

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年9月7日提出
【計算期間】	第1期(自 2020年1月8日至 2020年6月8日)
【ファンド名】	MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信
【発行者名】	三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目 1 2 番 1 号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目 1 2 番 1 号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 （東京都中央区日本橋兜町 2 番 1 号）

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（以下「対象指数」といいます。）に採用されている銘柄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、円換算した対象指数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。

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 不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年１回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経２２５	ブル・ベア型
一般	年２回					
大型株	年４回	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株	年６回	北米				
債券	(隔月)	欧州			その他 (MSCI オール・カン ントリー・ワールド・インデッ クス(円換算ベー ス))	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
一般	年12回	アジア				
公債	(毎月)	オセアニア				
社債	日々	中南米				
その他債券	その他	アフリカ				その他 ()
クレジット	()	中近東 (中東)				
属性		エマージング				
()						
不動産投信						
その他資産						
(投資信託証券 (株式 一般))						
資産複合						
()						

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

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

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

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。
--------	----	----	---------------------------------

有価証券報告書（内容投資信託）

	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

円換算した対象指数(MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス)に連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

投資方針

円換算したMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ファンドの1口当たりの純資産額の変動率を、円換算したMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスの変動率に一致させることを目的として、主として対象指数に採用されている銘柄の株式等(DR(預託証券)を含みます。)に投資を行います。
- 円換算した対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

■ DR(預託証券)とは、Depositary 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。

※実際の運用は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、日本株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

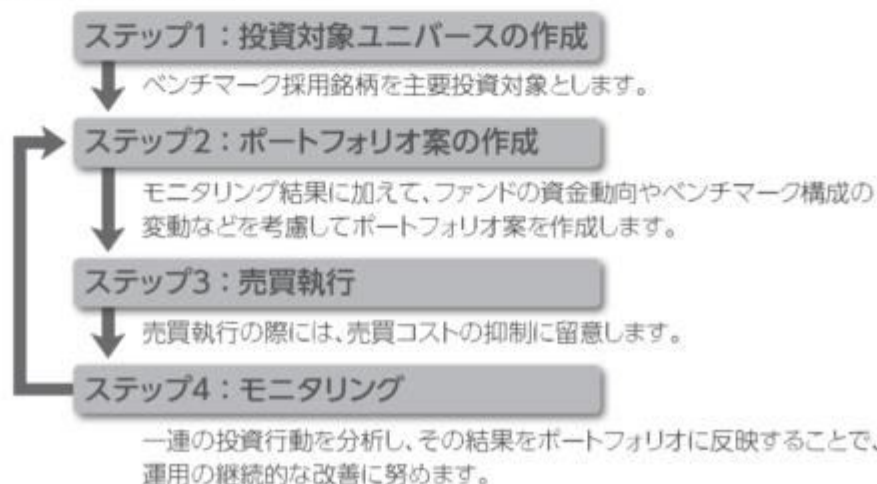
<MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスについて>

MSCI オール・カンントリー・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・新興国の株式で構成されています。

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(円換算ベース)は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算[※]したものです。

※原則として、わが国における計算日の午前10時の対顧客電信売買相場の仲値により円換算

<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。

☞ 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(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

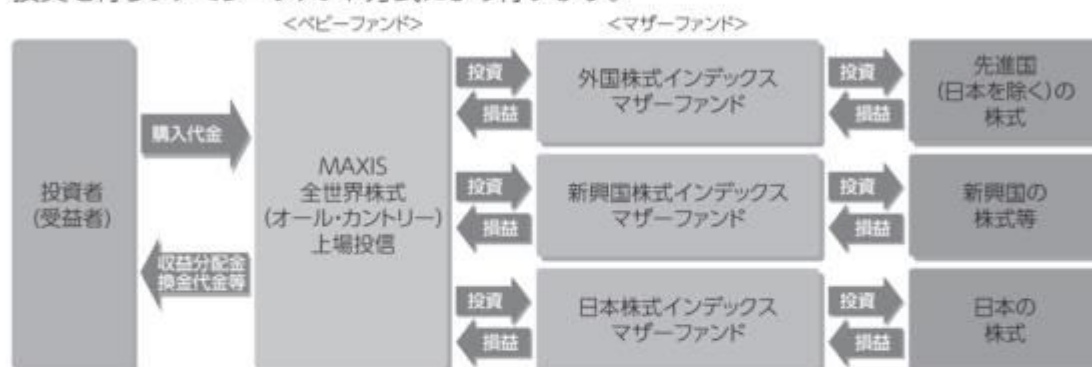
為替対応
方針

原則として、為替ヘッジを行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

運用は主に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、日本株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、日本を含む先進国および新興国の株式等に投資を行うファミリーファンド方式により行います。



- ・外国株式インデックスマザーファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
- ・新興国株式インデックスマザーファンドは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。
- ・日本株式インデックスマザーファンドは、MSCI ジャパン・インデックス（配当込み）に連動する投資成果をめざします。

■上場投信の仕組み

ファンドの受益権は、下記の金融商品取引所で上場され、株式と同様に、市場価格で売買することができます。

金融商品取引所における売買単位は1口単位です。

取引方法は、原則として株式と同様です。売買手数料等につきましては、お取引される第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。

＜金融商品取引所＞

- ・東京証券取引所（2020年1月9日に新規上場）

■主な投資制限

- ・株式への実質投資割合に制限を設けません。
- ・外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
- ・デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

分配方針

年2回の決算時に分配を行います。

- 年2回の決算時(6・12月の各8日)に分配を行います。
- 分配金額は、経費等控除後の配当等収益の全額を原則とします。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

●「MAXIS(マクシス)」の由来

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

「MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス」の著作権等について

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入力しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2020年1月8日	設定日、信託契約締結、運用開始
2020年1月9日	ファンドの受益権を東京証券取引所に上場

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割

投資家（受益者）	
お申込金 ↓ ↑ 解約代金等	
販売会社	募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。
お申込金 ↓ ↑ 解約代金等	
受託会社（受託者） 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本マスタートラスト 信託銀行株式会社）	委託会社（委託者） 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。
投資 ↓ ↑ 損益	
マザーファンド	
投資 ↓ ↑ 損益	
有価証券等	

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「上場投資信託の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い等に係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況（2020年6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
1985年8月1日
- ・資本金
2,000百万円
- ・沿革
1997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
2004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
2005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
2015年7月 三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等（ＤＲ（預託証券）を含みます。以下同じ。）に直接投資することがあります。

外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券および日本株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてＭＳＣＩオール・カンントリー・ワールド・インデックス（以下「対象指数」といいます。）に採用されている銘柄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、円換算した対象指数の変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

円換算した対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．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、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とする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および日本株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

- １．株券または新株引受権証書

- ２．国債証券

- ３．地方債証券

- ４．特別の法律により法人の発行する債券

- ５．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（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

- ６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）

- ９．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

- １０．資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第13号で定め

- るものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
 12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、１．から12．の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または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。)
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（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。16．において同じ。）で16．で定めるものの以外のもの
 16. 投資法人債券（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。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。)
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 19. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。)
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定めるものをいいます。)
 22. 外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。)
- なお、１．の証券または証書ならびに13．および19．の証券または証書のうち１．の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、２．から６．までの証券ならびに16．の証券ならびに13．および19．の証券または証書のうち２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14．および15．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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
 - ５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
 - ６．外国の者に対する権利で５．の権利の性質を有するもの
 - ７．信託の受益権（金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるものをいい、１．から６．に該当するものを除きます。)
 - ８．外国の者に対する権利で７．の権利の性質を有するもの
 - ９．合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第２条第２項第３号で定めるものをいいます。)
 - 10．外国法人の社員権で９．の権利の性質を有するもの
 - 11．投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第２条第２項第５号で定めるものをいいます。)
 - 12．外国の法令に基づく権利であって、11．の権利に類するもの
- 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

< マザーファンドの概要 >

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、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。

（運用方法）

投資対象

M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

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。

（投資制限）

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。

新興国株式インデックスマザーファンド**（基本方針）**

この投資信託は、M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動した投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）**投資対象**

新興国の株式等（D R（預託証書）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

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。

（投資制限）

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。

金利先渡し取引および為替先渡し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。

日本株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCI ジャパン・インデックス（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

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。

株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

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。

（投資制限）

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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等を行うことができます。

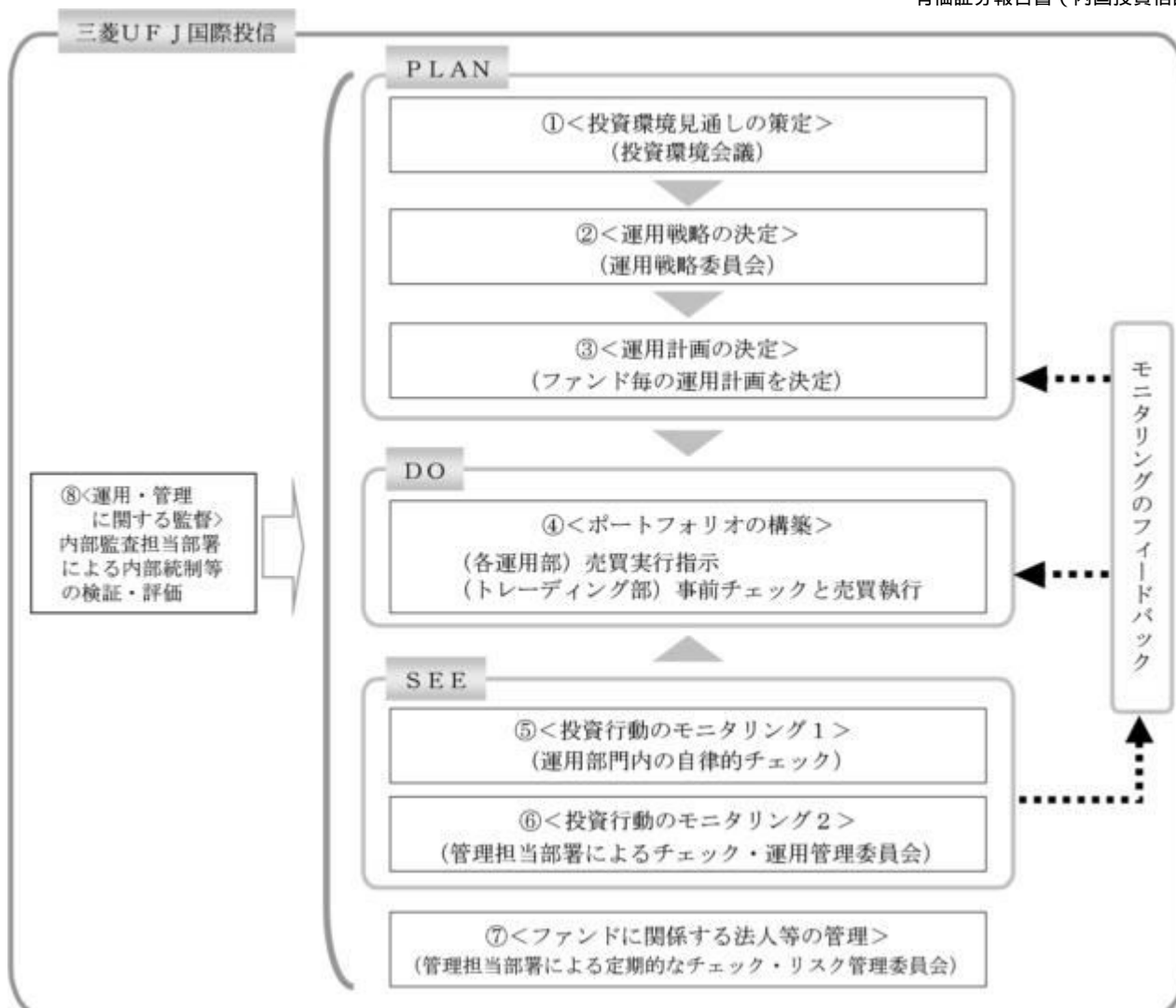
スワップ取引を行うことができます。

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。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部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。

ファンドに係る法人等の管理

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

運用・管理に関する監督

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

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

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。

経費等控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。）の全額を分配することを原則とします。ただし、当該金額が少額の場合等には分配を行わないことがあります。

売買益（評価益を含みます。）からの分配は行いません。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

新株引受権証券および新株予約権証券

- a．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

- a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a．およびb．において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

- a．委託会社は、信託財産に属する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（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a．委託会社は、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をする

ことができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2. 株式分割により取得する株券
 - 3. 有償増資により取得する株券
 - 4. 売出しにより取得する株券
 - 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、 ）の行使により取得可能な株券
 - 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ 5. に定めるものを除きます。 ）の行使により取得可能な株券

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。 ）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。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券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. の借入れに係る有価証券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有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。 ）を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。 ）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当また

は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度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契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券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. の売付けに係る有価証券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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

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。

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

信用リスクの分散規制

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

<その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産を

もって取得することを受託会社に指図しないものとします。

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、為替変動の影響を大きく受けます。
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

- ・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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、換金時期に制限がありますのでご注意ください。
- ・ファンドは、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス（円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、株価指数先物取引と当該指数の動きが連動しないこと、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、為替の評価による影響等の要因により乖離を生じることがあります。
- ・ファンドは金融商品取引所に上場され取引が行われますが、金融商品取引所における市場価格はファンドの需給などによって決まり、時間とともに変化します。このため、ファンドの市場価格は基準価額に必ずしも一致せず、またその差異の程度については予測できません。

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

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。

また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

トレーディング担当部署

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

コンプライアンス担当部署

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

リスク管理担当部署

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

内部監査担当部署

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

<流動性リスクに対する管理体制>

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した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。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

