	28.070000	2,272,884.04	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,175	159.520000	1,942,156.00	
WORKDAY INC-CLASS A	12,697	116.140000	1,474,629.58	
WR BERKLEY CORP	8,757	66.190000	579,625.83	
WR GRACE & CO	6,231	73.850000	460,159.35	
WW GRAINGER INC	5,552	200.150000	1,111,232.80	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	10,325	109.070000	1,126,147.75	
WYNN RESORTS LTD	8,080	159.420000	1,288,113.60	
XCEL ENERGY INC	47,986	50.710000	2,433,370.06	
XEROX CORP	22,536	28.490000	642,050.64	
XILINX INC	23,676	72.880000	1,725,506.88	
XL GROUP LTD	25,881	38.080000	985,548.48	
XYLEM INC	16,416	67.690000	1,111,199.04	
YUM! BRANDS INC	31,090	79.180000	2,461,706.20	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,621	35.590000	591,541.39	
ZILLOW GROUP INC - C	9,384	42.030000	394,409.52	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,871	113.070000	2,133,743.97	
ZIONS BANCORPORATION	20,248	46.350000	938,494.80	
ZOETIS INC	46,901	71.290000	3,343,572.29	
アメリカドル 小計	29,307,222		2,170,830,527.34 (242,394,936,682)	
カナダドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	22,900	57.220000	1,310,338.00	
AGRIUM INC	13,300	138.470000	1,841,651.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,900	64.080000	2,556,792.00	
ALTAGAS LTD	15,500	29.420000	456,010.00	
ARC RESOURCES LTD	31,600	15.770000	498,332.00	
ATCO LTD -CLASS I	7,200	45.960000	330,912.00	
BANK OF MONTREAL	62,300	99.060000	6,171,438.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	114,700	83.730000	9,603,831.00	
BARRICK GOLD CORP	110,400	18.060000	1,993,824.00	
BCE INC	15,800	61.730000	975,334.00	
BLACKBERRY LTD	46,000	13.620000	626,520.00	
BOMBARDIER INC-B	174,700	3.090000	539,823.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	85,200	53.370000	4,547,124.00	
CAE INC	23,900	22.820000	545,398.00	
CAMECO CORP	35,700	12.650000	451,605.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,000	115.100000	4,719,100.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	72,300	101.710000	7,353,633.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	106,400	44.070000	4,689,048.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,800	221.070000	3,050,766.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6,700	161.340000	1,080,978.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	11,800	38.540000	454,772.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	12,500	59.650000	745,625.00	
CENOVUS ENERGY INC	103,800	12.280000	1,274,664.00	
CGI GROUP INC - CLASS A	20,800	69.160000	1,438,528.00	
CI FINANCIAL CORP	23,700	28.680000	679,716.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,000	776.780000	1,553,560.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	49,000	9.600000	470,400.00	
DOLLARAMA INC	10,600	162.030000	1,717,518.00	

ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	35,200	9.800000	344,960.00	
EMERA INC	5,400	48.630000	262,602.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,600	24.920000	388,752.00	
ENBRIDGE INC	157,000	47.400000	7,441,800.00	
ENCANA CORP	96,500	15.160000	1,462,940.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,700	688.110000	1,857,897.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	30.950000	470,440.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	20.950000	289,110.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	70,300	15.900000	1,117,770.00	
FORTIS INC	40,400	48.030000	1,940,412.00	
FRANCO-NEVADA CORP	17,400	107.550000	1,871,370.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23,400	39.900000	933,660.00	
GOLDCORP INC	85,100	16.760000	1,426,276.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	30,300	35.410000	1,072,923.00	
HUSKY ENERGY INC	31,878	15.420000	491,558.76	
HYDRO ONE LTD	32,700	22.790000	745,233.00	
IGM FINANCIAL INC	7,700	45.250000	348,425.00	
IMPERIAL OIL LTD	29,900	39.400000	1,178,060.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,500	59.670000	566,865.00	
INTACT FINANCIAL CORP	12,900	108.250000	1,396,425.00	
INTER PIPELINE LTD	35,100	26.880000	943,488.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,300	24.320000	177,536.00	
KEYERA CORP	16,900	36.890000	623,441.00	
KINROSS GOLD CORP	112,100	5.400000	605,340.00	
LINAMAR CORP	4,400	68.360000	300,784.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	68.250000	1,467,375.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,400	68.710000	2,363,624.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	187,400	26.900000	5,041,060.00	
METHANEX CORP	8,000	66.860000	534,880.00	
METRO INC	23,400	40.270000	942,318.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	32,500	63.310000	2,057,575.00	
ONEX CORPORATION	7,500	93.620000	702,150.00	
OPEN TEXT CORP	26,700	42.260000	1,128,342.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	48,232	44.900000	2,165,616.80	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,900	15.370000	229,013.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	80,500	24.700000	1,988,350.00	
POWER CORP OF CANADA	35,800	32.960000	1,179,968.00	
POWER FINANCIAL CORP	22,700	35.720000	810,844.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	19,188	32.750000	628,407.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,610	84.210000	1,819,778.10	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	34,400	68.620000	2,360,528.00	
ROYAL BANK OF CANADA	139,000	101.060000	14,047,340.00	
SAPUTO INC	21,800	44.120000	961,816.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,100	17.310000	382,551.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,100	28.300000	1,191,430.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	8,000	142.200000	1,137,600.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,800	56.150000	999,470.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,600	50.530000	2,910,528.00	
SUNCOR ENERGY INC	159,900	44.990000	7,193,901.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	55,700	29.640000	1,650,948.00	
TELUS CORP	11,600	48.780000	565,848.00	
THOMSON REUTERS CORP	27,900	56.390000	1,573,281.00	
TORONTO-DOMINION BANK	175,900	73.990000	13,014,841.00	
TOURMALINE OIL CORP	20,400	23.440000	478,176.00	
TRANSCANADA CORP	83,700	63.480000	5,313,276.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	90,900	3.900000	354,510.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	29,800	21.070000	627,886.00	
VERMILION ENERGY INC	10,100	45.420000	458,742.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	81.740000	498,614.00	
WESTON (GEORGE) LTD	4,600	109.520000	503,792.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,800	27.250000	1,084,550.00	
YAMANA GOLD INC	83,800	3.380000	283,244.00	
カナダドル 小計	3,909,508		170,587,480.66 (14,984,404,301)	
オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	64,974	23.900000	1,552,878.60	
ALUMINA LTD	220,517	2.240000	493,958.08	
AMCOR LIMITED	112,709	15.530000	1,750,370.77	
AMP LTD	290,105	5.130000	1,488,238.65	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	50,407	23.080000	1,163,393.56	

ASX LTD	18,065	55.770000	1,007,485.05	
AURIZON HOLDINGS LTD	214,288	5.120000	1,097,154.56	
AUSNET SERVICES	184,070	1.815000	334,087.05	
AUST AND NZ BANKING GROUP	281,097	28.880000	8,118,081.36	
BANK OF QUEENSLAND LTD	36,107	12.580000	454,226.06	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,263	11.270000	487,574.01	
BHP BILLITON LIMITED	307,604	27.970000	8,603,683.88	
BLUESCOPE STEEL LTD	51,047	13.810000	704,959.07	
BORAL LTD	106,059	7.540000	799,684.86	
BRAMBLES LTD	157,555	10.000000	1,575,550.00	
CALTEX AUSTRALIA LTD	24,027	34.900000	838,542.30	
CHALLENGER LTD	53,120	13.740000	729,868.80	
CIMIC GROUP LTD	8,873	50.630000	449,239.99	
COCA-COLA AMATIL LTD	52,552	7.640000	401,497.28	
COCHLEAR LTD	5,273	182.480000	962,217.04	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	165,518	80.570000	13,335,785.26	
COMPUTERSHARE LTD	42,496	16.250000	690,560.00	
CROWN RESORTS LTD	35,622	12.430000	442,781.46	
CSL LTD	43,421	146.560000	6,363,781.76	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	46.640000	272,144.40	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,138	45.470000	233,624.86	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	140,882	4.640000	653,692.48	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	3.920000	204,588.72	
HEALTHSCOPE LTD	161,984	1.920000	311,009.28	
INCITEC PIVOT LTD	153,458	3.930000	603,089.94	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	234,237	7.270000	1,702,902.99	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	40,661	21.410000	870,552.01	
LENDELEASE GROUP	57,156	16.050000	917,353.80	
MACQUARIE GROUP LTD	30,710	99.340000	3,050,731.40	
MEDIBANK PRIVATE LTD	249,799	3.190000	796,858.81	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	256,388	29.560000	7,578,829.28	
NEWCREST MINING LTD	74,529	23.740000	1,769,318.46	
OIL SEARCH LTD	142,776	7.200000	1,027,987.20	
ORICA LTD	34,168	17.360000	593,156.48	
ORIGIN ENERGY LTD	174,771	8.580000	1,499,535.18	
QANTAS AIRWAYS LTD	45,862	5.570000	255,451.34	
QBE INSURANCE GROUP LTD	135,829	10.790000	1,465,594.91	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	13,281	68.170000	905,365.77	
REA GROUP LTD	4,869	77.260000	376,178.94	
RIO TINTO LTD	40,136	72.100000	2,893,805.60	
SANTOS LTD	171,653	5.070000	870,280.71	
SEEK LTD	30,420	19.100000	581,022.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	36,466	21.950000	800,428.70	
SOUTH32 LTD	511,684	3.420000	1,749,959.28	
SUNCORP GROUP LTD	127,178	14.110000	1,794,481.58	
SYDNEY AIRPORT	102,875	7.420000	763,332.50	
TABCORP HOLDINGS LTD	76,450	4.840000	370,018.00	
TATTS GROUP LTD	120,457	4.330000	521,578.81	
TELSTRA CORP LTD	410,084	3.480000	1,427,092.32	
TPG TELECOM LTD	34,153	5.740000	196,038.22	
TRANSURBAN GROUP	197,103	12.710000	2,505,179.13	
TREASURY WINE ESTATES LTD	76,007	15.830000	1,203,190.81	
WESFARMERS LTD	108,734	43.210000	4,698,396.14	
WESTPAC BANKING CORP	321,319	31.510000	10,124,761.69	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	72,511	31.520000	2,285,546.72	
WOOLWORTHS LTD	126,861	26.310000	3,337,712.91	
オーストラリアドル 小計	7,147,384		115,056,390.82 (9,777,492,091)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	94,618	9.295000	879,474.31	
ADMIRAL GROUP PLC	17,849	18.860000	336,632.14	
ANGLO AMERICAN PLC	125,414	14.605000	1,831,671.47	
ANTOFAGASTA PLC	35,355	9.785000	345,948.67	
ASHTED GROUP PLC	48,894	19.190000	938,275.86	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,225	30.430000	1,041,466.75	
ASTRAZENECA PLC	120,822	49.830000	6,020,560.26	
AUTO TRADER GROUP PLC	87,980	3.323000	292,357.54	
AVIVA PLC	395,251	4.994000	1,973,883.49	
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	6.660000	151,654.86	
BAE SYSTEMS PLC	310,241	5.420000	1,681,506.22	

