

【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5月2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】	海外株式セレクション（ラップ向け）
【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】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

海外株式セレクション(ラップ向け)(「ファンド」といいます。)

(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。

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】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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/>

(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、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

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5月3日から平成31年4月26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】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。

同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

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、主として値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、5,000億円です。

* 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 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回 年6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
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 ()	(隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX その他 ()	条件付運用型 ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型 その他 ()
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、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

海外株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色 1

投資信託証券への投資を通じて、主として海外株式に実質的な投資を行います。

- 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2018年5月3日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<外国株式インデックスマザーファンド>

日本を除く世界の主要国の株式への投資を行います。

- ・MSCI Kokusai Index(MSCI コクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・MSCI Kokusai Index(MSCI コクサイ インデックス)(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・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。

<新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等(預託証券(DR)を含みます。)に投資を行います。

- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・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。

<アセアン真成長株式マザーファンド>

アセアン諸国の株式等(預託証券(DR)を含みます。)に投資を行います。

<好配当海外株マザーファンド>

日本を除く世界主要国の株式等に投資を行います。

- ・日本を除く世界主要国の株式等の中から、配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。

<AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド>

世界のインフラ関連企業の株式等(預託証券および投資信託証券等を含むことがあります。)に投資を行います。

- ・世界各国(除く日本)のインフラ関連企業(公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要不可欠なインフラ資産を所有・運営し、その利用料を主な収益源とする企業)の株式等へ投資を行い、中長期的な値上がり益と配当収益の確保をめざして運用を行います。
- ・インフラ関連株式等の運用にあたっては、AMP キャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用の指図に関する権限を委託します。

AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド

AMP CAPITAL 

- オーストラリアを代表する総合金融グループであるAMPグループの一員で、オーストラリア大手の運用会社です。
- 債券・株式投資に加え、インフラ、不動産といった実物資産クラスへの豊富な投資経験を有しています。

<グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)>

グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅡへの投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長をめざします。

- ・MSCIワールド・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・マザーファンドの運用の指図に係る権限を、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。

・モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドは、モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントの欧州拠点です。

・モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメントはモルガン・スタンレーの資産運用部門として世界各国に展開し、様々な運用戦略を世界の投資家に提供しています。

- ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。
- 預託証券(DR)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。
- グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)は、2018年5月17日設定予定です。
- 運用の指図に関する権限の委託を受ける者、委託の内容、委託の有無等については、変更する場合があります。
- 組入投資信託証券の見直しに伴い、「アセアン真成長株式マザーファンド」は、2018年11月3日に投資対象から除外する予定です。

特色2

三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
 - 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。
 - 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

<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>)をご覧ください。

特色3

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。

特色4

年1回の決算時(2月5日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。

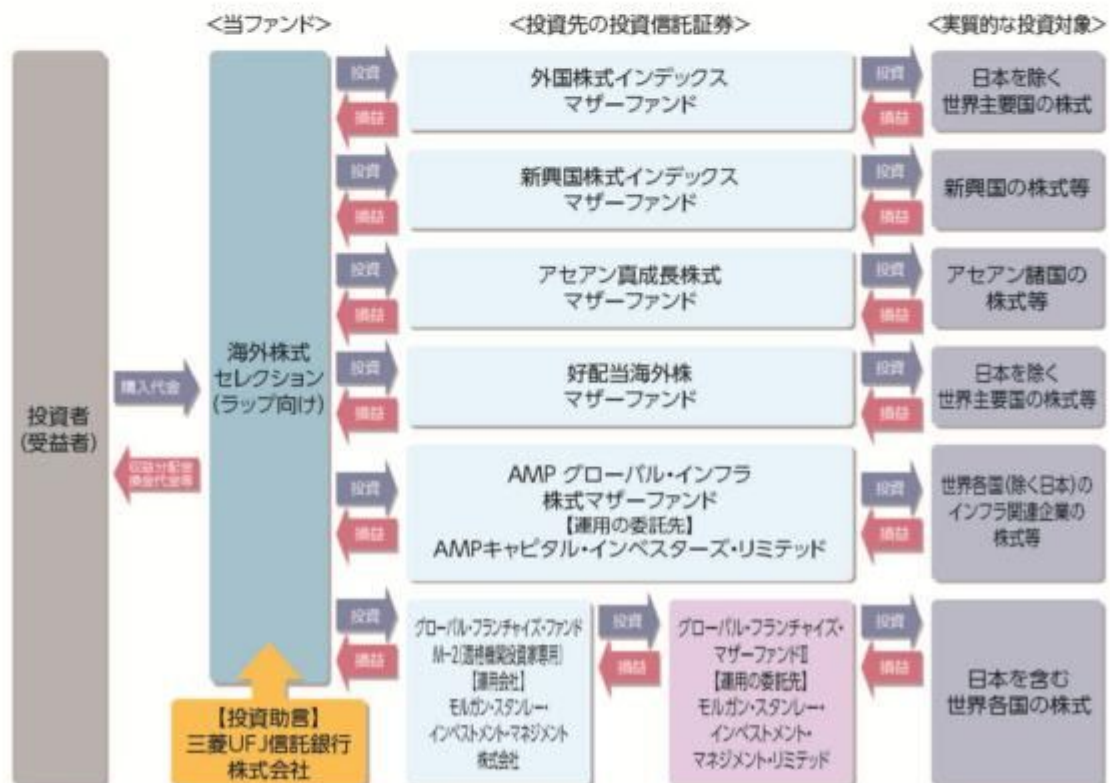
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

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。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



1 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

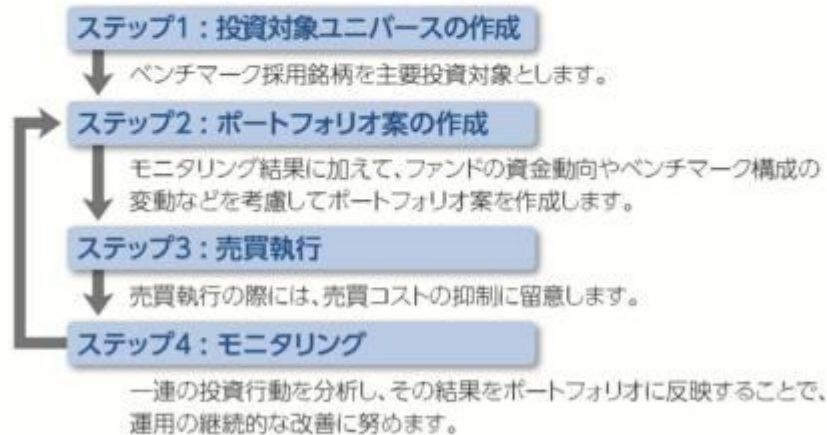
2 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

株式	株式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。
外貨建資産	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■各投資信託証券の運用プロセス

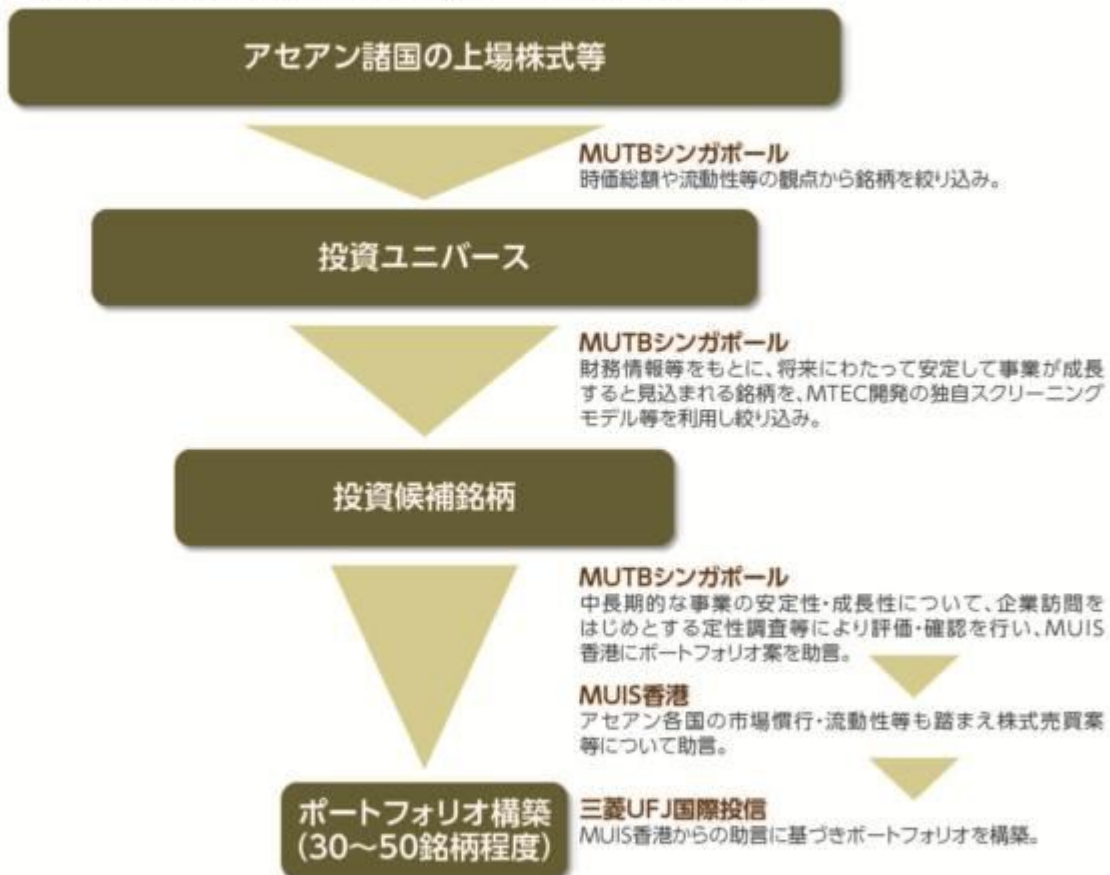
<外国株式インデックスマザーファンド／新興国株式インデックスマザーファンド>



■ 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。

<アセアン真成長株式マザーファンド>

- 株式等への投資にあたっては、事業の安定性・成長性等に着目して銘柄選定を行います。
- 運用にあたっては、三菱UFJ国際投信の香港現地法人であるMitsubishi UFJ Investment Services(HK) Limited(以下、「MUIS香港」)から投資助言を受け、三菱UFJ国際投信が運用します。
- MUIS香港は、三菱UFJ信託銀行(シンガポール支店。以下、「MUTBシンガポール」)の投資助言を活用します。MUTBシンガポールは、三菱UFJトラス投資工学研究所(以下、「MTEC」)のスクリーニングモデルや企業訪問等をはじめとする定性調査等を活用し、ポートフォリオ案をMUIS香港に助言します。
- 株式等の実質組入比率は高位を維持することを基本とします。



- ❗ MTECは、三菱UFJ信託銀行が1988年に設立した投資理論研究機関です。最新の投資理論研究や、高度なモデルの開発を専門に行っています。
- ❗ 投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。
- ❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。
- ❗ 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。

<好配当海外株マザーファンド>

- 投資にあたっては、世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、投資配分を決定します。
- 銘柄選定にあたっては、地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし、組入銘柄を選定します。
- 各地域内における個別銘柄投資は、ファンド設定時、リバランス時には等金額投資を基本とし、分散投資を行います。

定量・定性のスクリーニングを通じて、組入銘柄を選定します。

①『高配当ユニバース』の決定

地域毎に配当利回りが高い銘柄を、定量データを元に抽出します。

②『好配当ユニバース』の決定

デフォルトリスクが懸念される銘柄の除外等、定性的判断を加えてスクリーニングしたものを好配当ユニバースとします。

③ファンダメンタルズ分析

スクリーニングの結果抽出された組入候補銘柄に対し、個別企業の減配リスクや配当成長性に関する調査を実施します。

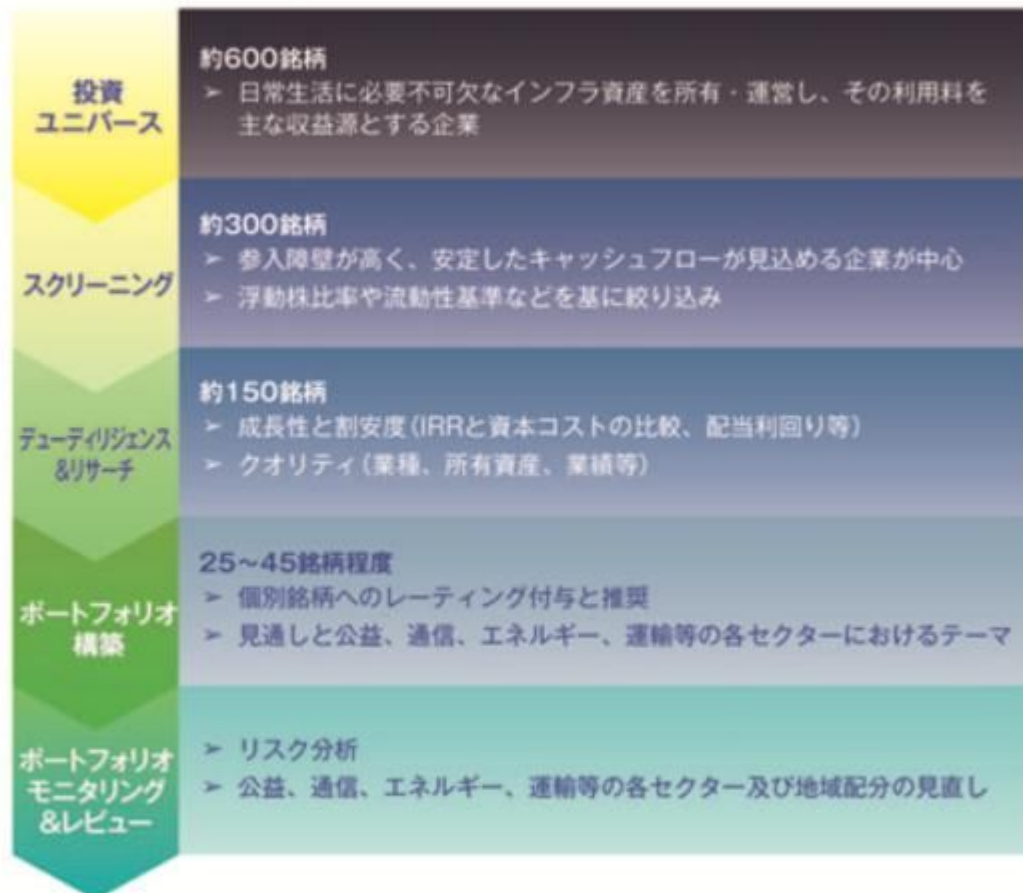
④ポートフォリオ構築

地域毎の資産配分戦略やポートフォリオ全体の利回り水準を加味し、最終の銘柄選定やウェイト判断を実施します。

- !** 上記の運用プロセスは銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。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。なお、今後、変更される場合があります。

<AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド>

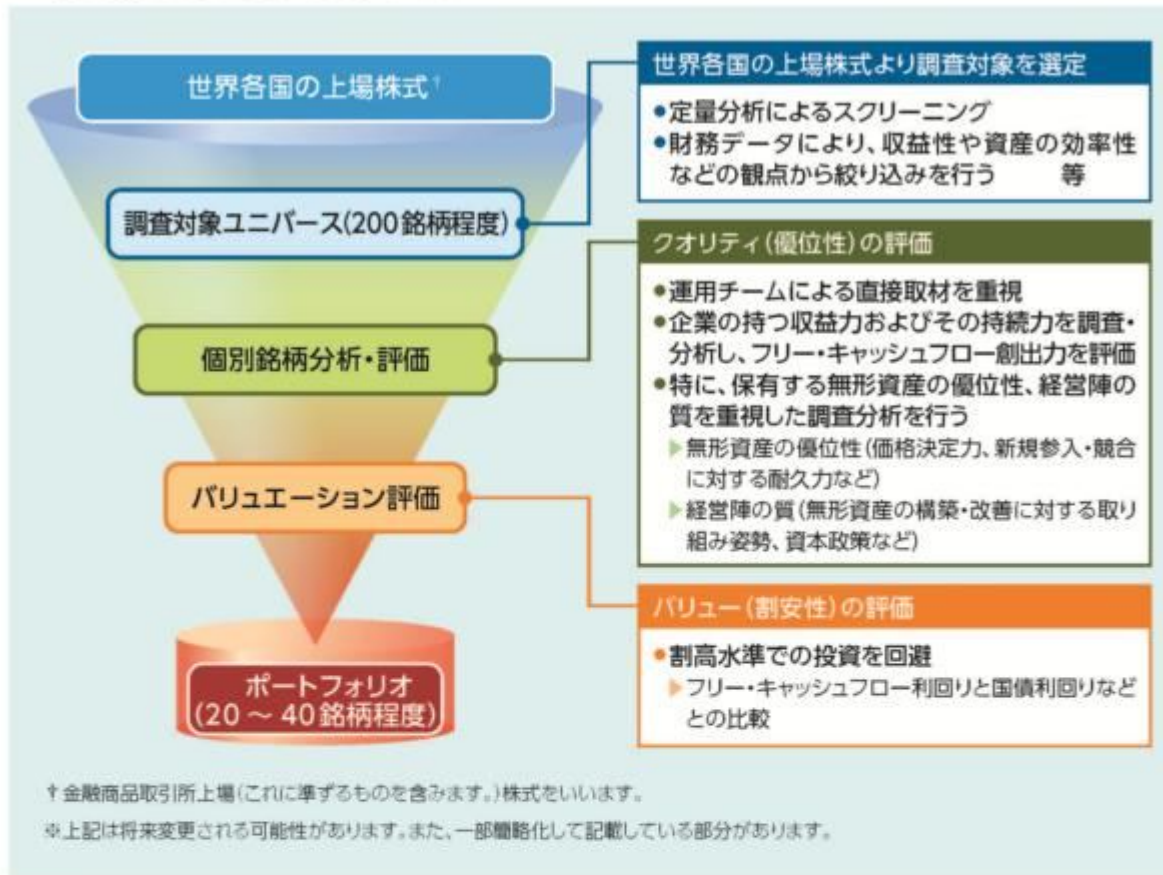
- インフラ関連株式等への投資にあたっては、インフラの種類や地域の分散に配慮しながら、個別企業の成長性、配当利回り、割安度、企業のクオリティに着目し、銘柄選定を行います。



- IRR(内部収益率)とは、プロジェクト案件への投資に対する収益率を表しています。IRRと資本コスト(インフラ投資にかかるコスト)の比較は、インフラ関連企業が有益なプロジェクトへ投資しているかどうかの判断材料の1つとなります。
- ! 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。

<グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)>

- 収益性、財務内容の分析に加え、保有する無形資産や経営陣の質などから利益成長の持続可能性を多面的に分析します。



- 1 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。



指数について

- ・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。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・MSCI エマージング・マーケット インデックスとは、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。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・MSCI ワールド インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の先進国で構成されています。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

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。

(2) 【ファンドの沿革】

平成29年3月27日

設定日、信託契約締結、運用開始

(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 収益分配金、解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。
お申込金 収益分配金、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 信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
信託財産の保管・管理等を行います。	
投資 損益	
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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い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30年2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（平成30年4月2日現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

投資信託証券を主要投資対象とします。

投資信託証券への投資を通じて、主として海外株式に実質的な投資を行います。

三菱UFJ信託銀行株式会社の助言に基づき、投資先ファンドの投資実績全体を重視し、ファンドを選定します。

投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。

投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

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（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。）のほか、次に掲げるものとします。

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せん。）

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

その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

< 投資信託証券の概要 >

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
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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。 ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	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
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・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。 ・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)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	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	新興国株式インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として対象インデックスに採用されている新興国の株式等に投資を行い、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。 ・株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・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等の投資比率が100%を超える場合があります。 ・組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ・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。
主な投資対象	新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・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。 ・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)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社

設定日	2009年4月1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	アセアン真成長株式マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・アセアン諸国の株式等を主要投資対象とし、主として中長期的な値上がり益の獲得をめざします。 ・株式等への投資にあたっては、事業の安定性・成長性等に着目して銘柄選定を行います。 ・株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・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。
主な投資対象	アセアン諸国の株式等(預託証券(DR)を含みます。)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避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。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2014年8月18日
決算日	原則として毎年6月10日、12月10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	好配当海外株マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・わが国を除く世界主要国の株式等の中から、配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。 ・投資にあたっては、世界を北米、欧州およびアジア・オセアニアの3地域に分け、地域毎の配当利回りの水準、配当成長性の水準および流動性等を勘案し、投資配分を決定します。 ・銘柄選定にあたっては、地域毎に配当利回りが高い銘柄および配当成長性が高いと判断される銘柄の中から流動性等を勘案して調査対象銘柄を決定し、減配リスク等をチェックし、組入銘柄を選定します。 ・株式の組入比率は高位を基本とします。 ・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、資金動向等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国を除く世界主要国の株式
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の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5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。

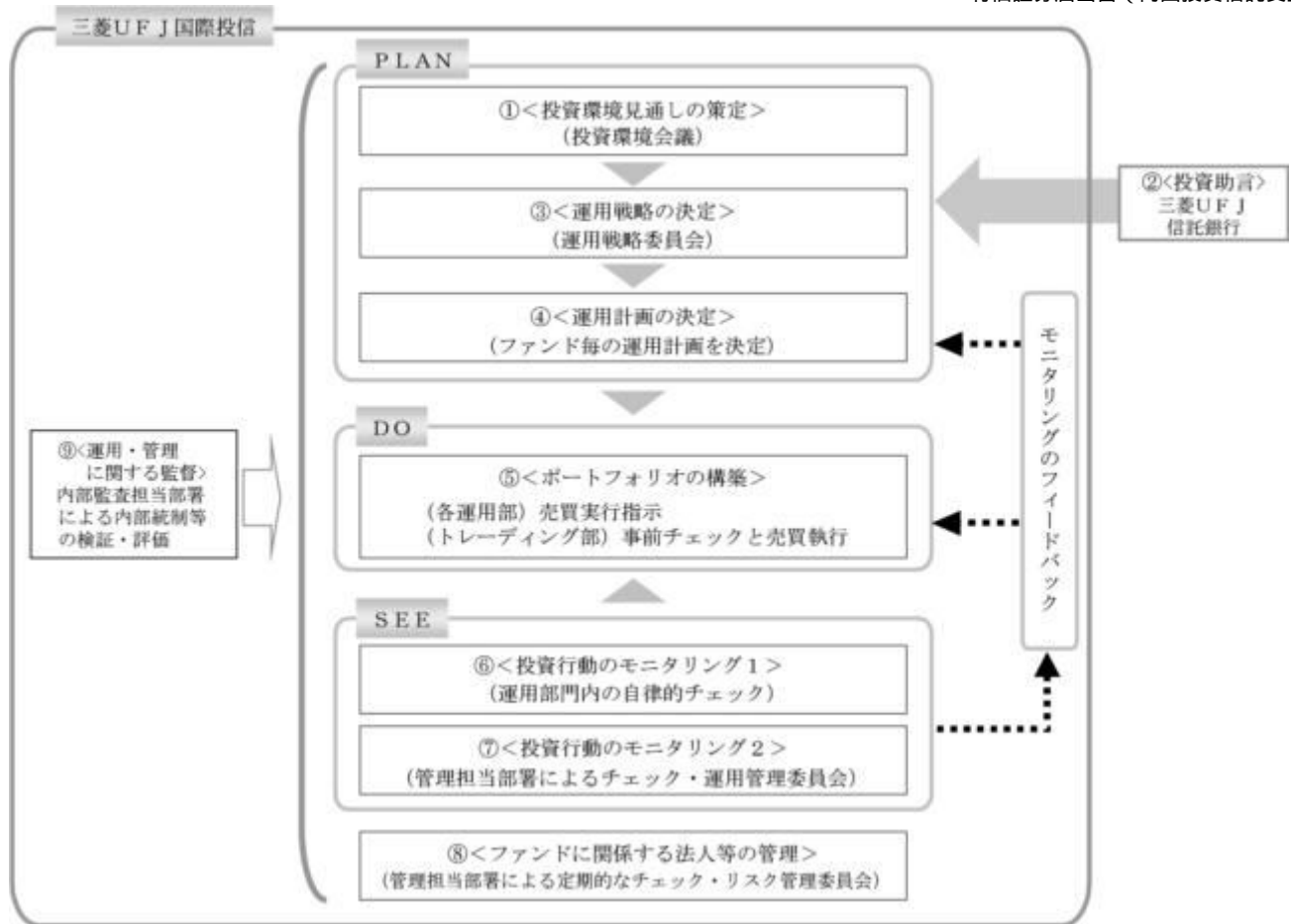
	<ul style="list-style-type: none"> ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJ国際投信株式会社
設定日	2006年11月22日
決算日	原則として毎年10月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、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	AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国(除く日本)のインフラ関連企業の株式等に投資を行います。なお、インフラ関連企業とは、公益、通信、エネルギーおよび運輸等の日常生活に必要な不可欠なインフラ資産を所有・運営し、その利用料を主な収益源とする企業をいいます。 ・株式等への投資にあたっては、インフラの種類や地域の分散に配慮しながら、個別企業の成長性、配当利回り、割安度、企業のクオリティに着目し、銘柄選定を行います。 ・株式等の運用にあたっては、AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。 ・株式等の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・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。
主な投資対象	世界各国(除く日本)のインフラ関連企業の株式等(預託証券および投資信託証券等を含むことがあります。)
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は為替変動リスクを回避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。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
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 (マザーファンドの運用委託先:AMPキャピタル・インベスターズ・リミテッド)
設定日	2016年4月13日
決算日	原則として毎年3月15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	グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2(適格機関投資家専用)
形態	証券投資信託
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅡ(以下、「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式(預託証券を含みます。以下同じ。)に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長をめざします。

	<ul style="list-style-type: none"> ・有力な無形資産(特許、著作権、ブランド等)を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 ・MSCIワールド・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。ただし、ベンチマークからの乖離を低減することには重点をおきません。 ・実質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。 ・資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
マザーファンドの投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を含む世界各国の株式(預託証券を含みます。)に投資を行います。 ・有力な無形資産(特許、著作権、ブランド等)を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選し、原則として20銘柄から40銘柄程度に集中投資を行います。 ・投資先企業は、主として以下のような視点に基づいて選定を行います。 <ul style="list-style-type: none"> 優れたフランチャイズ、有力な無形資産 グローバルな成長性 資本出資を伴わずに成長するビジネス 潤沢なキャッシュ・フローに支えられた反復性のあるビジネス 高い利払い負担能力を有する強固な財務基盤 卓越した経営能力 ・MSCIワールド・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。ただし、ベンチマークからの乖離を低減することには重点をおきません。 ・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。 ・運用の指図に係る権限をモルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。 ・資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資対象	マザーファンド受益証券
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式の実質投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。
運用管理費用(信託報酬)	純資産総額の年0.776%(税抜) なお、マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬を含みます。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	解約請求日の翌営業日の基準価額に0.2%を乗じた額
投資運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
設定日	2018年5月17日(予定)
決算日	原則として毎年12月1日
分配方針	<ul style="list-style-type: none"> ・毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ・分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で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。

(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。

投資助言

当ファンドは、三菱UFJ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

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、およびの投資助言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。

ファンドに関係する法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健

全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

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、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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、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 >

株式

株式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。

外国為替予約取引

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、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。

c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

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。

(主なリスクであり、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、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。