ファンドの年間騰落率はありません。

ベンチマークの年間騰落率は、2015年7月～2020年6月です。

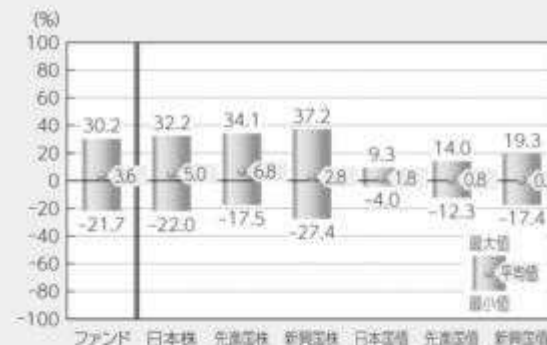
基準価額(分配金再投資)は、2020年1月末～2020年6月末です。



● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2015年7月末～2020年6月末)

ファンドの年間騰落率にはベンチマークを用いています。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(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で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)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国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定める額

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

（２）【換金（解約）手数料】

解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.1％）が差し引かれます。

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

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

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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0.0858％（税抜 年0.078％）以内の率を乗じて得た額

信託約款に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料およびマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額の55％（税抜50％）以内の額

1口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

上記 の配分

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	0.058％	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
受託会社	0.020％	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 の配分

委託会社と受託会社で折半します。

上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（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、外国株式インデックスマザーファンドおよび新興国株式インデックスマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

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

- ・受益権の上場に係る費用（追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、

新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のもののからの増加額）に対して0.00825%（税抜 0.0075%）、年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜 0.0075%））は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

- ・対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に年0.055%（税抜 年0.05%）（上限）を乗じて得た額）は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産から支払うことができるものとします。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、上場証券投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

１．受益権の売却時

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

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

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

２．収益分配金の受取り時

収益分配金は配当所得として課税されます。

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

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

３．受益権の解約時および償還時

上記１．と同様の取扱いとなります。

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

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

法人の受益者に対する課税

１．受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

２．収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

３．受益権の解約時および償還時

源泉徴収はありません。上記１．と同様の取扱いとなります。

分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2020年6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】

【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

（１）【投資状況】

令和 2年 6月30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	2,478,228,719	99.50
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	12,456,977	0.50
純資産総額		2,490,685,696	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

令和 2年 6月30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	699,561,721	3.0214	2,113,722,263	2.8547	1,997,038,844	80.18
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	130,284,035	2.3869	310,984,098	2.3320	303,822,369	12.20
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスマザーファンド	177,084,172	1.0450	185,052,960	1.0016	177,367,506	7.12

（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

令和 2年 6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

（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令和2年6月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 （１口当たりの純資産価額）		東京証券取引所 取引価格
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）	
第1計算期間末日（令和２年６月８日）	2,863,735,287	2,875,318,287	9,642	9,681	9,630
令和２年１月末日	441,590,534	—	10,036	—	10,180
２月末日	844,772,886	—	9,283	—	9,060
３月末日	1,396,752,062	—	7,891	—	7,950
４月末日	1,741,324,360	—	8,620	—	8,700
５月末日	1,902,084,880	—	8,972	—	8,950
６月末日	2,490,685,696	—	9,157	—	9,230

【分配の推移】

	１口当たりの分配金
第1計算期間	39円00銭

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	3.19

（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	297,000	—	297,000

（参考）

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30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	313,270,928,432	66.30
	イギリス	21,848,577,960	4.62
	スイス	16,074,902,770	3.40
	フランス	15,827,632,218	3.35
	カナダ	15,372,319,920	3.25
	ドイツ	14,159,716,750	3.00
	オーストラリア	9,713,861,606	2.06
	オランダ	7,940,411,230	1.68
	香港	4,810,922,579	1.02
	スウェーデン	4,787,170,894	1.01
	スペイン	3,779,750,005	0.80
	デンマーク	3,662,171,513	0.78
	イタリア	3,011,690,764	0.64
	フィンランド	1,584,585,807	0.34
	シンガポール	1,460,465,683	0.31
	ベルギー	1,420,659,266	0.30
	アイルランド	1,026,505,477	0.22
	ノルウェー	811,875,257	0.17
	ニュージーランド	501,879,314	0.11
	イスラエル	478,490,706	0.10
	ルクセンブルグ	348,426,562	0.07
	オーストリア	265,344,082	0.06
	ポルトガル	264,328,842	0.06
	小計	442,422,617,637	93.64
投資証券	アメリカ	9,330,722,928	1.97
	オーストラリア	615,565,057	0.13
	シンガポール	266,024,173	0.06
	イギリス	263,162,200	0.06
	香港	204,462,258	0.04
	フランス	176,400,774	0.04
	オランダ	99,640,248	0.02
	カナダ	84,452,718	0.02
	小計	11,040,430,356	2.34
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	19,032,662,241	4.02
純資産総額		472,495,710,234	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

令和 2年 6月30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	11,706,197,455	2.48
	買建	カナダ	538,278,072	0.11
	買建	ドイツ	2,122,251,494	0.45
	買建	オーストラリア	568,453,037	0.12
	買建	イギリス	764,360,745	0.16
	買建	スイス	579,327,492	0.12

（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

令和 2年 6月30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	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	484,116	34,083.54	16,500,391,407	38,978.17	18,869,959,233	3.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	799,398	20,136.60	16,097,162,563	21,379.92	17,091,069,765	3.62
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	46,814	260,576.73	12,198,639,122	288,784.14	13,519,140,786	2.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	46,060	151,675.29	6,986,164,070	150,531.09	6,933,462,273	1.47
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	266,185	23,113.46	6,152,456,936	23,771.75	6,327,684,232	1.34
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	291,479	16,057.56	4,680,444,330	14,980.16	4,366,404,855	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	329,283	11,942.44	3,932,444,315	11,879.04	3,911,566,719	0.83
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	188,724	19,894.19	3,754,511,302	20,619.28	3,891,353,225	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	273,163	12,439.66	3,398,054,953	12,676.68	3,462,802,233	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	339,976	9,773.09	3,322,617,881	10,019.81	3,406,498,324	0.72
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	104,969	31,253.21	3,280,619,166	31,218.74	3,277,000,171	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	120,665	25,613.03	3,090,596,289	26,516.96	3,199,670,040	0.68

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	21,055	151,300.82	3,185,638,860	150,294.06	3,164,441,598	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	98,984	30,513.04	3,020,303,286	31,560.27	3,123,962,577	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	473,171	6,501.03	3,076,099,623	6,278.00	2,970,572,175	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	153,306	18,988.09	2,910,989,291	19,090.45	2,926,680,620	0.62
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	77,764	38,917.11	3,026,350,188	37,526.76	2,918,231,664	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	457,189	6,087.31	2,783,051,172	5,892.30	2,693,895,019	0.57
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	67,715	35,278.38	2,388,875,881	39,648.32	2,684,785,989	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	793,287	3,179.40	2,522,182,558	3,222.50	2,556,370,055	0.54
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	53,346	40,219.34	2,145,541,019	45,703.30	2,438,088,669	0.52
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	199,715	11,714.57	2,339,575,387	12,015.16	2,399,608,638	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	48,543	47,323.71	2,297,235,223	48,185.63	2,339,075,406	0.50
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	469,395	4,706.08	2,209,011,923	4,972.20	2,333,926,288	0.49
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	280,717	8,420.95	2,363,906,179	8,201.16	2,302,207,502	0.49
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	237,885	9,467.45	2,252,165,866	9,439.15	2,245,432,531	0.48
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	123,297	15,626.60	1,926,714,084	18,138.02	2,236,364,562	0.47
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	468,161	4,943.11	2,314,171,882	4,775.03	2,235,486,003	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	868,844	2,445.69	2,124,930,033	2,520.03	2,189,520,417	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	153,672	14,463.01	2,222,560,840	14,122.55	2,170,241,917	0.46

（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

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	3.32
	素材	4.12
	資本財	5.94
	商業・専門サービス	1.17
	運輸	1.77

	自動車・自動車部品	1.12
	耐久消費財・アパレル	1.68
	消費者サービス	1.41
	メディア・娯楽	6.26
	小売	5.74
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	4.42
	家庭用品・パーソナル用品	2.09
	ヘルスケア機器・サービス	5.09
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.64
	銀行	5.25
	各種金融	4.14
	保険	3.06
	不動産	0.47
	ソフトウェア・サービス	11.77
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48
	電気通信サービス	2.12
	公益事業	3.36
	半導体・半導体製造装置	3.73
	小計	93.64
投資証券	—	2.34
合計		95.97

（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

令和 2年 6月30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 EMINI2009	買建	713	アメリカドル	109,742,349.24	11,823,640,707	108,652,287.5	11,706,197,455	2.48
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602009	買建	37	カナダドル	6,808,645.75	536,521,285	6,830,940	538,278,072	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2009	買建	544	ユーロ	17,465,706.6	2,114,747,755	17,527,680	2,122,251,494	0.45
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2009	買建	53	オーストラリアドル	7,851,645.75	580,079,588	7,694,275	568,453,037	0.12
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2009	買建	93	イギリスポンド	5,749,516.6	761,868,444	5,768,325	764,360,745	0.16

	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS 1X2009	買建	51	スイスフラン	5,129,394.35	580,750,028	5,116,830	579,327,492	0.12
--	-----	------------------	--------------	----	----	--------	--------------	-------------	-----------	-------------	------

（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

令和 2年 6月30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	28,318,324,877	22.93
	アメリカ	19,041,448,089	15.42
	台湾	14,500,055,369	11.74
	韓国	13,768,526,625	11.15
	インド	9,615,400,462	7.78
	ブラジル	6,254,796,375	5.06
	中国	5,288,808,731	4.28
	南アフリカ	4,426,292,009	3.58
	サウジアラビア	3,210,567,619	2.60
	タイ	2,677,255,960	2.17
	マレーシア	2,087,676,406	1.69
	メキシコ	2,014,085,437	1.63
	インドネシア	1,756,112,137	1.42
	フィリピン	983,313,247	0.80
	カタール	978,307,280	0.79
	ポーランド	850,657,158	0.69
	チリ	707,637,242	0.57
	アラブ首長国連邦	611,938,200	0.50
	トルコ	538,502,994	0.44
	ハンガリー	276,645,300	0.22
	コロンビア	221,475,100	0.18
	ギリシャ	162,655,560	0.13
	チェコ	136,960,086	0.11
	イギリス	91,312,101	0.07
	小計	118,518,754,364	95.96
投資証券	メキシコ	52,880,981	0.04
	南アフリカ	46,842,208	0.04
	小計	99,723,189	0.08
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	4,893,458,086	3.96
純資産総額		123,511,935,639	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

令和 2年 6月30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	4,671,349,978	3.78

（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 3 0 銘柄

令和 2年 6月30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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	357,887	22,223.67	7,953,562,729	23,166.25	8,290,901,432	6.71
香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	1,091,800	6,061.66	6,618,122,730	6,755.40	7,375,545,720	5.97
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	4,691,000	1,099.45	5,157,559,496	1,138.80	5,342,110,800	4.33
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	909,180	4,381.39	3,983,474,589	4,716.00	4,287,692,880	3.47
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	84,574	19,071.56	1,612,958,371	19,396.98	1,640,480,220	1.33
香港	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	677,300	1,914.74	1,296,858,819	2,386.63	1,616,464,499	1.31
香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	18,295,550	86.40	1,580,814,391	86.59	1,584,339,743	1.28
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	543,157	2,252.53	1,223,481,283	2,481.33	1,347,755,018	1.09
香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,132,000	1,099.93	1,245,122,582	1,081.42	1,224,167,440	0.99
アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	小売	161,934	5,281.64	855,277,682	6,419.14	1,039,478,507	0.84
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	1,171,000	818.64	958,630,417	720.02	843,143,420	0.68
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	314,092	2,402.01	754,452,417	2,507.25	787,509,052	0.64
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	103,648	7,623.92	790,204,317	7,524.00	779,847,552	0.63
ブラジル	株式	VALE SA	素材	699,330	970.71	678,848,418	1,108.70	775,351,297	0.63
香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	11,604,350	71.60	830,975,221	66.02	766,177,209	0.62
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	2,376,272	288.12	684,658,402	310.98	738,973,067	0.60
アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・ 娯楽	15,543	39,510.10	614,105,558	46,612.63	724,500,164	0.59

アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	52,385	10,816.16	566,604,815	13,067.78	684,555,896	0.55
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	649,044	985.82	639,842,901	1,053.72	683,910,644	0.55
アメリカ	株式	GAZPROM PJSC-SPON ADR	エネルギー	1,130,722	540.31	610,945,571	597.52	675,635,839	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	156,279	3,756.24	587,021,557	4,144.50	647,698,316	0.52
アメリカ	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	498,104	1,129.10	562,413,359	1,249.24	622,254,081	0.50
アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	76,498	7,253.32	554,864,588	8,117.13	620,944,333	0.50
香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	15,203,000	40.58	617,037,004	40.17	610,719,713	0.49
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	287,236	1,519.43	436,435,243	2,062.25	592,352,441	0.48
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	23,495	19,478.71	457,652,482	23,760.00	558,241,200	0.45
アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	73,261	5,902.02	432,388,595	7,265.98	532,313,371	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	172,110	2,796.93	481,380,502	3,026.37	520,869,573	0.42
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	18,115	19,246.98	348,659,170	27,990.00	507,038,850	0.41
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	157,131	2,954.88	464,304,467	3,143.44	493,933,128	0.40