BARCLAYS PLC	1,626,221	1.893500	3,079,249.46
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	101,916	6.005000	612,005.58
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	11,651	36.750000	428,174.25
BHP BILLITON PLC	201,121	14.105000	2,836,811.70
BP PLC	1,877,332	5.013000	9,411,065.31
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	219,395	50.040000	10,978,525.80
BT GROUP PLC	809,015	2.464500	1,993,817.46
BUNZL PLC	33,394	21.360000	713,295.84
BURBERRY GROUP PLC	43,692	17.400000	760,240.80
CAPITA PLC	60,112	4.673000	280,903.37
CARNIVAL PLC	18,291	49.580000	906,867.78
CENTRICA PLC	534,930	1.390000	743,552.70
COBHAM PLC	215,766	1.254000	270,570.56
COCA-COLA HBC AG-DI	16,463	24.180000	398,075.34
COMPASS GROUP PLC	150,650	15.100000	2,274,815.00
CONVATEC GROUP PLC	123,135	1.955000	240,728.92
CRODA INTERNATIONAL PLC	11,925	43.030000	513,132.75
DCC PLC	9,033	70.900000	640,439.70
DIAGEO PLC	240,053	26.225000	6,295,389.92
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	123,007	3.569000	439,011.98
DIXONS CARPHONE PLC	88,716	1.558000	138,219.52
EASYJET PLC	15,270	13.650000	208,435.50
EXPERIAN PLC	89,627	15.780000	1,414,314.06
FERGUSON PLC	24,232	53.200000	1,289,142.40
FRESNILLO PLC	19,964	13.650000	272,508.60
G4S PLC	140,955	2.574000	362,818.17
GKN PLC	175,545	3.061000	537,343.24
GLAXOSMITHKLINE PLC	469,569	12.975000	6,092,657.77
GLENCORE PLC	1,168,333	3.623500	4,233,454.62
HARGREAVES LANSDOWN PLC	23,412	16.200000	379,274.40
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,120	10.520000	138,022.40
HSBC HOLDINGS PLC	1,912,108	7.357000	14,067,378.55
IMI PLC	24,418	12.540000	306,201.72
IMPERIAL BRANDS PLC	90,556	31.315000	2,835,761.14
INMARSAT PLC	41,039	4.817000	197,684.86
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	18,142	43.440000	788,088.48
INTERTEK GROUP PLC	15,986	51.500000	823,279.00
INVESTEC PLC	59,244	5.005000	296,516.22
ITV PLC	367,957	1.504000	553,407.32
JOHNSON MATTHEY PLC	19,499	30.830000	601,154.17
KINGFISHER PLC	223,221	3.161000	705,601.58
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	563,705	2.660000	1,499,455.30
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,847,512	0.660900	4,525,520.68
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,985	37.760000	1,132,233.60
MARKS & SPENCER GROUP PLC	144,127	2.978000	429,210.20
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,328	5.205000	173,472.24
MEGGITT PLC	69,419	4.811000	333,974.80
MERLIN ENTERTAINMENT	63,785	3.619000	230,837.91
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	42,357	26.550000	1,124,578.35
MONDI PLC	36,476	17.510000	638,694.76
NATIONAL GRID PLC	329,635	8.666000	2,856,616.91
NEXT PLC	14,731	43.060000	634,316.86
OLD MUTUAL PLC	479,781	1.926000	924,058.20
PEARSON PLC	73,661	7.080000	521,519.88
PERSIMMON PLC	30,482	25.560000	779,119.92
PRUDENTIAL PLC	246,448	18.830000	4,640,615.84
RANDGOLD RESOURCES LTD	8,362	72.800000	608,753.60
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	63,615	64.700000	4,115,890.50
RELX PLC	100,828	17.640000	1,778,605.92
RIO TINTO PLC	117,836	36.550000	4,306,905.80
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	157,182	8.865000	1,393,418.43
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	7,218,182	0.001000	7,218.18
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	349,611	2.708000	946,746.58
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	427,414	23.375000	9,990,802.25
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357,101	23.850000	8,516,858.85
ROYAL MAIL PLC	80,182	4.130000	331,151.66
RSA INSURANCE GROUP PLC	104,248	6.035000	629,136.68
SAGE GROUP PLC/THE	107,162	8.045000	862,118.29
SAINSBURY (J) PLC	146,652	2.274000	333,486.64
SCHRODERS PLC	11,080	34.570000	383,035.60

SEVERN TRENT PLC	22,827	21.060000	480,736.62	
SHIRE PLC	86,716	37.110000	3,218,030.76	
SKY PLC	100,562	9.400000	945,282.80	
SMITH & NEPHEW PLC	83,779	13.190000	1,105,045.01	
SMITHS GROUP PLC	36,608	15.030000	550,218.24	
SSE PLC	96,657	13.440000	1,299,070.08	
ST JAMES'S PLACE PLC	53,880	11.860000	639,016.80	
STANDARD CHARTERED PLC	314,169	7.399000	2,324,536.43	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	259,900	4.190000	1,088,981.00	
TATE & LYLE PLC	41,375	6.835000	282,798.12	
TAYLOR WIMPEY PLC	331,747	1.922000	637,617.73	
TESCO PLC	775,096	1.926000	1,492,834.89	
TRAVIS PERKINS PLC	22,414	15.210000	340,916.94	
TUI AG-DI	39,635	13.560000	537,450.60	
UNILEVER PLC	122,089	42.610000	5,202,212.29	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,864	7.895000	567,366.28	
VODAFONE GROUP PLC	2,538,781	2.255000	5,724,951.15	
WEIR GROUP PLC/THE	19,526	20.460000	399,501.96	
WHITBREAD PLC	18,349	35.760000	656,160.24	
WM MORRISON SUPERMARKETS	197,017	2.122000	418,070.07	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	63,450	7.095000	450,177.75	
WORLDPAY GROUP PLC	198,953	4.150000	825,654.95	
WPP PLC	119,240	12.560000	1,497,654.40	
イギリスポンド 小計	36,590,956		180,884,009.05 (26,911,922,866)	
スイスフラン				
ABB LTD-REG	188,932	25.080000	4,738,414.56	
ADECCO GROUP AG-REG	15,950	73.550000	1,173,122.50	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,469	151.200000	675,712.80	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	200	1,769.000000	353,800.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	111	5,630.000000	624,930.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	9	66,725.000000	600,525.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	49,768	86.850000	4,322,350.80	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	231,030	16.350000	3,777,340.50	
DUFREY AG-REG	3,168	143.800000	455,558.40	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	742	655.000000	486,010.00	
GEBERIT AG-REG	3,557	427.000000	1,518,839.00	
GIVAUDAN-REG	883	2,231.000000	1,969,973.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	21,909	60.250000	1,320,017.25	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5,439	169.400000	921,366.60	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	44,301	55.450000	2,456,490.45	
LONZA GROUP AG-REG	7,076	258.900000	1,831,976.40	
NESTLE SA-REG	296,905	85.200000	25,296,306.00	
NOVARTIS AG-REG	212,307	83.400000	17,706,403.80	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,491	83.400000	291,149.40	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,703	671.000000	1,142,713.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	67,073	246.500000	16,533,494.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,922	214.900000	413,037.80	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,989	219.800000	876,782.20	
SGS SA-REG	535	2,423.000000	1,296,305.00	
SIKA AG-BR	207	7,525.000000	1,557,675.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	5,256	164.100000	862,509.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	907	733.000000	664,831.00	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,003	365.000000	1,096,095.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,171	70.550000	364,814.05	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,190	334.500000	1,067,055.00	
SWISS PRIME SITE-REG	6,430	85.600000	550,408.00	
SWISS RE AG	30,900	92.100000	2,845,890.00	
SWISSCOM AG-REG	2,522	510.500000	1,287,481.00	
UBS GROUP AG-REG	349,512	16.940000	5,920,733.28	
VIFOR PHARMA AG	4,430	126.700000	561,281.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,411	298.100000	4,295,919.10	
スイスフラン 小計	1,591,408		111,857,310.99 (12,740,547,721)	
香港ドル				
AIA GROUP LTD	1,153,800	68.350000	78,862,230.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,900	119.700000	2,860,830.00	
BANK OF EAST ASIA LTD	134,420	33.600000	4,516,512.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	352,500	37.350000	13,165,875.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	246,368	66.200000	16,309,561.60	

CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	258,868	98.750000	25,563,215.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	61,000	67.000000	4,087,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	161,500	80.800000	13,049,200.00	
FIRST PACIFIC CO	200,000	5.780000	1,156,000.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	226,000	58.050000	13,119,300.00	
HANG LUNG GROUP LTD	80,000	27.000000	2,160,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,000	17.760000	3,232,320.00	
HANG SENG BANK LTD	73,100	185.800000	13,581,980.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	121,589	52.450000	6,377,343.05	
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	345,000	9.720000	3,353,400.00	
HONG KONG & CHINA GAS	819,168	14.960000	12,254,753.28	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,500	247.000000	27,540,500.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	56,000	39.750000	2,226,000.00	
KERRY PROPERTIES LTD	59,500	34.700000	2,064,650.00	
LI & FUNG LTD	534,000	3.460000	1,847,640.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	86,800	19.180000	1,664,824.00	
MTR CORP	152,500	45.500000	6,938,750.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	545,000	11.500000	6,267,500.00	
NWS HOLDINGS LTD	141,500	13.980000	1,978,170.00	
PCCW LTD	404,000	4.520000	1,826,080.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	137,000	66.900000	9,165,300.00	
SANDS CHINA LTD	238,000	37.600000	8,948,800.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	17.800000	2,064,800.00	
SINO LAND CO	341,400	13.980000	4,772,772.00	
SJM HOLDINGS LTD	175,000	6.120000	1,071,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	142,000	130.000000	18,460,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	45,000	75.100000	3,379,500.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	105,600	26.550000	2,803,680.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	124,500	46.050000	5,733,225.00	
WH GROUP LTD	738,000	8.100000	5,977,800.00	
WHARF HOLDINGS LTD	119,000	25.450000	3,028,550.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	49.500000	5,890,500.00	
WHEELOCK & CO LTD	73,000	54.850000	4,004,050.00	
WYNN MACAU LTD	141,600	22.750000	3,221,400.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	67,500	27.900000	1,883,250.00	
香港ドル 小計	9,212,613		346,408,260.93 (4,953,638,131)	
シンガポールドル				
CAPITALAND LTD	270,500	3.570000	965,685.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	37,200	12.240000	455,328.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	197,100	2.040000	402,084.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	173,400	25.000000	4,335,000.00	
GENTING SINGAPORE PLC	549,100	1.380000	757,758.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	242,100	3.340000	808,614.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.375000	239,835.00	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,000	39.530000	355,770.00	
KEPPEL CORP LTD	134,200	7.750000	1,040,050.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	307,800	12.050000	3,708,990.00	
SATS LTD	62,600	5.150000	322,390.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	92,600	3.110000	287,986.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	68,140	10.580000	720,921.20	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	94,000	7.500000	705,000.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,550	2.720000	398,616.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	143,900	3.260000	469,114.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	809,060	3.690000	2,985,431.40	
STARHUB LTD	58,200	2.850000	165,870.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	124,700	26.000000	3,242,200.00	
UOL GROUP LTD	43,800	8.920000	390,696.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,100	3.170000	463,137.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	208,500	1.670000	348,195.00	
シンガポールドル 小計	4,558,110		23,568,670.60 (1,954,078,479)	
ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,732	6.310000	547,278.92	
CONTACT ENERGY LTD	65,898	5.630000	371,005.74	
FLETCHER BUILDING LTD	62,019	6.860000	425,450.34	
MERCURY NZ LTD	64,309	3.365000	216,399.78	
MERIDIAN ENERGY LTD	126,539	2.950000	373,290.05	
RYMAN HEALTHCARE LTD	35,654	9.800000	349,409.20	
SPARK NEW ZEALAND LTD	202,204	3.645000	737,033.58	

ニュージーランドドル 小計	643,355		3,019,867.61 (231,684,243)	
スウェーデンクローネ				
ALFA LAVAL AB	30,495	203.800000	6,214,881.00	
ASSA ABLOY AB-B	94,064	170.100000	16,000,286.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	63,222	368.300000	23,284,662.60	
ATLAS COPCO AB-B SHS	37,514	329.300000	12,353,360.20	
BOLIDEN AB	27,383	281.600000	7,711,052.80	
ELECTROLUX AB-SER B	24,544	280.300000	6,879,683.20	
ERICSSON LM-B SHS	293,825	53.600000	15,749,020.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,860	247.000000	14,291,420.00	
GETINGE AB-B SHS	22,021	151.200000	3,329,575.20	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	92,630	189.500000	17,553,385.00	
HEXAGON AB-B SHS	25,251	422.200000	10,660,972.20	
HUSQVARNA AB-B SHS	37,258	76.450000	2,848,374.10	
ICA GRUPPEN AB	7,186	299.400000	2,151,488.40	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,468	205.600000	2,974,620.80	
INVESTOR AB-B SHS	42,640	397.000000	16,928,080.00	
KINNEVIK AB - B	23,852	270.300000	6,447,195.60	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,319	620.500000	2,059,439.50	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,956	204.000000	3,459,024.00	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,988	535.000000	3,203,580.00	
NORDEA BANK AB	290,003	97.000000	28,130,291.00	
SANDVIK AB	108,140	147.200000	15,918,208.00	
SECURITAS AB-B SHS	28,100	145.300000	4,082,930.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,496	98.250000	14,196,732.00	
SKANSKA AB-B SHS	34,698	180.000000	6,245,640.00	
SKF AB-B SHARES	38,491	187.600000	7,220,911.60	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	143,772	112.800000	16,217,481.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	84,696	196.900000	16,676,642.40	
SWEDISH MATCH AB	16,479	321.700000	5,301,294.30	
TELE2 AB-B SHS	32,211	108.000000	3,478,788.00	
TELIA CO AB	252,914	37.240000	9,418,517.36	
VOLVO AB-B SHS	148,313	160.900000	23,863,561.70	
スウェーデンクローネ 小計	2,242,789		324,851,098.96 (4,372,495,792)	
ノルウェークローネ				
DNB ASA	93,134	151.500000	14,109,801.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,992	150.100000	2,700,599.20	
MARINE HARVEST	37,053	146.100000	5,413,443.30	
NORSK HYDRO ASA	133,726	61.700000	8,250,894.20	
ORKLA ASA	82,731	82.600000	6,833,580.60	
SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	202.500000	1,633,972.50	
SCHIBSTED ASA-CL A	6,727	221.300000	1,488,685.10	
STATOIL ASA	108,251	166.000000	17,969,666.00	
TELENOR ASA	71,990	183.100000	13,181,369.00	
YARA INTERNATIONAL ASA	16,041	375.900000	6,029,811.90	
ノルウェークローネ 小計	575,714		77,611,822.80 (1,062,505,854)	
デンマーククローネ				
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	356	10,030.000000	3,570,680.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	627	10,400.000000	6,520,800.00	
CARLSBERG AS-B	10,482	735.000000	7,704,270.00	
CHR HANSEN HOLDING A/S	8,952	579.000000	5,183,208.00	
COLOPLAST-B	11,843	499.200000	5,912,025.60	
DANSKE BANK A/S	72,709	234.500000	17,050,260.50	
DSV A/S	18,414	484.100000	8,914,217.40	
GENMAB A/S	5,624	1,195.000000	6,720,680.00	
H LUNDBECK A/S	6,220	336.300000	2,091,786.00	
ISS A/S	15,182	234.000000	3,552,588.00	
NOVO NORDISK A/S-B	177,948	325.700000	57,957,663.60	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,218	342.500000	7,609,665.00	
ORSTED A/S	18,910	337.100000	6,374,561.00	
PANDORA A/S	10,647	560.500000	5,967,643.50	
TDC A/S	72,933	37.210000	2,713,836.93	
TRYG A/S	10,139	152.300000	1,544,169.70	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	20,352	366.400000	7,456,972.80	
WILLIAM DEMANT HOLDING	10,386	177.700000	1,845,592.20	
デンマーククローネ 小計	493,942		158,690,620.23 (2,837,388,289)	
イスラエルシェゲル				