為替変動 リスク

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ので、為替変動の影響を受けます。

信用リスク

組入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は、当該組入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・償還金の支払いが滞ることがあります。

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場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

カントリー・ リスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、価格変動・為替変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。

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。
- 収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりの方が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

(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、定期的に行わ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。

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はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI (国債)	NOMURA-BPIとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI (国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI (国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	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・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・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】

ありません。

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】

かかりません。

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0.54%（税抜0.5%）の率を乗じて得た額とします。

1万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、毎計算期間の6ヵ月終了日および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	0.42%	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
販売会社	0.04%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
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（概算値）は、次の通りとなります。

実質的な信託報酬率（概算値）	うち投資信託証券に係る率
年0.54%～0.74%（税込）程度	年0%～0.2%（税込）程度

（注）上記概算値は、投資対象とする投資信託証券における信託報酬率を含めた実質的な信託報酬率を算出したものです（平成30年5月3日現在）。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、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、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。

< 投資信託証券の信託報酬率 >

投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
外国株式インデックスマザーファンド	-
新興国株式インデックスマザーファンド	-
アセアン真成長株式マザーファンド	-
好配当海外株マザーファンド	-
AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	外部委託報酬：純資産総額の年0.5%以内
グローバル・フランチャイズ・ファンド M-2（適格機関投資家専用）	年0.83808%

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。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。

（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。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

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。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

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。

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。

買取りの取扱いについては、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

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として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。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一

ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成30年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【海外株式セレクション（ラップ向け）】

（1）【投資状況】

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	3,697,934,861	97.69
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		87,438,843	2.31
純資産総額		3,785,373,704	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30年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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	862,549,829	2.7131	2,340,262,839	2.6196	2,259,535,532	59.69
日本	親投資信託受益証券	好配当海外株マザーファンド	815,276,382	1.4240	1,160,983,322	1.3623	1,110,651,015	29.34
日本	親投資信託受益証券	AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	162,914,745	1.1642	189,665,346	1.1062	180,216,290	4.76

日本	親投資信託受益証券	アセアン真成長株式マザーファンド	60,223,696	1.2558	75,628,917	1.2401	74,683,405	1.97
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	27,153,951	2.7813	75,523,283	2.6828	72,848,619	1.92

（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30年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.69
合計	97.69

（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30年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間末日 (平成30年 2月 5日)	3,853,426,838	3,853,426,838	11,655	11,655
平成29年 3月末日	10,198,853		10,199	
4月末日	10,285,474		10,285	
5月末日	2,385,431,744		10,447	
6月末日	3,542,785,216		10,613	
7月末日	3,495,036,509		10,690	
8月末日	3,506,895,188		10,674	
9月末日	3,623,480,301		11,089	
10月末日	3,600,954,614		11,318	
11月末日	3,674,313,404		11,384	
12月末日	3,873,750,851		11,696	
平成30年 1月末日	3,861,515,944		11,721	
2月末日	3,785,373,704		11,213	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	16.55

（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	4,057,047,119	750,883,116	3,306,164,003

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	227,337,379,755	61.38
	イギリス	24,224,165,785	6.54
	フランス	13,885,834,321	3.75
	ドイツ	13,727,225,054	3.71
	カナダ	12,844,436,380	3.47
	スイス	11,327,150,534	3.06
	オーストラリア	9,057,346,115	2.45
	オランダ	6,036,983,613	1.63
	香港	4,621,893,655	1.25
	スペイン	4,607,242,783	1.24
	スウェーデン	3,864,557,291	1.04
	イタリア	2,855,639,500	0.77
	デンマーク	2,620,576,359	0.71

	シンガポール	1,764,854,826	0.48
	ベルギー	1,582,988,389	0.43
	フィンランド	1,469,676,247	0.40
	ノルウェー	975,377,357	0.26
	アイルランド	642,589,953	0.17
	ルクセンブルグ	441,530,407	0.12
	イスラエル	384,282,172	0.10
	オーストリア	379,474,901	0.10
	ニュージーランド	238,304,532	0.06
	ポルトガル	216,286,007	0.06
	小計	345,105,795,936	93.18
投資証券	アメリカ	5,878,879,538	1.59
	オーストラリア	715,382,600	0.19
	フランス	451,746,656	0.12
	イギリス	299,364,372	0.08
	香港	174,905,325	0.05
	シンガポール	150,873,602	0.04
	カナダ	61,735,627	0.02
	小計	7,732,887,720	2.09
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		17,541,312,224	4.73
純資産総額		370,379,995,880	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,257,211,566	3.31
	買建	カナダ	655,766,176	0.18
	買建	ドイツ	2,841,429,571	0.77
	買建	オーストラリア	896,324,874	0.24
	買建	イギリス	1,279,297,011	0.35
	買建	スイス	580,415,883	0.16

（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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	454,060	16,603.69	7,539,074,569	19,153.73	8,696,944,596	2.35
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	643,345	7,510.53	4,831,862,888	10,114.25	6,506,954,740	1.76
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	35,891	103,620.63	3,719,048,376	162,341.29	5,826,591,333	1.57
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	208,371	16,556.45	3,449,884,876	19,483.36	4,059,767,248	1.10
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	309,474	9,536.60	2,951,330,801	12,600.94	3,899,664,296	1.05
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	235,984	13,464.19	3,177,335,301	14,137.40	3,336,202,066	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	27,520	100,806.47	2,774,194,107	120,070.79	3,304,348,342	0.89
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	26,189	103,291.01	2,705,088,357	119,987.04	3,142,340,818	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	372,655	8,826.88	3,289,383,836	8,321.17	3,100,927,470	0.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	881,195	2,616.60	2,305,740,917	3,471.27	3,058,867,618	0.83
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	414,734	5,788.31	2,400,611,738	6,357.37	2,636,620,683	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	111,468	18,019.90	2,008,643,005	22,511.19	2,509,277,795	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	273,729	9,256.82	2,533,861,122	8,678.41	2,375,533,914	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	413,048	3,874.98	1,600,554,102	5,358.83	2,213,456,781	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	539,862	4,098.31	2,212,523,399	3,958.73	2,137,168,921	0.58
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	160,946	10,153.98	1,634,242,610	13,246.23	2,131,928,844	0.58
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	439,487	3,604.41	1,584,091,733	4,835.94	2,125,334,872	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	85,035	19,242.85	1,636,315,869	24,965.67	2,122,955,953	0.57
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	522,951	3,588.30	1,876,507,897	3,951.21	2,066,292,358	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	103,681	16,919.36	1,754,216,641	19,861.30	2,059,239,715	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	166,726	11,574.48	1,929,767,753	12,198.30	2,033,774,716	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	239,592	6,728.87	1,612,185,313	8,200.92	1,964,874,968	0.53
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	224,210	9,351.92	2,096,795,553	8,647.57	1,938,873,867	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO/THE	資本財	49,393	21,048.81	1,039,664,109	39,151.39	1,933,804,942	0.52
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,767,636	1,029.89	1,820,477,710	1,073.47	1,897,518,216	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	358,817	4,981.96	1,787,614,812	5,158.05	1,850,797,749	0.50

スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	195,557	9,088.78	1,777,376,134	9,126.51	1,784,752,994	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,102	7,421.41	1,039,755,000	12,697.57	1,778,955,821	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	356,570	4,732.86	1,687,599,314	4,683.47	1,669,988,250	0.45
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア	413,657	4,214.27	1,743,263,320	3,936.18	1,628,230,148	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30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.07
	素材	4.85
	資本財	7.29
	商業・専門サービス	0.95
	運輸	1.92
	自動車・自動車部品	1.51
	耐久消費財・アパレル	1.70
	消費者サービス	1.76
	メディア	2.16
	小売	4.17
	食品・生活必需品小売り	1.57
	食品・飲料・タバコ	4.81
	家庭用品・パーソナル用品	1.79
	ヘルスケア機器・サービス	4.03
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.62
	銀行	9.54
	各種金融	4.55
	保険	3.91
	不動産	0.59
	ソフトウェア・サービス	10.36
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.05	
電気通信サービス	2.28	
公益事業	2.76	
半導体・半導体製造装置	2.96	
	小計	93.18
投資証券		2.09
合計		95.26

（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30年 2月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI1803	買建	831	アメリカドル	111,906,973.31	12,015,451,724	114,158,625	12,257,211,566	3.31
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE601803	買建	42	カナダドル	7,632,457.5	641,660,701	7,800,240	655,766,176	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 1803	買建	627	ユーロ	21,303,024.25	2,796,661,023	21,644,040	2,841,429,571	0.77
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1803	買建	71	オーストラリアドル	10,397,459	869,851,420	10,713,900	896,324,874	0.24
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 1803	買建	118	イギリスポンド	8,470,160	1,264,256,081	8,570,930	1,279,297,011	0.35
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX1803	買建	57	スイスフラン	5,020,093.75	573,846,916	5,077,560	580,415,883	0.16

（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。

新興国株式インデックスマザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（％）
株式	香港	15,271,579,998	21.65
	韓国	9,750,317,234	13.83
	アメリカ	8,057,987,887	11.43
	台湾	7,554,560,493	10.71
	インド	5,547,844,556	7.87
	ブラジル	5,062,682,546	7.18
	南アフリカ	4,585,752,144	6.50
	メキシコ	1,857,796,733	2.63
	タイ	1,621,915,597	2.30
	マレーシア	1,621,720,296	2.30
	インドネシア	1,467,257,243	2.08
	ポーランド	870,839,741	1.23

	チリ	836,162,591	1.19
	フィリピン	697,828,318	0.99
	トルコ	680,030,611	0.96
	アラブ首長国連邦	375,826,078	0.53
	カタール	364,027,052	0.52
	コロンビア	287,819,190	0.41
	ギリシャ	220,646,264	0.31
	ハンガリー	213,163,562	0.30
	チェコ	125,195,299	0.18
	小計	67,070,953,433	95.10
投資証券	南アフリカ	201,861,926	0.29
	メキシコ	52,134,696	0.07
	トルコ	19,435,121	0.03
	小計	273,431,743	0.39
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		3,180,559,362	4.51
純資産総額		70,524,944,538	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30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,391,078,520	4.81

（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。

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30年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	628,100	3,821.93	2,400,558,441	6,114.66	3,840,617,946	5.45
アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ソフトウェア・サービス	127,047	14,168.54	1,800,071,162	20,213.47	2,568,061,511	3.64
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,735	231,089.44	2,480,745,199	236,189.30	2,535,492,136	3.60

台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,706,000	778.73	2,107,263,134	902.82	2,443,030,920	3.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	48,304	25,477.25	1,230,653,567	30,302.51	1,463,732,564	2.08
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,284,550	89.52	831,211,409	114.88	1,066,700,093	1.51
アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	30,296	20,972.58	635,385,347	26,891.89	814,716,705	1.16
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	8,139,350	72.80	592,545,494	94.59	769,974,371	1.09
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	678,500	1,158.22	785,852,813	1,012.48	686,970,055	0.97
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	574,500	702.63	403,665,244	1,170.14	672,250,313	0.95
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	281,499	1,373.26	386,571,964	2,232.22	628,368,345	0.89
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	357,187	1,332.35	475,900,600	1,721.99	615,073,514	0.87
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,723,840	382.30	659,030,755	323.32	557,364,016	0.79
ブラジル	株式	VALE SA	素材	349,930	942.39	329,770,812	1,562.83	546,883,411	0.78
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,771,000	52.50	460,559,071	59.91	525,494,292	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	167,411	2,673.45	447,565,423	3,053.84	511,247,329	0.72
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	64,271	5,937.03	381,579,196	7,846.39	504,295,332	0.72
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	286,611	1,200.41	344,051,485	1,587.33	454,947,672	0.65
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	335,299	1,057.47	354,569,167	1,321.79	443,195,066	0.63
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	522,400	652.14	340,680,548	733.70	383,287,179	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,927	177,708.07	342,443,454	198,502.70	382,514,703	0.54
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,688,100	84.30	310,917,894	102.25	377,137,730	0.53
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	195,065	1,590.11	310,174,979	1,920.83	374,687,484	0.53
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	72,159	4,333.45	312,697,649	5,050.68	364,452,364	0.52
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	46,760	5,445.80	254,645,907	7,309.74	341,803,891	0.48
アメリカ	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	588,037	482.09	283,487,521	552.31	324,779,467	0.46
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	1,962,000	126.68	248,546,944	159.31	312,566,612	0.44
韓国	株式	POSCO	素材	8,208	28,647.10	235,135,398	37,736.45	309,740,782	0.44
韓国	株式	CELLTRION INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,751	11,490.72	100,555,327	34,994.70	306,238,620	0.43
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	427,000	494.96	211,352,105	709.93	303,140,110	0.43

(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30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	エネルギー	6.88
	素材	7.13
	資本財	3.34
	商業・専門サービス	0.09
	運輸	1.50
	自動車・自動車部品	2.90
	耐久消費財・アパレル	0.95
	消費者サービス	1.12
	メディア	2.44
	小売	1.99
	食品・生活必需品小売り	1.60
	食品・飲料・タバコ	3.32
	家庭用品・パーソナル用品	1.07
	ヘルスケア機器・サービス	0.56
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.05
	銀行	17.11
	各種金融	2.67
	保険	3.48
	不動産	2.16
	ソフトウェア・サービス	13.41
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.44
	電気通信サービス	4.40
	公益事業	2.19
半導体・半導体製造装置	5.31	
小計	95.10	
投資証券	0.39	
合計	95.49	

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成30年 2月28日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINI MS 1803	買建	527	アメリカドル	31,555,628.5	3,388,127,831	31,583,110	3,391,078,520	4.81

（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。

アセアン真成長株式マザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株式	シンガポール	835,692,001	29.51
	タイ	591,677,164	20.90
	インドネシア	535,436,443	18.91
	マレーシア	390,854,731	13.80
	フィリピン	326,379,725	11.53
	ベトナム	15,192,750	0.54
	小計	2,695,232,814	95.18
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		136,384,282	4.82
純資産総額		2,831,617,096	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。

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30年 2月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
シンガポール	株式	DBS GROUP HOLDINGS LTD	銀行	104,400	2,035.23	212,478,764	2,355.31	245,894,677	8.68
シンガポール	株式	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	銀行	181,500	1,014.03	184,047,172	1,080.39	196,091,965	6.93
インドネシア	株式	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	銀行	4,507,300	27.08	122,098,701	29.78	134,240,916	4.74
タイ	株式	PTT PCL-NVDR	エネルギー	45,700	1,464.57	66,931,008	1,957.34	89,450,438	3.16
タイ	株式	CP ALL PCL-NVDR	食品・生活必需品小売り	312,600	264.27	82,612,446	283.88	88,741,670	3.13
インドネシア	株式	ACE HARDWARE INDONESIA	小売	7,489,900	9.51	71,240,933	10.90	81,654,890	2.88
フィリピン	株式	JOLLIBEE FOODS CORP	消費者サービス	111,360	514.81	57,330,194	607.70	67,673,472	2.39
シンガポール	株式	KEPPEL CORP LTD	資本財	96,600	622.46	60,130,022	656.50	63,418,383	2.24
インドネシア	株式	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	電気通信サービス	1,946,800	32.34	62,976,416	31.75	61,826,474	2.18
シンガポール	株式	VENTURE CORP LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	28,100	1,641.26	46,119,476	2,196.45	61,720,385	2.18

インドネシア	株式	UNILEVER INDONESIA TBK PT	家庭用品・パーソナル用品	143,700	405.65	58,293,265	426.40	61,274,039	2.16
インドネシア	株式	UNITED TRACTORS TBK PT	エネルギー	209,600	262.92	55,109,859	289.14	60,603,744	2.14
タイ	株式	TPI POLENE POWER PCL-NVDR	資本財	2,335,400	27.14	63,401,291	25.06	58,533,298	2.07
マレーシア	株式	SCIENTEX BHD	素材	245,200	239.21	58,656,129	235.12	57,652,405	2.04
タイ	株式	MUANGTHAI LEASING PCL-NVDR	各種金融	388,700	132.36	51,450,017	145.77	56,663,714	2.00
フィリピン	株式	WILCON DEPOT INC	小売	2,440,000	18.70	45,647,359	22.37	54,586,704	1.93
マレーシア	株式	INARI AMERTRON BHD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	575,950	90.80	52,300,557	94.32	54,325,332	1.92
シンガポール	株式	CAPITALAND LTD	不動産	179,500	282.30	50,673,297	292.59	52,519,995	1.85
タイ	株式	BANGKOK CHAIN HOSPITAL-NVDR	ヘルスケア機器・サービス	906,800	54.14	49,098,058	55.58	50,402,664	1.78
マレーシア	株式	V.S. INDUSTRY BERHAD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	615,300	82.39	50,697,805	80.92	49,794,014	1.76
シンガポール	株式	VALUETRONICS HOLDINGS LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	624,500	72.69	45,397,339	79.02	49,350,332	1.74
タイ	株式	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	銀行	96,300	514.83	49,578,576	506.38	48,764,876	1.72
マレーシア	株式	QL RESOURCES BHD	食品・飲料・タバコ	361,250	118.83	42,929,091	134.78	48,691,515	1.72
フィリピン	株式	BDO UNIBANK INC	銀行	149,900	312.41	46,830,428	323.42	48,480,658	1.71
フィリピン	株式	SM PRIME HOLDINGS INC	不動産	644,900	76.70	49,467,263	74.98	48,357,181	1.71
タイ	株式	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	運輸	188,400	213.94	40,306,937	241.25	45,452,913	1.61
フィリピン	株式	AYALA LAND INC	不動産	454,100	88.84	40,345,786	87.55	39,756,455	1.40
シンガポール	株式	GENTING SINGAPORE PLC	消費者サービス	408,800	107.53	43,960,350	96.44	39,428,555	1.39
マレーシア	株式	ECONPILE HOLDINGS BHD	資本財	1,186,850	33.20	39,412,882	33.08	39,262,659	1.39
インドネシア	株式	MITRA ADIPERKASA TBK PT	小売	621,100	51.74	32,138,819	59.25	36,800,175	1.30

(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30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	6.29
	素材	2.04
	資本財	9.15
	運輸	4.52
	消費者サービス	4.81
	メディア	2.07
	小売	7.98

食品・生活必需品小売り	3.13
食品・飲料・タバコ	1.72
家庭用品・パーソナル用品	2.16
ヘルスケア機器・サービス	1.78
銀行	23.78
各種金融	2.00
不動産	9.59
ソフトウェア・サービス	2.27
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.60
電気通信サービス	2.18
公益事業	1.09
小計	95.18
合計	95.18

（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。

好配当海外株マザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株式	アメリカ	897,656,522	23.43
	オーストラリア	614,922,601	16.05
	香港	412,284,378	10.76
	カナダ	311,767,457	8.14
	イギリス	310,487,093	8.10
	フランス	218,964,499	5.72
	シンガポール	198,260,457	5.17
	スペイン	134,959,700	3.52
	フィンランド	101,094,543	2.64
	ノルウェー	76,566,897	2.00
	ドイツ	76,165,303	1.99

	スウェーデン	71,444,801	1.86
	スイス	64,637,876	1.69
	ニュージーランド	53,461,291	1.40
	ベルギー	47,095,781	1.23
	オランダ	45,341,027	1.18
	イタリア	40,381,324	1.05
	デンマーク	35,613,040	0.93
	小計	3,711,104,590	96.86
	コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	120,120,039	3.14
	純資産総額	3,831,224,629	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。

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30年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,797	9,844.75	37,380,536	12,697.57	48,212,697	1.26
シンガポール	株式	DBS GROUP HOLDINGS LTD	銀行	20,200	1,774.99	35,854,899	2,355.31	47,577,323	1.24
ベルギー	株式	KBC GROEP NV	銀行	4,659	9,515.17	44,331,197	10,108.55	47,095,781	1.23
オランダ	株式	NN GROUP NV	保険	9,398	4,754.96	44,687,129	4,824.54	45,341,027	1.18
アメリカ	株式	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	半導体・半導体製造装置	6,658	5,619.74	37,416,267	6,673.04	44,429,137	1.16
フランス	株式	NATIXIS	各種金融	47,009	909.77	42,767,397	928.93	43,668,412	1.14
イギリス	株式	PERSIMMON PLC	耐久消費財・アパレル	11,186	4,285.25	47,934,858	3,886.73	43,476,966	1.13
ドイツ	株式	HANNOVER RUECK SE	保険	2,932	13,863.16	40,646,808	14,742.74	43,225,725	1.13
香港	株式	HYSAN DEVELOPMENT CO	不動産	70,000	516.86	36,180,690	610.78	42,754,635	1.12
香港	株式	WYNN MACAU LTD	消費者サービス	113,600	274.88	31,226,993	372.91	42,362,803	1.11
アメリカ	株式	CME GROUP INC	各種金融	2,350	14,395.09	33,828,475	17,897.50	42,059,137	1.10
ノルウェー	株式	MARINE HARVEST	食品・飲料・タバコ	19,938	2,161.71	43,100,333	2,086.75	41,605,681	1.09
アメリカ	株式	HP INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	16,443	2,356.77	38,752,394	2,525.34	41,524,205	1.08
フィンランド	株式	ELISA OYJ	電気通信サービス	8,900	4,602.67	40,963,823	4,659.12	41,466,232	1.08
フランス	株式	BNP PARIBAS	銀行	4,708	8,937.54	42,077,950	8,601.46	40,495,700	1.06
イタリア	株式	TERNA SPA	公益事業	66,666	668.21	44,547,235	605.72	40,381,324	1.05
香港	株式	HANG SENG BANK LTD	銀行	15,100	2,548.68	38,485,204	2,672.07	40,348,393	1.05

アメリカ	株式	TARGET CORP	小売	4,925	8,145.30	40,115,632	8,113.95	39,961,208	1.04
香港	株式	CK ASSET HOLDINGS LTD	不動産	42,500	887.03	37,699,072	931.59	39,592,766	1.03
フランス	株式	CREDIT AGRICOLE SA	銀行	21,275	2,015.14	42,872,273	1,860.89	39,590,519	1.03
香港	株式	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	銀行	72,500	522.35	37,870,447	544.97	39,510,506	1.03
アメリカ	株式	EATON CORP PLC	資本財	4,484	8,544.50	38,313,559	8,800.04	39,459,403	1.03
香港	株式	KERRY PROPERTIES LTD	不動産	80,500	475.05	38,241,646	486.70	39,179,753	1.02
オーストラリア	株式	MEDIBANK PRIVATE LTD	保険	144,207	258.50	37,278,865	266.03	38,364,657	1.00
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	3,421	11,657.16	39,879,147	11,175.06	38,229,913	1.00
フィンランド	株式	UPM-KYMMENE OYJ	素材	10,184	3,347.63	34,092,365	3,720.47	37,889,319	0.99
アメリカ	株式	QUALCOMM INC	半導体・半導体製造装置	5,290	5,824.82	30,813,311	7,122.92	37,680,278	0.98
イギリス	株式	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	保険	64,767	555.24	35,961,695	578.97	37,498,767	0.98
スペイン	株式	ENAGAS SA	エネルギー	13,222	3,152.03	41,676,178	2,835.64	37,492,938	0.98
オーストラリア	株式	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	銀行	5,821	6,580.69	38,306,229	6,421.74	37,380,958	0.98

(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30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	4.68
	素材	5.61
	資本財	5.54
	運輸	2.53
	自動車・自動車部品	0.69
	耐久消費財・アパレル	3.63
	消費者サービス	3.25
	メディア	0.46
	小売	2.68
	食品・生活必需品小売り	0.54
	食品・飲料・タバコ	3.66
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.79
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.83
	銀行	15.05
	各種金融	4.55
	保険	11.65
	不動産	7.32
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.08
	電気通信サービス	5.30

	公益事業	13.13
	半導体・半導体製造装置	2.14
	小計	96.86
合計		96.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド

投資状況

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（%）
株式	アメリカ	262,601,721	32.42
	カナダ	159,548,320	19.70
	イタリア	98,001,132	12.10
	イギリス	68,298,329	8.43
	オーストラリア	41,467,253	5.12
	フランス	26,057,260	3.22
	香港	24,548,577	3.03
	スイス	14,855,681	1.83
	スペイン	13,316,439	1.64
	小計		708,694,712
投資証券	アメリカ	84,253,163	10.40
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		16,935,487	2.09
純資産総額		809,883,362	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。

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30年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORP		4,479	12,695.15	56,861,590	15,106.95	67,664,069	8.35
カナダ	株式	ENBRIDGE INC	エネルギー	16,005	4,489.86	71,860,228	3,538.50	56,633,793	6.99
アメリカ	株式	KINDER MORGAN INC	エネルギー	31,400	2,201.66	69,132,153	1,786.63	56,100,395	6.93
アメリカ	株式	SEMPRA ENERGY	公益事業	4,600	11,727.71	53,947,499	11,814.99	54,348,976	6.71
カナダ	株式	TRANSCANADA CORP	エネルギー	10,934	5,122.68	56,011,432	4,818.05	52,680,577	6.50
アメリカ	株式	WILLIAMS COS INC	エネルギー	11,400	3,043.93	34,700,910	3,045.01	34,713,150	4.29
カナダ	株式	PEMBINA PIPELINE CORP	エネルギー	8,428	3,221.67	27,152,245	3,547.75	29,900,471	3.69
オーストラリア	株式	APA GROUP	公益事業	38,384	722.82	27,744,815	649.20	24,918,954	3.08
イギリス	株式	PENNON GROUP PLC	公益事業	25,736	1,241.16	31,942,701	937.35	24,123,712	2.98
イタリア	株式	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	電気通信サービス	30,109	610.45	18,380,099	751.57	22,629,261	2.79
イタリア	株式	ATLANTIA SPA	運輸	6,719	3,373.04	22,663,486	3,338.45	22,431,048	2.77
イタリア	株式	RAI WAY SPA	メディア	35,453	584.19	20,711,501	611.10	21,665,626	2.68
アメリカ	株式	ENBRIDGE ENERGY MANAGEMENT L	エネルギー	15,827	1,633.90	25,859,893	1,300.25	20,579,068	2.54
カナダ	株式	KINDER MORGAN CANADA LTD	エネルギー	12,416	1,428.37	17,734,749	1,637.68	20,333,479	2.51
イタリア	株式	EI TOWERS SPA	電気通信サービス	3,126	6,770.10	21,163,363	6,242.36	19,513,630	2.41
アメリカ	株式	GREAT PLAINS ENERGY INC	公益事業	5,800	3,178.18	18,433,495	3,143.79	18,234,003	2.25
アメリカ	株式	GRUPO AEROPORTUARIO CEN-ADR	運輸	4,300	4,329.80	18,618,182	4,230.37	18,190,625	2.25
イギリス	株式	SEVERN TRENT PLC	公益事業	6,932	3,308.42	22,933,995	2,623.24	18,184,331	2.25
フランス	株式	GETLINK SE	運輸	12,379	1,159.20	14,349,766	1,399.44	17,323,727	2.14
アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTL CORP		1,400	9,816.83	13,743,574	11,849.35	16,589,094	2.05
オーストラリア	株式	MACQUARIE ATLAS ROADS GROUP	運輸	33,165	406.79	13,491,202	455.11	15,093,736	1.86
スイス	株式	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	運輸	571	24,311.99	13,882,151	26,016.95	14,855,681	1.83
香港	株式	GUANGDONG INVESTMENT LTD	公益事業	88,000	150.80	13,271,279	167.53	14,743,185	1.82
イギリス	株式	NATIONAL GRID PLC	公益事業	12,175	1,458.69	17,759,553	1,129.15	13,747,423	1.70
アメリカ	株式	P G & E CORP	公益事業	3,100	6,939.29	21,511,821	4,319.49	13,390,435	1.65
スペイン	株式	FERROVIAL SA	資本財	5,640	2,390.40	13,481,879	2,361.07	13,316,439	1.64
アメリカ	株式	EDISON INTERNATIONAL	公益事業	1,900	8,419.95	15,997,916	6,533.46	12,413,583	1.53
イギリス	株式	UNITED UTILITIES GROUP PLC	公益事業	12,034	1,471.16	17,704,042	1,017.35	12,242,863	1.51
イタリア	株式	ENAV SPA	運輸	21,630	452.91	9,796,573	543.76	11,761,567	1.45
アメリカ	株式	AMERICAN WATER WORKS CO INC	公益事業	1,300	8,190.18	10,647,239	8,585.30	11,160,897	1.38