（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

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	5.81
	素材	6.61
	資本財	2.71
	商業・専門サービス	0.27
	運輸	1.47
	自動車・自動車部品	1.84
	耐久消費財・アパレル	1.16
	消費者サービス	1.60
	メディア・娯楽	9.12
	小売	12.09
	食品・生活必需品小売り	1.48
	食品・飲料・タバコ	3.50
	家庭用品・パーソナル用品	1.19
	ヘルスケア機器・サービス	1.25
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.89

	銀行	13.17
	各種金融	1.98
	保険	3.25
	不動産	2.42
	ソフトウェア・サービス	1.86
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.74
	電気通信サービス	3.73
	公益事業	2.20
	半導体・半導体製造装置	6.63
	小計	95.96
投資証券	—	0.08
合計		96.04

（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

令和 2年 6月30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 2009	買建	876	アメリカドル	43,250,324.6	4,659,789,972	43,357,620	4,671,349,978	3.78

（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。

日本株式インデックスマザーファンド

投資状況

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	2,432,369,910	99.16
投資証券	日本	35,178,300	1.43
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	14,588,351	0.59
純資産総額		2,452,959,859	100.00

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

その他の資産の投資状況

令和 2年 6月30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	日本	31,170,000	1.27

（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 3 0 銘柄

令和 2年 6月30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 (％)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	14,600	6,655.56	97,171,302	6,762.00	98,725,200	4.02
日本	株式	ソニー	電気機器	8,700	6,838.70	59,496,750	7,384.00	64,240,800	2.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	10,800	4,658.69	50,313,940	5,450.00	58,860,000	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	39,085.97	50,811,770	45,030.00	58,539,000	2.39
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	10,800	3,994.66	43,142,418	3,848.00	41,558,400	1.69
日本	株式	任天堂	その他製品	800	46,705.12	37,364,100	48,010.00	38,408,000	1.57
日本	株式	K D D I	情報・通信業	11,300	3,192.26	36,072,556	3,234.00	36,544,200	1.49
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	84,000	424.48	35,656,540	421.60	35,414,400	1.44
日本	株式	第一三共	医薬品	3,900	7,724.80	30,126,730	8,806.00	34,343,400	1.40
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	8,700	3,054.92	26,577,884	3,682.00	32,033,400	1.31
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	11,200	2,565.64	28,735,170	2,755.50	30,861,600	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	2,400	11,892.08	28,541,010	12,595.00	30,228,000	1.23
日本	株式	ダイキン工業	機械	1,700	13,833.29	23,516,600	17,335.00	29,469,500	1.20
日本	株式	花王	化学	3,300	8,745.00	28,858,520	8,540.00	28,182,000	1.15
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	9,000	2,803.66	25,232,957	3,032.00	27,288,000	1.11
日本	株式	H O Y A	精密機器	2,600	9,950.95	25,872,480	10,260.00	26,676,000	1.09
日本	株式	中外製薬	医薬品	4,600	4,504.16	20,719,180	5,765.00	26,519,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,000	21,985.74	21,985,743	26,440.00	26,440,000	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	1,300	16,906.52	21,978,480	19,260.00	25,038,000	1.02
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	49,984.75	19,993,900	61,700.00	24,680,000	1.01
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,900	5,885.92	22,955,115	6,316.00	24,632,400	1.00
日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	8,000	3,227.59	25,820,782	2,882.00	23,056,000	0.94
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	12,800	1,807.05	23,130,284	1,799.50	23,033,600	0.94
日本	株式	日立製作所	電気機器	6,600	3,114.81	20,557,810	3,403.00	22,459,800	0.92
日本	株式	日本電産	電気機器	3,100	5,885.06	18,243,700	7,196.00	22,307,600	0.91
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	8,800	2,507.37	22,064,910	2,515.50	22,136,400	0.90

日本	株式	S M C	機械	400	50,732.50	20,293,000	55,180.00	22,072,000	0.90
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	165,700	124.64	20,652,930	132.20	21,905,540	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	9,300	2,182.62	20,298,410	2,321.50	21,589,950	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	9,300	2,262.71	21,043,240	2,270.00	21,111,000	0.86

（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

令和 2年 6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	鉱業	0.19
	建設業	1.69
	食料品	3.52
	繊維製品	0.28
	パルプ・紙	0.12
	化学	7.08
	医薬品	7.94
	石油・石炭製品	0.45
	ゴム製品	0.62
	ガラス・土石製品	0.59
	鉄鋼	0.46
	非鉄金属	0.53
	金属製品	0.30
	機械	4.99
	電気機器	17.53
	輸送用機器	8.20
	精密機器	2.91
	その他製品	2.51
	電気・ガス業	1.60
	陸運業	4.04
	海運業	0.07
	空運業	0.14
	倉庫・運輸関連業	0.06
	情報・通信業	9.68
	卸売業	3.92
	小売業	4.45
	銀行業	4.68
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.28
	その他金融業	1.01
	不動産業	1.74
	サービス業	4.81

小計		99.16
投資証券	—	1.43
合計		100.59

（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

令和 2年 6月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ ２０年０９月限	買建	2	円	32,361,100	31,170,000	1.27

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

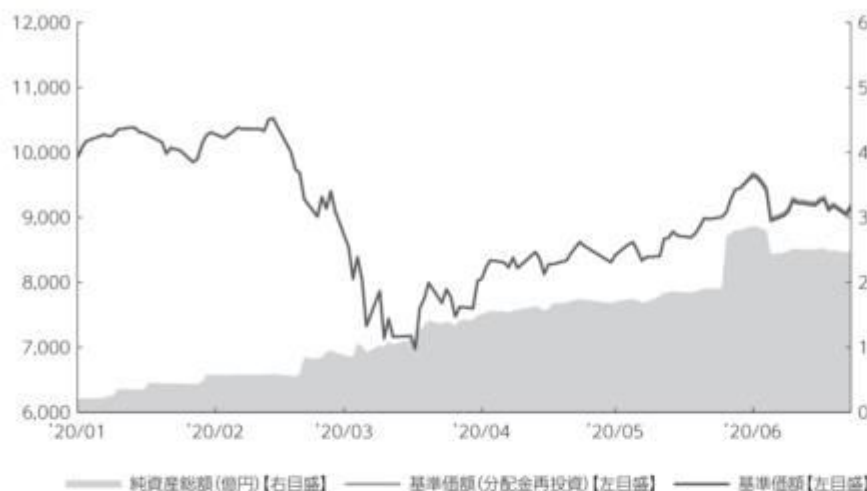
参考情報



運用実績

2020年6月30日現在

■基準価額・純資産の推移 2020年1月8日(設定日)～2020年6月30日



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000(当初元本1口当たり)を起点として表示
- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	9,157円
純資産総額	24.9億円

■分配の推移

2020年6月	39円
設定来累計	39円

・分配金は1口当たり、税引前

■主要な資産の状況

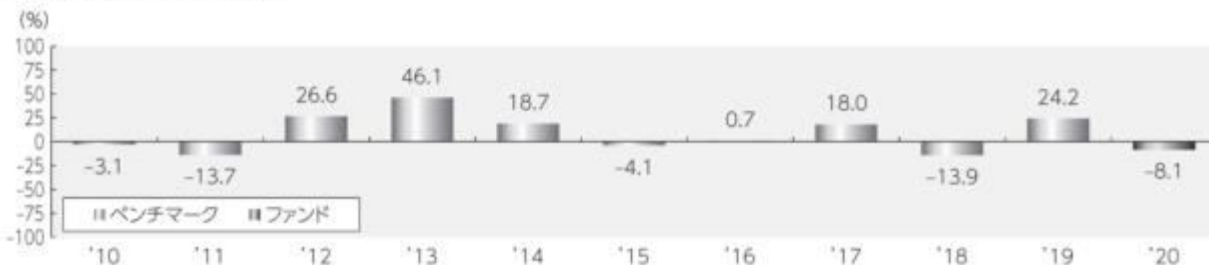
組入上位通貨	比率
1 アメリカドル	59.0%
2 ユーロ	8.8%
3 円	8.1%
4 イギリスポンド	3.9%
5 香港ドル	3.7%
6 スイスフラン	2.8%
7 カナダドル	2.7%
8 オーストラリアドル	1.8%
9 ニュー台湾ドル	1.4%
10 韓国ウォン	1.4%

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア・機器	アメリカ	3.2%
2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	2.9%
3 AMAZON.COM INC	小売	アメリカ	2.3%
4 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.2%
5 FACEBOOK INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	1.1%
6 ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	アメリカ	0.8%
7 JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー	アメリカ	0.7%
8 TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	香港	0.7%
9 NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	スイス	0.7%
10 VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.7%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	3.3%

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

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2020年は設定日から6月30日までの収益率を表示
- ・2019年以前は対象指数(ベンチマーク)の年間収益率を表示

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

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付

原則、取得申込受付日の正午までに受け付けた取得申込み（当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該取得申込受付日の申込みとします。正午過ぎに受け付けた取得申込みは翌営業日を取得申込受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には取得申込みができません。

- 1．ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行、香港取引所、香港の銀行のいずれかの休業日
- 2．計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内）
- 3．この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 4．1．から3．のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、2．から4．に定める日の申込みであっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における申込みについては受け付けることができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

申込単位

1,000口の整数倍で販売会社が定める単位

申込価額

当初設定：1口当たり10,000円

継続募集期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額

申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.mukam.jp/>

申込手数料

販売会社が定める額

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込方法

取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

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

取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情（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、取得申込みの受付け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けを取り消すことができます。

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、取得申込みの受付け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

受益者は自己に帰属する受益権につき解約の請求ができます。原則、解約請求受付日の正午までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当該解約請求受付日の請求とします。正午過ぎに受け付けた解約請求は翌営業日を解約請求受付日とします。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

ただし、以下に定める日には解約請求ができません。

- 1．ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドン証券取引所、ロンドンの銀行、香港取引所、香港の銀行のいずれかの休業日
- 2．計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の6営業日前から起算して6営業日以内）
- 3．この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 4．1．から3．のほか、委託会社が、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき

なお、委託会社は、2．から4．に定める日の解約請求であっても、信託財産の状況、資金動向、市況動向等を鑑み、信託財産に及ぼす影響が軽微である等と判断される期日および期間における解約請求については受け付けることができます。

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

解約単位

1,000口の整数倍で販売会社が定める単位

解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%をかけた額

解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

解約手数料

販売会社が定める額

解約手数料は販売会社にご確認ください。

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６営業日目から販売会社において支払います。

解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、信託約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたす恐れがあると判断した場合その他やむを得ない事情（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、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。

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。

買取り

販売会社は、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になった場合で、信託終了日の２営業日前までに受益者の請求があるときは、その受益権を買取ります。

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとします。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、当ファンドでは１口当たりの価額で表示されます。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

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

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

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

・公社債等

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

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

- ・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

- ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

- ・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

- ・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

- ・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

MAXIS専用サイト <https://maxis.mukam.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2020年１月８日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年６月９日から12月８日および12月９日から翌年６月８日まで

ただし、第１計算期間は信託契約締結日から2020年６月８日までとし、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・2023年１月10日以降に受益権の口数が10万口を下回ることとなったとき
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のとき、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合、対象指数が廃止された場合、対象指数の計算方法その他の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めたファンドの信託約款の変更が書面決議により否決された場合は、原則として、ファンドを償還させます。

なお、受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合によりファンドを償還するときには、その廃止された日にファンドを償還するための手続きを開始するものとし、

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発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

金融商品取引所への上場

委託会社は、ファンドの受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとし、

委託会社は、ファンドの受益権が上場された場合には、上記の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとし、

反対者の買取請求権

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「上場投資信託の取扱い等に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

運用報告書

投資信託及び投資法人に関する法律により、交付運用報告書および運用報告書（全体版）の作成・交付は行いません。運用内容については、販売会社または委託会社の照会先にてご確認いただけます。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者（計算期間終了日において受益者名簿に名義登録^{（注）}されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

- ・収益分配金は、原則として、毎計算期間終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式等により支払われます。
- ・受益者が、収益分配金について支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（注）受託会社は、ファンドに係る受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称および住所その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を、振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権に係る受益者として、その氏名または名称および住所その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

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

名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。

（２）償還金に対する請求権

受益者（信託終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者（「名義登録受益者」といいます。）とします。）は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

- ・ 償還金は、原則として信託終了後40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該償還金を振り込む方式により支払われます。
- ・ 受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、令和2年1月8日から令和2年6月8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（令和2年1月8日から令和2年6月8日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

第1期 [令和 2年 6月 8日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,319,991
親投資信託受益証券	2,851,241,108
未収入金	10,692,252
流動資産合計	2,876,253,351
資産合計	2,876,253,351
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	11,583,000
未払受託者報酬	107,171
未払委託者報酬	310,729
未払利息	25
その他未払費用	517,139
流動負債合計	12,518,064
負債合計	12,518,064
純資産の部	
元本等	
元本	2,970,000,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,264,713
（分配準備積立金）	175,066
元本等合計	2,863,735,287
純資産合計	2,863,735,287
負債純資産合計	2,876,253,351

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
営業収益	
受取利息	22
有価証券売買等損益	247,438,173
営業収益合計	247,438,195
営業費用	
支払利息	869
受託者報酬	107,171
委託者報酬	310,729
その他費用	517,139
営業費用合計	935,908
営業利益又は営業損失（ ）	246,502,287
経常利益又は経常損失（ ）	246,502,287
当期純利益又は当期純損失（ ）	246,502,287
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	341,184,000
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	341,184,000
分配金	11,583,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,264,713