AZRIELI GROUP LTD	3,746	186.500000	698,629.00	
BANK HAPOALIM BM	110,437	24.000000	2,650,488.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	148,479	19.150000	2,843,372.85	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	4.920000	917,634.12	
ELBIT SYSTEMS LTD	2,101	514.300000	1,080,544.30	
FRUTAROM	3,477	298.000000	1,036,146.00	
ISRAEL CHEMICALS LTD	46,853	13.800000	646,571.40	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	62.060000	778,170.34	
NICE LTD	6,723	306.000000	2,057,238.00	
イスラエルシェケル 小計	520,866		12,708,794.01 (404,266,737)	
ユーロ				
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	67,282	18.520000	1,246,062.64	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	40,478	24.985000	1,011,342.83	
ACCOR SA	17,150	41.815000	717,127.25	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,193	33.045000	733,367.68	
ADIDAS AG	17,792	180.000000	3,202,560.00	
ADP	2,719	156.950000	426,747.05	
AEGON NV	176,756	5.110000	903,223.16	
AENA SME SA	6,629	161.450000	1,070,252.05	
AGEAS	19,001	40.735000	774,005.73	
AIR LIQUIDE SA	40,978	106.300000	4,355,961.40	
AIRBUS SE	55,489	85.800000	4,760,956.20	
AKZO NOBEL	23,649	77.900000	1,842,257.10	
ALLIANZ SE-REG	43,586	197.950000	8,627,848.70	
ALSTOM	16,188	34.870000	564,475.56	
ALTICE NV - A	47,736	7.478000	356,969.80	
ALTICE NV - B	8,429	7.513000	63,327.07	
AMADEUS IT GROUP SA	41,681	61.490000	2,562,964.69	
ANDRITZ AG	6,583	45.675000	300,678.52	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,796	98.390000	7,162,398.44	
ARCELORMITTAL	63,150	24.760000	1,563,594.00	
ARKEMA	6,940	104.400000	724,536.00	
ASML HOLDING NV	35,548	155.800000	5,538,378.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	117,333	15.230000	1,786,981.59	
ATLANTIA SPA	43,897	27.300000	1,198,388.10	
ATOS SE	9,102	127.150000	1,157,319.30	
AXA SA	185,051	25.350000	4,691,042.85	
AXEL SPRINGER SE	4,257	64.720000	275,513.04	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	635,377	7.129000	4,529,602.63	
BANCO DE SABADELL SA	524,455	1.649000	864,826.29	
BANCO SANTANDER SA	1,540,512	5.557000	8,560,625.18	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,382	6.360000	536,669.52	
BANKIA SA	90,363	3.938000	355,849.49	
BANKINTER SA	60,028	7.791000	467,678.14	
BASF SE	87,747	95.100000	8,344,739.70	
BAYER AG-REG	78,983	107.750000	8,510,418.25	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,740	86.380000	2,741,701.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,933	73.360000	361,884.88	
BEIERSDORF AG	9,871	97.200000	959,461.20	
BNP PARIBAS	107,100	63.640000	6,815,844.00	
BOLLORE	79,699	4.440000	353,863.56	
BOSKALIS WESTMINSTER	8,202	30.745000	252,170.49	
BOUYGUES SA	19,566	43.130000	843,881.58	
BRENNTAG AG	14,409	51.450000	741,343.05	
BUREAU VERITAS SA	24,162	22.190000	536,154.78	
CAIXABANK S.A	340,654	3.947000	1,344,561.33	
CAPGEMINI SE	15,258	101.350000	1,546,398.30	
CARREFOUR SA	55,836	16.760000	935,811.36	
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,022	47.920000	240,654.24	
CNH INDUSTRIAL NV	100,275	11.020000	1,105,030.50	
CNP ASSURANCES	15,727	18.785000	295,431.69	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	19,539	32.190000	628,960.41	
COLRUYT SA	5,266	44.930000	236,601.38	
COMMERZBANK AG	103,317	12.080000	1,248,069.36	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	48,235	48.680000	2,348,079.80	
CONTINENTAL AG	10,662	216.900000	2,312,587.80	
COVESTRO AG	11,183	85.420000	955,251.86	
CREDIT AGRICOLE SA	107,867	14.125000	1,523,621.37	
CRH PLC	81,982	29.555000	2,422,978.01	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	91,930	70.000000	6,435,100.00	

DANONE	56,474	70.790000	3,997,794.46	
DASSAULT AVIATION SA	222	1,299.500000	288,489.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,562	91.400000	1,148,166.80	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	197,690	16.050000	3,172,924.50	
DEUTSCHE BOERSE AG	18,131	91.800000	1,664,425.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,780	28.625000	623,452.50	
DEUTSCHE POST AG-REG	92,233	39.560000	3,648,737.48	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	313,482	14.805000	4,641,101.01	
DEUTSCHE WOHNEN SE	34,052	37.080000	1,262,648.16	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	55,771	4.055000	226,151.40	
E.ON SE	207,934	9.722000	2,021,534.34	
EDENRED	20,231	23.955000	484,633.60	
EDF	50,318	10.925000	549,724.15	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,604	2.909000	702,826.03	
EIFFAGE	6,700	92.190000	617,673.00	
ELISA OYJ	15,201	33.710000	512,425.71	
ENAGAS SA	24,107	23.645000	570,010.01	
ENDESA SA	33,180	18.785000	623,286.30	
ENEL SPA	778,791	5.355000	4,170,425.80	
ENGIE	175,391	14.455000	2,535,276.90	
ENI SPA	241,115	13.820000	3,332,209.30	
ERSTE GROUP BANK AG	29,458	36.910000	1,087,294.78	
ESSILOR INTERNATIONAL	20,231	108.200000	2,188,994.20	
EURAZEO SA	3,949	72.480000	286,223.52	
EUROFINS SCIENTIFIC	984	510.050000	501,889.20	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,700	18.590000	291,863.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	14,769	31.465000	464,706.58	
EXOR NV	9,805	52.550000	515,252.75	
FERRARI NV	11,929	95.450000	1,138,623.05	
FERROVIAL SA	47,623	18.235000	868,405.40	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	102,020	14.740000	1,503,774.80	
FORTUM OYJ	40,592	17.600000	714,419.20	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,775	82.750000	312,381.25	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	20,301	82.350000	1,671,787.35	
FRESENIUS SE & CO KGAA	39,809	60.760000	2,418,794.84	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,184	45.205000	279,547.72	
GALP ENERGIA SGPS SA	50,845	15.925000	809,706.62	
GAS NATURAL SDG SA	35,824	18.200000	651,996.80	
GEA GROUP AG	18,667	39.885000	744,533.29	
GEMALTO	7,305	32.840000	239,896.20	
GRIFOLS SA	30,311	24.720000	749,287.92	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,199	89.600000	734,630.40	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	43,040	11.060000	476,022.40	
HANNOVER RUECK SE	6,214	108.100000	671,733.40	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,308	90.360000	1,292,870.88	
HEINEKEN HOLDING NV	11,136	80.560000	897,116.16	
HEINEKEN NV	24,519	85.420000	2,094,412.98	
HENKEL AG & CO KGAA	10,240	100.950000	1,033,728.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,776	112.850000	1,893,171.60	
HERMES INTERNATIONAL	3,040	443.600000	1,348,544.00	
HOCHTIEF AG	1,738	147.350000	256,094.30	
HUGO BOSS AG -ORD	5,624	67.950000	382,150.80	
IBERDROLA SA	545,184	6.431000	3,506,078.30	
ILIAD SA	2,350	196.650000	462,127.50	
IMERYS SA	3,211	77.250000	248,049.75	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	103,675	29.475000	3,055,820.62	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	109,925	24.715000	2,716,796.37	
ING GROEP NV	369,979	15.295000	5,658,828.80	
INGENICO GROUP	5,304	82.110000	435,511.44	
INNOGY SE	12,762	38.655000	493,315.11	
INTESA SANPAOLO	1,291,212	2.818000	3,638,635.41	
INTESA SANPAOLO-RSP	82,627	2.654000	219,292.05	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	58,425	6.657000	388,935.22	
IPSEN	3,371	101.600000	342,493.60	
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248			
JCDECAUX SA	6,778	33.885000	229,672.53	
JERONIMO MARTINS	22,605	16.195000	366,087.97	
K+S AG-REG	17,191	19.645000	337,717.19	
KBC GROEP NV	23,721	69.020000	1,637,223.42	
KERING	7,223	391.500000	2,827,804.50	

KERRY GROUP PLC-A	15,725	87.500000	1,375,937.50	
KION GROUP AG	6,359	66.600000	423,509.40	
KONE OYJ-B	32,044	43.660000	1,399,041.04	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	120,410	17.015000	2,048,776.15	
KONINKLIJKE DSM NV	17,462	78.080000	1,363,432.96	
KONINKLIJKE KPN NV	335,213	2.981000	999,269.95	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,387	32.910000	2,908,816.17	
LAGARDERE SCA	10,504	27.055000	284,185.72	
LANXESS AG	8,305	63.150000	524,460.75	
LEGRAND SA	25,725	62.270000	1,601,895.75	
LEONARDO SPA	41,903	10.370000	434,534.11	
LINDE AG	17,696	190.950000	3,379,051.20	
L'OREAL	23,983	187.200000	4,489,617.60	
LUXOTTICA GROUP SPA	17,078	48.680000	831,357.04	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	26,611	249.600000	6,642,105.60	
MAN SE	3,133	94.950000	297,478.35	
MAPFRE SA	94,896	2.754000	261,343.58	
MEDIOBANCA SPA	51,879	9.420000	488,700.18	
MERCK KGAA	12,442	89.150000	1,109,204.30	
METRO AG	16,244	16.220000	263,477.68	
METSO OYJ	10,175	30.090000	306,165.75	
MICHELIN (CGDE)	16,239	117.850000	1,913,766.15	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,796	189.600000	2,805,321.60	
NATIXIS	97,494	6.593000	642,777.94	
NESTE OYJ	11,624	50.700000	589,336.80	
NN GROUP NV	30,420	35.385000	1,076,411.70	
NOKIA OYJ	558,266	4.260000	2,378,213.16	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,377	36.560000	379,383.12	
OMV AG	13,487	51.480000	694,310.76	
ORANGE	191,305	14.265000	2,728,965.82	
ORION OYJ-CLASS B	9,317	32.340000	301,311.78	
OSRAM LICHT AG	9,181	71.050000	652,310.05	
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,509	98.800000	741,889.20	
PERNOD RICARD SA	20,340	129.650000	2,637,081.00	
PEUGEOT SA	50,452	18.120000	914,190.24	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	13,893	69.000000	958,617.00	
POSTE ITALIANE SPA	46,876	6.125000	287,115.50	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	23,869	26.375000	629,544.87	
PROXIMUS	13,567	28.290000	383,810.43	
PRYSMIAN SPA	18,585	28.030000	520,937.55	
PUBLICIS GROUPE	19,667	54.570000	1,073,228.19	
QIAGEN N.V.	22,300	27.080000	603,884.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	13,370	29.665000	396,621.05	
RANDSTAD HOLDING NV	12,331	50.130000	618,153.03	
RECORDATI SPA	9,371	37.990000	356,004.29	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40,110	18.410000	738,425.10	
RELX NV	91,570	19.435000	1,779,662.95	
REMY COINTREAU	2,005	110.900000	222,354.50	
RENAULT SA	17,959	85.870000	1,542,139.33	
REPSOL SA	116,028	15.015000	1,742,160.42	
REXEL SA	27,249	14.970000	407,917.53	
RTL GROUP	3,426	64.590000	221,285.34	
RWE AG	51,261	19.740000	1,011,892.14	
SAFRAN SA	30,026	86.800000	2,606,256.80	
SAIPEM SPA	53,596	3.428000	183,727.08	
SAMPO OYJ-A SHS	41,984	44.850000	1,882,982.40	
SANOFI	108,278	77.450000	8,386,131.10	
SAP SE	93,759	97.250000	9,118,062.75	
SCHAEFFLER AG	15,276	14.205000	216,995.58	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,829	71.750000	3,862,230.75	
SCOR SE	17,890	33.960000	607,544.40	
SEB SA	2,038	159.600000	325,264.80	
SES	37,565	12.405000	465,993.82	
SIEMENS AG-REG	73,073	114.050000	8,333,975.65	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,231	9.216000	195,664.89	
SNAM SPA	225,214	4.218000	949,952.65	
SOCIETE BIC SA	2,546	91.660000	233,366.36	
SOCIETE GENERALE SA	72,533	43.515000	3,156,273.49	
SODEXO SA	9,055	106.250000	962,093.75	
SOLVAY SA	7,331	119.250000	874,221.75	