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成30年 2月28日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	34.82

	資本財	2.72
	運輸	13.52
	メディア	2.68
	電気通信サービス	5.20
	公益事業	28.57
	小計	87.51
投資証券		10.40
合計		97.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

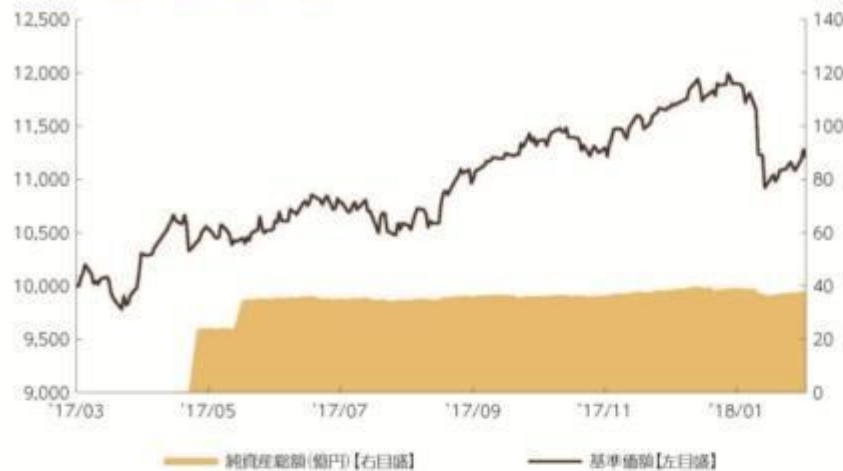
参考情報



運用実績

2018年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2017年3月27日(設定日)～2018年2月28日



- 基準価額は10,000を起点として表示
- 基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	11,213円
純資産総額	37.8億円

■分配の推移

2018年2月	0円
設定来累計	0円

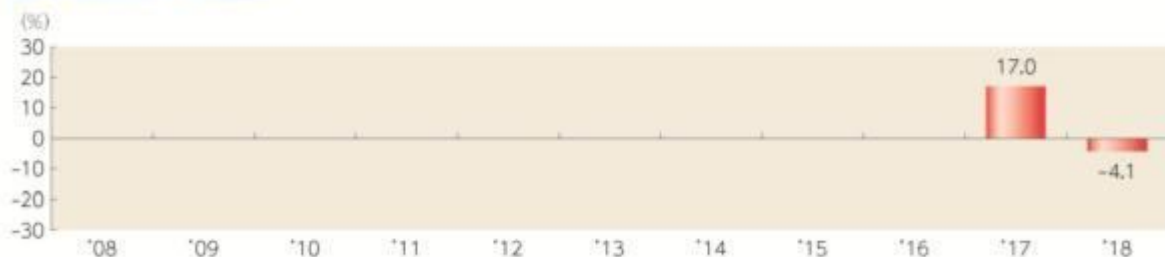
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

組入上位銘柄	比率
1 外国株式インデックスマザーファンド	59.7%
2 好配当海外株マザーファンド	29.3%
3 AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド	4.8%
4 アセアン真成長株式マザーファンド	2.0%
5 新興国株式インデックスマザーファンド	1.9%

•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)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額で計算
- 2017年は設定日から年末までの、2018年は年年初から2月28日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
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。

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

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

販売会社が定める単位

申込価額

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額

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いただけます。

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/>

申込手数料

ありません。

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、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得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日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

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、その他やむを得ない事情（投資対象証券の取得の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得の申込みの受付を中止することがあります。

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

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日の前営業日

ニューヨークの銀行の休業日の前営業日

ロンドン証券取引所の休業日の前営業日

ロンドンの銀行の休業日の前営業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

解約単位

販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌々営業日の基準価額

信託財産留保額

ありません。

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/>

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7営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

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、その他やむを得ない事情（投資対象証券の換金の制限、投資対象国・地域における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

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、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「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/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

平成39年2月5日まで（平成29年3月27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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

毎年2月6日から翌年2月5日まで
ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。
なお、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10億口を下回ることとなった場合
- ・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・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

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、これを行行使うことができます。なお、受益者が議決権を行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使う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。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

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「投資信託受益権の取扱いに関する契約」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

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

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。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

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受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

（2）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（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 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、平成29年3月27日から平成30年2月5日までとしております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成29年3月27日から平成30年2月5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】

【海外株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

第1期	
[平成30年 2月 5日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	109,524,749
親投資信託受益証券	3,759,593,707
流動資産合計	3,869,118,456
資産合計	3,869,118,456
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,625,110
未払受託者報酬	583,360
未払委託者報酬	7,437,815
未払利息	167
その他未払費用	45,166
流動負債合計	15,691,618
負債合計	15,691,618
純資産の部	
元本等	
元本	3,306,164,003
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	547,262,835
（分配準備積立金）	366,913,565
元本等合計	3,853,426,838
純資産合計	3,853,426,838
負債純資産合計	3,869,118,456

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5日
営業収益	
受取利息	550
有価証券売買等損益	437,633,707
営業収益合計	437,634,257
営業費用	
支払利息	40,550
受託者報酬	1,088,922
委託者報酬	13,883,565
その他費用	84,274
営業費用合計	15,097,311
営業利益又は営業損失（ ）	422,536,946
経常利益又は経常損失（ ）	422,536,946
当期純利益又は当期純損失（ ）	422,536,946
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（ ）	55,623,381
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	211,526,999
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	211,526,999
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,177,729
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,177,729
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	547,262,835

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 [平成30年 2月 5日現在]
1. 期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	4,047,047,119円
期中一部解約元本額	750,883,116円
2. 受益権の総数	3,306,164,003口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5日		
1. 運用に係る権限を委託するための費用		
「AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド」の信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産に属する同親投資信託の信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。		
2. 分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	59,179,718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	307,733,847円
収益調整金額	C	180,349,270円
分配準備積立金額	D	円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	547,262,835円
当ファンドの期末残存口数	F	3,306,164,003口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,655円
1万口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	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1期 自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。
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。
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [平成30年 2月 5日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 [平成30年 2月 5日現在]
	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	412,129,398
合計	412,129,398

（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。

（1口当たり情報）

	第1期 [平成30年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.1655円
(1万口当たり純資産額)	(11,655円)

（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	好配当海外株マザーファンド	801,223,127	1,141,983,322	
	新興国株式インデックスマザーファンド	27,153,951	75,523,283	
	アセアン真成長株式マザーファンド	60,223,696	75,628,917	
	A M P グローバル・インフラ株式マザーファンド	162,914,745	189,665,346	
	外国株式インデックスマザーファンド	838,319,835	2,276,792,839	
合計		1,889,835,354	3,759,593,707	

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。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	2,234,328,011
コール・ローン	717,169,917
株式	384,400,012,617
投資証券	8,917,544,044
派生商品評価勘定	29,128,226
未収入金	6,224,634,298
未収配当金	261,632,365
差入委託証拠金	3,246,889,772
流動資産合計	406,031,339,250
資産合計	406,031,339,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	104,199,393
未払解約金	497,446,681
未払利息	1,095
流動負債合計	601,647,169
負債合計	601,647,169
純資産の部	
元本等	
元本	149,281,071,434
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	256,148,620,647
元本等合計	405,429,692,081
純資産合計	405,429,692,081
負債純資産合計	406,031,339,250

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。 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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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30年 2月 5日現在]
1. 期首	平成29年 3月27日
期首元本額	147,345,278,651円
期中追加設定元本額	96,954,517,179円
期中一部解約元本額	95,018,724,396円
元本の内訳	
ファンド・マネジャー(海外株式)	10,382,008,400円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,470,082,909円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,179,578,644円
eMAXIS バランス(波乗り型)	146,624,945円
コアバランス	343,222円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	6,488,868円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	9,491,075円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	8,082,157円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	1,804,500,259円
海外株式セレクション(ラップ向け)	838,319,835円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	399,443,835円
つみたて先進国株式	75,466,306円
つみたて8資産均等バランス	10,795,659円
つみたて4資産均等バランス	3,078,686円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	822,736円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,107,414円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,379,567円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	514,518円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	740,609円

[平成30年 2月 5日現在]

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	853,832円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	9,610,367,208円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,507,072,843円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式抑制型)	2,170,403,033円
三菱UFJ バランス・イノベーション(株式重視型)	4,163,678,085円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	619,224,537円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション(KAKUSHIN)	191,549,056円
三菱UFJ バランス・イノベーション(債券重視型)	853,883,382円
eMAXIS バランス(4資産均等型)	67,930,880円
eMAXIS 最適化バランス(マイゴールキーパー)	17,734,466円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	28,288,379円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	106,882,425円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	85,118,704円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	251,093,436円
三菱UFJ バランスファンド45VA(適格機関投資家限定)	48,820,151円
三菱UFJ バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,536,826,192円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型(適格機関投資家限定)	194,503,409円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型(適格機関投資家限定)	1,998,128,557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)	58,454,633,079円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型(適格機関投資家限定)	181,730,596円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型(適格機関投資家限定)	69,310,971円
三菱UFJ バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,491,759,985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)	3,056,235,992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)	7,131,697,037円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	38,467,093円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	206,106,788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)	2,176,929,646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)	820,515,984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)	124,851,510円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	21,029,291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)	3,547,775,518円
MUKAMバランス・イノベーション(債券重視型)(適格機関投資家転売制限付)	404,901円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,339,986,863円

	[平成30年 2月 5日現在]
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	2,381,193円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	8,967,925円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	11,907,983円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,219,626円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	73,231,848円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	19,300,912円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	130,555,230円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	23,932,578円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	188,283,793円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	4,362,995,736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）	162,341,725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）	650,060,860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）	625,155,523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）	556,073,029円
合計	149,281,071,434円
2. 受益権の総数	149,281,071,434口

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29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>当ファンドは、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> <p>また、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>

区分	自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5日
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月 5日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 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。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	33,928,963,194
投資証券	206,560,415
合計	33,722,402,779

(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

[平成30年 2月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,675,012,918		9,599,626,151	75,386,767
	合計	9,675,012,918		9,599,626,151	75,386,767

（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

[平成30年 2月 5日現在]

区分	種類	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	98,486,100		98,901,000	414,900
	カナダドル	8,922,600		8,848,000	74,600
	イギリスポンド	15,611,300		15,514,000	97,300
	ユーロ	34,217,250		34,195,000	22,250
	売建				
	アメリカドル	1,505,424,500		1,505,356,000	68,500
	カナダドル	88,479,000		88,480,000	1,000
	オーストラリアドル	60,918,900		60,914,000	4,900
	イギリスポンド	170,654,550		170,654,000	550
	スイスフラン	70,818,600		70,818,000	600
	香港ドル	35,125,000		35,100,000	25,000
	シンガポールドル	16,648,200		16,648,000	200
	スウェーデンクローネ	20,818,500		20,820,000	1,500
	ユーロ	328,269,600		328,272,000	2,400
	合計	2,454,394,100		2,454,520,000	315,600

（注）時価の算定方法

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

（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 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。

（1口当たり情報）

		[平成30年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額		2.7159円
(1万口当たり純資産額)		(27,159円)

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	ANADARKO PETROLEUM CORP	52,812	59.11	3,121,717.32	
	ANDEAVOR	13,636	103.53	1,411,735.08	
	ANTERO RESOURCES CORP	19,804	18.68	369,938.72	
	APACHE CORP	36,500	42.82	1,562,930.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	38,944	31.05	1,209,211.20	
	CABOT OIL & GAS CORP	45,728	25.19	1,151,888.32	
	CHENIERE ENERGY INC	18,614	56.01	1,042,570.14	
	CHEVRON CORP	178,619	118.58	21,180,641.02	
	CIMAREX ENERGY CO	8,760	110.95	971,922.00	
	CONCHO RESOURCES INC	14,089	154.53	2,177,173.17	
	CONOCOPHILLIPS	114,816	57.72	6,627,179.52	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	8,468	53.74	455,070.32	
	DEVON ENERGY CORP	47,665	40.03	1,908,029.95	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,803	122.46	1,078,015.38	
	EOG RESOURCES INC	54,468	112.83	6,145,624.44	
	EQT CORP	24,122	51.91	1,252,173.02	
	EXXON MOBIL CORP	399,535	84.53	33,772,693.55	
	HALLIBURTON CO	82,052	52.19	4,282,293.88	

HELMERICH & PAYNE	9,896	70.11	693,808.56
HESS CORP	28,040	47.79	1,340,031.60
HOLLYFRONTIER CORP	15,538	46.40	720,963.20
KINDER MORGAN INC	189,391	17.50	3,314,342.50
MARATHON OIL CORP	77,621	17.52	1,359,919.92
MARATHON PETROLEUM CORP	48,617	67.41	3,277,271.97
NATIONAL OILWELL VARCO INC	36,990	35.69	1,320,173.10
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,967	30.36	545,478.12
NOBLE ENERGY INC	45,693	29.20	1,334,235.60
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	71,829	73.58	5,285,177.82
ONEOK INC	35,928	57.75	2,074,842.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,264	23.13	468,706.32
PHILLIPS 66	40,597	97.01	3,938,314.97
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,013	178.74	2,862,163.62
RANGE RESOURCES CORP	22,261	13.55	301,636.55
SCHLUMBERGER LTD	130,700	73.69	9,631,283.00
TARGA RESOURCES CORP	21,552	47.14	1,015,961.28
TECHNIPFMC PLC	43,400	32.68	1,418,312.00
VALERO ENERGY CORP	41,542	93.19	3,871,298.98
WILLIAMS COS INC	77,604	30.70	2,382,442.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,786	162.84	3,384,792.24
ALBEMARLE CORP	10,689	105.51	1,127,796.39
AVERY DENNISON CORP	7,989	117.63	939,746.07
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	19,420	30.84	598,912.80
BALL CORP	32,398	37.46	1,213,629.08
CELANESE CORP-SERIES A	13,482	105.09	1,416,823.38
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	21,358	39.91	852,397.78
CHEMOURS CO/THE	17,751	49.22	873,704.22
CROWN HOLDINGS INC	12,342	56.88	702,012.96
DOWDUPONT INC	219,630	70.89	15,569,570.70
EASTMAN CHEMICAL CO	14,237	99.27	1,413,306.99
ECOLAB INC	24,982	137.06	3,424,032.92
FMC CORP	13,104	85.72	1,123,274.88
FREEMPORT-MCMORAN INC	130,593	17.97	2,346,756.21
INTERNATIONAL PAPER CO	36,963	62.17	2,297,989.71
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,764	146.13	1,134,553.32
LYONDELLBASELL INDU-CL A	31,668	112.17	3,552,199.56
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,101	217.29	1,325,686.29
MONSANTO CO	41,163	121.00	4,980,723.00
MOSAIC CO/THE	30,291	26.04	788,777.64
NEWMONT MINING CORP	50,566	38.97	1,970,557.02
NUCOR CORP	30,361	64.24	1,950,390.64

PACKAGING CORP OF AMERICA	9,301	123.10	1,144,953.10
PPG INDUSTRIES INC	23,971	115.61	2,771,287.31
PRAXAIR INC	26,701	155.05	4,139,990.05
SEALED AIR CORP	17,712	46.22	818,648.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,997	403.13	3,223,830.61
STEEL DYNAMICS INC	22,089	44.15	975,229.35
VULCAN MATERIALS CO	12,700	131.00	1,663,700.00
WESTROCK CO	24,233	67.24	1,629,426.92
WR GRACE & CO	6,231	72.03	448,818.93
3M CO	56,230	245.17	13,785,909.10
ACUITY BRANDS INC	3,902	149.95	585,104.90
AERCAP HOLDINGS NV	13,000	53.04	689,520.00
AGCO CORP	5,701	73.12	416,857.12
ALLEGION PLC	8,500	81.85	695,725.00
AMETEK INC	22,138	77.25	1,710,160.50
ARCONIC INC	35,919	29.11	1,045,602.09
BOEING CO/THE	52,916	348.91	18,462,921.56
CATERPILLAR INC	55,667	157.49	8,766,995.83
CUMMINS INC	14,902	184.31	2,746,587.62
DEERE & CO	25,664	164.96	4,233,533.44
DOVER CORP	15,055	103.22	1,553,977.10
EATON CORP PLC	42,673	85.09	3,631,045.57
EMERSON ELECTRIC CO	59,837	70.57	4,222,697.09
FASTENAL CO	28,253	53.56	1,513,230.68
FLOWSERVE CORP	11,755	44.57	523,920.35
FLUOR CORP	12,821	58.79	753,746.59
FORTIVE CORP	29,437	75.35	2,218,077.95
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15,300	64.90	992,970.00
GENERAL DYNAMICS CORP	23,961	221.72	5,312,632.92
GENERAL ELECTRIC CO	816,839	15.64	12,775,361.96
HARRIS CORP	11,068	155.90	1,725,501.20
HD SUPPLY HOLDINGS INC	18,421	36.86	678,998.06
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	68,085	156.65	10,665,515.25
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,129	243.77	1,006,526.33
IDEX CORP	7,629	142.13	1,084,309.77
ILLINOIS TOOL WORKS	29,044	170.38	4,948,516.72
INGERSOLL-RAND PLC	23,964	95.24	2,282,331.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,860	67.12	728,923.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,400	64.92	1,324,368.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	22,000	39.99	879,780.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	89,081	39.53	3,521,371.93
L3 TECHNOLOGIES INC	7,503	210.50	1,579,381.50

LENNOX INTERNATIONAL INC	3,479	209.96	730,450.84
LOCKHEED MARTIN CORP	24,453	352.66	8,623,594.98
MASCO CORP	31,472	42.90	1,350,148.80
MIDDLEBY CORP	5,188	132.76	688,758.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,511	336.79	5,223,949.69
OWENS CORNING	10,752	88.88	955,637.76
PACCAR INC	32,993	72.60	2,395,291.80
PARKER HANNIFIN CORP	12,534	190.64	2,389,481.76
PENTAIR PLC	15,747	71.24	1,121,816.28
RAYTHEON COMPANY	27,252	206.80	5,635,713.60
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,165	194.02	2,360,253.30
ROCKWELL COLLINS INC	15,308	137.68	2,107,605.44
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,598	285.20	2,737,349.60
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	15,500	54.90	850,950.00
SMITH (A.O.) CORP	14,799	64.64	956,607.36
SNAP-ON INC	5,257	167.89	882,597.73
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	11,403	93.87	1,070,399.61
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,397	163.84	2,358,804.48
TEXTRON INC	25,896	59.06	1,529,417.76
TRANSDIGM GROUP INC	5,056	307.28	1,553,607.68
UNITED RENTALS INC	7,700	173.30	1,334,410.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	71,579	134.61	9,635,249.19
WABCO HOLDINGS INC	4,624	151.46	700,351.04
WABTEC CORP	7,807	73.40	573,033.80
WW GRAINGER INC	5,043	259.69	1,309,616.67
XYLEM INC	16,428	75.66	1,242,942.48
CINTAS CORP	8,754	161.82	1,416,572.28
EQUIFAX INC	10,978	121.49	1,333,717.22
IHS MARKIT LTD	38,549	47.02	1,812,573.98
MANPOWERGROUP INC	6,038	122.50	739,655.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	34,576	37.49	1,296,254.24
REPUBLIC SERVICES INC	22,704	68.24	1,549,320.96
ROBERT HALF INTL INC	11,431	56.24	642,879.44
ROLLINS INC	8,805	48.20	424,401.00
STERICYCLE INC	7,624	73.38	559,449.12
TRANSUNION	14,919	57.47	857,394.93
VERISK ANALYTICS INC	15,321	98.83	1,514,174.43
WASTE CONNECTIONS INC	25,082	70.31	1,763,515.42
WASTE MANAGEMENT INC	40,965	86.53	3,544,701.45
AMERCO	625	359.60	224,750.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	11,503	52.10	599,306.30
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,789	91.79	1,173,902.31

CSX CORP	85,890	55.25	4,745,422.50
DELTA AIR LINES INC	18,823	54.62	1,028,112.26
EXPEDITORS INTL WASH INC	16,559	63.61	1,053,317.99
FEDEX CORP	24,014	255.87	6,144,462.18
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,950	118.17	939,451.50
KANSAS CITY SOUTHERN	10,450	110.15	1,151,067.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,001	48.12	577,488.12
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	7,087	64.58	457,678.46
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,912	145.03	3,903,047.36
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,961	145.09	864,881.49
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,078	58.71	826,519.38
UNION PACIFIC CORP	75,406	129.36	9,754,520.16
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	7,192	65.68	472,370.56
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	64,944	116.47	7,564,027.68
APTIV PLC	24,916	94.21	2,347,336.36
AUTOLIV INC	7,938	144.61	1,147,914.18
BORGWARNER INC	21,049	54.47	1,146,539.03
FORD MOTOR CO	351,579	10.71	3,765,411.09
GENERAL MOTORS CO	123,283	41.00	5,054,603.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	25,606	34.35	879,566.10
HARLEY-DAVIDSON INC	15,803	47.50	750,642.50
LEAR CORP	6,217	186.11	1,157,045.87
TESLA INC	12,534	343.75	4,308,562.50
DR HORTON INC	34,701	46.37	1,609,085.37
GARMIN LTD	10,947	62.41	683,202.27
HANESBRANDS INC	37,085	20.99	778,414.15
HASBRO INC	11,161	94.12	1,050,473.32
LEGGETT & PLATT INC	11,889	45.05	535,599.45
LENNAR CORP-A	20,017	60.02	1,201,420.34
LULULEMON ATHLETICA INC	9,233	78.62	725,898.46
MATTEL INC	30,802	16.53	509,157.06
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,995	65.27	913,453.65
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,087	270.58	1,647,020.46
NEWELL BRANDS INC	44,511	27.98	1,245,417.78
NIKE INC -CL B	123,728	67.22	8,316,996.16
NVR INC	320	3,072.91	983,331.20
POLARIS INDUSTRIES INC	5,389	110.21	593,921.69
PULTEGROUP INC	25,803	30.70	792,152.10
PVH CORP	7,091	151.07	1,071,237.37
RALPH LAUREN CORP	4,951	109.80	543,619.80
TAPESTRY INC	27,688	45.96	1,272,540.48
TOLL BROTHERS INC	13,859	46.40	643,057.60

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	16,507	13.65	225,320.55
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17,041	12.41	211,478.81
VF CORP	32,144	79.89	2,567,984.16
WHIRLPOOL CORP	7,211	178.06	1,283,990.66
ARAMARK	24,355	45.30	1,103,281.50
CARNIVAL CORP	32,680	69.95	2,285,966.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,306	311.64	718,641.84
DARDEN RESTAURANTS INC	12,238	96.04	1,175,337.52
DOMINO'S PIZZA INC	4,822	214.38	1,033,740.36
H&R BLOCK INC	18,609	25.46	473,785.14
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,920	82.65	1,481,088.00
LAS VEGAS SANDS CORP	37,148	75.18	2,792,786.64
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	29,880	141.17	4,218,159.60
MCDONALD'S CORP	76,307	169.38	12,924,879.66
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	22,000	28.83	634,260.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,372	35.58	1,578,755.76
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	18,132	59.00	1,069,788.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,272	129.66	2,109,827.52
STARBUCKS CORP	136,172	55.77	7,594,312.44
VAIL RESORTS INC	3,609	217.98	786,689.82
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,373	121.54	1,139,194.42
WYNN RESORTS LTD	8,006	166.56	1,333,479.36
YUM! BRANDS INC	31,090	82.63	2,568,966.70
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	32,844	55.40	1,819,557.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18,224	387.50	7,061,800.00
COMCAST CORP-CLASS A	443,306	41.11	18,224,309.66
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15,325	23.81	364,888.25
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,335	22.80	440,838.00
DISH NETWORK CORP-A	22,311	46.79	1,043,931.69
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	40,052	21.29	852,707.08
LIBERTY BROADBAND-C	10,649	96.90	1,031,888.10
LIBERTY GLOBAL PLC- C	55,289	36.70	2,029,106.30
LIBERTY GLOBAL PLC-A	18,678	38.49	718,916.22
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,152	44.40	406,348.80
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	17,803	44.08	784,756.24
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	19,360	38.65	748,264.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,842	44.73	619,152.66
NEWS CORP - CLASS A	34,402	16.41	564,536.82
OMNICOM GROUP	22,390	74.91	1,677,234.90
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	7,663	87.95	673,960.85
SIRIUS XM HOLDINGS INC	146,504	6.11	895,139.44
TIME WARNER INC	73,307	96.75	7,092,452.25

TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	40,643	36.22	1,472,089.46
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	99,146	36.72	3,640,641.12
VIACOM INC-CLASS B	31,796	32.22	1,024,467.12
WALT DISNEY CO/THE	145,463	108.70	15,811,828.10
ADVANCE AUTO PARTS INC	6,772	113.93	771,533.96
AMAZON.COM INC	38,496	1,429.95	55,047,355.20
AUTONATION INC	5,912	57.23	338,343.76
AUTOZONE INC	2,706	750.58	2,031,069.48
BEST BUY CO INC	26,523	71.24	1,889,498.52
CARMAX INC	18,116	68.75	1,245,475.00
DOLLAR GENERAL CORP	25,888	99.44	2,574,302.72
DOLLAR TREE INC	22,466	108.83	2,444,974.78
EXPEDIA INC	11,842	126.64	1,499,670.88
GAP INC/THE	21,353	32.09	685,217.77
GENUINE PARTS CO	14,340	102.19	1,465,404.60
HOME DEPOT INC	111,129	193.97	21,555,692.13
KOHL'S CORP	15,351	63.47	974,327.97
L BRANDS INC	24,218	47.51	1,150,597.18
LIBERTY INTERACTIVE CORP Q-A	42,342	28.20	1,194,044.40
LKQ CORP	30,462	40.93	1,246,809.66
LOWE'S COS INC	78,953	101.50	8,013,729.50
MACY'S INC	26,986	24.89	671,681.54
NETFLIX INC	40,703	267.43	10,885,203.29
NORDSTROM INC	11,209	47.85	536,350.65
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,227	252.64	2,078,469.28
PRICELINE GROUP INC/THE	4,627	1,859.10	8,602,055.70
ROSS STORES INC	36,726	79.08	2,904,292.08
TARGET CORP	48,368	72.95	3,528,445.60
TIFFANY & CO	12,266	105.51	1,294,185.66
TJX COMPANIES INC	59,909	78.47	4,701,059.23
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,482	67.88	779,398.16
TRIPADVISOR INC	10,389	34.35	356,862.15
ULTA BEAUTY INC	5,712	219.47	1,253,612.64
COSTCO WHOLESALE CORP	41,373	190.99	7,901,829.27
CVS HEALTH CORP	95,909	76.45	7,332,243.05
KROGER CO	83,185	29.34	2,440,647.90
SYSCO CORP	47,529	61.18	2,907,824.22
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	85,805	73.56	6,311,815.80
WALMART INC	140,759	104.48	14,706,500.32
ALTRIA GROUP INC	180,826	69.40	12,549,324.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,057	41.43	2,198,151.51
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,918	67.00	1,267,506.00