（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 [令和 2年 6月 8日現在]
１．期首元本額	—円
期中追加設定元本額	2,970,000,000円
期中一部解約元本額	—円
２．元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	106,264,713円
３．受益権の総数	297,000口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日		
１．その他費用		
上場費用および商標使用料等を含んでおります。		
２．分配金の計算過程		
項目		
当期配当等収益額	A	847円
親ファンドの配当等収益額	B	12,693,952円
分配準備積立金額	C	—円
配当等収益合計額	D=A+B+C	12,693,105円
経費	E	935,039円
当ファンドの分配対象収益額	F=D-E	11,758,066円
収益分配金金額	G	11,583,000円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	175,066円
当ファンドの期末残存口数	I	297,000口
1口当たり分配金額	J=G/I	39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 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
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
	[令和 2年 6月 8日現在]
１．貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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
	[令和 2年 6月 8日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	248,980,515

合計	248,980,515
----	-------------

（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 [令和 2年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	9,642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	新興国株式インデックスマザーファンド	139,993,459	334,234,383	
	日本株式インデックスマザーファンド	191,497,350	200,229,629	
	外国株式インデックスマザーファンド	766,763,891	2,316,777,096	
合計		1,098,254,700	2,851,241,108	

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）	
[令和 2年 6月 8日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	12,965,898,575
コール・ローン	2,328,956,485
株式	503,161,878,494
投資証券	12,992,917,595
派生商品評価勘定	1,180,213,514
未収入金	2,289,823
未収配当金	651,153,057
差入委託証拠金	7,495,230,637
流動資産合計	540,778,538,180
資産合計	540,778,538,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,236,100
未払金	133,933,605
未払解約金	3,990,084,130
未払利息	4,138
流動負債合計	4,135,257,973
負債合計	4,135,257,973
純資産の部	
元本等	
元本	177,610,763,996
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	359,032,516,211
元本等合計	536,643,280,207
純資産合計	536,643,280,207
負債純資産合計	540,778,538,180

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）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1. 期首	令和 2年 1月 8日
期首元本額	189,180,510,316円
期中追加設定元本額	85,733,269,141円
期中一部解約元本額	97,303,015,461円
元本の内訳	
MAXIS 海外株式（MSCIコクサイ）上場投信	3,537,783,796円
MAXIS 全世界株式（オール・カントリー）上場投信	766,763,891円
ファンド・マネジャー（海外株式）	52,338,532円
eMAXIS 先進国株式インデックス	14,313,001,698円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,319,936,135円
eMAXIS バランス（波乗り型）	312,171,473円
コアバランス	234,655円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）	34,100,335円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）	55,390,577円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）	41,176,074円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	36,018,234,659円
海外株式セレクション（ラップ向け）	1,027,444,193円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	2,337,997,053円
つみたて先進国株式	4,602,563,434円
つみたて8資産均等バランス	950,513,161円
つみたて4資産均等バランス	265,933,982円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,564,768円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,114,630円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,378,068円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）	23,508,266円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）	21,492,493円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）	11,037,048円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	6,048,435,614円

	[令和 2年 6月 8日現在]
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	203,900,508円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	8,760,112,182円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）	11,126,950円
先進国株式インデックスファンド（ラップ向け）	117,801,109円
つみたて全世界株式	817,790円
三菱ＵＦＪ DC海外株式インデックスファンド	17,145,545,089円
eMAXIS 全世界株式インデックス	2,664,528,943円
eMAXIS バランス（4資産均等型）	203,573,056円
eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）	62,182,934円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	72,123,864円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	282,396,366円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	201,049,062円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	430,551,577円
三菱ＵＦＪ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	31,015,320円
三菱ＵＦＪ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	8,809,483,460円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）	138,680,568円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	1,553,091,953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）	40,869,380,226円
三菱ＵＦＪ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	2,193,866円
三菱ＵＦＪ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,240,012,192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）	8,132,846,516円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	23,715,417円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	127,088,923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）	737,230,088円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	52,661,174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）	334,406,481円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）	2,400,445,907円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）	693,812,173円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）	983,833,559円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,067,305,634円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	1,330,634円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	5,101,116円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	3,627,757円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	5,417,202円

	[令和 2年 6月 8日現在]
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	50,724,314円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	8,708,539円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	68,000,255円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	11,735,513円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	74,799,629円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	5,276,307,155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）	166,631,733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）	651,667,843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）	631,755,090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）	555,929,794円
合計	177,610,763,996円
２．受益権の総数	177,610,763,996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 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
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、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、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。 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。

区分	自 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8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	[令和 2年 6月 8日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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	[令和 2年 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	40,480,954,531
投資証券	1,361,857,282
合計	41,842,811,813

(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

[令和 2年 6月 8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	23,813,646,245	—	24,990,134,344	1,176,488,099
合計		23,813,646,245	—	24,990,134,344	1,176,488,099

（注）時価の算定方法

- 1 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。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 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

[令和 2年 6月 8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	3,139,829,040	—	3,139,599,600	229,440
	カナダドル	155,114,100	—	155,097,000	17,100
	オーストラリアドル	99,384,610	—	99,372,000	12,610
	イギリスポンド	222,576,000	—	222,560,000	16,000
	スイスフラン	157,023,300	—	157,016,400	6,900
	香港ドル	49,455,000	—	49,420,000	35,000
	シンガポールドル	15,725,960	—	15,724,000	1,960
	ニュージーランドドル	7,138,000	—	7,137,000	1,000
	スウェーデンクローネ	50,148,840	—	50,148,000	840
	ノルウェークローネ	13,002,220	—	12,991,000	11,220
	デンマーククローネ	34,840,470	—	34,839,000	1,470
	ユーロ	500,960,700	—	500,944,500	16,200
	売建				
	アメリカドル	1,132,312,680	—	1,136,298,600	3,985,920
	カナダドル	52,491,075	—	53,059,500	568,425
	オーストラリアドル	90,391,575	—	91,728,000	1,336,425
	イギリスポンド	76,957,440	—	77,896,000	938,560
	スイスフラン	51,379,200	—	51,201,000	178,200
	香港ドル	30,971,600	—	31,064,000	92,400
	シンガポールドル	6,245,440	—	6,289,600	44,160

	スウェーデンク ローネ	11,860,000	—	11,940,000	80,000
	デンマーククロ ーネ	27,972,525	—	28,203,000	230,475
	ユーロ	212,684,020	—	212,746,800	62,780
合計		6,138,463,795	—	6,145,275,000	7,510,685

（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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	3.0215円
(1万口当たり純資産額)	(30,215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	BAKER HUGHES CO	79,399	17.75	1,409,332.25	
	CABOT OIL & GAS CORP	45,122	20.42	921,391.24	
	CHENIERE ENERGY INC	25,890	50.70	1,312,623.00	
	CHEVRON CORP	223,398	100.81	22,520,752.38	
	CONCHO RESOURCES INC	22,291	70.25	1,565,942.75	
	CONOCOPHILLIPS	128,389	48.59	6,238,421.51	

DIAMONDBACK ENERGY INC	19,999	52.21	1,044,147.79
EOG RESOURCES INC	69,049	59.31	4,095,296.19
EXXON MOBIL CORP	503,051	53.08	26,701,947.08
HALLIBURTON CO	105,808	14.52	1,536,332.16
HESS CORP	31,660	57.03	1,805,569.80
HOLLYFRONTIER CORP	20,408	36.77	750,402.16
KINDER MORGAN INC	242,597	16.72	4,056,221.84
MARATHON PETROLEUM CORP	77,253	41.56	3,210,634.68
NATIONAL OILWELL VARCO INC	43,849	15.03	659,050.47
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	106,162	20.79	2,207,107.98
ONEOK INC	48,573	45.35	2,202,785.55
PHILLIPS 66	52,229	87.40	4,564,814.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,851	110.89	2,201,277.39
SCHLUMBERGER LTD	166,155	21.99	3,653,748.45
VALERO ENERGY CORP	49,118	74.64	3,666,167.52
WILLIAMS COS INC	144,189	21.14	3,048,155.46
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,217	248.58	6,517,021.86
ALBEMARLE CORP	12,947	84.31	1,091,561.57
AMCOR PLC	190,174	10.88	2,069,093.12
AVERY DENNISON CORP	9,234	123.32	1,138,736.88
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	23,266	24.70	574,670.20
BALL CORP	38,514	73.93	2,847,340.02
CELANESE CORP	14,056	97.72	1,373,552.32
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	27,020	32.72	884,094.40
CORTEVA INC	88,844	30.65	2,723,068.60
CROWN HOLDINGS INC	16,871	69.91	1,179,451.61
DOW INC	88,292	43.97	3,882,199.24
DUPONT DE NEMOURS INC	87,983	56.14	4,939,365.62
EASTMAN CHEMICAL CO	16,261	76.92	1,250,796.12
ECOLAB INC	30,810	229.56	7,072,743.60
FMC CORP	15,539	103.21	1,603,780.19
FREEPORT-MCMORAN INC	165,189	10.86	1,793,952.54
INTERNATIONAL PAPER CO	45,219	39.03	1,764,897.57
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,119	137.86	1,395,005.34
LINDE PLC	63,406	221.28	14,030,479.68
LYONDELLBASELL INDU-CL A	31,889	74.87	2,387,529.43
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,418	225.43	1,672,239.74
MOSAIC CO/THE	42,586	14.10	600,462.60
NEWMONT CORP	96,054	54.76	5,259,917.04
NUCOR CORP	37,658	45.47	1,712,309.26
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,156	110.56	1,233,407.36
PPG INDUSTRIES INC	28,055	113.95	3,196,867.25

RPM INTERNATIONAL INC	15,423	78.60	1,212,247.80
SEALED AIR CORP	16,560	35.13	581,752.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,870	585.29	5,776,812.30
STEEL DYNAMICS INC	23,118	29.14	673,658.52
VULCAN MATERIALS CO	16,213	124.13	2,012,519.69
WESTROCK CO	32,426	32.05	1,039,253.30
3M CO	68,452	167.41	11,459,549.32
AERCAP HOLDINGS NV	13,526	37.80	511,282.80
ALLEGION PLC	10,785	115.35	1,244,049.75
AMETEK INC	27,071	96.99	2,625,616.29
BOEING CO/THE	63,570	205.43	13,059,185.10
CARRIER GLOBAL CORP	97,330	23.56	2,293,094.80
CATERPILLAR INC	65,392	135.12	8,835,767.04
CUMMINS INC	17,770	180.01	3,198,777.70
DEERE & CO	35,408	166.72	5,903,221.76
DOVER CORP	17,185	107.60	1,849,106.00
EATON CORP PLC	48,968	95.43	4,673,016.24
EMERSON ELECTRIC CO	72,546	67.10	4,867,836.60
FASTENAL CO	68,045	42.66	2,902,799.70
FORTIVE CORP	36,426	70.61	2,572,039.86
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	16,770	65.28	1,094,745.60
GENERAL DYNAMICS CORP	29,228	162.22	4,741,366.16
GENERAL ELECTRIC CO	1,039,624	7.88	8,192,237.12
HD SUPPLY HOLDINGS INC	19,592	36.19	709,034.48
HEICO CORP	4,520	114.34	516,816.80
HEICO CORP-CLASS A	9,449	97.16	918,064.84
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	84,641	161.37	13,658,518.17
HOWMET AEROSPACE INC	50,219	17.16	861,758.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,873	202.57	987,123.61
IDEX CORP	9,205	167.29	1,539,904.45
ILLINOIS TOOL WORKS	37,836	182.87	6,919,069.32
INGERSOLL-RAND INC	44,046	33.24	1,464,089.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,364	89.06	1,457,377.84
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25,200	44.50	1,121,400.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	29,600	22.74	673,104.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	91,877	36.05	3,312,165.85
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	26,207	204.87	5,369,028.09
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,164	235.88	982,204.32
LOCKHEED MARTIN CORP	30,125	410.75	12,373,843.75
MASCO CORP	31,512	48.63	1,532,428.56
NORDSON CORP	6,495	200.64	1,303,156.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	18,909	342.10	6,468,768.90

OTIS WORLDWIDE CORP	49,315	58.57	2,888,379.55
OWENS CORNING	11,710	58.42	684,098.20
PACCAR INC	41,624	77.95	3,244,590.80
PARKER HANNIFIN CORP	15,396	195.45	3,009,148.20
PENTAIR PLC	20,934	41.86	876,297.24
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	179,924	72.07	12,967,122.68
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,778	227.39	3,132,979.42
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,597	405.83	5,112,240.51
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	19,783	41.67	824,357.61
SMITH (A.O.) CORP	17,333	52.00	901,316.00
SNAP-ON INC	6,624	152.20	1,008,172.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,262	146.64	2,677,939.68
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,193	377.00	1,580,761.00
TEXTRON INC	24,893	39.12	973,814.16
TRANE TECHNOLOGIES PLC	28,676	102.01	2,925,238.76
TRANSDIGM GROUP INC	6,041	490.78	2,964,801.98
UNITED RENTALS INC	8,770	161.36	1,415,127.20
WABTEC CORP	20,593	70.68	1,455,513.24
WW GRAINGER INC	5,500	322.83	1,775,565.00
XYLEM INC	22,050	72.75	1,604,137.50
CINTAS CORP	10,592	286.50	3,034,608.00
COPART INC	25,090	91.82	2,303,763.80
COSTAR GROUP INC	4,617	667.00	3,079,539.00
EQUIFAX INC	14,562	177.01	2,577,619.62
IHS MARKIT LTD	45,069	73.56	3,315,275.64
NIELSEN HOLDINGS PLC	40,926	16.26	665,456.76
REPUBLIC SERVICES INC	26,460	89.91	2,379,018.60
ROBERT HALF INTL INC	13,010	57.89	753,148.90
ROLLINS INC	18,879	43.43	819,914.97
TRANSUNION	22,340	93.21	2,082,311.40
VERISK ANALYTICS INC	18,358	166.13	3,049,814.54
WASTE CONNECTIONS INC	31,266	98.27	3,072,509.82
WASTE MANAGEMENT INC	50,435	112.20	5,658,807.00
AMERCO	1,352	347.06	469,225.12
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	16,074	83.06	1,335,106.44
CSX CORP	92,030	75.08	6,909,612.40
DELTA AIR LINES INC	21,881	34.16	747,454.96
EXPEDITORS INTL WASH INC	20,365	77.92	1,586,840.80
FEDEX CORP	29,565	142.21	4,204,438.65
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9,802	120.74	1,183,493.48
KANSAS CITY SOUTHERN	11,517	162.56	1,872,203.52
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16,364	40.70	666,014.80