STMICROELECTRONICS NV	62,484	20.590000	1,286,545.56	
STORA ENSO OYJ-R SHS	50,057	13.350000	668,260.95	
SUEZ	33,681	15.440000	520,034.64	
SYMRISE AG	12,375	71.240000	881,595.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,127,378	0.723000	815,094.29	
TELECOM ITALIA-RSP	535,180	0.597000	319,502.46	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,777	4.048000	270,313.29	
TELEFONICA SA	432,577	8.537000	3,692,909.84	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,843	58.990000	285,688.57	
TENARIS SA	42,968	12.430000	534,092.24	
TERNA SPA	146,330	5.085000	744,088.05	
THALES SA	10,379	87.880000	912,106.52	
THYSSENKRUPP AG	41,537	22.855000	949,328.13	
TOTAL SA	225,294	47.350000	10,667,670.90	
UCB SA	12,806	61.640000	789,361.84	
UMICORE	17,197	39.240000	674,810.28	
UNICREDIT SPA	189,450	17.100000	3,239,595.00	
UNILEVER NV-CVA	155,191	48.465000	7,521,331.81	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	88,023	1.903000	167,507.76	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	11,076	56.050000	620,809.80	
UPM-KYMMENE OYJ	51,397	25.530000	1,312,165.41	
VALEO SA	22,865	59.260000	1,354,979.90	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	47,608	21.040000	1,001,672.32	
VINCI SA	47,665	86.650000	4,130,172.25	
VIVENDI	96,358	23.275000	2,242,732.45	
VOESTALPINE AG	12,276	48.435000	594,588.06	
VOLKSWAGEN AG	3,139	169.100000	530,804.90	
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,676	169.450000	2,995,198.20	
VONOVIA SE	44,686	39.650000	1,771,799.90	
VOPAK	6,422	34.250000	219,953.50	
WARTSILA OYJ ABP	14,958	55.150000	824,933.70	
WENDEL	2,624	141.600000	371,558.40	
WOLTERS KLUWER	29,591	42.855000	1,268,122.30	
ZALANDO SE	10,117	42.855000	433,564.03	
ZODIAC AEROSPACE	18,512	24.700000	457,246.40	
ユーロ小計	18,688,489		379,664,549.91 (50,514,368,365)	
合計	115,482,356		373,139,729,551 (373,139,729,551)	

(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	35,704.00	722,648.96	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,974.00	1,137,813.46	
	AMERICAN TOWER CORP	40,450.00	5,958,285.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	113,044.00	1,332,788.76	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,964.00	2,393,543.32	
	BOSTON PROPERTIES INC	14,624.00	1,830,339.84	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	27,436.00	503,450.60	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,381.00	786,975.90	
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	46,657.00	580,879.65	
	CROWN CASTLE INTL CORP	38,099.00	4,294,519.28	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	19,214.00	2,258,413.56	
	DUKE REALTY CORP	32,395.00	944,314.25	
	EQUINIX INC	7,400.00	3,508,118.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	34,636.00	2,362,521.56	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,254.00	1,565,813.98	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,576.00	1,098,890.88	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,651.00	877,399.92	
	GGP INC	60,077.00	1,402,797.95	
	HCP INC	45,369.00	1,219,518.72	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	71,542.00	1,416,531.60	
	INVITATION HOMES INC	29,720.00	703,175.20	
	IRON MOUNTAIN INC	25,269.00	1,047,147.36	
	KIMCO REALTY CORP	39,433.00	741,340.40	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	13,238.00	599,549.02	
	MACERICH CO/THE	12,649.00	812,824.74	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,056.00	1,151,592.96	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,428.00	573,107.04	
	PROLOGIS INC	50,371.00	3,377,879.26	
	PUBLIC STORAGE	14,867.00	3,163,548.93	
	REALTY INCOME CORP	26,102.00	1,471,891.78	
	REGENCY CENTERS CORP	15,244.00	1,033,695.64	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,755.00	4,701,290.00	
	SL GREEN REALTY CORP	10,209.00	1,030,904.82	
	UDR INC	26,436.00	1,048,716.12	
	VENTAS INC	33,547.00	2,169,819.96	
	VEREIT INC	98,677.00	795,336.62	
	VORNADO REALTY TRUST	16,646.00	1,267,592.90	
	WELLTOWER INC	35,664.00	2,434,424.64	
	WEYERHAEUSER CO	70,540.00	2,551,431.80	
	投資証券 小計	1,215,298.00	66,870,834.38 (7,466,797,366)	
	アメリカドル 小計	1,215,298.00	66,870,834.38 (7,466,797,366)	
	カナダドル			
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200.00	261,446.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700.00	349,076.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700.00	169,461.00	
	投資証券 小計	31,600.00	779,983.00 (68,513,706)	
	カナダドル 小計	31,600.00	779,983.00 (68,513,706)	
	オーストラリアドル			
投資証券	DEXUS	105,980.00	1,035,424.60	
	GOODMAN GROUP	177,470.00	1,545,763.70	
	GPT GROUP	186,909.00	971,926.80	
	MIRVAC GROUP	391,606.00	947,686.52	
	SCENTRE GROUP	518,897.00	2,174,178.43	
	STOCKLAND	225,746.00	1,038,431.60	
	VICINITY CENTRES	353,862.00	976,659.12	
	WESTFIELD CORP	194,292.00	1,626,224.04	
	投資証券 小計	2,154,762.00	10,316,294.81 (876,678,732)	
	オーストラリアドル 小計	2,154,762.00	10,316,294.81 (876,678,732)	
	イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	99,366.00	614,578.71	
	HAMMERSON PLC	70,806.00	364,296.87	
	INTU PROPERTIES PLC	80,208.00	158,250.38	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	73,108.00	670,400.36	
	SEGRO PLC	88,932.00	496,240.56	
	投資証券 小計	412,420.00	2,303,766.88 (342,754,436)	
	イギリスポンド 小計	412,420.00	2,303,766.88 (342,754,436)	
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	212,500.00	14,811,250.00	
	投資証券 小計	212,500.00	14,811,250.00 (211,800,875)	
	香港ドル 小計	212,500.00	14,811,250.00 (211,800,875)	
	シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	222,800.00	590,420.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	276,100.00	510,785.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	225,900.00	465,354.00	
	SUNTEC REIT	231,600.00	458,568.00	
	投資証券 小計	956,400.00	2,025,127.00 (167,903,279)	
	シンガポールドル 小計	956,400.00	2,025,127.00 (167,903,279)	
	ユーロ			
投資証券	FONCIERE DES REGIONS	3,052.00	271,261.76	
	GECINA SA	4,799.00	661,302.20	
	ICADE	3,002.00	232,384.82	
	KLEPIERRE	22,095.00	765,702.22	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,497.00	2,073,195.10	

投資証券 小計	42,445.00	4,003,846.10 (532,711,723)	
ユーロ 小計	42,445.00	4,003,846.10 (532,711,723)	
合 計		9,667,160,117 (9,667,160,117)	

(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 602銘柄	97.01%		63.32%
	投資証券 39銘柄		2.99%	1.95%
カナダドル	株式 90銘柄	99.54%		3.91%
	投資証券 3銘柄		0.46%	0.02%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	91.77%		2.55%
	投資証券 8銘柄		8.23%	0.23%
イギリスポンド	株式 104銘柄	98.74%		7.03%
	投資証券 5銘柄		1.26%	0.09%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.00%		3.33%
香港ドル	株式 40銘柄	95.90%		1.29%
	投資証券 1銘柄		4.10%	0.06%
シンガポールドル	株式 22銘柄	92.09%		0.51%
	投資証券 4銘柄		7.91%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.00%		0.06%
スウェーデンクローネ	株式 31銘柄	100.00%		1.14%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%		0.28%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.00%		0.74%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.00%		0.11%
ユーロ	株式 234銘柄	98.96%		13.20%
	投資証券 5銘柄		1.04%	0.14%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「マネーブルファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)」の状況  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

#### (1) 貸借対照表

	第13期 [平成29年5月22日現在]	第14期 [平成29年11月20日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,997	27,097
親投資信託受益証券	10,177,156	10,175,493
未収入金	9	8
流動資産合計	10,204,162	10,202,598
資産合計	10,204,162	10,202,598
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	546	546
未払委託者報酬	988	1,092
流動負債合計	1,534	1,638
負債合計	1,534	1,638
純資産の部		
元本等		
元本	10,171,417	10,171,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,211	29,543
(分配準備積立金)	(16,026)	(16,026)
元本等合計	10,202,628	10,200,960
純資産合計	10,202,628	10,200,960
負債純資産合計	10,204,162	10,202,598