BUNGE LTD	13,939	78.60	1,095,605.40
CAMPBELL SOUP CO	16,347	44.60	729,076.20
COCA-COLA CO/THE	381,878	46.73	17,845,158.94
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	20,900	38.30	800,470.00
CONAGRA BRANDS INC	38,284	36.71	1,405,405.64
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,333	215.89	3,526,131.37
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,569	118.71	2,085,615.99
GENERAL MILLS INC	55,081	55.95	3,081,781.95
HERSHEY CO/THE	13,877	102.97	1,428,914.69
HORMEL FOODS CORP	26,342	33.65	886,408.30
INGREDION INC	6,495	135.28	878,643.60
JM SMUCKER CO/THE	10,479	120.12	1,258,737.48
KELLOGG CO	25,074	65.45	1,641,093.30
KRAFT HEINZ CO/THE	56,983	77.19	4,398,517.77
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,127	103.56	1,152,312.12
MOLSON COORS BREWING CO -B	18,094	81.06	1,466,699.64
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	142,072	45.50	6,464,276.00
MONSTER BEVERAGE CORP	37,480	66.63	2,497,292.40
PEPSICO INC	134,343	118.67	15,942,483.81
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146,420	103.44	15,145,684.80
TYSON FOODS INC-CL A	27,357	74.49	2,037,822.93
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,223	46.33	1,122,251.59
CLOROX COMPANY	12,308	130.91	1,611,240.28
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,820	72.43	5,708,932.60
COTY INC-CL A	44,566	18.05	804,416.30
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20,999	134.39	2,822,055.61
KIMBERLY-CLARK CORP	33,218	116.21	3,860,263.78
PROCTER & GAMBLE CO/THE	240,174	84.25	20,234,659.50
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,399	113.34	271,902.66
ABBOTT LABORATORIES	163,585	61.69	10,091,558.65
AETNA INC	31,155	185.00	5,763,675.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,355	257.38	1,893,029.90
AMERISOURCEBERGEN CORP	15,913	96.02	1,527,966.26
ANTHEM INC	24,680	239.18	5,902,962.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	46,587	68.55	3,193,538.85
BECTON DICKINSON AND CO	24,855	237.11	5,893,369.05
BOSTON SCIENTIFIC CORP	130,664	27.39	3,578,886.96
CARDINAL HEALTH INC	29,696	67.46	2,003,292.16
CENTENE CORP	16,498	103.75	1,711,667.50
CERNER CORP	28,132	66.39	1,867,683.48
CIGNA CORP	23,556	204.46	4,816,259.76
COOPER COS INC/THE	4,777	241.32	1,152,785.64

DANAHER CORP	58,739	102.18	6,001,951.02
DAVITA INC	13,983	75.65	1,057,813.95
DENTSPLY SIRONA INC	22,208	60.06	1,333,812.48
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19,681	131.83	2,594,546.23
ENVISION HEALTHCARE CORP	12,987	35.00	454,545.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	54,690	76.50	4,183,785.00
HCA HEALTHCARE INC	27,700	99.69	2,761,413.00
HENRY SCHEIN INC	15,435	74.35	1,147,592.25
HOLOGIC INC	25,355	42.04	1,065,924.20
HUMANA INC	13,766	276.50	3,806,299.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,530	186.36	1,589,650.80
INTUITIVE SURGICAL INC	10,469	416.96	4,365,154.24
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,835	169.66	1,668,606.10
MCKESSON CORP	19,508	159.21	3,105,868.68
MEDTRONIC PLC	127,956	84.45	10,805,884.20
QUEST DIAGNOSTICS INC	13,303	103.11	1,371,672.33
RESMED INC	13,930	96.97	1,350,792.10
STRYKER CORP	31,528	162.25	5,115,418.00
TELEFLEX INC	4,431	272.36	1,206,827.16
UNITEDHEALTH GROUP INC	91,046	231.88	21,111,746.48
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8,008	119.30	955,354.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,332	124.86	1,040,333.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,740	60.04	584,789.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,938	125.79	2,382,211.02
ABBVIE INC	150,282	115.17	17,307,977.94
AGILENT TECHNOLOGIES INC	30,469	71.25	2,170,916.25
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,817	116.15	2,417,894.55
ALKERMES PLC	13,785	63.42	874,244.70
ALLERGAN PLC	31,451	172.51	5,425,612.01
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,488	124.50	1,056,756.00
AMGEN INC	68,818	187.01	12,869,654.18
BIOGEN INC	19,934	343.83	6,853,907.22
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,748	90.82	1,521,053.36
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	154,574	63.48	9,812,357.52
CELGENE CORP	73,799	99.80	7,365,140.20
ELI LILLY & CO	93,367	81.18	7,579,533.06
GILEAD SCIENCES INC	123,205	81.73	10,069,544.65
ILLUMINA INC	13,942	220.18	3,069,749.56
INCYTE CORP	16,393	85.92	1,408,486.56
IQVIA HOLDINGS INC	13,636	100.54	1,370,963.44
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,095	143.83	876,643.85
JOHNSON & JOHNSON	252,913	137.68	34,821,061.84

MERCK & CO. INC.	257,092	58.56	15,055,307.52
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,475	667.16	1,651,221.00
MYLAN NV	44,026	42.10	1,853,494.60
PERRIGO CO PLC	11,620	90.40	1,050,448.00
PFIZER INC	560,190	36.61	20,508,555.90
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,293	347.86	2,536,942.98
SEATTLE GENETICS INC	9,002	55.90	503,211.80
TESARO INC	3,392	59.94	203,316.48
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	87,900	20.57	1,808,103.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,717	217.69	8,210,613.73
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,067	133.31	542,171.77
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23,790	166.24	3,954,849.60
WATERS CORP	7,706	212.49	1,637,447.94
ZOETIS INC	45,464	76.78	3,490,725.92
BANK OF AMERICA CORP	944,370	31.95	30,172,621.50
BB&T CORP	75,385	55.11	4,154,467.35
CIT GROUP INC	12,949	50.62	655,478.38
CITIGROUP INC	256,644	77.02	19,766,720.88
CITIZENS FINANCIAL GROUP	48,274	46.02	2,221,569.48
COMERICA INC	16,106	94.96	1,529,425.76
EAST WEST BANCORP INC	14,565	65.80	958,377.00
FIFTH THIRD BANCORP	71,088	33.13	2,355,145.44
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,134	90.27	1,366,146.18
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,019	16.08	1,688,705.52
JPMORGAN CHASE & CO	331,533	114.28	37,887,591.24
KEYCORP	103,966	21.76	2,262,300.16
M & T BANK CORP	13,078	189.20	2,474,357.60
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	44,196	13.92	615,208.32
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	30,850	19.63	605,585.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45,105	157.97	7,125,236.85
REGIONS FINANCIAL CORP	114,690	19.25	2,207,782.50
SIGNATURE BANK	4,963	157.79	783,111.77
SUNTRUST BANKS INC	45,043	69.48	3,129,587.64
SVB FINANCIAL GROUP	4,801	249.10	1,195,929.10
US BANCORP	157,540	56.90	8,964,026.00
WELLS FARGO & CO	444,418	64.07	28,473,861.26
ZIONS BANCORPORATION	18,191	54.15	985,042.65
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,056	197.11	996,588.16
ALLY FINANCIAL INC	41,530	28.89	1,199,801.70
AMERICAN EXPRESS CO	70,724	96.68	6,837,596.32
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,416	167.50	2,414,680.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	97,198	56.33	5,475,163.34

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	119,329	209.12	24,954,080.48
BLACKROCK INC	11,352	548.32	6,224,528.64
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,866	101.57	4,658,609.62
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,933	134.65	1,337,478.45
CME GROUP INC	31,730	159.11	5,048,560.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	34,547	78.97	2,728,176.59
E*TRADE FINANCIAL CORP	27,003	52.57	1,419,547.71
EATON VANCE CORP	10,253	57.05	584,933.65
FRANKLIN RESOURCES INC	32,456	40.88	1,326,801.28
GOLDMAN SACHS GROUP INC	34,635	260.04	9,006,485.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	54,870	73.98	4,059,282.60
INVESCO LTD	39,530	35.16	1,389,874.80
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,367	26.29	772,058.43
MOODY'S CORP	16,237	158.61	2,575,350.57
MORGAN STANLEY	129,743	55.48	7,198,141.64
MSCI INC	8,228	142.53	1,172,736.84
NASDAQ INC	11,759	80.34	944,718.06
NORTHERN TRUST CORP	20,688	104.63	2,164,585.44
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,884	94.33	1,121,017.72
S&P GLOBAL INC	24,456	177.33	4,336,782.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	113,413	53.34	6,049,449.42
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,209	74.26	906,640.34
STATE STREET CORP	34,834	107.47	3,743,609.98
SYNCHRONY FINANCIAL	73,756	38.68	2,852,882.08
T ROWE PRICE GROUP INC	22,934	109.89	2,520,217.26
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,728	56.28	1,335,411.84
VOYA FINANCIAL INC	16,758	51.34	860,355.72
AFLAC INC	36,541	88.95	3,250,321.95
ALLEGHANY CORP	1,557	617.96	962,163.72
ALLSTATE CORP	33,500	97.94	3,280,990.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,662	116.09	773,391.58
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	84,990	63.04	5,357,769.60
AON PLC	24,906	143.59	3,576,252.54
ARCH CAPITAL GROUP LTD	12,667	90.95	1,152,063.65
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,725	68.57	1,215,403.25
ASSURANT INC	4,931	91.95	453,405.45
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	9,500	50.35	478,325.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,548	50.17	378,683.16
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	7,882	62.15	489,866.30
CHUBB LTD	43,775	153.25	6,708,518.75
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,317	76.38	1,169,912.46
EVEREST RE GROUP LTD	4,105	229.61	942,549.05

FNF GROUP	23,522	37.92	891,954.24
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,804	58.01	2,018,980.04
LINCOLN NATIONAL CORP	21,512	83.04	1,786,356.48
LOEWS CORP	27,819	50.82	1,413,761.58
MARKEL CORP	1,349	1,117.37	1,507,332.13
MARSH & MCLENNAN COS	47,830	84.69	4,050,722.70
METLIFE INC	84,656	47.56	4,026,239.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	27,470	66.35	1,822,634.50
PROGRESSIVE CORP	54,232	53.24	2,887,311.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,985	117.33	4,691,440.05
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,825	155.47	905,612.75
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,620	129.90	470,238.00
TORCHMARK CORP	10,035	88.21	885,187.35
TRAVELERS COS INC/THE	25,841	147.95	3,823,175.95
UNUM GROUP	20,487	52.71	1,079,869.77
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,175	161.66	1,968,210.50
WR BERKLEY CORP	8,757	73.31	641,975.67
XL GROUP LTD	25,881	38.25	989,948.25
CBRE GROUP INC - A	27,555	44.11	1,215,451.05
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	120,000	7.21	865,200.00
JONES LANG LASALLE INC	4,112	151.67	623,667.04
SBA COMMUNICATIONS CORP	11,539	173.21	1,998,670.19
ACCENTURE PLC-CL A	58,112	156.90	9,117,772.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	67,231	71.42	4,801,638.02
ADOBE SYSTEMS INC	46,443	195.64	9,086,108.52
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,682	65.72	1,030,621.04
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,567	249.91	1,141,338.97
ALPHABET INC-CL A	28,097	1,119.20	31,446,162.40
ALPHABET INC-CL C	29,514	1,111.90	32,816,616.60
ANSYS INC	7,791	160.29	1,248,819.39
AUTODESK INC	18,741	111.64	2,092,245.24
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,700	118.57	4,944,369.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,637	94.77	1,008,068.49
CA INC	28,681	34.97	1,002,974.57
CADENCE DESIGN SYS INC	27,647	41.10	1,136,291.70
CDK GLOBAL INC	12,166	68.50	833,371.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12,600	101.38	1,277,388.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,817	92.19	1,365,979.23
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	56,090	75.72	4,247,134.80
COSTAR GROUP INC	3,312	343.40	1,137,340.80
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	19,553	70.90	1,386,307.70
DXC TECHNOLOGY CO	26,616	98.89	2,632,056.24

EBAY INC	94,769	44.30	4,198,266.70
ELECTRONIC ARTS INC	28,717	124.53	3,576,128.01
FACEBOOK INC-A	223,449	190.28	42,517,875.72
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	31,452	100.81	3,170,676.12
FIRST DATA CORP- CLASS A	45,138	17.15	774,116.70
FISERV INC	19,871	137.55	2,733,256.05
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,937	207.51	1,854,516.87
FORTINET INC	13,493	44.94	606,375.42
GARTNER INC	8,949	135.19	1,209,815.31
GLOBAL PAYMENTS INC	14,718	108.72	1,600,140.96
IAC/INTERACTIVECORP	7,087	144.48	1,023,929.76
INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,399	159.03	13,262,942.97
INTUIT INC	22,642	163.42	3,700,155.64
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,253	122.96	891,828.88
LEIDOS HOLDINGS INC	12,953	66.23	857,877.19
MASTERCARD INC - A	88,829	170.55	15,149,785.95
MERCADOLIBRE INC	3,867	368.39	1,424,564.13
MICROSOFT CORP	689,530	91.78	63,285,063.40
ORACLE CORP	292,072	50.13	14,641,569.36
PAYCHEX INC	30,673	66.60	2,042,821.80
PAYPAL HOLDINGS INC	107,507	76.57	8,231,810.99
RED HAT INC	16,940	128.01	2,168,489.40
SABRE CORP	18,948	20.19	382,560.12
SALESFORCE.COM INC	64,239	110.78	7,116,396.42
SERVICENOW INC	16,115	149.76	2,413,382.40
SPLUNK INC	12,712	91.23	1,159,715.76
SQUARE INC - A	24,040	43.61	1,048,384.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,633	48.94	765,079.02
SYMANTEC CORP	57,384	27.02	1,550,515.68
SYNOPSYS INC	14,659	90.16	1,321,655.44
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,072	121.67	1,225,460.24
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	15,161	86.83	1,316,429.63
TWITTER INC	57,741	25.92	1,496,646.72
VERISIGN INC	8,292	112.51	932,932.92
VISA INC-CLASS A SHARES	172,176	120.91	20,817,800.16
VMWARE INC-CLASS A	6,365	122.72	781,112.80
WESTERN UNION CO	42,386	20.28	859,588.08
WORKDAY INC-CLASS A	12,697	117.49	1,491,770.53
WORLDPAY INC-CLASS A	27,854	78.08	2,174,840.32
ZILLOW GROUP INC - C	9,384	44.16	414,397.44
AMPHENOL CORP-CL A	28,630	91.25	2,612,487.50
APPLE INC	486,925	160.50	78,151,462.50

ARISTA NETWORKS INC	4,616	273.48	1,262,383.68
ARROW ELECTRONICS INC	7,923	81.00	641,763.00
AVNET INC	11,219	41.48	465,364.12
CDW CORP/DE	14,140	75.92	1,073,508.80
CISCO SYSTEMS INC	470,381	40.93	19,252,694.33
COGNEX CORP	16,568	61.17	1,013,464.56
COMMSCOPE HOLDING CO INC	17,665	38.67	683,105.55
CORNING INC	86,051	31.28	2,691,675.28
F5 NETWORKS INC	5,809	144.13	837,251.17
FLEX LTD	53,538	17.78	951,905.64
FLIR SYSTEMS INC	12,291	49.94	613,812.54
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	154,385	16.65	2,570,510.25
HP INC	156,644	22.48	3,521,357.12
IPG PHOTONICS CORP	3,597	246.75	887,559.75
JUNIPER NETWORKS INC	37,836	26.26	993,573.36
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15,891	103.87	1,650,598.17
NETAPP INC	24,723	60.22	1,488,819.06
PALO ALTO NETWORKS INC	8,933	155.18	1,386,222.94
SEAGATE TECHNOLOGY	27,074	51.77	1,401,620.98
TE CONNECTIVITY LTD	32,860	102.18	3,357,634.80
TRIMBLE INC	25,293	43.24	1,093,669.32
WESTERN DIGITAL CORP	27,274	85.25	2,325,108.50
XEROX CORP	19,324	31.63	611,218.12
AT&T INC	578,758	38.07	22,033,317.06
CENTURYLINK INC	90,262	17.73	1,600,345.26
SPRINT CORP	71,605	5.36	383,802.80
T-MOBILE US INC	27,617	63.59	1,756,165.03
VERIZON COMMUNICATIONS INC	384,585	52.98	20,375,313.30
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,621	36.61	608,494.81
AES CORP	59,786	11.12	664,820.32
ALLIANT ENERGY CORP	23,188	38.91	902,245.08
AMEREN CORPORATION	23,630	54.89	1,297,050.70
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,249	67.75	3,201,119.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,357	81.22	1,409,735.54
ATMOS ENERGY CORP	10,791	81.50	879,466.50
CENTERPOINT ENERGY INC	40,546	27.55	1,117,042.30
CMS ENERGY CORP	27,601	43.48	1,200,091.48
CONSOLIDATED EDISON INC	28,753	77.96	2,241,583.88
DOMINION ENERGY INC	60,308	75.68	4,564,109.44
DTE ENERGY COMPANY	17,136	103.28	1,769,806.08
DUKE ENERGY CORP	65,643	76.53	5,023,658.79
EDISON INTERNATIONAL	30,291	61.60	1,865,925.60

ENERGY CORP	17,635	75.98	1,339,907.30	
EVERSOURCE ENERGY	30,287	59.35	1,797,533.45	
EXELON CORP	89,352	37.72	3,370,357.44	
FIRSTENERGY CORP	43,314	32.11	1,390,812.54	
NEXTERA ENERGY INC	44,171	155.92	6,887,142.32	
NISOURCE INC	33,979	23.97	814,476.63	
OGE ENERGY CORP	18,186	31.35	570,131.10	
P G & E CORP	48,947	41.44	2,028,363.68	
PINNACLE WEST CAPITAL	11,336	77.73	881,147.28	
PPL CORP	63,722	31.19	1,987,489.18	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,931	50.04	2,398,467.24	
SCANA CORP	12,154	39.17	476,072.18	
SEMPRA ENERGY	22,329	105.58	2,357,495.82	
SOUTHERN CO/THE	93,352	44.17	4,123,357.84	
UGI CORP	15,746	45.70	719,592.20	
VISTRA ENERGY CORP	24,359	19.15	466,474.85	
WEC ENERGY GROUP INC	30,060	62.01	1,864,020.60	
WESTAR ENERGY INC	13,089	49.95	653,795.55	
XCEL ENERGY INC	47,986	44.48	2,134,417.28	
ADVANCED MICRO DEVICES	79,972	12.45	995,651.40	
ANALOG DEVICES INC	34,957	89.11	3,115,018.27	
APPLIED MATERIALS INC	100,092	50.68	5,072,662.56	
BROADCOM LTD	38,247	235.48	9,006,403.56	
INTEL CORP	442,332	46.15	20,413,621.80	
KLA-TENCOR CORP	15,078	106.52	1,606,108.56	
LAM RESEARCH CORP	15,578	179.06	2,789,396.68	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	35,922	22.43	805,730.46	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	27,436	60.54	1,660,975.44	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,693	93.31	2,024,173.83	
MICRON TECHNOLOGY INC	99,501	40.82	4,061,630.82	
NVIDIA CORP	56,523	233.52	13,199,250.96	
NXP SEMICONDUCTORS NV	32,265	120.62	3,891,804.30	
QORVO INC	12,738	80.77	1,028,848.26	
QUALCOMM INC	138,969	66.07	9,181,681.83	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,545	98.96	1,736,253.20	
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,940	107.66	10,005,920.40	
XILINX INC	23,676	70.64	1,672,472.64	
	28,843,610		2,284,308,633.47	
			(251,045,518,818)	
アメリカドル 小計				
カナダドル				
ALTAGAS LTD	15,500	26.94	417,570.00	
ARC RESOURCES LTD	31,600	13.16	415,856.00	
CAMECO CORP	35,700	11.34	404,838.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	103,000	41.88	4,313,640.00
CENOVUS ENERGY INC	103,800	11.06	1,148,028.00
CRESCENT POINT ENERGY CORP	49,000	9.37	459,130.00
ENBRIDGE INC	154,900	43.11	6,677,739.00
ENCANA CORP	96,500	14.34	1,383,810.00
HUSKY ENERGY INC	31,878	17.39	554,358.42
IMPERIAL OIL LTD	29,900	37.12	1,109,888.00
INTER PIPELINE LTD	35,100	23.06	809,406.00
KEYERA CORP	20,700	33.60	695,520.00
PEMBINA PIPELINE CORP	48,232	40.79	1,967,383.28
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	19,188	30.27	580,820.76
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	22,100	16.70	369,070.00
SUNCOR ENERGY INC	156,600	43.81	6,860,646.00
TOURMALINE OIL CORP	20,400	19.58	399,432.00
TRANSCANADA CORP	81,500	55.11	4,491,465.00
VERMILION ENERGY INC	10,100	45.49	459,449.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,600	56.91	1,172,346.00
BARRICK GOLD CORP	110,400	17.04	1,881,216.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,600	56.27	821,542.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63,300	17.81	1,127,373.00
FRANCO-NEVADA CORP	17,400	92.23	1,604,802.00
GOLDCORP INC	85,100	17.02	1,448,402.00
KINROSS GOLD CORP	112,100	5.08	569,468.00
LUNDIN MINING CORP	62,100	8.50	527,850.00
METHANEX CORP	8,000	74.38	595,040.00
NUTRIEN LTD	62,059	62.14	3,856,346.26
TECK RESOURCES LTD-CLS B	55,600	35.19	1,956,564.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	90,900	3.66	332,694.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	85.09	519,049.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,000	26.24	1,023,360.00
BOMBARDIER INC-B	174,700	3.31	578,257.00
CAE INC	23,900	22.34	533,926.00
FINNING INTERNATIONAL INC	15,200	33.52	509,504.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,800	52.76	939,128.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,800	97.48	6,901,584.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,800	222.73	3,073,674.00
LINAMAR CORP	4,400	69.71	306,724.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,600	67.60	2,203,760.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,100	40.52	814,452.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,610	73.34	1,584,877.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,100	26.22	1,103,862.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	165.68	977,512.00

DOLLARAMA INC	9,800	165.10	1,617,980.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	39,900	62.03	2,474,997.00
EMPIRE CO LTD 'A'	15,600	23.31	363,636.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	7,300	24.13	176,149.00
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	65.02	1,397,930.00
METRO INC	23,400	40.00	936,000.00
WESTON (GEORGE) LTD	4,600	105.17	483,782.00
SAPUTO INC	21,800	41.29	900,122.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	29,800	22.44	668,712.00
BANK OF MONTREAL	61,000	100.21	6,112,810.00
BANK OF NOVA SCOTIA	112,700	80.01	9,017,127.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,000	119.00	4,879,000.00
NATIONAL BANK OF CANADA	32,500	62.86	2,042,950.00
ROYAL BANK OF CANADA	137,200	103.55	14,207,060.00
TORONTO-DOMINION BANK	173,400	73.94	12,821,196.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	79,200	49.78	3,942,576.00
CI FINANCIAL CORP	23,700	28.91	685,167.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	35,200	8.13	286,176.00
IGM FINANCIAL INC	7,700	42.80	329,560.00
ONEX CORPORATION	7,500	88.70	665,250.00
THOMSON REUTERS CORP	27,900	52.59	1,467,261.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,700	639.75	1,727,325.00
GREAT-WEST LIFECO INC	30,400	34.63	1,052,752.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	9,500	58.10	551,950.00
INTACT FINANCIAL CORP	12,900	102.10	1,317,090.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	186,200	25.27	4,705,274.00
POWER CORP OF CANADA	35,800	30.91	1,106,578.00
POWER FINANCIAL CORP	22,700	33.37	757,499.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,700	52.87	3,050,599.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	13,800	20.02	276,276.00
BLACKBERRY LTD	46,000	15.44	710,240.00
CGI GROUP INC - CLASS A	20,800	71.30	1,483,040.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,000	796.28	1,592,560.00
OPEN TEXT CORP	26,700	45.32	1,210,044.00
SHOPIFY INC - CLASS A	8,000	155.45	1,243,600.00
BCE INC	13,500	56.37	760,995.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	34,400	59.06	2,031,664.00
TELUS CORP	11,600	45.56	528,496.00
ATCO LTD -CLASS I	7,200	43.42	312,624.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	11,800	35.94	424,092.00
EMERA INC	5,400	44.03	237,762.00
FORTIS INC	40,400	42.55	1,719,020.00

	HYDRO ONE LTD	33,200	21.69	720,108.00
	カナダドル 小計	3,801,267		163,476,391.12 (14,466,025,850)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	24,027	35.79	859,926.33
	OIL SEARCH LTD	125,885	7.87	990,714.95
	ORIGIN ENERGY LTD	174,771	9.60	1,677,801.60
	SANTOS LTD	171,653	5.37	921,776.61
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,845	34.24	2,733,892.80
	ALUMINA LTD	220,517	2.39	527,035.63
	AMCOR LIMITED	112,709	14.52	1,636,534.68
	BHP BILLITON LIMITED	308,042	30.81	9,490,774.02
	BLUESCOPE STEEL LTD	51,047	14.90	760,600.30
	BORAL LTD	124,498	8.13	1,012,168.74
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	140,882	4.99	703,001.18
	INCITEC PIVOT LTD	153,458	3.73	572,398.34
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	40,661	23.65	961,632.65
	NEWCREST MINING LTD	74,529	23.07	1,719,384.03
	ORICA LTD	34,168	19.19	655,683.92
	RIO TINTO LTD	40,136	78.25	3,140,642.00
	SOUTH32 LTD	511,684	3.83	1,959,749.72
	CIMIC GROUP LTD	8,873	48.50	430,340.50
	BRAMBLES LTD	157,555	9.98	1,572,398.90
	SEEK LTD	30,420	20.32	618,134.40
	AURIZON HOLDINGS LTD	214,288	4.70	1,007,153.60
	SYDNEY AIRPORT	102,875	6.80	699,550.00
	TRANSURBAN GROUP	215,167	11.93	2,566,942.31
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	50,407	24.46	1,232,955.22
	CROWN RESORTS LTD	35,622	13.77	490,514.94
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,835	47.60	277,746.00
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	5,138	52.61	270,310.18
	TABCORP HOLDINGS LTD	199,743	5.21	1,040,661.03
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	52,191	4.49	234,337.59
	WESFARMERS LTD	108,999	44.15	4,812,305.85
	WOOLWORTHS GROUP LTD	126,986	27.70	3,517,512.20
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,552	8.43	443,013.36
TREASURY WINE ESTATES LTD	76,045	17.25	1,311,776.25	
COCHLEAR LTD	5,273	175.16	923,618.68	
HEALTHSCOPE LTD	161,984	1.95	316,678.72	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	13,281	68.81	913,865.61	
SONIC HEALTHCARE LTD	42,490	24.65	1,047,378.50	
CSL LTD	43,430	147.29	6,396,804.70	
AUST AND NZ BANKING GROUP	281,840	29.11	8,204,362.40	