NORFOLK SOUTHERN CORP	30,652	194.25	5,954,151.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,376	169.63	1,929,710.88
SOUTHWEST AIRLINES CO	19,097	38.18	729,123.46
UBER TECHNOLOGIES INC	113,016	37.21	4,205,325.36
UNION PACIFIC CORP	82,101	184.83	15,174,727.83
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	83,528	106.65	8,908,261.20
XPO LOGISTICS INC	10,923	83.56	912,725.88
APTIV PLC	29,911	85.85	2,567,859.35
AUTOLIV INC	10,784	69.90	753,801.60
BORGWARNER INC	26,573	37.29	990,907.17
FORD MOTOR CO	464,043	7.34	3,406,075.62
GENERAL MOTORS CO	152,866	30.61	4,679,228.26
LEAR CORP	6,934	123.77	858,221.18
TESLA INC	17,538	885.66	15,532,705.08
DR HORTON INC	41,262	56.48	2,330,477.76
GARMIN LTD	16,848	96.53	1,626,337.44
HASBRO INC	16,142	80.86	1,305,242.12
LENNAR CORP-A	33,338	63.71	2,123,963.98
LULULEMON ATHLETICA INC	14,688	319.78	4,696,928.64
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,344	108.65	797,925.60
NEWELL BRANDS INC	44,055	16.40	722,502.00
NIKE INC -CL B	147,580	102.71	15,157,941.80
NVR INC	422	3,491.07	1,473,231.54
PULTEGROUP INC	31,738	36.72	1,165,419.36
RALPH LAUREN CORP	5,268	89.57	471,854.76
VF CORP	40,646	68.31	2,776,528.26
WHIRLPOOL CORP	7,598	136.85	1,039,786.30
ARAMARK	26,004	30.46	792,081.84
CARNIVAL CORP	52,388	21.51	1,126,865.88
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,130	1,053.46	3,297,329.80
DARDEN RESTAURANTS INC	16,156	85.59	1,382,792.04
DOMINO'S PIZZA INC	4,629	376.41	1,742,401.89
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	32,941	87.20	2,872,455.20
LAS VEGAS SANDS CORP	41,084	52.97	2,176,219.48
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33,262	107.96	3,590,965.52
MCDONALD'S CORP	88,614	197.16	17,471,136.24
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	22,259	18.75	417,356.25
MGM RESORTS INTERNATIONAL	57,968	21.72	1,259,064.96
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,284	69.44	1,477,960.96
STARBUCKS CORP	139,487	82.14	11,457,462.18
VAIL RESORTS INC	4,861	196.75	956,401.75
WYNN RESORTS LTD	10,816	101.61	1,099,013.76

YUM! BRANDS INC	35,718	96.52	3,447,501.36
ACTIVISION BLIZZARD INC	91,344	69.43	6,342,013.92
ALPHABET INC-CL A	51,104	1,440.02	73,590,782.08
ALPHABET INC-CL C	21,055	1,438.39	30,285,301.45
ALTICE USA INC- A	39,800	25.87	1,029,626.00
CABLE ONE INC	541	1,741.83	942,330.03
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,463	530.72	9,267,963.36
COMCAST CORP-CLASS A	540,177	42.09	22,736,049.93
DISCOVERY INC - A	20,266	24.78	502,191.48
DISCOVERY INC-C	39,779	22.35	889,060.65
DISH NETWORK CORP-A	30,677	35.82	1,098,850.14
ELECTRONIC ARTS INC	34,446	118.32	4,075,650.72
FACEBOOK INC-CLASS A	286,101	230.77	66,023,527.77
FOX CORP - CLASS A	42,463	30.85	1,309,983.55
FOX CORP - CLASS B	20,364	30.25	616,011.00
IAC/INTERACTIVECORP	9,182	284.73	2,614,390.86
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	47,608	19.35	921,214.80
LIBERTY BROADBAND-A	2,794	131.87	368,444.78
LIBERTY BROADBAND-C	12,926	134.57	1,739,451.82
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	9,306	39.13	364,143.78
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	22,332	38.88	868,268.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,507	36.91	830,733.37
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	19,071	56.96	1,086,284.16
MATCH GROUP INC	6,909	90.09	622,431.81
NETFLIX INC	52,181	419.60	21,895,147.60
NEWS CORP - CLASS A	41,339	12.95	535,546.74
OMNICOM GROUP	26,711	60.78	1,623,494.58
PINTEREST INC- CLASS A	43,202	22.13	956,060.26
ROKU INC	11,695	104.38	1,220,724.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	131,106	6.51	853,500.06
SNAP INC - A	103,822	20.33	2,110,701.26
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	13,479	128.91	1,737,577.89
TWITTER INC	92,999	34.87	3,242,875.13
VIACOMCBS INC - CLASS B	64,944	24.82	1,611,910.08
WALT DISNEY CO/THE	214,647	124.82	26,792,238.54
ZILLOW GROUP INC - C	15,708	59.32	931,798.56
ADVANCE AUTO PARTS INC	8,651	146.10	1,263,911.10
AMAZON.COM INC	50,323	2,483.00	124,952,009.00
AUTOZONE INC	2,811	1,153.93	3,243,697.23
BEST BUY CO INC	27,557	82.53	2,274,279.21
BOOKING HOLDINGS INC	4,884	1,812.64	8,852,933.76
BURLINGTON STORES INC	7,966	216.05	1,721,054.30

CARMAX INC	18,899	95.93	1,812,981.07
DOLLAR GENERAL CORP	30,274	185.66	5,620,670.84
DOLLAR TREE INC	28,237	92.90	2,623,217.30
EBAY INC	94,680	48.82	4,622,277.60
EXPEDIA GROUP INC	16,200	93.06	1,507,572.00
GENUINE PARTS CO	17,933	92.28	1,654,857.24
HOME DEPOT INC	129,778	254.90	33,080,412.20
LKQ CORP	33,103	30.28	1,002,358.84
LOWE'S COS INC	91,207	130.97	11,945,380.79
MERCADOLIBRE INC	5,319	866.93	4,611,200.67
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,918	422.70	3,769,638.60
ROSS STORES INC	42,737	102.48	4,379,687.76
TARGET CORP	60,267	121.53	7,324,248.51
TIFFANY & CO	13,031	121.99	1,589,651.69
TJX COMPANIES INC	143,204	57.26	8,199,861.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,413	122.13	1,760,259.69
ULTA BEAUTY INC	6,347	252.08	1,599,951.76
WAYFAIR INC- CLASS A	7,643	170.76	1,305,118.68
COSTCO WHOLESALE CORP	52,477	312.04	16,374,923.08
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,900	4.75	218,025.00
KROGER CO	94,994	32.48	3,085,405.12
SYSCO CORP	57,863	61.59	3,563,782.17
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89,295	45.35	4,049,528.25
WALMART INC	168,581	121.56	20,492,706.36
ALTRIA GROUP INC	220,972	41.91	9,260,936.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	66,266	42.52	2,817,630.32
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36,797	67.42	2,480,853.74
BUNGE LTD	17,109	42.47	726,619.23
CAMPBELL SOUP CO	21,449	48.18	1,033,412.82
COCA-COLA CO/THE	484,600	49.09	23,789,014.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	22,637	42.48	961,619.76
CONAGRA BRANDS INC	57,813	33.42	1,932,110.46
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19,899	181.42	3,610,076.58
GENERAL MILLS INC	71,775	61.00	4,378,275.00
HERSHEY CO/THE	17,754	135.44	2,404,601.76
HORMEL FOODS CORP	34,245	48.00	1,643,760.00
INGREDION INC	8,754	89.50	783,483.00
JM SMUCKER CO/THE	13,545	107.44	1,455,274.80
KELLOGG CO	29,759	65.62	1,952,785.58
KEURIG DR PEPPER INC	41,746	28.69	1,197,692.74
KRAFT HEINZ CO/THE	80,166	32.62	2,615,014.92
LAMB WESTON HOLDINGS INC	16,942	71.25	1,207,117.50

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,663	170.83	2,504,880.29
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	24,052	42.40	1,019,804.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	170,206	52.53	8,940,921.18
MONSTER BEVERAGE CORP	47,863	72.23	3,457,144.49
PEPSICO INC	165,159	132.44	21,873,657.96
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	185,033	75.91	14,045,855.03
TYSON FOODS INC-CL A	35,528	64.92	2,306,477.76
CHURCH & DWIGHT CO INC	29,714	73.79	2,192,596.06
CLOROX COMPANY	14,827	197.57	2,929,370.39
COLGATE-PALMOLIVE CO	96,462	72.40	6,983,848.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26,389	205.17	5,414,231.13
KIMBERLY-CLARK CORP	40,570	139.28	5,650,589.60
PROCTER & GAMBLE CO/THE	293,538	118.33	34,734,351.54
ABBOTT LABORATORIES	209,673	89.86	18,841,215.78
ABIOMED INC	5,388	249.81	1,345,976.28
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,902	288.21	2,565,645.42
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,323	98.97	1,813,427.31
ANTHEM INC	29,989	287.89	8,633,533.21
BAXTER INTERNATIONAL INC	60,671	89.19	5,411,246.49
BECTON DICKINSON AND CO	32,246	242.01	7,803,854.46
BOSTON SCIENTIFIC CORP	166,109	38.83	6,450,012.47
CARDINAL HEALTH INC	33,567	57.27	1,922,382.09
CENTENE CORP	69,677	65.11	4,536,669.47
CERNER CORP	37,378	73.01	2,728,967.78
CIGNA CORP	44,262	209.48	9,272,003.76
COOPER COS INC/THE	6,039	318.54	1,923,663.06
CVS HEALTH CORP	155,055	68.35	10,598,009.25
DANAHER CORP	74,446	173.23	12,896,280.58
DAVITA INC	10,182	88.28	898,866.96
DENTSPLY SIRONA INC	25,680	50.18	1,288,622.40
DEXCOM INC	10,891	364.49	3,969,660.59
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	74,613	74.37	5,548,968.81
HCA HEALTHCARE INC	32,188	115.56	3,719,645.28
HENRY SCHEIN INC	18,027	65.83	1,186,717.41
HOLOGIC INC	30,494	52.41	1,598,190.54
HUMANA INC	15,696	389.86	6,119,242.56
IDEXX LABORATORIES INC	10,166	311.71	3,168,843.86
INSULET CORP	7,626	179.03	1,365,282.78
INTUITIVE SURGICAL INC	13,794	592.76	8,176,531.44
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,628	179.74	2,090,016.72
MASIMO CORP	6,107	220.24	1,345,005.68
MCKESSON CORP	19,204	161.62	3,103,750.48

MEDTRONIC PLC	159,483	102.04	16,273,645.32
MOLINA HEALTHCARE INC	7,217	171.03	1,234,323.51
QUEST DIAGNOSTICS INC	16,387	117.10	1,918,917.70
RESMED INC	17,174	160.84	2,762,266.16
STERIS PLC	10,291	163.91	1,686,797.81
STRYKER CORP	40,092	207.03	8,300,246.76
TELADOC HEALTH INC	8,345	161.65	1,348,969.25
TELEFLEX INC	5,436	376.58	2,047,088.88
UNITEDHEALTH GROUP INC	112,782	311.85	35,171,066.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9,965	109.16	1,087,779.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,216	132.37	1,352,291.92
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15,689	202.80	3,181,729.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,875	205.73	1,825,853.75
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24,568	137.40	3,375,643.20
ABBVIE INC	210,053	93.85	19,713,474.05
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36,873	90.38	3,332,581.74
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26,313	115.21	3,031,520.73
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	13,574	127.59	1,731,906.66
AMGEN INC	70,128	225.67	15,825,785.76
AVANTOR INC	51,253	18.17	931,267.01
BEIGENE LTD-ADR	4,978	172.03	856,365.34
BIO-RAD LABORATORIES-A	2,514	452.52	1,137,635.28
BIOGEN INC	20,788	306.72	6,376,095.36
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,377	105.80	2,261,686.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	268,364	61.33	16,458,764.12
CATALENT INC	18,500	74.70	1,381,950.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	45,318	23.75	1,076,302.50
ELI LILLY & CO	102,312	149.21	15,265,973.52
EXACT SCIENCES CORP	18,158	86.73	1,574,843.34
GILEAD SCIENCES INC	150,240	76.75	11,530,920.00
ILLUMINA INC	17,471	354.11	6,186,655.81
INCYTE CORP	21,875	93.51	2,045,531.25
IONIS PHARMACEUTICALS INC	15,180	57.56	873,760.80
IQVIA HOLDINGS INC	22,885	149.58	3,423,138.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,176	120.65	745,134.40
JOHNSON & JOHNSON	313,303	147.30	46,149,531.90
MERCK & CO. INC.	301,543	82.26	24,804,927.18
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,778	859.54	2,387,802.12
MODERNA INC	32,340	58.19	1,881,864.60
MYLAN NV	63,542	17.67	1,122,787.14
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,017	115.86	1,160,569.62
PERKINELMER INC	13,379	104.40	1,396,767.60