#### (2) 損益及び剰余金計算書

	第 13 期 自 平成28年11月22日 至 平成29年 5月22日	第 14 期 自 平成29年 5月23日 至 平成29年11月20日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	28	30
営業収益合計	28	30
営業費用		
受託者報酬	546	546
委託者報酬	988	1,092
営業費用合計	1,534	1,638
営業利益又は営業損失（ ）	1,562	1,668
経常利益又は経常損失（ ）	1,562	1,668
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,562	1,668
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（ ）	32,464	31,211
剰余金増加額又は欠損金減少額	309	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	309	
分配金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,211	29,543

## (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、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成29年5月23日から平成29年11月20日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [ 平成29年5月22日現在 ]	第 14 期 [ 平成29年11月20日現在 ]
1 期首元本額	10,071,726円	10,171,417円
期中追加設定元本額	99,691円	
期中一部解約元本額		
2 受益権の総数	10,171,417口	10,171,417口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0031円 (10,031円)	1.0029円 (10,029円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

## 第 13 期（自 平成28年11月22日 至 平成29年5月22日）

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	5,495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	34,945円
分配準備積立金額	D	10,531円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	50,971円
当ファンドの期末残存口数	F	10,171,417口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	50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 14 期（自 平成29年5月23日 至 平成29年11月20日）

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	
収益調整金額	C	34,945円
分配準備積立金額	D	16,026円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	50,971円
当ファンドの期末残存口数	F	10,171,417口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	50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 13 期	第 14 期
	（ 自 平成28年11月22日 至 平成29年 5月22日 ）	（ 自 平成29年 5月23日 至 平成29年11月20日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 13 期	第 14 期
	[ 平成29年5月22日現在 ]	[ 平成29年11月20日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	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	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 13 期	第 14 期
	[ 平成29年5月22日現在 ]	[ 平成29年11月20日現在 ]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1	1
合計	1	1

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	マネー・マーケット・マザーファンド	9,991,647	10,175,493	
	親投資信託受益証券 小計	9,991,647	10,175,493	
	合計	9,991,647	10,175,493	

## 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。

「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29年5月22日現在 ]	[ 平成29年11月20日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	98,829,950	71,623,500
現先取引勘定	1,599,999,281	1,199,999,966
流動資産合計	1,698,829,231	1,271,623,466
資産合計	1,698,829,231	1,271,623,466
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,981,064	5,066,444
未払利息	163	118
流動負債合計	16,981,227	5,066,562
負債合計	16,981,227	5,066,562
純資産の部		
元本等		
元本	1,651,473,732	1,243,696,990
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	30,374,272	22,859,914
元本等合計	1,681,848,004	1,266,556,904
純資産合計	1,681,848,004	1,266,556,904
負債純資産合計	1,698,829,231	1,271,623,466

(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)  
該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	[ 平成29年5月22日現在 ]	[ 平成29年11月20日現在 ]
1 期首	平成28年11月22日	平成29年5月23日
期首元本額	4,340,785,954円	1,651,473,732円
期首からの追加設定元本額	377,829,430円	203,575,952円
期首からの一部解約元本額	3,067,141,652円	611,352,694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	284,151,127円	313,747,092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	1,048,688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)	62,265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	31,213,655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)	635,856円	635,856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)	3,078,471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>	283,694,306円	143,999,990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・マネーブル・ ファンド	2,383,955円	2,383,743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)	26,506,400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)	2,272,200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)	15,211,722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)	393,503円	344,406円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<マネーボールファンド>	5,744,737円	6,013,964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)	9,071,898円	9,071,898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	2,016,707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)	551,512円	1,513,806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>	80,349,636円	75,631,547円
三菱UFJ 欧州ハイイールド債券ファンド 通貨選択シリーズ<円コース>(毎月分配型)	1,364,852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)	600,566円	600,566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)	1,647,957円	1,647,957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	1,979,971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	140,355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>	3,491,498円	1,008,013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)	31,208,972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)	756,099円	6,336,371円
欧州ハイイールド債券ファンド(為替ヘッジなし)	684,529円	5,622,977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)	12,561,714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)	69,931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)	924,121円	4,881,309円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<米ドルコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658円
ピクテ・グローバル・インカム株式オープン 通貨選択シリーズ<トルコリラコース>(毎月分配型)	19,658円	19,658円

三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジあり> (毎月決算型)	491,449円	491,449円
三菱UFJ 米国高配当株式プラス<為替ヘッジなし> (毎月決算型)	9,828,976円	9,828,976円
PIMCO ニューワールドインカムファンド<世界通 貨分散コース>(毎月分配型)	12,234,366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)	348,598円	348,598円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(毎 月決算型)	1,936,118円	1,936,118円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月 決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替リスク軽減型>(年 1回決算型)	9,829円	9,829円
バリュー・ボンド・ファンド<為替ヘッジなし>(年1 回決算型)	9,829円	9,829円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリー ズ<円コース>(毎月分配型)	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)	13,128,307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)	14,819,878円	14,819,878円
三菱UFJ 米国バンクローンファンド 通貨選択シリー ズ<メキシコペソコース>(毎月分配型)	3,123,514円	3,123,514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)	1,312,527円	6,722,976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)	24,184,985円	24,184,985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)	4,117,720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)	961,645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)	105,642円	243,113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)	1,809,102円	1,809,102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>	2,984,793円	38,413,663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>	2,557,537円	979,536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)	8,473,583円	8,473,583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)	2,464,335円	2,464,335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
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(毎月分 配型)	5,920,244円	5,920,244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)	3,175,643円	8,478,079円
PIMCO インカム戦略ファンド<円インカム>(年2回分配型)	679,527円	4,145,749円
PIMCO インカム戦略ファンド<米ドルインカム>(毎月分配型)	8,067,104円	8,067,104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)	1,551,577円	1,551,577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	20,075,917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)	25,781,668円	16,492,587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)	4,824,746円	3,165,280円
PIMCO 米国バンクローンファンド<円インカム>(毎月分配型)	128,636円	128,636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)	79,540円	79,540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)	564,702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)	89,371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 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 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	9,820円
スマート・プロテクター90(限定追加型)2016-12	6,313,826円	6,313,826円
米国政策テーマ株式オープン(為替ヘッジあり)	412,412円	412,412円
米国政策テーマ株式オープン(為替ヘッジなし)	1,188,139円	1,188,139円
スマート・プロテクター90オープン	981,933円	981,933円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジあり>(資産成長型)	982円	256,285円
米国バンクローンファンド<為替ヘッジなし>(資産成長型)	982円	305,382円
テンブルトン新興国小型株ファンド		49,097円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(毎月決算型)		982円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<限定為替ヘッジあり>(年2回決算型)		982円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(毎月決算型)		982円
ピムコ・インカム・ストラテジー・ファンド<為替ヘッジなし>(年2回決算型)		982円
Navio インド債券ファンド	885,566円	885,566円
Navio マネープールファンド	4,243,064円	1,853,235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 バランス・イノベーション(債券重視型)	315,194,509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	
マネープールファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	9,993,280円	9,991,647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)	6,526,415円	

ビムコ・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
ビムコ・エマージング・ボンド・オープン Bコース （為替ヘッジあり）	21,620,196円	21,620,196円
（合計）	1,651,473,732円	1,243,696,990円
2 受益権の総数	1,651,473,732口	1,243,696,990口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0184円 （10,184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28年11月22日 至平成29年5月22日）	（自平成29年5月23日 至平成29年11月20日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債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29年5月22日現在]	[平成29年11月20日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、該当事項はありません。 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）

該当事項はありません。

（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

該当事項はありません。

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】

## 【MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信】

## 【純資産額計算書】

平成29年12月29日現在  
（単位：円）

資産総額	8,307,245,177
負債総額	1,025,379
純資産総額（ - ）	8,306,219,798
発行済口数	3,500,000 口
1口当たり純資産価額（ / ）	2,373.21 （100口当たり 237,321）

（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）

## 純資産額計算書

平成29年12月29日現在  
（単位：円）

資産総額	8,291,876,432
負債総額	774,602
純資産総額（ - ）	8,291,101,830
発行済口数	3,487,120,428 口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.3776 （1万口当たり 23,776）

## 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年12月29日現在  
（単位：円）

資産総額	414,896,167,970
負債総額	182,757,833
純資産総額（ - ）	414,713,410,137
発行済口数	152,895,859,796 口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.7124 （1万口当たり 27,124）

## マネーブルファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）

## 純資産額計算書

平成29年12月29日現在  
（単位：円）

資産総額	10,200,953
負債総額	351
純資産総額（ - ）	10,200,602
発行済口数	10,171,417 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0029 （1万口当たり 10,029）

## マネー・マーケット・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年12月29日現在  
(単位：円)

資産総額	1,280,677,140
負債総額	180
純資産総額( - )	1,280,676,960
発行済口数	1,257,565,889 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) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等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、委託会社は、この信託の受益権を取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。なお、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、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

該当事項はありません。

## (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 ） 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

平成29年12月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 投資環境見通しの策定

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

###### 運用戦略の決定

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

###### 運用計画の決定

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

###### ポートフォリオの構築

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

###### 投資行動のモニタリング1

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

###### 投資行動のモニタリング2

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

###### ファンドに係る法人等の管理

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

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。平成29年12月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	840	12,022,282
追加型公社債投資信託	16	1,438,361
単位型株式投資信託	54	343,935
単位型公社債投資信託	1	6,480
合計	911	13,811,059

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度に係る中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

#### (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)		第32期 (平成29年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	80,707,781	2	69,212,680
有価証券		2,728,127		36,210
前払費用		402,267		337,699
未収入金		14,286		35,896