	BANK OF QUEENSLAND LTD	36,107	12.51	451,698.57
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	43,263	11.89	514,397.07
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	166,119	80.79	13,420,754.01
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	258,232	29.56	7,633,337.92
	WESTPAC BANKING CORP	325,678	31.70	10,323,992.60
	AMP LTD	290,105	5.28	1,531,754.40
	ASX LTD	18,041	55.79	1,006,507.39
	CHALLENGER LTD	53,120	13.72	728,806.40
	MACQUARIE GROUP LTD	30,710	104.99	3,224,242.90
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	234,237	7.38	1,728,669.06
	MEDIBANK PRIVATE LTD	292,503	3.25	950,634.75
	QBE INSURANCE GROUP LTD	135,829	10.81	1,468,311.49
	SUNCORP GROUP LTD	127,178	13.81	1,756,328.18
	LENDLEASE GROUP	57,156	15.91	909,351.96
	COMPUTERSHARE LTD	42,496	17.02	723,281.92
	REA GROUP LTD	4,869	74.49	362,691.81
	TELSTRA CORP LTD	410,084	3.67	1,505,008.28
	TPG TELECOM LTD	34,153	6.55	223,702.15
	AGL ENERGY LTD	64,974	23.27	1,511,944.98
	AUSNET SERVICES	184,070	1.70	313,839.35
	オーストラリアドル 小計	7,188,430		118,941,333.63 (10,352,653,679)
イギリスポンド	BP PLC	1,862,350	4.89	9,115,272.07
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	425,113	23.95	10,183,581.91
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	353,192	24.23	8,559,608.12
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	63,450	6.50	412,551.90
	ANGLO AMERICAN PLC	125,350	16.48	2,065,768.00
	ANTOFAGASTA PLC	35,355	9.01	318,689.97
	BHP BILLITON PLC	197,522	15.37	3,036,308.18
	CRODA INTERNATIONAL PLC	11,925	43.54	519,214.50
	FRESNILLO PLC	19,964	13.35	266,519.40
	GLENCORE PLC	1,152,563	3.82	4,411,434.88
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,499	33.36	650,486.64
	MONDI PLC	36,476	18.96	691,584.96
	RANDGOLD RESOURCES LTD	8,336	70.44	587,187.84
	RIO TINTO PLC	116,153	39.01	4,531,709.29
	ASHTREAD GROUP PLC	48,894	20.34	994,503.96
	BAE SYSTEMS PLC	297,257	5.91	1,759,166.92
	BUNZL PLC	33,394	20.61	688,250.34
	COBHAM PLC	215,766	1.16	252,014.68
	DCC PLC	9,033	73.45	663,473.85
	FERGUSON PLC	24,232	53.00	1,284,296.00

IMI PLC	24,418	13.03	318,166.54
MEGGITT PLC	69,419	4.54	315,439.93
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	157,182	8.65	1,359,624.30
SMITHS GROUP PLC	36,608	15.67	573,830.40
TRAVIS PERKINS PLC	22,414	14.25	319,511.57
WEIR GROUP PLC/THE	19,948	21.35	425,889.80
BABCOCK INTL GROUP PLC	22,771	6.57	149,605.47
CAPITA PLC	60,112	1.62	97,561.77
EXPERIAN PLC	89,627	15.96	1,430,446.92
G4S PLC	140,955	2.80	395,801.64
INTERTEK GROUP PLC	15,986	49.72	794,823.92
RELX PLC	100,828	15.11	1,524,015.22
EASYJET PLC	15,270	16.53	252,413.10
ROYAL MAIL PLC	80,182	5.08	407,645.28
GKN PLC	157,312	4.15	653,316.73
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	90,075	5.74	517,570.95
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	11,651	38.98	454,155.98
BURBERRY GROUP PLC	39,262	15.62	613,468.75
PERSIMMON PLC	30,482	25.04	763,269.28
TAYLOR WIMPEY PLC	294,631	1.89	557,441.85
CARNIVAL PLC	18,291	49.39	903,392.49
COMPASS GROUP PLC	150,650	14.65	2,207,022.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	16,470	46.56	766,843.20
MERLIN ENTERTAINMENT	63,785	3.30	210,490.50
TUI AG-DI	39,694	15.88	630,539.19
WHITBREAD PLC	18,349	38.14	699,830.86
ITV PLC	367,957	1.68	621,295.39
PEARSON PLC	74,172	6.92	513,270.24
SKY PLC	100,562	10.62	1,067,968.44
WPP PLC	119,240	12.93	1,541,773.20
KINGFISHER PLC	198,771	3.49	694,505.87
MARKS & SPENCER GROUP PLC	144,127	2.97	428,057.19
NEXT PLC	13,235	50.26	665,191.10
SAINSBURY (J) PLC	146,652	2.49	365,310.13
TESCO PLC	775,096	2.02	1,567,244.11
WM MORRISON SUPERMARKETS	198,878	2.22	442,503.55
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,225	27.23	931,946.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	216,146	47.60	10,288,549.60
COCA-COLA HBC AG-DI	16,463	23.46	386,221.98
DIAGEO PLC	237,288	25.13	5,964,233.88
IMPERIAL BRANDS PLC	90,274	28.58	2,580,030.92
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,928	67.14	4,224,985.92

UNILEVER PLC	118,944	40.39	4,804,148.16	
CONVATEC GROUP PLC	123,135	1.90	234,449.04	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	33,328	5.85	195,168.76	
SMITH & NEPHEW PLC	83,779	12.53	1,049,750.87	
ASTRAZENECA PLC	119,328	50.36	6,009,358.08	
GLAXOSMITHKLINE PLC	463,938	13.10	6,081,299.30	
SHIRE PLC	87,071	33.13	2,885,097.58	
BARCLAYS PLC	1,594,909	1.95	3,119,004.04	
HSBC HOLDINGS PLC	1,893,392	7.50	14,204,226.78	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,783,567	0.68	4,663,702.31	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	349,611	2.86	1,001,985.12	
STANDARD CHARTERED PLC	314,169	8.13	2,557,021.49	
3I GROUP PLC	94,618	9.49	898,303.29	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	23,412	18.48	432,770.82	
INVESTEC PLC	59,244	5.49	325,249.56	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,985	40.16	1,204,197.60	
SCHRODERS PLC	11,176	37.01	413,623.76	
ST JAMES' S PLACE PLC	53,880	11.88	640,363.80	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	259,900	4.24	1,101,976.00	
ADMIRAL GROUP PLC	17,849	18.54	330,920.46	
AVIVA PLC	379,778	5.14	1,953,578.03	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	123,007	3.74	461,153.24	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	563,705	2.68	1,515,239.04	
OLD MUTUAL PLC	479,781	2.34	1,122,687.54	
PRUDENTIAL PLC	243,344	18.85	4,588,251.12	
RSA INSURANCE GROUP PLC	92,182	6.22	573,372.04	
AUTO TRADER GROUP PLC	87,980	3.64	320,423.16	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	43,031	21.38	920,002.78	
SAGE GROUP PLC/THE	107,162	7.38	791,069.88	
BT GROUP PLC	810,109	2.50	2,028,107.88	
VODAFONE GROUP PLC	2,513,547	2.19	5,517,235.66	
CENTRICA PLC	534,930	1.28	687,919.98	
NATIONAL GRID PLC	320,683	7.91	2,537,885.26	
SEVERN TRENT PLC	22,827	19.10	435,995.70	
SSE PLC	96,657	12.61	1,219,328.05	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	62,248	7.33	456,402.33	
イギリスポンド 小計	28,634,416		177,898,098.33 (27,600,889,955)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	22,478	25.95	583,304.10
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	742	671.00	497,882.00
	GIVAUDAN-REG	883	2,179.00	1,924,057.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	42,522	56.28	2,393,138.16

	SIKA AG-BR	207	7,820.00	1,618,740.00
	ABB LTD-REG	173,178	25.67	4,445,479.26
	GEBERIT AG-REG	3,557	435.60	1,549,429.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,922	225.40	433,218.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,989	231.80	924,650.20
	ADECCO GROUP AG-REG	15,950	75.30	1,201,035.00
	SGS SA-REG	495	2,469.00	1,222,155.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	5,439	167.55	911,304.45
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	48,837	88.78	4,335,748.86
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,003	417.20	1,252,851.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,171	78.40	405,406.40
	DUFREY AG-REG	3,168	143.50	454,608.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	200	1,893.00	378,600.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	93	5,745.00	534,285.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	68,700.00	687,000.00
	NESTLE SA-REG	293,302	79.42	23,294,044.84
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,256	145.05	762,382.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,049	660.00	692,340.00
	LONZA GROUP AG-REG	7,076	251.60	1,780,321.60
	NOVARTIS AG-REG	209,607	82.64	17,321,922.48
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	66,226	224.15	14,844,557.90
	VIFOR PHARMA AG	4,430	133.35	590,740.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	231,030	18.06	4,172,401.80
	JULIUS BAER GROUP LTD	21,909	63.58	1,392,974.22
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,491	85.15	297,258.65
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,559	712.00	1,110,008.00
	UBS GROUP AG-REG	345,187	18.94	6,537,841.78
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,469	152.20	680,181.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,190	351.20	1,120,328.00
	SWISS RE AG	29,793	92.22	2,747,510.46
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,149	307.80	4,355,062.20
	SWISS PRIME SITE-REG	6,530	89.80	586,394.00
	SWISSCOM AG-REG	2,522	506.80	1,278,149.60
	スイスフラン 小計	1,582,619		109,317,313.66 (12,902,722,531)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	258,868	105.20	27,232,913.60
	NWS HOLDINGS LTD	141,500	15.16	2,145,140.00
	MTR CORP	152,500	44.20	6,740,500.00
	MINTH GROUP LTD	72,000	43.95	3,164,400.00
	LI & FUNG LTD	534,000	3.91	2,087,940.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	126,000	49.80	6,274,800.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	67,500	34.80	2,349,000.00

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	226,000	68.40	15,458,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	86,800	23.80	2,065,840.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	44.60	10,614,800.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	18.12	2,101,920.00	
	SJM HOLDINGS LTD	175,000	7.74	1,354,500.00	
	WYNN MACAU LTD	141,600	26.90	3,809,040.00	
	WH GROUP LTD	855,000	9.60	8,208,000.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	110,420	33.05	3,649,381.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	352,500	39.70	13,994,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	73,100	184.10	13,457,710.00	
	FIRST PACIFIC CO	200,000	5.71	1,142,000.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	111,500	289.00	32,223,500.00	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	400,000	5.94	2,376,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,135,400	65.20	74,028,080.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	246,368	74.60	18,379,052.80	
	HANG LUNG GROUP LTD	80,000	29.35	2,348,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,000	20.55	3,740,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	106,589	53.80	5,734,488.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	56,000	45.25	2,534,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	59,500	37.60	2,237,200.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	545,000	12.36	6,736,200.00	
	SINO LAND CO	283,400	14.64	4,148,976.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	136,000	133.30	18,128,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	45,000	78.45	3,530,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	105,600	27.30	2,882,880.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	119,000	32.10	3,819,900.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	55.05	6,550,950.00	
	WHEELOCK & CO LTD	74,000	61.10	4,521,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	345,000	9.61	3,315,450.00	
	PCCW LTD	404,000	4.43	1,789,720.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	61,000	69.20	4,221,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	161,500	79.90	12,903,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	819,168	15.44	12,647,953.92	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	137,000	69.15	9,473,550.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,900	109.90	2,626,610.00	
	香港ドル 小計	9,682,713		366,748,645.52 (5,152,818,469)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	134,200	8.71	1,168,882.00	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	92,600	3.57	330,582.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	143,900	3.35	482,065.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	208,500	1.57	327,345.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	197,100	2.14	421,794.00	

	SATS LTD	62,600	5.48	343,048.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	55,040	11.32	623,052.80
	GENTING SINGAPORE PLC	549,100	1.33	730,303.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	146,550	2.68	392,754.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,000	40.00	360,000.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	639,560	0.38	246,230.60
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	146,100	3.16	461,676.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	168,200	26.68	4,487,576.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	295,100	12.81	3,780,231.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	130,200	27.52	3,583,104.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	75,500	8.16	616,080.00
	CAPITALAND LTD	270,200	3.72	1,005,144.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,200	13.33	495,876.00
	UOL GROUP LTD	43,800	9.04	395,952.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	770,060	3.49	2,687,509.40
	STARHUB LTD	58,200	2.86	166,452.00
	シンガポールドル 小計	4,232,710		23,105,656.80 (1,923,545,928)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,019	7.96	493,671.24
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	86,732	6.65	576,767.80
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	55,727	13.35	743,955.45
	RYMAN HEALTHCARE LTD	35,654	10.91	388,985.14
	SPARK NEW ZEALAND LTD	161,174	3.57	576,197.05
	MERCURY NZ LTD	64,309	3.41	219,293.69
	MERIDIAN ENERGY LTD	126,539	2.86	361,901.54
	ニュージーランドドル 小計	592,154		3,360,771.91 (269,668,338)
スウェーデンクローネ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,956	193.25	3,276,747.00
	BOLIDEN AB	27,383	280.50	7,680,931.50
	ALFA LAVAL AB	26,406	206.50	5,452,839.00
	ASSA ABLOY AB-B	94,128	176.25	16,590,060.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	63,222	357.50	22,601,865.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	37,514	317.80	11,921,949.20
	SANDVIK AB	108,140	149.90	16,210,186.00
	SKANSKA AB-B SHS	34,698	163.25	5,664,448.50
	SKF AB-B SHARES	33,976	181.25	6,158,150.00
	VOLVO AB-B SHS	148,313	157.90	23,418,622.70
	SECURITAS AB-B SHS	28,100	146.45	4,115,245.00
	ELECTROLUX AB-SER B	21,449	278.20	5,967,111.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	37,258	85.80	3,196,736.40
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	93,044	142.22	13,232,717.68
	ICA GRUPPEN AB	7,186	306.70	2,203,946.20

	SWEDISH MATCH AB	16,479	315.50	5,199,124.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	57,860	233.50	13,510,310.00	
	GETINGE AB-B SHS	22,021	107.70	2,371,661.70	
	NORDEA BANK AB	290,278	96.96	28,145,354.88	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,496	100.10	14,464,049.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	143,421	115.35	16,543,612.35	
	SWEDBANK AB - A SHARES	84,872	201.10	17,067,759.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,468	210.10	3,039,726.80	
	INVESTOR AB-B SHS	42,640	381.20	16,254,368.00	
	KINNEVIK AB - B	20,941	295.50	6,188,065.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,319	639.50	2,122,500.50	
	ERICSSON LM-B SHS	293,825	53.80	15,807,785.00	
	HEXAGON AB-B SHS	25,251	464.20	11,721,514.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,988	579.00	3,467,052.00	
	TELE2 AB-B SHS	32,211	97.78	3,149,591.58	
	TELIA CO AB	252,914	39.31	9,942,049.34	
	スウェーデンクローネ 小計	2,228,757		316,686,081.13 (4,395,602,806)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	108,667	178.25	19,369,892.75	
	NORSK HYDRO ASA	133,726	55.40	7,408,420.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,051	366.50	5,882,691.50	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	8,069	230.00	1,855,870.00	
	MARINE HARVEST	37,053	139.40	5,165,188.20	
	ORKLA ASA	72,957	79.96	5,833,641.72	
	DNB ASA	93,134	158.25	14,738,455.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,992	145.50	2,617,836.00	
	TELENOR ASA	71,990	177.40	12,771,026.00	
	ノルウェークローネ 小計	559,639		75,643,022.07 (1,071,861,622)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,960	509.60	4,566,016.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,218	321.40	7,140,865.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	20,352	404.20	8,226,278.40	
	ISS A/S	15,182	229.70	3,487,305.40	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	356	9,975.00	3,551,100.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	627	10,470.00	6,564,690.00	
	DSV A/S	18,414	473.00	8,709,822.00	
	PANDORA A/S	9,618	557.60	5,362,996.80	
	CARLSBERG AS-B	10,482	763.20	7,999,862.40	
	COLOPLAST-B	11,843	497.90	5,896,629.70	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	10,386	182.50	1,895,445.00	
	GENMAB A/S	5,624	1,066.00	5,995,184.00	
	H LUNDBECK A/S	6,220	301.20	1,873,464.00	

	NOVO NORDISK A/S-B	175,876	302.85	53,264,046.60
	DANSKE BANK A/S	70,067	244.90	17,159,408.30
	TRYG A/S	10,139	145.40	1,474,210.60
	TDC A/S	72,933	37.14	2,708,731.62
	ORSTED A/S	17,114	353.10	6,042,953.40
	デンマーククローネ 小計	486,411		151,919,009.42 (2,792,271,393)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,477	348.50	1,211,734.50
	ISRAEL CHEMICALS LTD	46,853	14.11	661,095.83
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,101	498.30	1,046,928.30
	BANK HAPOALIM BM	96,701	25.20	2,436,865.20
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	131,411	20.79	2,732,034.69
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,539	65.15	816,915.85
	AZRIELI GROUP LTD	3,746	182.20	682,521.20
	NICE LTD	5,540	306.00	1,695,240.00
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	186,511	5.43	1,012,941.24
	イスラエルシェケル 小計	488,879		12,296,276.81 (391,636,416)
ユーロ	ENAGAS SA	20,481	21.75	445,461.75
	ENI SPA	240,036	14.34	3,444,036.52
	GALP ENERGIA SGPS SA	45,148	15.26	689,184.22
	NESTE OYJ	11,624	54.94	638,622.56
	OMV AG	13,426	50.50	678,013.00
	REPSOL SA	115,963	15.04	1,744,083.52
	SNAM SPA	225,214	3.83	862,569.62
	TENARIS SA	42,968	13.75	590,810.00
	TOTAL SA	224,384	46.13	10,351,955.84
	VOPAK	6,422	35.02	224,898.44
	AIR LIQUIDE SA	40,189	104.45	4,197,741.05
	AKZO NOBEL	23,649	74.68	1,766,107.32
	ARCELORMITTAL	63,150	27.80	1,755,570.00
	ARKEMA	6,944	100.00	694,400.00
	BASF SE	86,577	90.39	7,825,695.03
	COVESTRO AG	15,203	89.52	1,360,972.56
	CRH PLC	79,144	28.89	2,286,470.16
	EVONIK INDUSTRIES AG	14,769	30.74	453,999.06
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	6,184	43.20	267,148.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	14,308	86.00	1,230,488.00
	IMERYS SA	3,211	84.25	270,526.75
	K+S AG-REG	17,191	21.83	375,279.53
KONINKLIJKE DSM NV	17,462	80.80	1,410,929.60	
LANXESS AG	8,305	67.50	560,587.50	

LINDE AG - TENDER	17,360	187.00	3,246,320.00
SOLVAY SA	7,331	113.30	830,602.30
STORA ENSO OYJ-R SHS	50,057	13.85	693,289.45
SYMRISE AG	11,186	66.12	739,618.32
THYSSENKRUPP AG	41,537	24.52	1,018,487.24
UMICORE	17,197	40.76	701,035.70
UPM-KYMMENE OYJ	51,397	27.82	1,429,864.54
VOESTALPINE AG	10,577	50.76	536,888.52
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,183	31.48	698,320.84
ACS ACTIVIDADES CONS Y-RTS	22,193	0.42	9,332.15
AIRBUS SE	54,726	87.97	4,814,246.22
ALSTOM	13,693	34.70	475,147.10
ANDRITZ AG	6,583	47.46	312,429.18
BOSKALIS WESTMINSTER	8,202	31.96	262,135.92
BOUYGUES SA	19,611	43.61	855,235.71
BRENTAG AG	14,409	51.40	740,622.60
CNH INDUSTRIAL NV	100,275	12.18	1,221,349.50
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	48,235	45.63	2,201,204.22
DASSAULT AVIATION SA	222	1,334.00	296,148.00
EIFFAGE	6,737	95.24	641,631.88
FERROVIAL SA	47,623	18.02	858,166.46
GEA GROUP AG	16,513	39.21	647,474.73
HOCHTIEF AG	1,738	141.00	245,058.00
KION GROUP AG	6,359	72.98	464,079.82
KONE OYJ-B	32,044	46.70	1,496,454.80
LEGRAND SA	25,725	65.38	1,681,900.50
LEONARDO SPA	41,903	9.60	402,268.80
MAN SE	3,133	95.40	298,888.20
METSO OYJ	10,175	27.40	278,795.00
MTU AERO ENGINES AG	5,117	139.10	711,774.70
OSRAM LICHT AG	9,181	69.00	633,489.00
PRYSMIAN SPA	18,585	27.69	514,618.65
REXEL SA	27,249	14.36	391,431.88
SAFRAN SA	31,153	86.74	2,702,211.22
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53,829	72.38	3,896,143.02
SIEMENS AG-REG	72,235	114.88	8,298,356.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	21,231	12.02	255,196.62
THALES SA	10,379	88.94	923,108.26
VINCI SA	47,469	84.88	4,029,168.72
WARTSILA OYJ ABP	13,421	57.16	767,144.36
ZODIAC AEROSPACE	18,512	25.05	463,725.60
BUREAU VERITAS SA	24,364	23.01	560,615.64

EDENRED	20,231	25.61	518,115.91
RANDSTAD HOLDING NV	10,800	56.10	605,880.00
RELX NV	91,570	17.16	1,571,341.20
SOCIETE BIC SA	2,546	85.00	216,410.00
TELEPERFORMANCE	5,602	117.60	658,795.20
WOLTERS KLUWER	29,591	42.11	1,246,077.01
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	67,282	19.60	1,318,727.20
ADP	2,719	166.60	452,985.40
AENA SME SA	6,629	172.50	1,143,502.50
ATLANTIA SPA	43,897	25.85	1,134,737.45
BOLLORE	79,699	4.52	360,239.48
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,780	28.08	611,582.40
DEUTSCHE POST AG-REG	92,233	37.23	3,433,834.59
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,775	92.82	350,395.50
GETLINK SE	43,040	11.08	477,098.40
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	58,425	7.15	417,855.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	31,740	90.18	2,862,313.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	4,933	77.95	384,527.35
CONTINENTAL AG	10,293	233.40	2,402,386.20
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	90,935	71.17	6,471,843.95
FAURECIA	7,308	71.44	522,083.52
FERRARI NV	11,929	103.80	1,238,230.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	102,020	18.79	1,917,159.84
MICHELIN (CGDE)	16,239	125.50	2,037,994.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,377	38.08	395,156.16
PEUGEOT SA	56,498	18.65	1,053,687.70
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	13,936	72.20	1,006,179.20
RENAULT SA	17,959	87.58	1,572,849.22
SCHAEFFLER AG	15,276	13.70	209,281.20
VALEO SA	22,865	61.38	1,403,453.70
VOLKSWAGEN AG	3,139	174.90	549,011.10
VOLKSWAGEN AG-PREF	17,231	172.06	2,964,765.86
ADIDAS AG	17,770	180.25	3,203,042.50
HERMES INTERNATIONAL	3,040	443.00	1,346,720.00
HUGO BOSS AG -ORD	5,624	72.90	409,989.60
KERING	7,223	396.50	2,863,919.50
LUXOTTICA GROUP SPA	17,124	50.26	860,652.24
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	26,291	247.90	6,517,538.90
SEB SA	2,038	169.90	346,256.20
ACCOR SA	17,207	44.13	759,344.91
PADDY POWER BETFAIR PLC	7,509	92.20	692,329.80
SODEXO SA	8,267	99.02	818,598.34

ALTICE NV - A	47,736	8.52	407,092.60
AXEL SPRINGER SE	4,257	70.70	300,969.90
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,700	17.93	281,579.50
JCDECAUX SA	6,778	34.26	232,214.28
LAGARDERE SCA	10,504	24.99	262,494.96
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	21,028	29.97	630,209.16
PUBLICIS GROUPE	19,667	55.44	1,090,338.48
RTL GROUP	3,426	67.65	231,768.90
SES	37,565	12.65	475,385.07
TELENET GROUP HOLDING NV	4,843	62.00	300,266.00
VIVENDI	96,460	22.66	2,185,783.60
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	103,675	27.65	2,866,613.75
ZALANDO SE	10,117	46.27	468,113.59
CARREFOUR SA	55,836	18.68	1,043,295.66
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,022	45.97	230,861.34
COLRUYT SA	5,266	44.34	233,494.44
JERONIMO MARTINS	22,605	16.86	381,233.32
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	120,724	17.85	2,154,923.40
METRO AG	16,244	17.46	283,620.24
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	71,895	89.69	6,448,262.55
DANONE	56,724	68.50	3,885,594.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	54,194	6.47	350,635.18
HEINEKEN HOLDING NV	11,136	85.20	948,787.20
HEINEKEN NV	24,519	90.30	2,214,065.70
KERRY GROUP PLC-A	15,725	86.20	1,355,495.00
PERNOD RICARD SA	19,686	126.90	2,498,153.40
REMY COINTREAU	2,005	105.20	210,926.00
BEIERSDORF AG	9,871	94.78	935,573.38
HENKEL AG & CO KGAA	9,575	101.60	972,820.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,776	111.90	1,877,234.40
L'OREAL	23,658	180.65	4,273,817.70
UNILEVER NV-CVA	153,599	46.70	7,173,841.29
BIOMERIEUX	4,050	71.30	288,765.00
ESSILOR INTERNATIONAL	19,496	111.05	2,165,030.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	20,301	87.58	1,777,961.58
FRESENIUS SE & CO KGAA	38,722	66.68	2,581,982.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,416	31.98	2,827,985.76
BAYER AG-REG	78,028	102.00	7,958,856.00
EUROFINS SCIENTIFIC	982	505.00	495,910.00
GRIFOLS SA	26,932	24.88	670,068.16
IPSEN	3,371	111.65	376,372.15
MERCK KGAA	12,442	85.78	1,067,274.76

ORION OYJ-CLASS B	9,317	32.23	300,286.91
QIAGEN N.V.	22,300	27.00	602,100.00
RECORDATI SPA	9,371	35.28	330,608.88
SANOFI	107,191	69.95	7,498,010.45
UCB SA	11,488	67.52	775,669.76
ABN AMRO GROUP NV-CVA	40,478	27.15	1,098,977.70
AIB GROUP PLC	79,880	5.42	433,349.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	627,091	7.35	4,611,627.21
BANCO DE SABADELL SA	524,455	1.83	963,948.29
BANCO SANTANDER SA	1,525,635	5.85	8,931,067.29
BANK OF IRELAND GROUP PLC	84,620	7.86	665,113.20
BANKIA SA	90,363	4.01	362,355.63
BANKINTER SA	60,287	9.17	552,952.36
BNP PARIBAS	105,936	66.00	6,991,776.00
CAIXABANK S.A	340,654	4.23	1,442,669.69
COMMERZBANK AG	103,317	13.10	1,354,279.23
CREDIT AGRICOLE SA	107,867	15.03	1,621,780.34
ERSTE GROUP BANK AG	29,458	40.16	1,183,033.28
ING GROEP NV	366,660	15.66	5,742,628.92
INTESA SANPAOLO	1,267,870	3.11	3,950,048.98
INTESA SANPAOLO-RSP	82,627	3.03	250,772.94
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248		
KBC GROEP NV	23,721	77.32	1,834,107.72
MEDIOBANCA SPA	51,879	9.94	515,988.53
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	13,370	34.16	456,719.20
SOCIETE GENERALE SA	72,439	45.92	3,326,761.07
UNICREDIT SPA	188,694	17.57	3,315,353.58
AMUNDI SA	5,763	73.90	425,885.70
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	198,364	13.85	2,748,531.58
DEUTSCHE BOERSE AG	18,131	102.05	1,850,268.55
EURAZEO SA	3,949	84.30	332,900.70
EXOR NV	9,853	62.86	619,359.58
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,204	94.36	774,129.44
NATIXIS	84,670	7.28	617,074.96
WENDEL	2,624	148.90	390,713.60
AEGON NV	160,224	5.52	885,718.27
AGEAS	19,001	42.84	814,002.84
ALLIANZ SE-REG	42,354	200.35	8,485,623.90
ASSICURAZIONI GENERALI	117,333	15.94	1,870,874.68
AXA SA	182,440	26.56	4,846,518.60
CNP ASSURANCES	15,727	20.70	325,548.90
HANNOVER RUECK SE	6,202	110.80	687,181.60