PERRIGO CO PLC	16,945	55.61	942,311.45
PFIZER INC	657,983	35.99	23,680,808.17
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,950	597.00	7,134,150.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8,679	147.99	1,284,405.21
SEATTLE GENETICS INC	14,312	148.39	2,123,757.68
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	134,760	12.84	1,730,318.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,392	354.20	16,786,246.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30,795	265.69	8,181,923.55
WATERS CORP	7,389	208.93	1,543,783.77
ZOETIS INC	56,444	141.01	7,959,168.44
BANK OF AMERICA CORP	933,763	28.11	26,248,077.93
CITIGROUP INC	250,448	58.86	14,741,369.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	52,255	29.25	1,528,458.75
COMERICA INC	15,248	45.52	694,088.96
EAST WEST BANCORP INC	16,395	40.84	669,571.80
FIFTH THIRD BANCORP	83,535	23.49	1,962,237.15
FIRST REPUBLIC BANK/CA	20,240	120.11	2,431,026.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	117,440	10.99	1,290,665.60
JPMORGAN CHASE & CO	365,439	111.23	40,647,779.97
KEYCORP	111,207	14.56	1,619,173.92
M & T BANK CORP	15,908	123.30	1,961,456.40
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	50,100	13.45	673,845.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51,386	128.03	6,578,949.58
REGIONS FINANCIAL CORP	115,656	13.33	1,541,694.48
SIGNATURE BANK	6,710	115.57	775,474.70
SVB FINANCIAL GROUP	6,388	235.20	1,502,457.60
TRUIST FINANCIAL CORP	159,363	44.31	7,061,374.53
US BANCORP	162,783	42.37	6,897,115.71
WELLS FARGO & CO	462,834	31.67	14,657,952.78
ZIONS BANCORP NA	20,780	38.61	802,315.80
AGNC INVESTMENT CORP	68,812	13.49	928,273.88
ALLY FINANCIAL INC	42,677	22.64	966,207.28
AMERICAN EXPRESS CO	81,552	109.73	8,948,700.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	14,526	155.57	2,259,809.82
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	163,933	6.82	1,118,023.06
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	20,600	53.15	1,094,890.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96,851	42.30	4,096,797.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	164,759	200.66	33,060,540.94
BLACKROCK INC	18,132	556.53	10,091,001.96
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	80,070	58.95	4,720,126.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54,745	79.02	4,325,949.90
CARLYLE GROUP INC/THE	16,600	29.66	492,356.00

CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,517	97.84	1,224,663.28
CME GROUP INC	42,623	192.14	8,189,583.22
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	36,619	60.62	2,219,843.78
E*TRADE FINANCIAL CORP	33,164	51.06	1,693,353.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	52,677	22.19	1,168,902.63
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,673	317.00	1,481,341.00
FRANKLIN RESOURCES INC	33,923	22.70	770,052.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39,080	217.92	8,516,313.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	65,826	97.81	6,438,441.06
INVESCO LTD	42,877	10.41	446,349.57
KKR & CO INC	58,197	30.36	1,766,860.92
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,503	493.90	2,224,031.70
MOODY'S CORP	20,049	279.69	5,607,504.81
MORGAN STANLEY	142,839	49.53	7,074,815.67
MSCI INC	10,077	330.88	3,334,277.76
NASDAQ INC	13,947	119.90	1,672,245.30
NORTHERN TRUST CORP	23,159	90.70	2,100,521.30
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,741	81.34	1,280,372.94
S&P GLOBAL INC	28,972	333.37	9,658,395.64
SCHWAB (CHARLES) CORP	137,811	42.82	5,901,067.02
SEI INVESTMENTS COMPANY	15,024	60.31	906,097.44
STATE STREET CORP	43,155	70.70	3,051,058.50
SYNCHRONY FINANCIAL	68,387	25.52	1,745,236.24
T ROWE PRICE GROUP INC	28,074	128.28	3,601,332.72
TD AMERITRADE HOLDING CORP	33,691	46.23	1,557,534.93
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,686	62.17	602,178.62
VOYA FINANCIAL INC	17,071	52.11	889,569.81
AFLAC INC	81,983	40.53	3,322,770.99
ALLEGHANY CORP	1,621	579.26	938,980.46
ALLSTATE CORP	37,720	105.47	3,978,328.40
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,675	71.53	620,522.75
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	103,997	36.36	3,781,330.92
AON PLC-CLASS A	27,528	200.20	5,511,105.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	46,864	34.98	1,639,302.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22,355	100.45	2,245,559.75
ASSURANT INC	7,109	114.88	816,681.92
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	17,062	35.57	606,895.34
BROWN & BROWN INC	29,818	42.73	1,274,123.14
CHUBB LTD	53,743	140.67	7,560,027.81
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,581	68.78	1,209,221.18
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,279	185.34	607,729.86
EVEREST RE GROUP LTD	4,605	226.15	1,041,420.75

FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	32,377	34.42	1,114,416.34
GLOBE LIFE INC	11,500	85.92	988,080.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,057	46.67	1,916,130.19
LINCOLN NATIONAL CORP	21,760	47.27	1,028,595.20
LOEWS CORP	30,087	39.08	1,175,799.96
MARKEL CORP	1,577	1,021.42	1,610,779.34
MARSH & MCLENNAN COS	59,880	111.49	6,676,021.20
METLIFE INC	92,359	40.74	3,762,705.66
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	33,626	47.05	1,582,103.30
PROGRESSIVE CORP	69,549	81.87	5,693,976.63
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	47,268	69.23	3,272,363.64
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,809	100.09	781,602.81
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,173	190.31	984,473.63
TRAVELERS COS INC/THE	30,338	124.36	3,772,833.68
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15,288	206.81	3,161,711.28
WR BERKLEY CORP	18,317	63.86	1,169,723.62
CBRE GROUP INC - A	40,752	54.02	2,201,423.04
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	124,100	4.26	528,666.00
JONES LANG LASALLE INC	6,176	122.68	757,671.68
ACCENTURE PLC-CL A	75,453	208.49	15,731,195.97
ADOBE INC	57,314	392.90	22,518,670.60
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19,565	99.00	1,936,935.00
ANSYS INC	10,196	289.10	2,947,663.60
AUTODESK INC	26,164	233.71	6,114,788.44
AUTOMATIC DATA PROCESSING	51,316	160.13	8,217,231.08
AVALARA INC	8,809	99.10	872,971.90
BLACK KNIGHT INC	18,128	73.53	1,332,951.84
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	16,941	80.53	1,364,258.73
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,652	126.67	1,729,298.84
CADENCE DESIGN SYS INC	33,246	91.40	3,038,684.40
CDK GLOBAL INC	13,633	43.70	595,762.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13,405	111.67	1,496,936.35
CITRIX SYSTEMS INC	13,816	139.15	1,922,496.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65,189	57.82	3,769,227.98
COUPA SOFTWARE INC	7,917	216.94	1,717,513.98
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	12,295	93.93	1,154,869.35
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,832	105.40	403,892.80
DATADOG INC - CLASS A	12,513	70.66	884,168.58
DOCUSIGN INC	20,256	139.64	2,828,547.84
DROPBOX INC-CLASS A	26,431	21.98	580,953.38
DYNATRACE INC	15,034	37.30	560,768.20
EPAM SYSTEMS INC	6,332	238.05	1,507,332.60

FAIR ISAAC CORP	3,473	420.71	1,461,125.83
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	73,227	143.07	10,476,586.89
FISERV INC	68,648	109.55	7,520,388.40
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,370	282.43	2,928,799.10
FORTINET INC	17,770	140.48	2,496,329.60
GARTNER INC	10,127	135.00	1,367,145.00
GLOBAL PAYMENTS INC	35,587	189.40	6,740,177.80
GODADDY INC - CLASS A	21,388	78.59	1,680,882.92
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,877	107.07	1,057,530.39
INTL BUSINESS MACHINES CORP	105,654	132.06	13,952,667.24
INTUIT INC	30,963	288.11	8,920,749.93
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9,104	179.87	1,637,536.48
LEIDOS HOLDINGS INC	15,588	106.05	1,653,107.40
MASTERCARD INC - A	106,406	311.88	33,185,903.28
MICROSOFT CORP	859,321	187.20	160,864,891.20
MONGODB INC	5,563	197.98	1,101,362.74
NORTONLIFELOCK INC	70,141	21.05	1,476,468.05
OKTA INC	13,468	180.60	2,432,320.80
ORACLE CORP	266,997	53.98	14,412,498.06
PALO ALTO NETWORKS INC	11,859	231.39	2,744,054.01
PAYCHEX INC	38,423	80.05	3,075,761.15
PAYCOM SOFTWARE INC	6,103	329.78	2,012,647.34
PAYPAL HOLDINGS INC	132,482	156.00	20,667,192.00
PTC INC	12,907	83.74	1,080,832.18
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,559	252.88	2,164,399.92
SALESFORCE.COM INC	100,202	173.88	17,423,123.76
SERVICENOW INC	22,564	390.46	8,810,339.44
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	36,603	32.56	1,191,793.68
SPLUNK INC	18,550	183.12	3,396,876.00
SQUARE INC - A	42,175	89.93	3,792,797.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	28,203	60.74	1,713,050.22
SYNOPSYS INC	17,829	182.97	3,262,172.13
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	4,854	354.29	1,719,723.66
TWILIO INC - A	14,066	196.71	2,766,922.86
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,805	358.43	1,722,256.15
VERISIGN INC	12,466	211.28	2,633,816.48
VISA INC-CLASS A SHARES	202,836	199.61	40,488,093.96
VMWARE INC-CLASS A	10,076	149.77	1,509,082.52
WESTERN UNION CO	46,057	24.55	1,130,699.35
WIX.COM LTD	6,057	213.29	1,291,897.53
WORKDAY INC-CLASS A	19,866	178.67	3,549,458.22
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,871	207.60	2,672,019.60

AMPHENOL CORP-CL A	35,360	107.00	3,783,520.00
APPLE INC	520,345	331.50	172,494,367.50
ARISTA NETWORKS INC	6,759	235.17	1,589,514.03
ARROW ELECTRONICS INC	8,719	76.08	663,341.52
CDW CORP/DE	17,070	125.34	2,139,553.80
CISCO SYSTEMS INC	503,887	47.83	24,100,915.21
COGNEX CORP	21,194	57.96	1,228,404.24
CORNING INC	90,683	26.68	2,419,422.44
DELL TECHNOLOGIES -C	28,697	50.52	1,449,772.44
F5 NETWORKS INC	7,710	145.14	1,119,029.40
FLIR SYSTEMS INC	15,771	46.43	732,247.53
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	153,009	11.11	1,699,929.99
HP INC	167,500	17.41	2,916,175.00
IPG PHOTONICS CORP	4,789	169.47	811,591.83
JUNIPER NETWORKS INC	42,320	24.85	1,051,652.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22,358	106.41	2,379,114.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,245	155.90	3,156,195.50
NETAPP INC	26,342	48.06	1,265,996.52
SEAGATE TECHNOLOGY	28,530	54.39	1,551,746.70
TE CONNECTIVITY LTD	39,650	91.04	3,609,736.00
TRIMBLE INC	31,061	45.12	1,401,472.32
WESTERN DIGITAL CORP	36,881	48.46	1,787,253.26
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6,183	277.55	1,716,091.65
AT&T INC	852,810	32.77	27,946,583.70
CENTURYLINK INC	107,816	10.81	1,165,490.96
LIBERTY GLOBAL PLC- C	50,430	22.69	1,144,256.70
LIBERTY GLOBAL PLC-A	20,125	23.24	467,705.00
T-MOBILE US INC	51,067	101.13	5,164,405.71
VERIZON COMMUNICATIONS INC	491,702	57.74	28,390,873.48
AES CORP	76,330	14.30	1,091,519.00
ALLIANT ENERGY CORP	28,171	50.64	1,426,579.44
AMEREN CORPORATION	29,049	75.58	2,195,523.42
AMERICAN ELECTRIC POWER	58,576	85.51	5,008,833.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,412	131.56	2,816,962.72
ATMOS ENERGY CORP	14,435	104.53	1,508,890.55
CENTERPOINT ENERGY INC	57,809	18.25	1,055,014.25
CMS ENERGY CORP	34,589	59.44	2,055,970.16
CONSOLIDATED EDISON INC	39,722	75.33	2,992,258.26
DOMINION ENERGY INC	99,494	84.29	8,386,349.26
DTE ENERGY COMPANY	22,973	114.87	2,638,908.51
DUKE ENERGY CORP	87,064	89.49	7,791,357.36
EDISON INTERNATIONAL	43,119	60.88	2,625,084.72