未収委託者報酬		11,275,577		10,076,022
未収収益	2	564,923	2	659,405
繰延税金資産		491,700		446,374
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		438,012		113,754
流動資産合計		96,652,678		80,948,042
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	846,844	1	806,798
器具備品	1	768,584	1	759,446
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,971,428		2,922,245
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,813,951		1,844,549
ソフトウェア仮勘定		341,815		608,066
その他		71		10
無形固定資産合計		2,171,661		2,468,448
投資その他の資産				
投資有価証券		24,223,272		24,327,081
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		686,446		654,402
前払年金費用		499,178		463,105
繰延税金資産		786,810		711,230
その他		51,090		50,235
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,543,335		26,502,592
固定資産合計		31,686,425		31,893,286
資産合計		128,339,103		112,841,328

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	199,091	166,493
未払金		
未払収益分配金	101,046	108,024
未払償還金	821,178	547,707
未払手数料	2 4,866,423	2 4,225,009
その他未払金	2 2,521,849	2 2,355,815
未払費用	2 3,419,978	2 3,061,479
未払消費税等	370,110	351,670
未払法人税等	947,540	756,668

賞与引当金	882,523	843,729
役員賞与引当金		100,680
その他	670,983	711,633
流動負債合計	14,800,725	13,228,909
固定負債		
退職給付引当金	508,142	590,154
役員退職慰労引当金	166,789	166,458
時効後支払損引当金	257,105	253,070
固定負債合計	932,038	1,009,684
負債合計	15,732,763	14,238,594
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	57,079,782	43,034,713
利益剰余金合計	64,420,372	50,375,303
株主資本合計	111,153,216	97,108,147

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券 評価差額金	1,446,576	1,494,586
繰延ヘッジ損益	6,546	
評価・換算差額等合計	1,453,123	1,494,586
純資産合計	112,606,339	98,602,734
負債純資産合計	128,339,103	112,841,328

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,096,942	81,709,776

投資顧問料		2,226,322		2,396,020
その他営業収益		35,063		25,763
営業収益合計		84,358,328		84,131,560
営業費用				
支払手数料	2	34,821,751	2	33,975,255
広告宣伝費		742,632		731,771
公告費				482
調査費				
調査費		1,642,352		1,713,892
委託調査費		14,530,744		13,961,993
事務委託費		751,410		984,749
営業雑経費				
通信費		122,574		158,915
印刷費		704,639		699,940
協会費		51,201		51,995
諸会費		7,730		9,887
事務機器関連費		1,674,745		1,611,608
その他営業雑経費		30,382		11,925
営業費用合計		55,080,164		53,912,419
一般管理費				
給料				
役員報酬		280,681		331,997
給料・手当		5,948,603		6,496,165
賞与引当金繰入		882,523		843,729
役員賞与引当金繰入				100,680
福利厚生費		1,091,897		1,196,210
交際費		17,062		14,843
旅費交通費		212,578		233,159
租税公課		264,376		422,030
不動産賃借料		795,415		706,571
退職給付費用		341,073		441,736
役員退職慰労引当金繰入		34,369		48,393
固定資産減価償却費		1,068,796		1,030,040
諸経費		426,547		474,521
一般管理費合計		11,363,925		12,340,079
営業利益		17,914,238		17,879,061

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	235,697	243,048
有価証券利息	523	0
受取利息	2 15,142	2 4,601
投資有価証券償還益	9,315	260,190
収益分配金等時効完成分	71,619	278,148

その他		17,393		4,383
営業外収益合計		349,691		790,372
営業外費用				
投資有価証券償還損		152,298		11,552
時効後支払損引当金繰入		98,891		
事務過誤費		421		218
その他		5,862		4,357
営業外費用合計		257,473		16,128
経常利益		18,006,455		18,653,304
特別利益				
投資有価証券売却益		424,605		259,137
ゴルフ会員権売却益		1,300		
特別利益合計		425,905		259,137
特別損失				
投資有価証券売却損		52,623		42,248
デリバティブ解約損				126,228
有価証券評価損		67,284		
投資有価証券評価損		18,539		157,482
固定資産除却損	1	1,305	1	13,540
減損損失	3	42,073	3	48,575
合併関連費用		829,181		
特別損失合計		1,011,007		388,075
税引前当期純利益		17,421,353		18,524,367
法人税、住民税及び事業税	2	5,796,941	2	5,658,953
法人税等調整額		1,035,591		103,169
法人税等合計		4,761,350		5,762,122
当期純利益		12,660,003		12,762,244

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金			
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096		222,096	342,589	6,998,000	48,527,422	55,868,012	58,090,240
当期変動額									
剰余金の配当							4,107,643	4,107,643	4,107,643
当期純利益							12,660,003	12,660,003	12,660,003
合併による増加		3,350,000	41,160,616	44,510,616					44,510,616
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計		3,350,000	41,160,616	44,510,616			8,552,359	8,552,359	53,062,976

当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
-------	-----------	-----------	------------	------------	---------	-----------	------------	------------	-------------

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,300,727		2,300,727	60,390,967
当期変動額				
剰余金の配当				4,107,643
当期純利益				12,660,003
合併による増加	903,495	148,745	754,749	45,265,365
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,757,645	155,292	1,602,353	1,602,353
当期変動額合計	854,150	6,546	847,604	52,215,371
当期末残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339

## 第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

## [注記事項]

## （重要な会計方針）

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (4) 退職給付引当金

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

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

## （追加情報）

当社では退職給付制度を統合するため、平成28年9月21日に確定給付企業年金制度、退職一



時金制度、確定拠出年金制度を改定し、同年10月1日より退職一時金制度、確定拠出年金制度を柱とした新制度に移行しております。この移行に伴い「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準委員会 平成14年1月31日 企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（企業会計基準委員会 平成19年2月7日 実務対応報告第2号）を適用しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段... 株式指数先物

ヘッジ対象... 投資有価証券

(3) ヘッジ方針

株価変動リスクの低減のため、対象資産の範囲内でヘッジを行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ開始から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして判断しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[会計方針の変更]

（平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱いの適用）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。

[追加情報]

（繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針の適用）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
建物	467,206千円	539,649千円
器具備品	897,207千円	1,029,950千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
預金	43,128,360千円	47,798,472千円
未収収益	52,753千円	46,963千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	2,612,168千円	1,993,055千円
その他未払金	2,296,632千円	2,071,256千円
未払費用	442,340千円	456,748千円

## (損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	254千円	2,392千円
器具備品	1,051千円	7,791千円
ソフトウェア	-	3,356千円
計	1,305千円	13,540千円

## 2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
支払手数料	15,120,269千円	13,862,465千円
受取利息	12,609千円	4,375千円
法人税、住民税及び事業税	3,980,844千円	4,204,969千円

## 3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第31期（自平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
静岡県裾野市	遊休資産（不動産）	土地	35,031千円
東京都千代田区（本社）	遊休資産（美術品）	器具備品	7,041千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

前事業年度において、事業の用に供していない遊休資産のうち、時価が著しく下落した資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、当資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、土地、美術品については外部鑑定評価額により評価しております。

第32期（自平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア （遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグループ

ングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式（注）	124,098	87,483	-	211,581
合計	124,098	87,483	-	211,581

（注）普通株式の発行済株式総数の増加は、平成27年7月1日に、国際投信投資顧問株式会社との間で吸収合併方式による経営統合を行ない、同社の普通株式1株に対して当社の普通株式10.0497株を交付したことによる増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	4,107,643千円
1株当たり配当額	33,100円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月30日

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

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

- (2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,651,815千円	1,973,699千円
合計	3,329,932千円	2,651,815千円

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。デリバティブ取引は、後述するリスクを回避するために利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。なお、一部の投資信託の価格変動リスクに対して、デリバティブ取引を利用してヘッジしております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1)現金及び預金	80,707,781	80,707,781	-
(2)有価証券	2,728,127	2,728,127	-
(3)未収委託者報酬	11,275,577	11,275,577	-
(4)投資有価証券	24,054,542	24,054,542	-
資産計	118,766,029	118,766,029	-
(1)未払手数料	4,866,423	4,866,423	-
負債計	4,866,423	4,866,423	-

デリバティブ取引( )	(3,459)	(3,459)	-
-------------	---------	---------	---

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については( )で表示しております。

### 第32期(平成29年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

### (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

#### 資 産

#### (1) 現金及び預金、(3) 未収委託者報酬

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

#### (2) 有価証券、(4) 投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

#### 負 債

#### (1) 未払手数料

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

#### デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照ください。

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	168,730	137,160
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

### (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	80,707,781	-	-	-
未収委託者報酬	11,275,577	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				

その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	2,728,127	9,234,321	9,756,778	5,050
合計	94,711,487	9,234,321	9,756,778	5,050

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第31期(平成28年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	113,875	30,541	83,333
	債券	-	-	-
	その他	19,085,937	16,697,402	2,388,535
	小計	19,199,812	16,727,944	2,471,868
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,582,857	7,969,134	386,277
	小計	7,582,857	7,969,134	386,277
合計		26,782,669	24,697,079	2,085,590

第32期(平成29年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

## 3. 売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	5,649,814	424,605	52,623
合計	5,649,814	424,605	52,623

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について85,823千円（その他有価証券のその他85,823千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（デリバティブ取引関係）

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

重要な取引はありません。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（単位：千円）

ヘッジ会計の方法	取引の種類	主なヘッジ対象	契約額等	契約額等のうち1年超	時価
原則的処理方法	株式指数先物取引 売建	投資有価証券	945,410	-	3,459
合計			945,410	-	3,459

（注）時価の算定方法

大阪取引所が定める清算指数によっております。

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

重要な取引はありません。

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けておりません。

## 2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	263,476 千円	2,997,931 千円
勤務費用	135,457	199,166
利息費用	19,818	22,711
数理計算上の差異の発生額	113,714	40,934
退職給付の支払額	159,115	183,403
過去勤務費用の発生額	-	653,618
合併による増加	2,624,579	-
退職給付債務の期末残高	2,997,931	3,649,089