MAPFRE SA	94,896	2.87	273,015.79
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,796	189.45	2,803,102.20
NN GROUP NV	27,944	38.22	1,068,019.68
POSTE ITALIANE SPA	46,876	6.58	308,631.58
SAMPO OYJ-A SHS	42,025	47.12	1,980,218.00
SCOR SE	15,449	36.16	558,635.84
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	88,023	2.03	178,686.69
DEUTSCHE WOHNEN SE	34,052	33.99	1,157,427.48
VONOVIA SE	44,773	37.87	1,695,553.51
AMADEUS IT GROUP SA	41,681	60.66	2,528,369.46
ATOS SE	9,102	125.70	1,144,121.40
CAPGEMINI SE	15,258	105.35	1,607,430.30
DASSAULT SYSTEMES SA	12,562	98.62	1,238,864.44
SAP SE	92,626	88.00	8,151,088.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,026	67.84	408,803.84
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,633	57.80	730,187.40
WIRECARD AG	11,261	96.12	1,082,407.32
INGENICO GROUP	5,304	91.60	485,846.40
NOKIA OYJ	558,266	4.40	2,456,370.40
1&1 DRILLISCH AG	5,142	65.30	335,772.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	314,377	13.80	4,339,974.48
ELISA OYJ	15,323	35.80	548,563.40
ILIAD SA	2,360	207.50	489,700.00
KONINKLIJKE KPN NV	335,213	2.78	932,227.35
ORANGE	191,435	14.16	2,710,719.60
PROXIMUS	13,567	26.90	364,952.30
TELECOM ITALIA SPA	1,127,378	0.70	799,761.95
TELECOM ITALIA-RSP	535,180	0.60	323,569.82
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,777	4.06	271,314.95
TELEFONICA SA	423,895	8.05	3,413,202.54
E.ON SE	207,934	8.23	1,712,336.49
EDF	58,355	10.85	633,151.75
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,604	2.77	670,934.30
ENDESA SA	28,382	17.51	496,968.82
ENEL SPA	762,338	4.97	3,788,819.86
ENGIE	175,391	13.57	2,380,932.82
FORTUM OYJ	40,592	17.70	718,478.40
GAS NATURAL SDG SA	35,824	18.82	674,386.80
IBERDROLA SA	542,903	6.40	3,475,665.00
INNOGY SE	12,762	30.52	389,496.24
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40,110	17.08	685,078.80
RWE AG	51,261	15.59	799,158.99

SUEZ	33,681	12.14	409,055.74
TERNA SPA	128,643	4.73	608,610.03
UNIPER SE	19,009	23.45	445,761.05
VEOLIA ENVIRONNEMENT	47,608	19.93	948,827.44
ASML HOLDING NV	36,488	158.15	5,770,577.20
INFINEON TECHNOLOGIES AG	106,187	22.40	2,378,588.80
STMICROELECTRONICS NV	62,441	18.50	1,155,158.50
ユーロ 小計	18,602,515		380,426,939.70 (52,034,796,812)
合 計	106,924,120		384,400,012,617 (384,400,012,617)

(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	659,809.92	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,974	1,113,852.88	
		AMERICAN TOWER CORP	40,331	5,856,867.82	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	113,044	1,171,135.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,964	2,125,577.44	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,624	1,745,228.16	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	27,436	428,275.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,381	698,975.40	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	46,657	407,782.18	
		CROWN CASTLE INTL CORP	38,086	4,269,440.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	19,214	2,069,539.94	
		DUKE REALTY CORP	32,395	867,538.10	
		EQUINIX INC	7,400	3,236,390.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	34,636	2,076,428.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,254	1,409,526.52	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,307	925,364.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,651	768,456.54	
		GGP INC	60,077	1,352,934.04	
		HCP INC	45,369	1,082,504.34	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	71,542	1,438,709.62	
		INVITATION HOMES INC	29,720	655,920.40	
		IRON MOUNTAIN INC	25,269	850,554.54	
KIMCO REALTY CORP	39,433	586,368.71			
LIBERTY PROPERTY TRUST	13,238	535,874.24			

		MACERICH CO/THE	11,029	677,842.34	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,056	1,013,724.64	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	13,428	517,649.40	
		PROLOGIS INC	50,371	3,215,180.93	
		PUBLIC STORAGE	14,867	2,829,338.77	
		REALTY INCOME CORP	26,102	1,337,727.50	
		REGENCY CENTERS CORP	13,645	820,337.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	29,124	4,558,488.48	
		SL GREEN REALTY CORP	9,188	901,067.16	
		UDR INC	26,436	930,547.20	
		VENTAS INC	33,547	1,822,608.51	
		VEREIT INC	98,677	699,619.93	
		VORNADO REALTY TRUST	16,646	1,170,713.18	
		WELLTOWER INC	34,013	1,988,059.85	
		WEYERHAEUSER CO	70,618	2,519,650.24	
アメリカドル合計			1,207,453	61,335,611.80 (6,740,783,736)	
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,200	250,344.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,700	323,868.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,700	167,580.00	
カナダドル合計			31,600	741,792.00 (65,641,174)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	107,134	1,015,630.32	
		GOODMAN GROUP	177,470	1,417,985.30	
		GPT GROUP	186,909	936,414.09	
		MIRVAC GROUP	336,014	715,709.82	
		SCENTRE GROUP	518,897	2,132,666.67	
		STOCKLAND	225,746	941,360.82	
		VICINITY CENTRES	356,298	954,878.64	
		WESTFIELD CORP	194,292	1,783,600.56	
オーストラリアドル合計			2,102,760	9,898,246.22 (861,543,350)	
イギリスポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	87,749	577,563.91	
		HAMMERSON PLC	70,806	344,117.16	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	73,108	721,137.31	
		SEGRO PLC	89,418	520,412.76	
イギリスポンド合計			321,081	2,163,231.14 (335,625,311)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	212,500	14,450,000.00	
香港ドル合計			212,500	14,450,000.00 (203,022,500)	
	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	275,700	747,147.00	

シンガ ポールド ル		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	276,100	491,458.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	225,900	467,613.00	
		SUNTEC REIT	231,600	467,832.00	
シンガポールドル合計			1,009,300	2,174,050.00 (180,989,662)	
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	3,052	268,423.40	
		GECINA SA	4,233	656,538.30	
		ICADE	3,002	256,971.20	
		KLEPIERRE	22,095	782,604.90	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	9,497	1,909,846.70	
ユーロ合計			41,879	3,874,384.50 (529,938,311)	
合計				8,917,544,044 (8,917,544,044)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()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

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	601銘柄	97.39%	63.83%
	投資証券	39銘柄		1.71%
カナダドル	株式	88銘柄	99.55%	3.68%
	投資証券	3銘柄		0.02%
オーストラリアドル	株式	59銘柄	92.32%	2.63%
	投資証券	8銘柄		0.22%
イギリスポンド	株式	98銘柄	98.80%	7.02%
	投資証券	4銘柄		0.09%
スイスフラン	株式	37銘柄	100.00%	3.28%
香港ドル	株式	42銘柄	96.21%	1.31%
	投資証券	1銘柄		0.05%
シンガポールドル	株式	21銘柄	91.40%	0.49%
	投資証券	4銘柄		0.05%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%	0.07%
スウェーデンクローネ	株式	31銘柄	100.00%	1.12%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.00%	0.27%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%	0.71%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.00%	0.10%
ユーロ	株式	241銘柄	98.99%	13.23%
	投資証券	5銘柄		0.13%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

新興国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
[平成30年 2月 5日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	2,713,665,482
コール・ローン	738,360,407
株式	68,769,938,240
投資証券	284,049,225
派生商品評価勘定	2,160,161
未収入金	2,713,299
未収配当金	124,292,351
差入委託証拠金	718,602,754
流動資産合計	73,353,781,919
資産合計	73,353,781,919
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,537,234
未払金	5,281
未払解約金	530,830,450
未払利息	1,127
流動負債合計	633,374,092
負債合計	633,374,092
純資産の部	
元本等	
元本	26,146,448,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,573,959,404
元本等合計	72,720,407,827
純資産合計	72,720,407,827
負債純資産合計	73,353,781,919

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式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。</p> <p>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。</p>
--------------------	---

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。 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。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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30年 2月 5日現在]
1. 期首	平成29年 3月27日
期首元本額	21,242,700,660円
期中追加設定元本額	7,968,184,253円
期中一部解約元本額	3,064,436,490円
元本の内訳	
eMAXIS 新興国株式インデックス	13,495,254,285円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,181,900,612円
eMAXIS バランス(波乗り型)	327,866,746円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	162,606,585円
コアバランス	84,162円
海外株式セレクション(ラップ向け)	27,153,951円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	389,706,566円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	1,440,766,281円
つみたて新興国株式	68,661,400円
つみたて8資産均等バランス	10,543,256円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	361,112円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	520,780円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,303,317円
三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド	6,370,457,820円
新興国株式インデックスオープン	284,823,635円
eMAXIS 全世界株式インデックス	371,668,613円
三菱UFJ バランス・イノベーション(新興国投資型)	602,006,279円
新興国株式インデックスファンド(ラップ向け)	7,779,900円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	7,897,981円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	46,443,826円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	41,629,622円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	237,344,456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)	1,057,605,711円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	1,397,806円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	6,537,849円
世界8資産バランスファンドVL(適格機関投資家限定)	4,125,872円
合計	26,146,448,423円

	[平成30年 2月 5日現在]
2. 受益権の総数	26,146,448,423口

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29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、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。</p> <p>当ファンドは、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> <p>また、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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p>

区分	[平成30年 2月 5日現在]
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>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	10,262,584,388
投資証券	23,755,376
合計	10,238,829,012

(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

[平成30年 2月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,934,733,215		3,834,858,842	99,874,373
	合計	3,934,733,215		3,834,858,842	99,874,373

（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

[平成30年 2月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建			
	アメリカドル	175,588,000		175,813,000
	香港ドル	91,175,000		91,260,000
	メキシコペソ	35,798,400		35,400,000
	韓国ウォン	50,811,000		50,450,000
	ニュー台湾ドル	48,715,300		48,880,000
	南アフリカランド	36,468,000		36,440,000
	売建			
	メキシコペソ	29,310,000		29,500,000
	合計	467,865,700		467,743,000

(注) 時価の算定方法

- 1 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。

- 2 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。

(1口当たり情報)

	[平成30年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	2.7813円
(1万口当たり純資産額)	(27,813円)

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	GAZPROM PAO -SPON ADR	572,037	5.05	2,888,786.85	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	46,760	67.00	3,132,920.00	

NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9,866	136.70	1,348,682.20
ROSNEFT OIL CO PJSC	124,300	6.05	752,733.30
SURGUTNEFTGAS OJSC	870,900	0.51	449,273.36
SURGUTNEFTGAS-PREFERENCE	723,400	0.54	392,708.03
TATNEFT PJSC	170,810	10.31	1,762,019.45
TRANSNEFT PJSC	62	3,240.79	200,929.28
ALROSA PJSC	264,200	1.45	385,086.26
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	20,697	15.20	314,594.40
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	17,700	10.28	181,956.00
MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,053	204.81	1,444,572.97
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	128,760	2.60	335,250.09
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	14,167	15.61	221,146.87
POLYUS PJSC-REG S-GDR	5,400	39.85	215,190.00
SEVERSTAL PJSC	22,700	16.35	371,267.88
SOUTHERN COPPER CORP	10,046	47.40	476,180.40
DP WORLD LTD	17,357	26.60	461,696.20
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	14,842	89.58	1,329,546.36
TAL EDUCATION GROUP- ADR	30,129	31.52	949,666.08
YUM CHINA HOLDINGS INC	41,946	45.55	1,910,640.30
CTRIIP.COM INTERNATIONAL-ADR	42,809	46.87	2,006,457.83
JD.COM INC-ADR	71,359	46.03	3,284,654.77
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	45,216	15.65	707,630.40
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,510	20.91	826,154.10
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	142,542	4.54	647,140.68
CREDICORP LTD	7,470	224.00	1,673,280.00
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	269,050	19.32	5,198,046.00
VTB BANK PJSC	558,190,000	0.00	489,253.53
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	159,120	2.06	328,285.85
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	105,800	1.48	156,689.80
58.COM INC-ADR	9,681	73.36	710,198.16
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	125,610	187.31	23,528,009.10
AUTOHOME INC-ADR	5,473	77.52	424,266.96
BAIDU INC - SPON ADR	29,896	233.17	6,970,850.32
MOMO INC-SPON ADR	10,871	29.83	324,281.93
NETEASE INC-ADR	8,678	317.40	2,754,397.20
SINA CORP	6,454	112.57	726,526.78
WEIBO CORP-SPON ADR	5,111	121.44	620,679.84
YY INC-ADR	4,807	128.32	616,834.24
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	54,750	12.13	664,117.50
INTER RAO UES PJSC	3,193,000	0.06	217,566.54
RUSHYDRO PJSC	10,464,000	0.01	135,683.54
	576,104,339		72,535,851.35

	アメリカドル 小計			(7,971,690,063)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	218,000	9.95	2,169,100.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,764,000	6.97	19,265,080.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	365,500	25.55	9,338,525.00
	CNOOC LTD	1,940,000	12.66	24,560,400.00
	KUNLUN ENERGY CO LTD	334,000	7.93	2,648,620.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,241,000	6.33	14,185,530.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	212,000	14.66	3,107,920.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	422,000	5.35	2,257,700.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	133,500	44.70	5,967,450.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	390,000	5.99	2,336,100.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	322,000	8.58	2,762,760.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	149,000	13.90	2,071,100.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	174,000	9.16	1,593,840.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	187,000	12.50	2,337,500.00
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	385,000	4.79	1,844,150.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	666,000	4.16	2,770,560.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	188,000	4.14	778,320.00
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	53,500	47.20	2,525,200.00
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	467,000	9.23	4,310,410.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	172,000	22.05	3,792,600.00
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	208,000	9.34	1,942,720.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	408,000	6.01	2,452,080.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	230,000	11.38	2,617,400.00
	CITIC LTD	616,000	12.18	7,502,880.00
	CRRG CORP LTD - H	420,550	7.69	3,234,029.50
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	287,000	18.80	5,395,600.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	79,000	25.00	1,975,000.00
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	254,000	3.14	797,560.00
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	60,000	22.75	1,365,000.00
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	227,800	9.71	2,211,938.00
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	58,000	43.65	2,531,700.00
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	255,000	12.02	3,065,100.00
	AIR CHINA LTD-H	214,000	11.82	2,529,480.00
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	164,000	12.02	1,971,280.00
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	134,000	19.34	2,591,560.00
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	170,000	10.20	1,734,000.00
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	7.71	1,403,220.00
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	140,000	12.14	1,699,600.00
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	132,000	9.45	1,247,400.00
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	340,000	20.00	6,800,000.00
	BYD CO LTD-H	71,500	72.65	5,194,475.00

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	278,000	9.97	2,771,660.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	59,600	32.70	1,948,920.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	527,000	24.75	13,043,250.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	310,500	9.36	2,906,280.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	230,675	17.50	4,036,812.50
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	99,000	16.86	1,669,140.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	38.75	4,688,750.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	129,000	26.80	3,457,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	82,000	78.40	6,428,800.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,410,000	1.05	1,480,500.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,128,000	0.97	1,094,160.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	265,000	10.24	2,713,600.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	0.42	156,240.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	291,000	24.65	7,173,150.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	176,000	29.65	5,218,400.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	212,000	15.52	3,290,240.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	42,000	43.05	1,808,100.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	576,000	6.59	3,795,840.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	76,500	76.35	5,840,775.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	418,000	4.03	1,684,540.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	172,000	5.45	937,400.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	81,700	20.65	1,687,105.00
SINOPHARM GROUP CO-H	130,800	34.45	4,506,060.00
3SBIO INC	94,000	15.58	1,464,520.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	139,000	17.06	2,371,340.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	228,500	10.34	2,362,690.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	516,000	17.30	8,926,800.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	53,000	45.35	2,403,550.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	340,000	3.00	1,020,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	477,000	14.84	7,078,680.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,802,000	4.74	13,281,480.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,625,000	4.66	40,192,500.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	906,900	6.73	6,103,437.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	938,000	6.46	6,059,480.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,161,550	8.95	81,995,872.50
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	288,000	4.40	1,267,200.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	426,550	38.25	16,315,537.50
CHINA MINSHENG BANKING-H	614,600	8.85	5,439,210.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	302,000	7.03	2,123,060.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	8,025,350	7.39	59,307,336.50
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	895,000	3.28	2,935,600.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	106,000	18.78	1,990,680.00

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	346,500	6.23	2,158,695.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,116,000	3.92	4,374,720.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	251,500	20.30	5,105,450.00
FAR EAST HORIZON LTD	226,000	8.15	1,841,900.00
GF SECURITIES CO LTD-H	145,400	17.02	2,474,708.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	12.56	4,486,432.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	169,200	17.26	2,920,392.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	811,000	26.55	21,532,050.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	290,400	40.30	11,703,120.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	173,000	33.40	5,778,200.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	85,100	49.85	4,242,235.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	718,000	4.72	3,388,960.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	490,000	16.58	8,124,200.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	567,500	90.70	51,472,250.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	168,000	14.72	2,472,960.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	351,000	25.85	9,073,350.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	446,000	5.21	2,323,660.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	424,000	31.00	13,144,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	298,000	32.05	9,550,900.00
CHINA VANKE CO LTD-H	128,451	38.65	4,964,631.15
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	572,232	16.76	9,590,608.32
FULLSHARE HOLDINGS LTD	740,000	3.62	2,678,800.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	110,800	22.20	2,459,760.00
LONGFOR PROPERTIES	168,500	25.80	4,347,300.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	133,500	23.75	3,170,625.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	346,000	6.38	2,207,480.00
SOHO CHINA LTD	193,000	4.61	889,730.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	268,000	36.05	9,661,400.00
KINGSOFT CORP LTD	90,000	27.45	2,470,500.00
TENCENT HOLDINGS LTD	621,100	452.40	280,985,640.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	98,000	24.45	2,396,100.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	79,500	141.10	11,217,450.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	73,500	19.16	1,408,260.00
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	68,000	42.65	2,900,200.00
LENOVO GROUP LTD	826,000	4.31	3,560,060.00
MEITU INC	138,000	10.92	1,506,960.00
SUNNY OPTICAL TECH	76,000	112.10	8,519,600.00
ZTE CORP-H	81,131	27.60	2,239,215.60
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	304,000	4.92	1,495,680.00
CHINA MOBILE LTD	668,500	80.90	54,081,650.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,558,000	3.85	5,998,300.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	676,000	11.64	7,868,640.00

	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	484,000	5.60	2,710,400.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,111,000	2.19	2,433,090.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	193,000	24.05	4,641,650.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	347,000	5.70	1,977,900.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	90,000	26.25	2,362,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	226,000	14.26	3,222,760.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	85,000	59.55	5,061,750.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	332,000	11.78	3,910,960.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	438,000	4.97	2,176,860.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	512,000	2.67	1,367,040.00	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,507,000	1.32	1,989,240.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	323,400	11.04	3,570,336.00	
	香港ドル 小計	80,620,989		1,147,825,641.57 (16,126,950,264)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	386,580	2.62	1,012,839.60	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	26,100	25.48	665,028.00	
	SAPURA ENERGY BHD	357,800	0.73	262,983.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	246,100	8.02	1,973,722.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	117,000	5.80	678,600.00	
	GAMUDA BHD	205,700	5.14	1,057,298.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	70,300	9.72	683,316.00	
	IJM CORP BHD	311,300	3.01	937,013.00	
	SIME DARBY BERHAD	248,500	2.96	735,560.00	
	AIRASIA BHD	140,000	4.30	602,000.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	91,500	9.18	839,970.00	
	MISC BHD	173,000	7.57	1,309,610.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.49	517,916.00	
	UMW HOLDINGS BHD	49,000	6.82	334,180.00	
	GENTING BHD	251,900	9.42	2,372,898.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	302,700	5.54	1,676,958.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	217,200	2.57	558,204.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	17,300	33.60	581,280.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	244,600	1.97	481,862.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.12	396,704.00	
	IOI CORP BHD	241,900	4.70	1,136,930.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	46,700	25.26	1,179,642.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	5,000	115.90	579,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	55,700	17.50	974,750.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	248,500	5.55	1,379,175.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	60,100	11.58	695,958.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	232,200	6.03	1,400,166.00	

	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	146,200	4.33	633,046.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	165,700	4.74	785,418.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	480,800	7.25	3,485,800.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	84,800	18.80	1,594,240.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	19.00	632,700.00	
	MALAYAN BANKING BHD	432,000	10.10	4,363,200.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	312,300	22.00	6,870,600.00	
	RHB BANK BHD	114,349	5.49	627,776.01	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	172,800	2.03	350,784.00	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	248,500	1.55	385,175.00	
	SP SETIA BHD	158,000	3.22	508,760.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	272,300	5.70	1,552,110.00	
	DIGI.COM BHD	363,600	4.98	1,810,728.00	
	MAXIS BHD	237,400	6.10	1,448,140.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	135,500	6.21	841,455.00	
	PETRONAS GAS BHD	73,500	18.28	1,343,580.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	342,300	15.80	5,408,340.00	
	YTL CORP BHD	545,663	1.54	840,321.02	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	194,820	1.24	241,576.80	
	マレーシアリングット 小計	9,048,112		58,747,812.43 (1,656,688,310)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	270,600	21.80	5,899,080.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	133,000	65.00	8,645,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	1,161,700	7.45	8,654,665.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	158,200	122.50	19,379,500.00	
	PTT PCL-NVDR	111,800	502.00	56,123,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	117,100	102.00	11,944,200.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	159,900	55.50	8,874,450.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	240,861	95.00	22,881,795.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	39,550	492.00	19,458,600.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	132,900	58.50	7,774,650.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	473,100	70.00	33,117,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	862,300	7.65	6,596,595.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	722,800	8.05	5,818,540.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,700	44.00	10,414,800.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	500,701	14.20	7,109,954.20	
	ROBINSON PCL-NVDR	45,900	70.50	3,235,950.00	
	CP ALL PCL-NVDR	542,500	79.75	43,264,375.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	298,500	23.40	6,984,900.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	262,200	20.20	5,296,440.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	422,000	22.20	9,368,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,900	202.00	8,059,800.00	

	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	30,300	210.00	6,363,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	194,000	230.00	44,620,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	408,600	20.00	8,172,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	196,700	155.50	30,586,850.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	1,726,300	2.90	5,006,270.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	143,600	82.50	11,847,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	60,600	72.50	4,393,500.00	
	KCE ELECTRONICS - NVDR	26,000	72.25	1,878,500.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	109,800	194.50	21,356,100.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	1,227,076	6.65	8,160,055.40	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	12,700	220.00	2,794,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	66,900	84.00	5,619,600.00	
	タイパーツ 小計	11,134,788		459,699,169.60 (1,604,350,101)	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	209,710	75.30	15,791,163.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	559,300	15.60	8,725,080.00	
	DMCI HOLDINGS INC	571,900	14.56	8,326,864.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	320,650	77.40	24,818,310.00	
	SM INVESTMENTS CORP	24,590	1,030.00	25,327,700.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	45,000	110.00	4,950,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	48,550	294.00	14,273,700.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,220	162.20	14,633,684.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	87,830	120.00	10,539,600.00	
	BDO UNIBANK INC	216,670	153.50	33,258,845.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	83,040	98.60	8,187,744.00	
	SECURITY BANK CORP	21,400	243.40	5,208,760.00	
	AYALA CORPORATION	27,335	1,050.00	28,701,750.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	10,115	1,350.00	13,655,250.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	1,538,500	6.46	9,938,710.00	
	AYALA LAND INC	767,100	45.85	35,171,535.00	
	MEGAWORLD CORP	999,000	4.96	4,955,040.00	
	ROBINSONS LAND CO	145,000	20.85	3,023,250.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	923,300	36.95	34,115,935.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,210	1,899.00	7,994,790.00	
	PLDT INC	8,830	1,558.00	13,757,140.00	
	ABOITIZ POWER CORP	195,300	41.00	8,007,300.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,800	336.20	8,337,760.00	
	フィリピン 小計	6,922,350		341,699,910.00 (727,820,808)	
インドネシア ピア	ADARO ENERGY TBK PT	1,586,200	2,470.00	3,917,914,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	195,100	39,200.00	7,647,920,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	201,300	21,175.00	4,262,527,500.00	

SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	318,000	10,700.00	3,402,600,000.00	
AKR CORPORINDO TBK PT	154,300	5,825.00	898,797,500.00	
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	436,500	2,810.00	1,226,565,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	281,200	5,600.00	1,574,720,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,223,700	8,700.00	19,346,190,000.00	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	500,000	2,810.00	1,405,000,000.00	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	276,200	10,850.00	2,996,770,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	877,400	3,370.00	2,956,838,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	49,100	81,500.00	4,001,650,000.00	
HM SAMPOERNA TBK PT	1,006,600	4,800.00	4,831,680,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	283,800	8,800.00	2,497,440,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	446,600	7,775.00	3,472,315,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	162,900	55,025.00	8,963,572,500.00	
KALBE FARMA TBK PT	2,187,900	1,660.00	3,631,914,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,090,400	23,975.00	26,142,340,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	401,400	6,925.00	2,779,695,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,048,100	8,125.00	16,640,812,500.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	829,600	9,300.00	7,715,280,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,024,300	3,740.00	22,530,882,000.00	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	580,600	3,670.00	2,130,802,000.00	
BUMI SERPONG DAMAI PT	701,700	1,885.00	1,322,704,500.00	
PAKUWON JATI TBK PT	1,900,000	685.00	1,301,500,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	5,518,800	4,000.00	22,075,200,000.00	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	212,600	6,100.00	1,296,860,000.00	
XL AXIATA TBK PT	320,000	3,000.00	960,000,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	1,314,400	2,460.00	3,233,424,000.00	
インドネシアルピア 小計	32,128,700		185,163,913,500.00 (1,518,344,090)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-CPO	1,573,368	15.21	23,930,927.28	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	428,370	64.96	27,826,915.20	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,420	412.75	6,364,605.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	121,598	53.44	6,498,197.12	
ALFA S.A.B.-A	352,900	23.16	8,173,164.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	50,300	70.68	3,555,204.00	
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	41,900	191.65	8,030,135.00	
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	23,965	362.42	8,685,395.30	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	24,200	189.34	4,582,028.00	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	261,300	76.55	20,002,515.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	16,500	136.12	2,245,980.00	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	561,800	46.64	26,202,352.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,466	138.72	6,168,323.52	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	52,200	144.02	7,517,844.00	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,000	182.76	37,831,320.00
	GRUMA S.A.B. -B	22,680	230.20	5,220,936.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	190,500	46.31	8,822,055.00
	GRUPO LALA SAB DE CV	55,200	29.23	1,613,496.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	172,300	35.47	6,111,481.00
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	183,300	28.62	5,246,046.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	266,900	119.67	31,939,923.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	270,700	33.09	8,957,463.00
	GENEREA SAB DE CV	90,100	16.25	1,464,125.00
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	3,674,600	17.42	64,011,532.00
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	59,700	98.71	5,892,987.00
	メキシコペソ 小計	8,761,267		336,894,949.42 (1,991,049,151)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	19,200	44.01	844,992.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	334,200	21.54	7,198,668.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	425,700	19.97	8,501,229.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	38,900	80.94	3,148,566.00
	BRASKEM SA-PREF A	19,100	48.80	932,080.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	73,800	10.77	794,826.00
	FIBRIA CELULOSE SA	26,600	56.43	1,501,038.00
	GERDAU SA-PREF	113,100	14.57	1,647,867.00
	KLABIN SA - UNIT	61,600	17.64	1,086,624.00
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	53,200	21.20	1,127,840.00
	VALE SA	346,530	40.80	14,138,424.00
	EMBRAER SA	67,900	21.30	1,446,270.00
	WEG SA	65,880	22.75	1,498,770.00
	CCR SA	126,400	15.11	1,909,904.00
	LOCALIZA RENT A CAR	54,375	25.40	1,381,125.00
	RUMO SA	125,300	13.75	1,722,875.00
	KROTON EDUCACIONAL SA	153,992	16.29	2,508,529.68
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	74,161	16.60	1,231,072.60
	LOJAS RENNER S.A.	78,200	37.26	2,913,732.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	42,800	15.72	672,816.00
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	16,100	72.83	1,172,563.00
	RAIA DROGASIL SA	24,900	81.54	2,030,346.00
	AMBEV SA	514,300	22.01	11,319,743.00
	BRF SA	48,300	35.06	1,693,398.00
	JBS SA	93,400	9.99	933,066.00
	M DIAS BRANCO SA	12,800	57.00	729,600.00
	NATURA COSMETICOS SA	15,700	34.50	541,650.00
	ODONTOPREV S.A.	24,500	16.65	407,925.00
	QUALICORP SA	26,400	30.35	801,240.00

	HYPERMARCAS SA	36,200	36.81	1,332,522.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	112,998	37.25	4,209,175.50	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	320,099	38.42	12,298,203.58	
	BANCO DO BRASIL S.A.	91,900	39.25	3,607,075.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	48,500	36.40	1,765,400.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	352,387	51.85	18,271,265.95	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	422,207	13.00	5,488,691.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	221,375	26.00	5,755,750.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	79,400	31.75	2,520,950.00	
	PORTO SEGURO SA	15,200	43.98	668,496.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	27,358	20.99	574,244.42	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	82,954	13.01	1,079,231.54	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	9,900	73.74	730,026.00	
	CIELO SA	134,121	26.22	3,516,652.62	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	50,275	53.45	2,687,198.75	
	TIM PARTICIPACOES SA	89,277	13.35	1,191,847.95	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	20,100	23.00	462,300.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	29,400	19.79	581,826.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	101,173	7.45	753,738.85	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	35,000	35.42	1,239,700.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	40,100	13.73	550,573.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	19,800	36.00	712,800.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	20,100	69.31	1,393,131.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	17,000	20.26	344,420.00	
	ブラジルリアル 小計	5,454,162		147,571,998.44	(5,036,632,306)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	47,919	10,421.00	499,363,899.00	
	EMPRESAS CMPC SA	130,245	2,384.70	310,595,251.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	10,805	32,289.00	348,882,645.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	31,400	10,087.00	316,731,800.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	78,067	6,338.50	494,827,679.00	
	CENCOSUD SA	145,440	1,870.30	272,016,432.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	17,584	8,799.80	154,735,683.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	22,000	2,930.00	64,460,000.00	
	BANCO DE CHILE	2,561,915	103.68	265,619,347.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,119	46,660.00	238,852,540.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	7,467,266	50.10	374,110,026.00	
	ITAU CORPBANCA	14,192,300	6.02	85,551,184.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	17,574	7,297.10	128,239,235.00	
	AES GENER SA	260,100	190.59	49,572,459.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	239,300	406.08	97,174,944.00	
	COLBUN SA	958,889	149.54	143,392,261.00	

	ENEL AMERICAS SA	3,137,061	139.91	438,906,204.00	
	ENEL CHILE SA	2,251,641	77.90	175,402,833.00	
	ENEL GENERACION CHILE SA	372,759	587.23	218,895,267.00	
	チリペソ 小計	31,947,384		4,677,329,689.00 (852,209,469)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	5,214	68,000.00	354,552,000.00	
	S-OIL CORP	5,104	123,000.00	627,792,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,994	200,000.00	1,398,800,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	11,326	35,400.00	400,940,400.00	
	HYOSUNG CORPORATION	2,186	133,500.00	291,831,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	8,945	56,600.00	506,287,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	986	494,500.00	487,577,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,157	106,000.00	228,642,000.00	
	LG CHEM LTD	4,947	400,500.00	1,981,273,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	961	234,000.00	224,874,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	1,708	417,500.00	713,090,000.00	
	OCI CO LTD	1,883	156,000.00	293,748,000.00	
	POSCO	8,066	383,500.00	3,093,311,000.00	
	CJ CORP	1,568	179,500.00	281,456,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3,208	80,700.00	258,885,600.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	11,700	6,140.00	71,838,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,200	36,050.00	115,360,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	4,900	16,250.00	79,625,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,600	32,500.00	149,500,000.00	
	HANWHA CORPORATION	5,451	46,400.00	252,926,400.00	
	HANWHA TECHWIN CO LTD	3,400	32,950.00	112,030,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	6,991	44,250.00	309,351,750.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	8,030	43,450.00	348,903,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,634	139,000.00	505,126,000.00	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	1,097	455,500.00	499,683,500.00	
	KCC CORP	654	415,500.00	271,737,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,500	50,500.00	378,750,000.00	
	LG CORP	10,561	90,400.00	954,714,400.00	
	LOTTE CORP	2,834	69,100.00	195,829,400.00	
	POSCO DAEWOO CORP	4,198	24,250.00	101,801,500.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,409	140,000.00	1,177,260,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,644	9,500.00	262,618,000.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,408	313,500.00	1,068,408,000.00	
	SK NETWORKS CO LTD	12,100	6,420.00	77,682,000.00	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	2,040	41,050.00	83,742,000.00	
	S-1 CORPORATION	1,650	98,600.00	162,690,000.00	
	CJ LOGISTICS	730	144,500.00	105,485,000.00	

HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,125	143,500.00	304,937,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	5,796	37,450.00	217,060,200.00
PAN OCEAN CO LTD	19,000	5,780.00	109,820,000.00
HANKOOK TIRE CO LTD	8,476	55,800.00	472,960,800.00
HANON SYSTEMS	23,021	13,750.00	316,538,750.00
HYUNDAI MOBIS CO LTD	7,515	255,000.00	1,916,325,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,968	162,500.00	2,757,300,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	3,775	104,500.00	394,487,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,671	92,900.00	248,135,900.00
HYUNDAI WIA CORP	1,390	62,300.00	86,597,000.00
KIA MOTORS CORP	28,331	35,250.00	998,667,750.00
COWAY CO LTD	5,978	95,800.00	572,692,400.00
HANSSEM CO LTD	1,257	167,000.00	209,919,000.00
LG ELECTRONICS INC	11,450	101,000.00	1,156,450,000.00
KANGWON LAND INC	13,902	33,400.00	464,326,800.00
CHEIL WORLDWIDE INC	9,543	20,500.00	195,631,500.00
CJ E&M CORP	1,720	92,400.00	158,928,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,680	95,700.00	352,176,000.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,360	101,500.00	138,040,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,167	247,500.00	288,832,500.00
SHINSEGAE INC	882	357,500.00	315,315,000.00
BGF RETAIL CO LTD	933	214,000.00	199,662,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	4,963	28,600.00	141,941,800.00
E-MART INC	2,319	289,000.00	670,191,000.00
GS RETAIL CO LTD	2,340	39,150.00	91,611,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	843	353,000.00	297,579,000.00
KT&G CORP	12,362	105,000.00	1,298,010,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,149	125,000.00	268,625,000.00
OTTOGI CORPORATION	105	759,000.00	79,695,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,434	302,000.00	1,037,068,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	156,500.00	191,243,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	2,995	142,000.00	425,290,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,052	1,160,000.00	1,220,320,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	190	679,000.00	129,010,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,700	125,200.00	463,240,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW	74	125,200.00	9,264,800.00
CELLTRION INC	8,684	301,400.00	2,617,357,600.00
CELLTRION INC-NEW	163	301,400.00	49,128,200.00
HANMI PHARM CO LTD	686	563,000.00	386,218,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	1,704	102,000.00	173,808,000.00
MEDY-TOX INC	506	590,000.00	298,540,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,868	440,000.00	821,920,000.00

	SILLAJEN INC	6,052	104,200.00	630,618,400.00	
	YUHAN CORP	967	227,500.00	219,992,500.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	27,737	10,500.00	291,238,500.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	20,041	12,550.00	251,514,550.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	32,259	51,400.00	1,658,112,600.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	25,548	16,750.00	427,929,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	43,259	66,400.00	2,872,397,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	46,407	52,800.00	2,450,289,600.00	
	WOORI BANK	40,958	16,800.00	688,094,400.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,218	84,700.00	357,264,600.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	42,663	10,650.00	454,360,950.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	15,720	16,050.00	252,306,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	3,090	38,100.00	117,729,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	7,484	42,400.00	317,321,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	5,115	74,000.00	378,510,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,553	7,280.00	200,585,840.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	6,778	46,200.00	313,143,600.00	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,300	57,800.00	190,740,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,386	294,500.00	997,177,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	7,636	128,500.00	981,226,000.00	
	KAKAO CORP	3,488	143,500.00	500,528,000.00	
	NAVER CORP	3,054	905,000.00	2,763,870,000.00	
	NCSOFT CORP	1,830	438,500.00	802,455,000.00	
	NETMARBLE GAMES CORP	1,869	169,500.00	316,795,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,724	247,000.00	919,828,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	26,276	31,450.00	826,380,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,685	127,500.00	214,837,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,001	101,000.00	606,101,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,606	2,385,000.00	25,295,310,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,909	1,973,000.00	3,766,457,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,057	179,000.00	1,084,203,000.00	
	KT CORP	2,250	29,450.00	66,262,500.00	
	SK TELECOM	2,189	262,000.00	573,518,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,829	35,650.00	956,453,850.00	
	KOREA GAS CORPORATION	2,550	49,600.00	126,480,000.00	
	SK HYNIX INC	63,132	72,200.00	4,558,130,400.00	
	韓国ウォン 小計	955,903		98,401,146,640.00 (9,928,675,695)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	143,150	120.50	17,249,575.00	
	ASIA CEMENT CORP	259,281	29.50	7,648,789.50	
	CHINA STEEL CORP	1,365,947	24.80	33,875,485.60	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	314,430	107.00	33,644,010.00	

FORMOSA PLASTICS CORP	449,600	100.00	44,960,000.00
NAN YA PLASTICS CORP	512,557	79.80	40,902,048.60
TAIWAN CEMENT	413,706	37.90	15,679,457.40
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	480.00	6,240,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	337,138	26.35	8,883,586.30
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	24,755	377.00	9,332,635.00
TECO ELECTRIC & MACHINERY	238,000	28.00	6,664,000.00
CHINA AIRLINES LTD	373,000	12.15	4,531,950.00
EVA AIRWAYS CORP	179,142	15.45	2,767,743.90
EVERGREEN MARINE CORP LTD	251,318	16.80	4,222,142.40
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	228,000	23.55	5,369,400.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	221,413	51.30	11,358,486.90
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	16,728	294.00	4,918,032.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,926	135.00	5,930,010.00
FORMOSA TAFFETA CO.	111,000	32.00	3,552,000.00
GIANT MANUFACTURING	35,000	163.50	5,722,500.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	19,000	290.00	5,510,000.00
POU CHEN	228,500	38.65	8,831,525.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,000	51.00	2,397,000.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	33,000	370.00	12,210,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	62,000	291.00	18,042,000.00
STANDARD FOODS CORP	79,023	74.00	5,847,702.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	528,624	69.00	36,475,056.00
TAIMED BIOLOGICS INC	15,000	198.00	2,970,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	655,377	17.25	11,305,253.25
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,530,255	10.65	16,297,215.75
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,878,955	21.30	40,021,741.50
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,056,603	19.30	20,392,437.90
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,044,886	20.15	21,054,452.90
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	857,255	17.40	14,916,237.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,213,754	25.30	30,707,976.20
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,258,842	10.05	12,651,362.10
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,056,267	14.60	15,421,498.20
TAIWAN BUSINESS BANK	573,578	8.67	4,972,921.26
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	878,311	17.30	15,194,780.30
CHAILEASE HOLDING CO LTD	136,464	96.20	13,127,836.80
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	722,087	53.40	38,559,445.80
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,149,321	13.90	15,975,561.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	891,366	54.70	48,757,720.20
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	272,016	30.30	8,242,084.80
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	906,281	10.65	9,651,892.65
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	75,000	45.60	3,420,000.00

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	91,200	32.80	2,991,360.00
ACER INC	331,168	26.05	8,626,926.40
ADVANTECH CO LTD	36,676	225.50	8,270,438.00
ASUSTEK COMPUTER INC	73,774	282.50	20,841,155.00
AU OPTRONICS CORP	868,000	13.50	11,718,000.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	71,000	353.50	25,098,500.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	69,419	75.80	5,261,960.20
COMPAL ELECTRONICS	448,775	21.40	9,603,785.00
DELTA ELECTRONICS INC	213,220	147.00	31,343,340.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	97,042	84.10	8,161,232.20
GENERAL INTERFACE SOLUTION	17,000	202.00	3,434,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,696,840	95.20	161,539,168.00
HTC CORP	84,744	70.60	5,982,926.40
INNOLUX CORP	1,004,112	13.70	13,756,334.40
INVENTEC CORP	281,429	23.70	6,669,867.30
LARGAN PRECISION CO LTD	10,820	3,980.00	43,063,600.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	213,160	41.95	8,942,062.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	81,000	94.60	7,662,600.00
PEGATRON CORP	219,976	77.60	17,070,137.60
QUANTA COMPUTER INC	281,150	64.00	17,993,600.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	170,193	40.20	6,841,758.60
WISTRON CORP	281,141	24.20	6,803,612.20
WPG HOLDINGS LTD	171,400	38.50	6,598,900.00
YAGEO CORPORATION	21,000	400.00	8,400,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	40,000	67.00	2,680,000.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	381,000	10.00	3,810,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	401,000	109.00	43,709,000.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	183,000	75.90	13,889,700.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	173,400	109.00	18,900,600.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	694,589	41.70	28,964,361.30
GLOBALWAFERS CO LTD	25,000	445.00	11,125,000.00
MACRONIX INTERNATIONAL	186,000	46.10	8,574,600.00
MEDIATEK INC	161,236	304.50	49,096,362.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	64,000	79.60	5,094,400.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	63,000	130.50	8,221,500.00
PHISON ELECTRONICS CORP	14,000	301.00	4,214,000.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	84,300	95.20	8,025,360.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	41,703	116.00	4,837,548.00
SILICONWARE PRECISION INDS	217,000	50.30	10,915,100.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,677,000	259.50	694,681,500.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,250,000	14.55	18,187,500.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	110,000	65.00	7,150,000.00

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	35,000	263.00	9,205,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	303,000	23.40	7,090,200.00
	ニュー台湾ドル 小計	36,638,323		2,111,452,548.71 (7,939,061,583)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	78,728	477.15	37,565,065.20
	COAL INDIA LTD	72,972	290.35	21,187,420.20
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	62,316	374.50	23,337,342.00
	INDIAN OIL CORP LTD	59,408	408.65	24,277,079.20
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	151,258	192.70	29,147,416.60
	PETRONET LNG LTD	46,400	243.30	11,289,120.00
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	284,277	904.35	257,085,904.95
	ACC LTD	5,580	1,679.80	9,373,284.00
	AMBUJA CEMENTS LTD	63,614	259.55	16,511,013.70
	ASIAN PAINTS LTD	31,197	1,137.90	35,499,066.30
	GRASIM INDUSTRIES LTD	37,029	1,128.85	41,800,186.65
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,360	249.85	30,321,796.00
	JSW STEEL LTD	89,367	299.00	26,720,733.00
	SHREE CEMENT LTD	895	17,038.40	15,249,368.00
	TATA STEEL LTD	32,661	670.45	21,897,567.45
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,165	4,179.45	42,484,109.25
	UPL LTD	40,466	733.05	29,663,601.30
	VEDANTA LTD	165,274	334.30	55,251,098.20
	ASHOK LEYLAND LTD	130,037	122.30	15,903,525.10
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	121,084	93.50	11,321,354.00
	EICHER MOTORS LTD	1,401	27,811.75	38,964,261.75
	HAVELLS INDIA LTD	28,929	509.60	14,742,218.40
	LARSEN & TOUBRO LTD	52,669	1,415.45	74,550,336.05
	SIEMENS LTD	8,272	1,292.85	10,694,455.20
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	82,476	417.95	34,470,844.20
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,787	1,337.70	5,065,869.90
	BAJAJ AUTO LTD	9,613	3,241.30	31,158,616.90
	BHARAT FORGE LTD	23,964	690.80	16,554,331.20
	BOSCH LTD	793	19,474.40	15,443,199.20
	HERO MOTOCORP LTD	5,182	3,623.45	18,776,717.90
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	79,759	770.25	61,434,369.75
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,403	8,990.60	102,519,811.80
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	65,010	352.05	22,886,770.50	
TATA MOTORS LTD	181,263	383.75	69,559,676.25	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	35,000	214.20	7,497,000.00	
TITAN CO LTD	33,047	822.20	27,171,243.40	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	57,513	586.10	33,708,369.30	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,000	4,726.45	14,179,350.00	

ITC LTD	377,864	275.35	104,044,852.40
NESTLE INDIA LTD	2,499	7,135.45	17,831,489.55
UNITED SPIRITS LTD	6,812	3,182.30	21,677,827.60
DABUR INDIA LTD	57,083	344.45	19,662,239.35
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	24,662	1,051.60	25,934,559.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	71,650	1,372.20	98,318,130.00
MARICO LTD	53,035	304.50	16,149,157.50
AUROBINDO PHARMA LTD	27,351	605.45	16,559,662.95
CADILA HEALTHCARE LTD	27,181	410.85	11,167,313.85
CIPLA LTD	35,859	581.15	20,839,457.85
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,764	2,123.55	27,104,992.20
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	12,600	589.55	7,428,330.00
LUPIN LTD	26,667	847.00	22,586,949.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	8,151	2,648.65	21,589,146.15
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	102,917	551.20	56,727,850.40
AXIS BANK LTD	197,190	564.90	111,392,631.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	165,204	1,903.85	314,523,635.40
ICICI BANK LTD	253,955	335.10	85,100,320.50
IDFC BANK LTD	120,000	52.70	6,324,000.00
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	34,003	1,319.60	44,870,358.80
LIC HOUSING FINANCE LTD	31,322	511.90	16,033,731.80
STATE BANK OF INDIA	185,208	297.35	55,071,598.80
YES BANK LTD	181,130	349.05	63,223,426.50
BAJAJ FINANCE LTD	16,823	1,628.90	27,402,984.70
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	33,735	446.35	15,057,617.25
POWER FINANCE CORPORATION	89,431	110.95	9,922,369.45
RURAL ELECTRIFICATION CORP	87,685	145.40	12,749,399.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	16,355	1,321.90	21,619,674.50
BAJAJ FINSERV LTD	4,020	4,935.75	19,841,715.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	60,423	990.90	59,873,150.70
INFOSYS LTD	195,065	1,143.25	223,008,061.25
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	50,461	3,153.65	159,136,332.65
TECH MAHINDRA LTD	49,066	619.45	30,393,933.70
VAKRANGEE LTD	41,800	262.65	10,978,770.00
WIPRO LTD	129,679	300.60	38,981,507.40
BHARTI AIRTEL LTD	129,153	422.35	54,547,769.55
BHARTI INFRATEL LTD	68,727	344.85	23,700,505.95
IDEA CELLULAR LTD	163,526	88.30	14,439,345.80
GAIL INDIA LTD	53,768	466.45	25,080,083.60
NTPC LTD	183,584	165.20	30,328,076.80
TATA POWER CO LTD	144,584	84.80	12,260,723.20
	5,820,161		3,328,747,174.10

インドルピー 小計				(5,758,732,611)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,864	933.00	8,270,112.00
	MONETA MONEY BANK AS	57,129	85.00	4,855,965.00
	O2 CZECH REPUBLIC AS	9,494	280.00	2,658,320.00
	CEZ AS	16,855	528.00	8,899,440.00
チェココルナ 小計		92,342		24,683,837.00 (133,786,396)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	538,294	2,665.00	1,434,553,510.00
	CEMENTOS ARGOS SA	50,956	11,440.00	582,936,640.00
	GRUPO ARGOS SA	32,301	21,300.00	688,011,300.00
	BANCOLOMBIA SA	33,198	32,100.00	1,065,655,800.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	44,628	32,080.00	1,431,666,240.00
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	400,277	1,285.00	514,355,945.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	31,873	40,800.00	1,300,418,400.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	5,983	38,300.00	229,148,900.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	45,615	14,700.00	670,540,500.00
コロンビアペソ 小計		1,183,125		7,917,287,235.00 (306,399,015)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	42,150	3,040.00	128,136,000.00
	RICHTER GEDEON NYRT	16,549	6,405.00	105,996,345.00
	OTP BANK PLC	25,561	11,460.00	292,929,060.00
ハンガリーフォリント 小計		84,260		527,061,405.00 (232,855,728)
アラブディルハム	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	260,000	0.63	163,800.00
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	220,831	7.22	1,594,399.82
	DUBAI ISLAMIC BANK	138,060	6.20	855,972.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	153,829	11.30	1,738,267.70
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	153,000	2.40	367,200.00
	ALDAR PROPERTIES PJSC	353,653	2.27	802,792.31
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	160,000	3.31	529,600.00
	EMAAR MALLS PJSC	256,775	2.27	582,879.25
	EMAAR PROPERTIES PJSC	366,395	6.54	2,396,223.30
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	182,353	17.50	3,191,177.50
アラブディルハム 小計		2,244,896		12,222,311.88 (366,302,687)
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	8,600	56.90	489,340.00
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	33,416	103.15	3,446,860.40
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	181,261	6.59	1,194,509.99
	GRUPA AZOTY SA	6,391	69.50	444,174.50
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	4,700	99.60	468,120.00
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,870	108.50	1,721,895.00
	CCC SA	3,290	280.00	921,200.00

	LPP SA	139	9,950.00	1,383,050.00
	CYFROWY POLSAT SA	26,995	24.02	648,419.90
	DINO POLSKA SA	4,500	88.20	396,900.00
	ALIOR BANK SA	10,598	86.35	915,137.30
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	5,658	85.20	482,061.60
	BANK MILLENNIUM SA	76,012	9.40	714,512.80
	BANK PEKAO SA	16,845	133.55	2,249,649.75
	BANK ZACHODNI WBK SA	4,028	420.00	1,691,760.00
	MBANK SA	1,716	500.50	858,858.00
	PKO BANK POLSKI SA	103,404	45.00	4,653,180.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	65,857	43.50	2,864,779.50
	CD PROJEKT SA	6,700	113.40	759,780.00
	ORANGE POLSKA SA	57,240	5.84	334,281.60
	PLAY COMMUNICATIONS SA	14,900	33.20	494,680.00
	PGE SA	87,510	11.94	1,044,869.40
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	95,940	3.08	295,495.20
	ポーランドズロチ 小計	831,570		28,473,514.94 (934,500,760)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	25,153	144.00	3,622,032.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,900	355.20	1,740,480.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,703	129.71	5,279,586.13
	GOLD FIELDS LTD	85,465	51.60	4,409,994.00
	KUMBA IRON ORE LTD	6,900	345.00	2,380,500.00
	MONDI LTD	12,149	323.96	3,935,790.04
	SAPPI LIMITED	56,542	86.74	4,904,453.08
	SASOL LTD	60,437	418.27	25,278,983.99
	SIBANYE GOLD LTD	192,319	13.45	2,586,690.55
	BIDVEST GROUP LTD	37,152	237.75	8,832,888.00
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	308,060	6.58	2,027,034.80
	NASPERS LTD-N SHS	47,781	3,246.00	155,097,126.00
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,915	271.55	4,593,268.25
	MR PRICE GROUP LTD	27,874	270.94	7,552,181.56
	THE FOSCHINI GROUP LTD	22,531	186.75	4,207,664.25
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	47,220	96.38	4,551,063.60
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	109,873	63.19	6,942,874.87
	BID CORP LTD	36,142	275.00	9,939,050.00
	PICK N PAY STORES LTD	42,191	66.49	2,805,279.59
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	47,922	240.36	11,518,531.92
	SPAR GROUP LIMITED/THE	21,107	199.26	4,205,780.82
	PIONEER FOODS GROUP LTD	17,184	129.68	2,228,421.12
TIGER BRANDS LTD	17,695	467.01	8,263,741.95	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	142,938	27.09	3,872,190.42	

	NETCARE LTD	120,289	26.00	3,127,514.00
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	41,510	262.54	10,898,035.40
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	71,709	181.99	13,050,320.91
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,393	924.27	4,060,318.11
	NEDBANK GROUP LTD	25,687	264.00	6,781,368.00
	STANDARD BANK GROUP LTD	141,258	203.13	28,693,737.54
	BRAIT SE	33,120	38.85	1,286,712.00
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	30,502	78.87	2,405,692.74
	FIRSTRAND LTD	366,528	66.40	24,337,459.20
	INVESTEC LTD	30,241	93.38	2,823,904.58
	PSG GROUP LTD	11,156	231.50	2,582,614.00
	REMGRO LTD	56,307	232.59	13,096,445.13
	RMB HOLDINGS LTD	82,310	78.74	6,481,089.40
	DISCOVERY LTD	40,296	166.60	6,713,313.60
	LIBERTY HOLDINGS LTD	17,401	130.74	2,275,006.74
	MMI HOLDINGS LTD	128,397	22.25	2,856,833.25
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	78,513	44.61	3,502,464.93
	SANLAM LTD	153,877	88.95	13,687,359.15
	NEPI ROCKCASTLE PLC	39,514	133.41	5,271,562.74
	MTN GROUP LTD	185,364	131.10	24,301,220.40
	TELKOM SA SOC LTD	24,490	50.10	1,226,949.00
	VODACOM GROUP LTD	64,693	165.06	10,678,226.58
	南アフリカランド 小計	3,174,708		480,913,754.34 (4,385,933,439)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	13,031	112.60	1,467,290.60
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	143,073	10.04	1,436,452.92
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	62,700	7.78	487,806.00
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	18,000	32.86	591,480.00
	KOC HOLDING AS	78,940	18.17	1,434,339.80
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	112,856	4.87	549,608.72
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	14,000	21.58	302,120.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	61,133	16.63	1,016,641.79
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,460	61.05	394,383.00
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	16,554	31.56	522,444.24
	ARCELIC AS	29,629	19.40	574,802.60
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,976	74.00	1,774,224.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	27,231	28.06	764,101.86
	COCA-COLA ICECEK AS	6,400	35.24	225,536.00
	ULKER BISKUVI SANAYI	23,160	23.60	546,576.00
	AKBANK T.A.S.	227,815	10.65	2,426,229.75
	TURKIYE GARANTI BANKASI	241,254	12.02	2,899,873.08
	TURKIYE HALK BANKASI	56,840	9.99	567,831.60