	ENTERGY CORP	24,040	103.73	2,493,669.20	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	26,941	45.67	1,230,395.47	
	EVERGY INC	27,517	63.06	1,735,222.02	
	EVERSOURCE ENERGY	39,047	86.52	3,378,346.44	
	EXELON CORP	115,789	40.36	4,673,244.04	
	FIRSTENERGY CORP	64,255	43.27	2,780,313.85	
	NEXTERA ENERGY INC	58,090	254.38	14,776,934.20	
	NISOURCE INC	46,954	25.08	1,177,606.32	
	NRG ENERGY INC	30,339	36.72	1,114,048.08	
	OGE ENERGY CORP	24,702	33.60	829,987.20	
	PINNACLE WEST CAPITAL	12,778	79.38	1,014,317.64	
	PPL CORP	91,293	30.04	2,742,441.72	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,033	53.48	3,210,564.84	
	SEMPRA ENERGY	34,733	133.79	4,646,928.07	
	SOUTHERN CO/THE	125,115	58.45	7,312,971.75	
	UGI CORP	23,265	35.69	830,327.85	
	VISTRA ENERGY CORP	52,196	20.87	1,089,330.52	
	WEC ENERGY GROUP INC	37,393	92.85	3,471,940.05	
	XCEL ENERGY INC	62,167	65.26	4,057,018.42	
	ADVANCED MICRO DEVICES	139,058	53.10	7,383,979.80	
	ANALOG DEVICES INC	43,791	124.59	5,455,920.69	
	APPLIED MATERIALS INC	109,063	60.19	6,564,501.97	
	BROADCOM INC	47,515	317.08	15,066,056.20	
	INTEL CORP	508,629	64.34	32,725,189.86	
	KLA CORP	18,604	192.48	3,580,897.92	
	LAM RESEARCH CORP	17,280	304.92	5,269,017.60	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	79,786	35.89	2,863,519.54	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	31,722	61.28	1,943,924.16	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,518	110.00	3,136,980.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	132,115	53.72	7,097,217.80	
	NVIDIA CORP	72,774	356.80	25,965,763.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	33,233	113.82	3,782,580.06	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	45,265	20.16	912,542.40	
	QORVO INC	13,433	115.67	1,553,795.11	
	QUALCOMM INC	135,977	88.55	12,040,763.35	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	20,649	136.16	2,811,567.84	
	TERADYNE INC	20,798	76.76	1,596,454.48	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	111,095	131.44	14,602,326.80	
	XILINX INC	29,616	96.20	2,849,059.20	
	アメリカドル 小計	35,224,649		3,251,026,033.52 (355,922,330,149)	
カナダドル	CAMECO CORP	52,400	13.82	724,168.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	142,800	28.86	4,121,208.00	
CENOVUS ENERGY INC	134,800	7.05	950,340.00	
ENBRIDGE INC	240,900	44.84	10,801,956.00	
IMPERIAL OIL LTD	28,300	24.86	703,538.00	
INTER PIPELINE LTD	47,200	14.30	674,960.00	
KEYERA CORP	23,600	23.29	549,644.00	
PARKLAND CORP	15,800	39.54	624,732.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	65,332	37.20	2,430,350.40	
SUNCOR ENERGY INC	183,200	28.57	5,234,024.00	
TC ENERGY CORP	111,800	63.19	7,064,642.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	28,800	78.23	2,253,024.00	
B2GOLD CORP	125,100	6.89	861,939.00	
BARRICK GOLD CORP	211,700	31.29	6,624,093.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	18,800	45.84	861,792.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	75,600	9.52	719,712.00	
FRANCO-NEVADA CORP	22,500	172.94	3,891,150.00	
KINROSS GOLD CORP	141,500	8.35	1,181,525.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	32,300	51.35	1,658,605.00	
LUNDIN MINING CORP	90,800	7.00	635,600.00	
NUTRIEN LTD	66,559	51.38	3,419,801.42	
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,000	35.95	898,750.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	53,700	15.69	842,553.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,200	50.70	2,697,240.00	
YAMANA GOLD INC	114,800	6.75	774,900.00	
CAE INC	36,500	25.91	945,715.00	
WSP GLOBAL INC	11,900	88.15	1,048,985.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13,100	58.46	765,826.00	
THOMSON REUTERS CORP	19,732	95.43	1,883,024.76	
AIR CANADA	12,400	20.29	251,596.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	85,000	122.28	10,393,800.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	16,300	357.47	5,826,761.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	33,500	62.93	2,108,155.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,200	24.10	535,020.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	33,710	79.95	2,695,114.50	
QUEBECOR INC -CL B	18,500	30.78	569,430.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	54,700	24.12	1,319,364.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7,400	125.14	926,036.00	
DOLLARAMA INC	34,700	47.68	1,654,496.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	103,100	43.12	4,445,672.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	23,400	30.16	705,744.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	21,500	67.46	1,450,390.00	
METRO INC/CN	31,000	56.15	1,740,650.00	

	WESTON (GEORGE) LTD	8,311	97.50	810,322.50	
	SAPUTO INC	27,600	33.58	926,808.00	
	BAUSCH HEALTH COS INC	37,600	25.90	973,840.00	
	CANOPY GROWTH CORP	29,700	22.19	659,043.00	
	CRONOS GROUP INC	25,600	8.85	226,560.00	
	BANK OF MONTREAL	76,200	76.07	5,796,534.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	144,100	60.54	8,723,814.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	53,000	97.90	5,188,700.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,800	65.52	2,542,176.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	169,500	96.80	16,407,600.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	215,000	65.01	13,977,150.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	159,450	48.72	7,768,404.00	
	CI FINANCIAL CORP	21,000	18.08	379,680.00	
	IGM FINANCIAL INC	8,800	35.05	308,440.00	
	ONEX CORPORATION	9,400	67.59	635,346.00	
	TMX GROUP LTD	6,700	130.87	876,829.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,000	439.48	1,318,440.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	38,500	24.32	936,320.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	11,700	48.37	565,929.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	17,300	133.87	2,315,951.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	232,700	19.52	4,542,304.00	
	POWER CORP OF CANADA	72,500	25.38	1,840,050.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	70,400	52.80	3,717,120.00	
	BLACKBERRY LTD	52,200	7.38	385,236.00	
	CGI INC	29,600	92.27	2,731,192.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,400	1,499.44	3,598,656.00	
	OPEN TEXT CORP	33,900	58.01	1,966,539.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	12,400	978.32	12,131,168.00	
	BCE INC	17,700	59.50	1,053,150.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	42,300	58.75	2,485,125.00	
	TELUS CORP	50,100	24.95	1,249,995.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	64,900	19.39	1,258,411.00	
	ALTAGAS LTD	28,800	16.24	467,712.00	
	ATCO LTD -CLASS I	10,400	39.02	405,808.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,400	33.02	442,468.00	
	EMERA INC	29,900	55.40	1,656,460.00	
	FORTIS INC	55,200	53.87	2,973,624.00	
	HYDRO ONE LTD	36,900	26.64	983,016.00	
	カナダドル 小計	4,642,094		215,691,946.58 (17,609,090,518)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	28,939	28.27	818,105.53	
	OIL SEARCH LTD	220,605	3.58	789,765.90	

ORIGIN ENERGY LTD	216,727	6.23	1,350,209.21
SANTOS LTD	222,183	5.75	1,277,552.25
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,472	20.13	351,711.36
WOODSIDE PETROLEUM LTD	116,227	23.36	2,715,062.72
BHP GROUP LTD	349,876	36.33	12,710,995.08
BLUESCOPE STEEL LTD	52,098	12.37	644,452.26
EVOLUTION MINING LTD	192,818	5.60	1,079,780.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	202,080	14.54	2,938,243.20
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	54,083	26.95	1,457,536.85
NEWCREST MINING LTD	96,043	29.05	2,790,049.15
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,919	13.48	1,185,148.12
ORICA LTD	42,452	17.55	745,032.60
RIO TINTO LTD	43,795	98.60	4,318,187.00
SOUTH32 LTD	583,896	2.19	1,278,732.24
CIMIC GROUP LTD	14,688	27.07	397,604.16
BRAMBLES LTD	190,095	11.22	2,132,865.90
AURIZON HOLDINGS LTD	221,393	4.77	1,056,044.61
QANTAS AIRWAYS LTD	76,723	4.63	355,227.49
SYDNEY AIRPORT	126,628	6.48	820,549.44
TRANSURBAN GROUP	325,560	14.68	4,779,220.80
ARISTOCRAT LEISURE LTD	67,759	27.17	1,841,012.03
CROWN RESORTS LTD	38,274	10.37	396,901.38
TABCORP HOLDINGS LTD	207,851	3.45	717,085.95
REA GROUP LTD	7,136	104.81	747,924.16
SEEK LTD	35,923	20.10	722,052.30
WESFARMERS LTD	135,008	41.71	5,631,183.68
COLES GROUP LTD	164,104	15.76	2,586,279.04
WOOLWORTHS GROUP LTD	149,723	37.06	5,548,734.38
COCA-COLA AMATIL LTD	51,988	8.81	458,014.28
TREASURY WINE ESTATES LTD	79,600	10.68	850,128.00
COCHLEAR LTD	7,174	192.46	1,380,708.04
RAMSAY HEALTH CARE LTD	22,087	67.11	1,482,258.57
SONIC HEALTHCARE LTD	55,017	28.78	1,583,389.26
CSL LTD	53,944	285.33	15,391,841.52
AUST AND NZ BANKING GROUP	338,108	19.77	6,684,395.16
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	210,728	68.73	14,483,335.44
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	381,560	19.48	7,432,788.80
WESTPAC BANKING CORP	430,737	18.79	8,093,548.23
AMP LTD	432,472	1.79	774,124.88
ASX LTD	23,379	87.03	2,034,674.37
MACQUARIE GROUP LTD	40,359	118.00	4,762,362.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	13,777	58.00	799,066.00

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	288,140	6.18	1,780,705.20	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	360,493	2.90	1,045,429.70	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	162,243	9.08	1,473,166.44	
	SUNCORP GROUP LTD	160,834	9.96	1,601,906.64	
	LENDLEASE GROUP	80,199	13.05	1,046,596.95	
	AFTERPAY LTD	25,400	50.61	1,285,494.00	
	COMPUTERSHARE LTD	50,525	13.46	680,066.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,384	22.15	473,655.60	
	TELSTRA CORP LTD	456,721	3.22	1,470,641.62	
	TPG TELECOM LTD	31,501	7.89	248,542.89	
	AGL ENERGY LTD	73,209	17.49	1,280,425.41	
	APA GROUP	130,000	11.45	1,488,500.00	
	AUSNET SERVICES	190,003	1.71	325,855.14	
	オーストラリアドル 小計	8,459,660		144,594,870.23 (11,054,277,829)	
イギリスポンド	BP PLC	2,406,236	3.62	8,716,589.91	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	486,650	14.77	7,188,793.80	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	444,616	14.26	6,342,891.85	
	ANGLO AMERICAN PLC	145,029	18.65	2,705,951.08	
	ANTOFAGASTA PLC	52,176	9.27	483,671.52	
	BHP GROUP PLC	251,069	17.22	4,323,408.18	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,607	51.74	755,766.18	
	EVRAZ PLC	56,606	3.14	177,799.44	
	GLENCORE PLC	1,210,435	1.80	2,190,645.26	
	JOHNSON MATTHEY PLC	23,710	22.61	536,083.10	
	MONDI PLC	60,326	15.72	948,324.72	
	RIO TINTO PLC	133,022	45.50	6,052,501.00	
	ASHTED GROUP PLC	53,721	26.10	1,402,118.10	
	BAE SYSTEMS PLC	389,598	5.14	2,004,092.11	
	BUNZL PLC	39,884	20.17	804,460.28	
	DCC PLC	11,203	69.52	778,832.56	
	FERGUSON PLC	27,344	66.10	1,807,438.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	565,432	1.48	842,210.96	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	247,092	3.55	879,400.42	
	SMITHS GROUP PLC	47,981	14.35	688,527.35	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,618	101.20	872,141.60	
	EXPERIAN PLC	108,227	28.46	3,080,140.42	
	INTERTEK GROUP PLC	18,273	54.74	1,000,264.02	
	RELX PLC	230,382	19.09	4,399,144.29	
	RENTOKIL INITIAL PLC	215,505	4.83	1,041,751.17	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	111,911	5.50	615,734.32	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	13,870	43.80	607,506.00	

BURBERRY GROUP PLC	50,646	17.21	871,617.66
PERSIMMON PLC	39,651	25.40	1,007,135.40
TAYLOR WIMPEY PLC	418,238	1.61	675,036.13
COMPASS GROUP PLC	212,548	13.36	2,839,641.28
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,970	114.25	682,072.50
GVC HOLDINGS PLC	62,983	8.30	523,136.79
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21,735	43.14	937,647.90
WHITBREAD PLC	17,823	27.47	489,597.81
AUTO TRADER GROUP PLC	121,736	5.51	670,765.36
INFORMA PLC	181,179	5.22	946,841.45
ITV PLC	385,089	0.88	339,648.49
PEARSON PLC	86,984	5.31	461,885.04
WPP PLC	143,982	7.00	1,008,737.89
JD SPORTS FASHION PLC	45,700	6.91	315,878.40
KINGFISHER PLC	231,025	2.07	478,452.77
NEXT PLC	15,223	54.80	834,220.40
OCADO GROUP PLC	55,379	21.23	1,175,696.17
SAINSBURY (J) PLC	185,058	1.97	365,674.60
TESCO PLC	1,166,145	2.27	2,655,312.16
WM MORRISON SUPERMARKETS	263,276	1.86	490,483.18
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	40,366	20.50	827,503.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	272,893	31.82	8,684,819.72
COCA-COLA HBC AG-DI	22,214	21.64	480,710.96
DIAGEO PLC	278,253	29.00	8,069,337.00
IMPERIAL BRANDS PLC	116,335	15.06	1,752,586.77
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	84,386	68.74	5,800,693.64
UNILEVER PLC	138,985	44.09	6,127,848.65
SMITH & NEPHEW PLC	105,616	17.36	1,833,493.76
ASTRAZENECA PLC	156,072	84.27	13,152,187.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	597,080	16.37	9,777,782.08
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,313	23.30	403,392.90
BARCLAYS PLC	2,072,138	1.31	2,722,789.33
HSBC HOLDINGS PLC	2,417,585	4.22	10,225,175.75
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,427,880	0.35	2,995,689.94
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	577,894	1.37	793,737.40
STANDARD CHARTERED PLC	326,356	4.64	1,515,923.62
3I GROUP PLC	112,735	9.23	1,040,769.52
HARGREAVES LANSDOWN PLC	37,749	16.28	614,553.72
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,508	80.72	3,027,645.76
M&G PLC	312,047	1.65	515,345.62
SCHRODERS PLC	13,260	31.45	417,027.00
ST JAMES'S PLACE PLC	60,295	10.06	606,869.17