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	196,439 千円	2,678,827 千円
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の発生額	111,449	7,066
事業主からの拠出額	210,960	107,823
退職給付の支払額	139,379	142,532
合併による増加	2,486,329	-
年金資産の期末残高	2,678,827	2,698,738

## (3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,422,447 千円	3,471,120 千円
年金資産	2,678,827	2,698,738
	256,380	772,381
非積立型制度の退職給付債務	575,484	177,969
未積立退職給付債務	319,103	950,350
未認識数理計算上の差異	310,139	207,810
未認識過去勤務費用	-	615,490
貸借対照表に計上された負債と資産 の純額	8,964	127,049
退職給付引当金	508,142	590,154
前払年金費用	499,178	463,105
貸借対照表に計上された負債と資産 の純額	8,964	127,049

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
勤務費用	135,457 千円	199,166 千円



利息費用	19,818	22,711
期待運用収益	35,926	47,553
数理計算上の差異の費用処理額	13,847	54,327
過去勤務費用の費用処理額	-	38,127
その他	65,395	28,533
確定給付制度に係る退職給付費用	198,592	295,314

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

#### (5)年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
債券	58.1 %	62.9 %
株式	35.5	33.3
その他	6.3	3.7
合計	100	100

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

#### (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.077～0.71%	0.061～0.90%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

### 3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,480千円、当事業年度146,421千円であります。

(税効果会計関係)

#### 1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	475,116 千円	455,165 千円
投資有価証券評価損	238,391	242,551
ゴルフ会員権評価損	295	295
未払事業税	185,473	124,367
賞与引当金	272,346	260,374
役員賞与引当金	-	11,509
役員退職慰労引当金	51,071	50,969
退職給付引当金	155,593	180,726
減価償却超過額	29,059	19,277
委託者報酬	204,395	217,902
長期差入保証金	6,344	14,803
時効後支払損引当金	78,725	77,490

連結納税適用による時価評価	309,675	236,450
その他	69,525	68,614
繰延税金資産 小計	2,076,013	1,960,499
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,076,013	1,960,499
繰延税金負債		
未収配当金	1,228	-
前払年金費用	152,848	141,802
連結納税適用による時価評価	1,516	1,447
その他有価証券評価差額金	639,013	659,638
繰延ヘッジ損益	2,889	-
その他	6	3
繰延税金負債 合計	797,502	802,893
繰延税金資産の純額	1,278,511	1,157,605

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
法定実効税率	33.06 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
(調整)		
評価性引当額の減少	6.34	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.59	
その他	0.02	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.33	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）及び第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### (関連当事者情報)

#### 1. 関連当事者との取引

##### (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513 百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税 役員の兼任	連結納税に伴う支払	3,980,844 千円	その他未払金	2,296,632 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 事務所の賃借	投資信託に係る事務代行手数料の支払 事務所賃借料	5,895,622 千円 223,695 千円	未払手数料	805,721 千円
主要株	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払 コーラブル預金の預入	9,224,647 千円 35,000,000 千円	未払手数料 現金及び預金	1,806,446 千円 35,000,000 千円

主						コーラブル預金に係る受取利息	9,263千円	未収収益	2,372千円
---	--	--	--	--	--	----------------	---------	------	---------

## 第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税  役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969千円	その他未払金	2,071,256千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,983,874千円	未払手数料	716,117千円
						投資の助言  役員の兼任	投資助言料	662,992千円	未払費用	352,297千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,878,591千円	未払手数料	1,276,937千円

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

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

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。

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

## (2) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

## 第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,398,782 千円	未払手数料	898,096 千円

## 第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱い及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

## （注）取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
1株当たり純資産額	532,213.85円	466,028.30円
1株当たり当期純利益金額	66,691.34円	60,318.47円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	12,660,003	12,762,244
普通株式の期中平均株式数 (株)	189,829	211,581

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)	
(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	46,287,102
有価証券	78,897
前払費用	496,625
未収入金	87,286
未収委託者報酬	9,160,402
未収収益	681,527
繰延税金資産	471,973
金銭の信託	30,000
その他	95,228
流動資産合計	57,389,043
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 780,721
器具備品	1 764,182
土地	1,356,000
有形固定資産合計	2,900,904
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	1,938,735
ソフトウェア仮勘定	1,212,251
無形固定資産合計	3,166,809
投資その他の資産	
投資有価証券	28,266,735
関係会社株式	320,136
長期差入保証金	640,950
前払年金費用	448,902
繰延税金資産	451,891
その他	45,230
貸倒引当金	23,600
投資その他の資産合計	30,150,247
固定資産合計	36,217,960
資産合計	93,607,004

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		196,841
未払金		
未払収益分配金		174,797
未払償還金		514,622
未払手数料		3,754,874
その他未払金		2,503,473
未払費用		4,229,858
未払消費税等	2	305,160
未払法人税等		792,896
賞与引当金		863,522
役員賞与引当金		66,649
その他		776,417
流動負債合計		14,179,114

## 固定負債

退職給付引当金		651,492
役員退職慰労引当金		163,557
時効後支払損引当金		252,546
固定負債合計		1,067,596

## 負債合計

15,246,710

## (純資産の部)

## 株主資本

資本金		2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712

## 利益剰余金

利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		22,251,535
利益剰余金合計		29,592,124

## 株主資本合計

76,324,968

(単位：千円)

第33期中間会計期間  
(平成29年9月30日現在)

## 評価・換算差額等

その他有価証券		2,035,325
評価差額金		

評価・換算差額等合計		2,035,325
------------	--	-----------

## 純資産合計

78,360,294

## 負債純資産合計

93,607,004

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	38,184,632
投資顧問料	1,346,730
その他営業収益	26,405
営業収益合計	39,557,767
営業費用	
支払手数料	15,720,488
広告宣伝費	318,084
公告費	500
調査費	
調査費	861,247
委託調査費	6,711,776
事務委託費	436,601
営業雑経費	
通信費	85,593
印刷費	251,837
協会費	24,207
諸会費	7,746
事務機器関連費	821,139
その他営業雑経費	13,599
営業費用合計	25,252,824
一般管理費	
給料	
役員報酬	178,839
給料・手当	2,821,754
賞与引当金繰入	863,522
役員賞与引当金繰入	66,649
福利厚生費	619,913
交際費	6,009
旅費交通費	93,328
租税公課	222,435
不動産賃借料	341,770
退職給付費用	210,625
役員退職慰労引当金繰入	23,884
固定資産減価償却費	1 512,328
諸経費	199,624
一般管理費合計	6,160,685
営業利益	8,144,257

(単位：千円)

第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	134,154
受取利息	277
投資有価証券償還益	29,656



収益分配金等時効完成分	34,222
その他	9,043
営業外収益合計	207,354
営業外費用	
投資有価証券償還損	20,261
時効後支払損引当金繰入	26,116
その他	5,612
営業外費用合計	51,990
経常利益	8,299,622
特別利益	
投資有価証券売却益	196,888
ゴルフ会員権売却益	2,495
特別利益合計	199,383
特別損失	
投資有価証券売却損	60,319
固定資産除却損	0
特別損失合計	60,319
税引前中間純利益	8,438,686
法人税、住民税及び事業税	2,631,045
法人税等調整額	4,911
法人税等合計	2,626,133
中間純利益	5,812,552

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当中間期変動額									
剰余金の配当							26,595,731	26,595,731	26,595,731
中間純利益							5,812,552	5,812,552	5,812,552
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							20,783,178	20,783,178	20,783,178
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	22,251,535	29,592,124	76,324,968

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当中間期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
中間純利益			5,812,552

株主資本以外の項目 の当中間期変動額 (純額)	540,738	540,738	540,738
当中間期変動額合計	540,738	540,738	20,242,440
当中間期末残高	2,035,325	2,035,325	78,360,294

## [重要な会計方針]

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (4) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

#### (5) 役員退職慰労引当金

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

#### (6) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

**[注記事項]**

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第33期中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
建物	571,713千円
器具備品	1,115,446千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
有形固定資産	114,767千円
無形固定資産	397,560千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日至平成29年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	-	-	211,581
合計	211,581	-	-	211,581

2. 配当に関する事項

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

(リース取引関係)

## 第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 借主側

## オペレーティング・リース取引

## オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	678,116千円
1年超	1,634,641千円
合 計	2,312,757千円

## (金融商品関係)

## 第33期中間会計期間(平成29年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,287,102	46,287,102	-
(2) 有価証券	78,897	78,897	-
(3) 未収委託者報酬	9,160,402	9,160,402	-
(4) 投資有価証券	28,129,575	28,129,575	-
資産計	83,655,978	83,655,978	-
(1) 未払手数料	3,754,874	3,754,874	-
負債計	3,754,874	3,754,874	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## 資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

## (2)有価証券、(4)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## 負 債

## (1)未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## (有価証券関係)

## 第33期中間会計期間（平成29年9月30日現在）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	21,493,708	18,316,441	3,177,266
	小計	21,493,708	18,316,441	3,177,266
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,714,765	6,958,415	243,650
	小計	6,714,765	6,958,415	243,650
合計		28,208,473	25,274,857	2,933,616

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 （平成29年9月30日現在）
1株当たり純資産額	370,356.00円
（算定上の基礎）	

純資産の部の合計額（千円）	78,360,294
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	78,360,294
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	27,471.99円
中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株主に帰属しない金額（千円）	-
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	5,812,552
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の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29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29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	5,500 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MUF G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29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【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、また使用開始日、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（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
  - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されていません。
  - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
  - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
  - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
  - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
  - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

- ( 3 ) 投資信託説明書(請求目論見書)に信託約款を掲載します。
- ( 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6月28日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年1月10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 大畑 茂 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 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29年6月9日から平成29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29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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成29年12月1日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木 裕晃	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

---

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