	TURKIYE IS BANKASI-C	168,876	7.87	1,329,054.12	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	65,670	7.30	479,391.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	74,500	4.56	339,720.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	94,696	11.21	1,061,542.16	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	76,648	6.28	481,349.44	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	129,733	15.45	2,004,374.85	
	トルコリラ 小計	1,773,175		23,677,173.53	(690,189,608)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,850	23.65	91,052.50	
	OPAP SA	23,143	10.73	248,324.39	
	FF GROUP	5,889	19.00	111,891.00	
	JUMBO SA	12,381	16.06	198,838.86	
	ALPHA BANK AE	158,150	2.10	332,115.00	
	EUROBANK ERGASIAS SA	203,876	0.91	185,527.16	
	NATIONAL BANK OF GREECE	572,412	0.33	193,704.22	
	PIRAEUS BANK S.A	29,079	3.90	113,408.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,539	12.27	313,363.53	
	ユーロ 小計	1,034,319		1,788,224.76	(244,593,382)
カタールリアル	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	23,470	17.41	408,612.70	
	INDUSTRIES QATAR	16,223	106.50	1,727,749.50	
	COMMERCIAL BANK QSC	21,639	27.99	605,675.61	
	DOHA BANK QPSC	12,420	32.55	404,271.00	
	MASRAF AL RAYAN	38,797	39.27	1,523,558.19	
	QATAR ISLAMIC BANK	7,135	97.11	692,879.85	
	QATAR NATIONAL BANK	24,452	134.00	3,276,568.00	
	QATAR INSURANCE CO	14,092	49.52	697,835.84	
	BARWA REAL ESTATE CO	8,300	36.70	304,610.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	84,250	10.82	911,585.00	
	OOREDOO QPSC	8,931	91.00	812,721.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,479	185.00	643,615.00	
	カタールリアル 小計	263,188		12,009,681.69	(363,172,774)
	合計	816,218,061		68,769,938,240	(68,769,938,240)

(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
----	----	----	----	-----	----

メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	328,300	9,629,039.00	
メキシコペソ合計			328,300	9,629,039.00 (56,907,620)	
南アフリカランド	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	93,800	1,596,476.00	
		FORTRESS REIT LTD-B	89,509	2,237,725.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	242,610	6,572,304.90	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	28,577	3,149,756.94	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	568,113	5,879,969.55	
		RESILIENT REIT LTD	30,408	3,253,656.00	
南アフリカランド合計			1,053,017	22,689,888.39 (206,931,782)	
トルコリラ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	264,620	693,304.40	
トルコリラ合計			264,620	693,304.40 (20,209,823)	
合計				284,049,225 (284,049,225)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()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

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 43銘柄	100.00%		11.54%
香港ドル	株式 138銘柄	100.00%		23.35%
マレーシアリングgit	株式 46銘柄	100.00%		2.40%
タイバーツ	株式 33銘柄	100.00%		2.32%
フィリピンペソ	株式 23銘柄	100.00%		1.05%
インドネシアルピア	株式 29銘柄	100.00%		2.20%
メキシコペソ	株式 25銘柄	97.22%		2.88%
	投資証券 1銘柄		2.78%	0.08%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	100.00%		7.29%
チリペソ	株式 19銘柄	100.00%		1.23%
韓国ウォン	株式 115銘柄	100.00%		14.38%
ニュー台湾ドル	株式 90銘柄	100.00%		11.50%
インドルピー	株式 79銘柄	100.00%		8.34%
チェココルナ	株式 4銘柄	100.00%		0.19%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	100.00%		0.44%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%		0.34%
アラブディルハム	株式 10銘柄	100.00%		0.53%

ポーランドズロチ	株式	23銘柄	100.00%		1.35%
南アフリカランド	株式	46銘柄	95.49%		6.35%
	投資証券	6銘柄		4.51%	0.30%
トルコリラ	株式	24銘柄	97.16%		1.00%
	投資証券	1銘柄		2.84%	0.03%
ユーロ	株式	9銘柄	100.00%		0.35%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.00%		0.53%

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。

アセアン真成長株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	5,727,714
コール・ローン	85,056,277
株式	2,699,586,567
派生商品評価勘定	2,002
未収配当金	669,888
流動資産合計	2,791,042,448
資産合計	2,791,042,448
負債の部	
流動負債	
未払解約金	874
未払利息	129
流動負債合計	1,003
負債合計	1,003
純資産の部	
元本等	
元本	2,222,551,722
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	568,489,723
元本等合計	2,791,041,445
純資産合計	2,791,041,445
負債純資産合計	2,791,042,448

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。 新株予約権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	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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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30年 2月 5日現在]
1. 期首	平成29年 3月27日
期首元本額	1,033,643,370円
期中追加設定元本額	1,712,687,707円
期中一部解約元本額	523,779,355円
元本の内訳	
海外株式セレクション(ラップ向け)	60,223,696円
アセアン真成長株式ファンド	2,121,089,922円
アセアン真成長株式ファンド(ラップ向け)	21,319,990円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	3,025,022円
アドバンスト・バランス (FOFs用)(適格機関投資家限定)	16,893,092円
合計	2,222,551,722円
2. 受益権の総数	2,222,551,722口

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29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。

区分	自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5日
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>当ファンドは、新株予約権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。</p> <p>当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。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> <p>また、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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月 5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <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>(2) デリバティブ取引</p> <p>デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</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>
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	166,026,248
合計	166,026,248

(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

通貨関連

[平成30年 2月 5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	タイパーツ	3,038,951		3,036,949	2,002
	合計	3,038,951		3,036,949	2,002

(注)時価の算定方法

- 1 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。

- 2 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。

(1口当たり情報)

	[平成30年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.2558円
(1万口当たり純資産額)	(12,558円)

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	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	100,400	8.71	874,484.00	
	SATS LTD	73,400	5.48	402,232.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	408,800	1.33	543,704.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	104,400	26.68	2,785,392.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	181,500	12.81	2,325,015.00	
	APAC REALTY LTD	374,000	1.05	392,700.00	
	CAPITALAND LTD	179,500	3.72	667,740.00	
	GUOCOLAND LTD	188,100	2.22	417,582.00	
	HI-P INTERNATIONAL LTD	110,300	1.98	218,394.00	
	VALUETRONICS HOLDINGS LTD	624,500	0.99	618,255.00	
	VENTURE CORP LTD	28,100	23.57	662,317.00	
シンガポールドル 小計		2,373,000		9,907,815.00 (824,825,598)	
マレーシアリングット	SERBA DINAMIK HOLDINGS BHD	214,800	3.51	753,948.00	
	SCIENTEX BHD	245,200	8.69	2,130,788.00	
	ECONPILE HOLDINGS BHD	1,186,850	1.23	1,459,825.50	
	GENTING MALAYSIA BHD	202,100	5.54	1,119,634.00	
	HAI-O ENTERPRISE BHD	215,000	5.36	1,152,400.00	
	PADINI HOLDINGS BERHAD	162,700	5.19	844,413.00	
	QL RESOURCES BHD	361,250	4.83	1,744,837.50	
	MY EG SERVICES BHD	301,000	2.46	740,460.00	
	INARI AMERTRON BHD	575,950	3.17	1,825,761.50	
	V.S. INDUSTRY BERHAD	615,300	3.03	1,864,359.00	
マレーシアリングット 小計		4,080,150		13,636,426.50 (384,547,227)	
タイバーツ	PTT PCL-NVDR	44,800	502.00	22,489,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	149,900	102.00	15,289,800.00	
	PYLON PCL-NVDR	407,300	16.40	6,679,720.00	
	TPI POLENE POWER PCL-NVDR	2,335,400	8.00	18,683,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	188,400	70.00	13,188,000.00	
	MK RESTAURANTS GROUP - NVDR	103,400	85.75	8,866,550.00	
	RS PCL-NVDR	296,200	31.50	9,330,300.00	
	CP ALL PCL-NVDR	222,900	79.75	17,776,275.00	
	BANGKOK CHAIN HOSPITAL-NVDR	806,800	16.50	13,312,200.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	96,300	155.50	14,974,650.00	
	MUANGTHAI LEASING PCL-NVDR	370,600	41.75	15,472,550.00	
	AMATA CORP PUBLIC COLTD-NVDR	331,700	25.50	8,458,350.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	308,200	29.25	9,014,850.00	

	タイパーツ 小計	5,661,900		173,536,045.00 (605,640,797)	
フィリピンペソ	MEGAWIDE CONSTRUCTION CORP	719,700	21.50	15,473,550.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	111,360	294.00	32,739,840.00	
	WILCON DEPOT INC	2,440,000	9.62	23,472,800.00	
	BDO UNIBANK INC	149,900	153.50	23,009,650.00	
	AYALA LAND INC	857,600	45.85	39,320,960.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	644,900	36.95	23,829,055.00	
	フィリピンペソ 小計	4,923,460		157,845,855.00 (336,211,671)	
インドネシアルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	209,600	39,200.00	8,216,320,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	1,220,000	2,810.00	3,428,200,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	1,424,800	2,810.00	4,003,688,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	7,689,800	1,350.00	10,381,230,000.00	
	MITRA ADIPERKASA TBK PT	621,100	7,225.00	4,487,447,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	143,700	55,025.00	7,907,092,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,671,400	3,740.00	17,471,036,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	6,404,700	685.00	4,387,219,500.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,185,700	4,000.00	4,742,800,000.00	
	インドネシアルピア 小計	23,570,800		65,025,033,500.00 (533,205,274)	
ベトナムドン	GEMADEPT CORP	75,000	42,100.00	3,157,500,000.00	
	ベトナムドン 小計	75,000		3,157,500,000.00 (15,156,000)	
	合 計	40,684,310		2,699,586,567 (2,699,586,567)	

(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

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
シンガポールドル	株式 11銘柄	100.00%	30.55%
マレーシアリングット	株式 10銘柄	100.00%	14.24%
タイパーツ	株式 13銘柄	100.00%	22.43%
フィリピンペソ	株式 6銘柄	100.00%	12.45%
インドネシアルピア	株式 9銘柄	100.00%	19.75%

ベトナムドン	株式	1銘柄	100.00%	0.56%
--------	----	-----	---------	-------

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。

好配当海外株マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[平成30年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	65,997,283
コール・ローン	43,796,456
株式	3,855,082,363
未収配当金	1,936,029
流動資産合計	3,966,812,131
資産合計	3,966,812,131
負債の部	
流動負債	
未払解約金	22,558
未払利息	66
流動負債合計	22,624
負債合計	22,624
純資産の部	
元本等	
元本	2,783,067,113
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,183,722,394
元本等合計	3,966,789,507
純資産合計	3,966,789,507
負債純資産合計	3,966,812,131

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。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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30年 2月 5日現在]
1. 期首	平成29年 3月27日
期首元本額	5,366,558,915円
期中追加設定元本額	956,544,514円
期中一部解約元本額	3,540,036,316円
元本の内訳	
海外株式セレクション（ラップ向け）	801,223,127円
三菱UFJ バランスインカム・グローバル（毎月決算型）	1,121,265,129円
好配当海外株ファンド（ラップ向け）	164,255,021円
世界の好配当利回り株ファンド（毎月決算型）	14,384,026円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	36,519,817円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	197,207,901円
MUAM 好配当海外株ファンド2010-11（適格機関投資家限定）	448,212,092円
合計	2,783,067,113円
2. 受益権の総数	2,783,067,113口

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29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。
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、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。
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月 5日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 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。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	64,147,665
合計	64,147,665

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

[平成30年 2月 5日現在]	
1口当たり純資産額	1.4253円
(1万口当たり純資産額)	(14,253円)

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	CHEVRON CORP	2,149	118.58	254,828.42	
	EXXON MOBIL CORP	3,944	84.53	333,386.32	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,206	112.17	247,447.02	
	EATON CORP PLC	4,484	85.09	381,543.56	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,610	96.04	346,704.40	
	MACY'S INC	11,702	24.89	291,262.78	
	TARGET CORP	3,447	72.95	251,458.65	
	GENERAL MILLS INC	4,836	55.95	270,574.20	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,421	103.44	353,868.24	
	KIMBERLY-CLARK CORP	2,346	116.21	272,628.66	
	ABBVIE INC	3,797	115.17	437,300.49	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	11,247	19.63	220,778.61	
	CME GROUP INC	2,350	159.11	373,908.50	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,688	66.35	311,048.80	
	HP INC	16,443	22.48	369,638.64	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,630	52.98	245,297.40	
	ALLIANT ENERGY CORP	6,409	38.91	249,374.19	
	AMEREN CORPORATION	6,162	54.89	338,232.18	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	4,921	67.75	333,397.75	
	CMS ENERGY CORP	7,360	43.48	320,012.80	
	DOMINION ENERGY INC	3,893	75.68	294,622.24	
	EXELON CORP	6,525	37.72	246,123.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	5,097	62.01	316,064.97	
XCEL ENERGY INC	5,749	44.48	255,715.52		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	6,658	60.54	403,075.32		
QUALCOMM INC	5,290	66.07	349,510.30		
アメリカドル 小計		143,364		8,067,802.96 (886,651,545)	
カナダドル	TRANSCANADA CORP	6,700	55.11	369,237.00	
	BANK OF MONTREAL	4,000	100.21	400,840.00	

	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,700	119.00	321,300.00
	ROYAL BANK OF CANADA	3,000	103.55	310,650.00
	TORONTO-DOMINION BANK	5,700	73.94	421,458.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	9,600	25.27	242,592.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	8,200	52.87	433,534.00
	FIRST CAPITAL REALTY INC	15,600	20.02	312,312.00
	BCE INC	5,200	56.37	293,124.00
	EMERA INC	6,600	44.03	290,598.00
	FORTIS INC	7,400	42.55	314,870.00
	カナダドル 小計	74,700		3,710,515.00 (328,343,472)
オーストラリア ドル	WOODSIDE PETROLEUM LTD	9,764	34.24	334,319.36
	ALUMINA LTD	89,760	2.39	214,526.40
	AMCOR LIMITED	14,206	14.52	206,271.12
	BHP BILLITON LIMITED	13,474	30.81	415,133.94
	BORAL LTD	40,051	8.13	325,614.63
	INCITEC PIVOT LTD	85,657	3.73	319,500.61
	RIO TINTO LTD	4,321	78.25	338,118.25
	CIMIC GROUP LTD	7,763	48.50	376,505.50
	AURIZON HOLDINGS LTD	74,861	4.70	351,846.70
	CROWN RESORTS LTD	23,982	13.77	330,232.14
	TABCORP HOLDINGS LTD	47,760	5.21	248,829.60
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	70,139	4.49	314,924.11
	WESFARMERS LTD	6,020	44.15	265,783.00
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,893	24.65	367,112.45
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	5,821	80.79	470,278.59
	WESTPAC BANKING CORP	13,892	31.70	440,376.40
	CHALLENGER LTD	35,843	13.72	491,765.96
	MACQUARIE GROUP LTD	3,667	104.99	384,998.33
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	46,962	7.38	346,579.56
	MEDIBANK PRIVATE LTD	144,207	3.25	468,672.75
TELSTRA CORP LTD	55,776	3.67	204,697.92	
AUSNET SERVICES	199,586	1.70	340,294.13	
	オーストラリアドル 小計	1,008,405		7,556,381.45 (657,707,441)
イギリスポンド	BAE SYSTEMS PLC	42,046	5.91	248,828.22
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,986	5.74	201,029.55
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,349	38.98	247,484.02
	PERSIMMON PLC	11,186	25.04	280,097.44
	TAYLOR WIMPEY PLC	104,201	1.89	197,148.29
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,198	47.60	247,424.80
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	64,767	3.74	242,811.48

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	74,296	2.68	199,707.64	
	NATIONAL GRID PLC	30,656	7.91	242,611.58	
	イギリスポンド 小計	373,685		2,107,143.02	(326,923,239)
スイスフラン	SWISS RE AG	3,277	92.22	302,204.94	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,781	89.80	249,733.80	
	スイスフラン 小計	6,058		551,938.74	(65,145,329)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	17,000	105.20	1,788,400.00	
	NWS HOLDINGS LTD	128,000	15.16	1,940,480.00	
	WYNN MACAU LTD	113,600	26.90	3,055,840.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	72,500	39.70	2,878,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	15,100	184.10	2,779,910.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	42,500	74.60	3,170,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	52,250	53.80	2,811,050.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	70,000	45.25	3,167,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	80,500	37.60	3,026,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	133.30	2,532,700.00	
	PCCW LTD	279,000	4.43	1,235,970.00	
	CLP HOLDINGS LTD	29,500	79.90	2,357,050.00	
	香港ドル 小計	918,950		30,744,450.00	(431,959,522)
シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	81,800	3.35	274,030.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	103,500	2.14	221,490.00	
	SATS LTD	54,000	5.48	295,920.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	82,900	2.68	222,172.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	20,200	26.68	538,936.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,000	8.16	261,120.00	
	CAPITALAND LTD	116,500	3.72	433,380.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	60,800	3.49	212,192.00	
	シンガポールドル 小計	551,700		2,459,240.00	(204,731,730)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	56,534	6.65	375,951.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	95,670	3.57	342,020.25	
	ニュージーランドドル 小計	152,204		717,971.35	(57,610,021)
スウェーデンクローネ	SKANSKA AB-B SHS	16,119	163.25	2,631,426.75	
	SWEDBANK AB - A SHARES	13,452	201.10	2,705,197.20	
	スウェーデンクローネ 小計	29,571		5,336,623.95	(74,072,340)
ノルウェークローネ	MARINE HARVEST	19,938	139.40	2,779,357.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,629	145.50	2,565,019.50	
		37,567		5,344,376.70	

ノルウェークローネ 小計				(75,729,817)
デンマーククローネ	DANSKE BANK A/S	8,330	244.90	2,040,017.00
デンマーククローネ 小計		8,330		2,040,017.00 (37,495,512)
ユーロ	ENAGAS SA	13,222	21.75	287,578.50
	REPSOL SA	14,567	15.04	219,087.68
	UPM-KYMMENE OYJ	10,184	27.82	283,318.88
	ORION OYJ-CLASS B	6,149	32.23	198,182.27
	BNP PARIBAS	4,708	66.00	310,728.00
	CREDIT AGRICOLE SA	21,275	15.03	319,869.62
	KBC GROEP NV	4,659	77.32	360,233.88
	SOCIETE GENERALE SA	4,961	45.92	227,833.92
	NATIXIS	47,009	7.28	342,601.59
	ALLIANZ SE-REG	1,301	200.35	260,655.35
	HANNOVER RUECK SE	2,932	110.80	324,865.60
	NN GROUP NV	9,398	38.22	359,191.56
	SCOR SE	6,008	36.16	217,249.28
	ELISA OYJ	8,900	35.80	318,620.00
	ORANGE	20,332	14.16	287,901.12
	ENDESA SA	14,401	17.51	252,161.51
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,326	17.08	295,928.08	
TERNA SPA	66,666	4.73	315,396.84	
ユーロ 小計		273,998		5,181,403.68 (708,712,395)
合 計		3,578,532		3,855,082,363 (3,855,082,363)

(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

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 26銘柄	100.00%	23.00%
カナダドル	株式 11銘柄	100.00%	8.52%
オーストラリアドル	株式 22銘柄	100.00%	17.06%
イギリスポンド	株式 9銘柄	100.00%	8.48%
スイスフラン	株式 2銘柄	100.00%	1.69%

香港ドル	株式	12銘柄	100.00%	11.20%
シンガポールドル	株式	8銘柄	100.00%	5.31%
ニュージーランドドル	株式	2銘柄	100.00%	1.49%
スウェーデンクローネ	株式	2銘柄	100.00%	1.92%
ノルウェークローネ	株式	2銘柄	100.00%	1.96%
デンマーククローネ	株式	1銘柄	100.00%	0.97%
ユーロ	株式	18銘柄	100.00%	18.38%

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。

AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[平成30年 2月 5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	17,422,004
コール・ローン	27,150,232
株式	718,676,236
投資証券	85,539,168
未収入金	137,716
未収配当金	2,188,111
流動資産合計	851,113,467
資産合計	851,113,467
負債の部	
流動負債	
未払金	2,271,380
未払利息	41
流動負債合計	2,271,421
負債合計	2,271,421
純資産の部	
元本等	
元本	729,102,434
剰余金	
剰余金又は欠損金()	119,739,612
元本等合計	848,842,046
純資産合計	848,842,046
負債純資産合計	851,113,467

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	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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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30年 2月 5日現在]
1. 期首	平成29年 3月27日
期首元本額	760,128,975円
期中追加設定元本額	186,651,923円
期中一部解約元本額	217,678,464円
元本の内訳	
AMP グローバル・インフラ株式ファンド(ラップ向け)	36,848,578円
海外株式セレクション(ラップ向け)	162,914,745円
AMP グローバル・インフラ株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家限定)	529,339,111円
合計	729,102,434円
2. 受益権の総数	729,102,434口

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29年 3月27日 至 平成30年 2月 5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。
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。 当ファンドは、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。

区分	自 平成29年 3月27日 至 平成30年 2月 5日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。</p> <p>また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。</p> <p>当ファンドは、ファンドの運用の指図に関する権限を再委託しております。この場合、再委託先で投資リスクに対する管理体制を構築しているほか、当該再委託先のリスクの管理体制や管理状況の確認を委託会社で行っております。</p>

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 2月 5日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 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>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[平成30年 2月 5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	46,265,863
投資証券	16,366,435
合計	29,899,428

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[平成30年 2月 5日現在]
1口当たり純資産額	1.1642円
(1万口当たり純資産額)	(11,642円)

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	ENBRIDGE ENERGY MANAGEMENT L	15,439	13.15	203,022.85	
	KINDER MORGAN INC	31,400	17.50	549,500.00	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,177	20.56	85,879.12	
	WILLIAMS COS INC	11,400	30.70	349,980.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO CEN-ADR	4,300	40.87	175,741.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,300	81.22	105,586.00	
	EDISON INTERNATIONAL	1,900	61.60	117,040.00	
	EVERSOURCE ENERGY	1,200	59.35	71,220.00	
	GREAT PLAINS ENERGY INC	4,500	30.17	135,765.00	
	NISOURCE INC	2,600	23.97	62,322.00	
	P G & E CORP	2,900	41.44	120,176.00	
	SEMPRA ENERGY	3,900	105.58	411,762.00	
アメリカドル 小計		85,016		2,387,993.97 (262,440,537)	
カナダドル	ENBRIDGE INC	15,005	43.11	646,865.55	
	KINDER MORGAN CANADA LTD	12,300	17.01	209,223.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,428	40.79	343,778.12	
	TRANSCANADA CORP	10,221	55.11	563,279.31	

	カナダドル 小計	45,954		1,763,145.98 (156,020,787)
オーストラリアドル	MACQUARIE ATLAS ROADS GROUP	33,165	5.59	185,392.35
	APA GROUP	38,384	8.29	318,203.36
	オーストラリアドル 小計	71,549		503,595.71 (43,832,970)
イギリスポンド	NATIONAL GRID PLC	12,175	7.91	96,352.95
	PENNON GROUP PLC	25,736	6.99	179,894.64
	SEVERN TRENT PLC	6,095	19.10	116,414.50
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	11,826	7.33	86,708.23
	イギリスポンド 小計	55,832		479,370.32 (74,374,305)
スイスフラン	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	571	235.20	134,299.20
	スイスフラン 小計	571		134,299.20 (15,851,334)
香港ドル	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	60,000	12.02	721,200.00
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	88,000	11.78	1,036,640.00
	香港ドル 小計	148,000		1,757,840.00 (24,697,652)
ユーロ	EIFFAGE	725	95.24	69,049.00
	FERROVIAL SA	3,842	18.02	69,232.84
	ATLANTIA SPA	6,719	25.85	173,686.15
	ENAV SPA	21,630	4.18	90,456.66
	GETLINK SE	12,379	11.08	137,221.21
	RAI WAY SPA	35,453	4.89	173,365.17
	EI TOWERS SPA	3,126	47.80	149,422.80
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,109	5.70	171,771.84
	ユーロ 小計	113,983		1,034,205.67 (141,458,651)
	合 計	520,905		718,676,236 (718,676,236)

(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	AMERICAN TOWER CORP	4,279	621,396.38	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,400	156,940.00	
アメリカドル合計			5,679	778,336.38 (85,539,168)	

合計		85,539,168 (85,539,168)	
----	--	----------------------------	--

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()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

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	12銘柄	75.42%	32.63%
	投資証券	2銘柄		10.64%
カナダドル	株式	4銘柄	100.00%	19.40%
オーストラリアドル	株式	2銘柄	100.00%	5.45%
イギリスポンド	株式	4銘柄	100.00%	9.25%
スイスフラン	株式	1銘柄	100.00%	1.97%
香港ドル	株式	2銘柄	100.00%	3.07%
ユーロ	株式	8銘柄	100.00%	17.59%

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】

【海外株式セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	3,790,028,049
負債総額	4,654,345
純資産総額（ - ）	3,785,373,704
発行済口数	3,375,863,777口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1213
（10,000口当たり）	（11,213）

（参考）

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30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	371,585,349,729
負債総額	1,205,353,849
純資産総額（ - ）	370,379,995,880
発行済口数	141,387,981,204口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.6196
（10,000口当たり）	（26,196）

新興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30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	70,683,764,248
負債総額	158,819,710
純資産総額（ - ）	70,524,944,538
発行済口数	26,287,597,040口

1口当たり純資産価額（ / ）	2.6828
（10,000口当たり）	（26,828）

アセアン真成長株式マザーファンド

純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	2,831,644,236
負債総額	27,140
純資産総額（ - ）	2,831,617,096
発行済口数	2,283,407,242口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.2401
（10,000口当たり）	（12,401）

好配当海外株マザーファンド

純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	3,831,303,396
負債総額	78,767
純資産総額（ - ）	3,831,224,629
発行済口数	2,812,321,715口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3623
（10,000口当たり）	（13,623）

AMP グローバル・インフラ株式マザーファンド

純資産額計算書

平成30年 2月28日現在

（単位：円）

資産総額	813,398,338
負債総額	3,514,976
純資産総額（ - ）	809,883,362
発行済口数	732,131,601口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1062

(10,000口当たり)

(11,062)

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、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30年2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。

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」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

平成30年2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	844	11,748,864
追加型公社債投資信託	16	1,329,544
単位型株式投資信託	54	320,129
単位型公社債投資信託	1	6,116
合計	915	13,404,653

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	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	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・サービスの区別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
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

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、収益分配金・償還金の支払い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30年4月2日現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581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3月14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」に掲げられている海外株式セレクション（ラップ向け）の平成29年3月27日から平成30年2月5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、海外株式セレクション（ラップ向け）の平成30年2月5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。