	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	297,694	2.80	834,138.58	
	ADMIRAL GROUP PLC	20,702	23.20	480,286.40	
	AVIVA PLC	491,564	2.96	1,456,504.13	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	152,128	2.86	435,694.59	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	688,854	2.50	1,728,334.68	
	PRUDENTIAL PLC	310,193	12.74	3,953,409.78	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	116,152	4.35	505,958.11	
	AVEVA GROUP PLC	8,992	41.15	370,020.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	134,068	6.90	925,605.47	
	HALMA PLC	45,996	23.22	1,068,027.12	
	BT GROUP PLC	1,078,692	1.19	1,293,891.05	
	VODAFONE GROUP PLC	3,187,619	1.38	4,429,515.36	
	NATIONAL GRID PLC	417,995	9.18	3,839,702.07	
	SEVERN TRENT PLC	26,963	24.79	668,412.77	
	SSE PLC	127,157	12.87	1,637,146.37	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	80,912	9.16	741,153.92	
	イギリスポンド 小計	34,494,534		184,769,353.37 (25,703,264,747)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	27,401	19.30	528,976.30	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	886	719.00	637,034.00	
	GIVAUDAN-REG	1,099	3,395.00	3,731,105.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	62,170	43.64	2,713,098.80	
	SIKA AG-REG	16,800	172.45	2,897,160.00	
	ABB LTD-REG	219,362	21.02	4,610,989.24	
	GEBERIT AG-REG	4,262	479.70	2,044,481.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,688	226.20	608,025.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,544	227.70	1,034,668.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,283	51.64	944,134.12	
	SGS SA-REG	708	2,331.00	1,650,348.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6,126	148.80	911,548.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	62,109	65.22	4,050,748.98	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	3,350	206.70	692,445.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	6,832	40.16	274,373.12	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	331	1,899.00	628,569.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	131	7,790.00	1,020,490.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	13	83,400.00	1,084,200.00	
	NESTLE SA-REG	353,845	102.60	36,304,497.00	
	ALCON INC	58,495	61.08	3,572,874.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,267	209.80	1,314,816.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,291	806.60	1,041,320.60	
	LONZA GROUP AG-REG	8,843	468.50	4,142,945.50	
	NOVARTIS AG-REG	255,438	83.04	21,211,571.52	

	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	83,540	332.15	27,747,811.00	
	VIFOR PHARMA AG	5,810	147.25	855,522.50	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,582	94.30	337,782.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	291,627	10.21	2,977,511.67	
	JULIUS BAER GROUP LTD	27,542	45.02	1,239,940.84	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,943	80.15	316,031.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,227	842.00	1,875,134.00	
	UBS GROUP AG-REG	431,362	11.34	4,891,645.08	
	BALOISE HOLDING AG - REG	5,693	154.90	881,845.70	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,025	380.10	1,529,902.50	
	SWISS RE AG	35,208	77.86	2,741,294.88	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,832	350.50	6,250,116.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	9,482	94.65	897,471.30	
	TEMENOS AG - REG	7,971	145.50	1,159,780.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	19,565	55.68	1,089,379.20	
	SWISSCOM AG-REG	3,088	501.20	1,547,705.60	
	スイスフラン 小計	2,073,771		153,989,296.80 (17,520,902,189)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	326,868	53.60	17,520,124.80	
	NWS HOLDINGS LTD	214,500	7.11	1,525,095.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	156,000	73.65	11,489,400.00	
	MTR CORP	178,500	40.70	7,264,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	262,000	56.05	14,685,100.00	
	SANDS CHINA LTD	273,200	32.95	9,001,940.00	
	SJM HOLDINGS LTD	210,000	9.48	1,990,800.00	
	WYNN MACAU LTD	205,600	14.54	2,989,424.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	205,300	24.80	5,091,440.00	
	WH GROUP LTD	1,196,000	6.75	8,073,000.00	
	BANK OF EAST ASIA LTD	129,420	18.52	2,396,858.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	453,000	24.50	11,098,500.00	
	HANG SENG BANK LTD	92,900	134.80	12,522,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	142,900	294.20	42,041,180.00	
	AIA GROUP LTD	1,439,200	71.60	103,046,720.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	315,868	46.15	14,577,308.20	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	211,000	17.48	3,688,280.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	31.00	5,041,871.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	92,500	20.95	1,937,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	769,000	8.91	6,851,790.00	
	SINO LAND CO	431,400	9.94	4,288,116.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	155,500	99.75	15,511,125.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	52,000	46.30	2,407,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	167,600	19.50	3,268,200.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	135,000	33.25	4,488,750.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	77,000	58.70	4,519,900.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	492,000	11.58	5,697,360.00	
	PCCW LTD	446,000	4.43	1,975,780.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	70,000	42.20	2,954,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	191,500	78.30	14,994,450.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	300,000	7.92	2,376,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,185,532	13.66	16,194,367.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	164,000	44.60	7,314,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30,500	76.55	2,334,775.00	
香港ドル 小計		10,934,429		371,159,399.52 (5,244,482,315)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	167,100	6.30	1,052,730.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	169,300	3.53	597,629.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	321,300	1.03	330,939.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	161,040	4.33	697,303.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	820,900	0.83	681,347.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	13,500	23.58	318,330.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	250,500	4.07	1,019,535.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	214,200	22.28	4,772,376.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	399,000	9.44	3,766,560.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	144,300	22.00	3,174,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	87,100	8.45	735,995.00	
	CAPITALAND LTD	302,200	3.17	957,974.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,900	9.18	393,822.00	
	UOL GROUP LTD	44,000	7.49	329,560.00	
	VENTURE CORP LTD	28,400	16.69	473,996.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,004,160	2.63	2,640,940.80	
シンガポールドル 小計		4,169,900		21,943,637.00 (1,725,428,177)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	146,555	6.96	1,020,022.80	
	A2 MILK CO LTD	91,959	19.00	1,747,221.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	70,688	28.08	1,984,919.04	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	38,282	13.45	514,892.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	226,021	4.43	1,002,403.13	
	MERCURY NZ LTD	67,670	4.77	322,785.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	164,842	4.92	811,022.64	
ニュージーランドドル 小計		806,017		7,403,267.41 (528,445,227)	
スウェーデンクローネ	LUNDIN ENERGY AB	21,146	246.70	5,216,718.20	
	BOLIDEN AB	30,803	218.10	6,718,134.30	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	72,147	113.70	8,203,113.90	

	ALFA LAVAL AB	34,290	211.70	7,259,193.00	
	ASSA ABLOY AB-B	120,069	203.70	24,458,055.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	78,239	386.30	30,223,725.70	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	48,212	347.90	16,772,954.80	
	EPIROC AB-A	79,343	114.25	9,064,937.75	
	EPIROC AB-B	41,796	113.95	4,762,654.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	18,200	182.30	3,317,860.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	37,134	213.20	7,916,968.80	
	SANDVIK AB	138,396	175.85	24,336,936.60	
	SKANSKA AB-B SHS	39,585	199.30	7,889,290.50	
	SKF AB-B SHARES	44,526	185.50	8,259,573.00	
	VOLVO AB-B SHS	177,579	153.00	27,169,587.00	
	SECURITAS AB-B SHS	42,967	135.15	5,806,990.05	
	ELECTROLUX AB-SER B	23,799	162.15	3,859,007.85	
	HUSQVARNA AB-B SHS	59,750	74.26	4,437,035.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	15,100	593.20	8,957,320.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	92,057	168.25	15,488,590.25	
	ICA GRUPPEN AB	12,550	423.60	5,316,180.00	
	SWEDISH MATCH AB	20,564	666.20	13,699,736.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	72,483	284.10	20,592,420.30	
	NORDEA BANK ABP	392,487	70.64	27,725,281.68	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,765	87.30	17,090,284.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	177,757	93.56	16,630,944.92	
	SWEDBANK AB - A SHARES	112,873	130.76	14,759,273.48	
	EQT AB	28,400	182.20	5,174,480.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,934	229.60	3,658,446.40	
	INVESTOR AB-B SHS	54,615	527.40	28,803,951.00	
	KINNEVIK AB - B	31,064	255.70	7,943,064.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,476	456.20	3,410,551.20	
	ERICSSON LM-B SHS	344,243	88.40	30,431,081.20	
	HEXAGON AB-B SHS	33,522	549.80	18,430,395.60	
	TELE2 AB-B SHS	57,289	127.45	7,301,483.05	
	TELIA CO AB	289,421	34.00	9,840,314.00	
	スウェーデンクローネ 小計	3,061,581		460,926,535.13 (5,503,462,829)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	122,299	153.20	18,736,206.80	
	NORSK HYDRO ASA	183,430	27.94	5,125,034.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,588	350.30	6,861,676.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,712	248.20	2,410,518.40	
	MOWI ASA	53,156	196.70	10,455,785.20	
	ORKLA ASA	81,286	84.94	6,904,432.84	
	DNB ASA	110,538	143.35	15,845,622.30	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,100	180.00	3,978,000.00	
	TELENOR ASA	87,217	152.05	13,261,344.85	
ノルウェークローネ 小計		689,326		83,578,620.99 (987,899,300)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	13,087	616.80	8,072,061.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	26,042	371.60	9,677,207.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	23,616	701.60	16,568,985.60	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	371	7,000.00	2,597,000.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	749	7,514.00	5,627,986.00	
	DSV PANALPINA A/S	25,136	739.60	18,590,585.60	
	PANDORA A/S	10,575	357.90	3,784,792.50	
	CARLSBERG AS-B	12,796	900.60	11,524,077.60	
	AMBU A/S-B	19,383	221.70	4,297,211.10	
	COLOPLAST-B	14,309	1,052.50	15,060,222.50	
	DEMANT A/S	11,895	192.30	2,287,408.50	
	GN STORE NORD A/S	15,298	364.60	5,577,650.80	
	GENMAB A/S	7,599	1,913.50	14,540,686.50	
	H LUNDBECK A/S	9,855	267.40	2,635,227.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	210,333	429.50	90,338,023.50	
	DANSKE BANK A/S	82,953	90.74	7,527,155.22	
	TRYG A/S	14,757	199.60	2,945,497.20	
	ORSTED A/S	22,457	777.60	17,462,563.20	
デンマーククローネ 小計		521,211		239,114,341.62 (3,966,906,927)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	96,941	12.66	1,227,273.06	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,261	518.00	1,689,198.00	
	BANK HAPOLIM BM	121,579	21.35	2,595,711.65	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	158,751	19.22	3,051,194.22	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	124,481	10.88	1,354,353.28	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	14,019	70.15	983,432.85	
	AZRIELI GROUP LTD	5,293	176.50	934,214.50	
	NICE LTD	6,779	648.80	4,398,215.20	
イスラエルシェケル 小計		531,104		16,233,592.76 (512,656,859)	
ユーロ	ENI SPA	302,762	9.50	2,878,055.57	
	GALP ENERGIA SGPS SA	64,775	11.98	776,328.37	
	NESTE OYJ	51,411	36.82	1,892,953.02	
	OMV AG	19,517	34.44	672,165.48	
	REPSOL SA	167,361	9.53	1,594,950.33	
	TENARIS SA	48,662	6.79	330,706.95	
	TOTAL SA	293,717	38.33	11,259,641.19	
	VOPAK	7,470	48.23	360,278.10	

AIR LIQUIDE SA	56,247	126.75	7,129,307.25
AKZO NOBEL N.V.	22,951	78.56	1,803,030.56
ARCELORMITTAL	87,018	10.45	909,686.17
ARKEMA	7,451	87.98	655,538.98
BASF SE	109,415	57.43	6,283,703.45
COVESTRO AG	20,208	37.44	756,587.52
CRH PLC	93,352	33.16	3,095,552.32
EVONIK INDUSTRIES AG	22,799	24.93	568,379.07
FUCHS PETROLUB SE-PREF	9,295	37.90	352,280.50
HEIDELBERGCEMENT AG	18,624	52.20	972,172.80
KONINKLIJKE DSM NV	20,779	118.10	2,453,999.90
LANXESS AG	8,620	51.34	442,550.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,953	29.86	774,956.58
SOLVAY SA	8,657	77.98	675,072.86
STORA ENSO OYJ-R SHS	68,929	11.55	796,129.95
SYMRISE AG	15,624	95.76	1,496,154.24
THYSENKRUPP AG	41,124	7.45	306,373.80
UMICORE	23,850	42.78	1,020,303.00
UPM-KYMMENE OYJ	62,887	27.28	1,715,557.36
VOESTALPINE AG	10,934	20.27	221,632.18
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29,781	26.05	775,795.05
AIRBUS SE	69,725	80.98	5,646,330.50
ALSTOM	23,128	44.00	1,017,632.00
ANDRITZ AG	10,478	34.82	364,843.96
BOUYGUES SA	27,838	30.68	854,069.84
BRENNTAG AG	18,754	49.20	922,696.80
CNH INDUSTRIAL NV	129,887	6.87	892,843.23
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	63,372	32.64	2,068,462.08
DASSAULT AVIATION SA	255	941.00	239,955.00
EIFFAGE	9,901	87.44	865,743.44
FERROVIAL SA	58,250	26.00	1,514,500.00
GEA GROUP AG	20,545	29.79	612,035.55
HOCHTIEF AG	2,413	88.55	213,671.15
KINGSPAN GROUP PLC	18,896	57.05	1,078,016.80
KION GROUP AG	8,829	56.46	498,485.34
KNORR-BREMSE AG	5,236	100.50	526,218.00
KONE OYJ-B	41,095	61.72	2,536,383.40
LEGRAND SA	31,707	66.64	2,112,954.48
LEONARDO SPA	41,656	7.08	294,924.48
METSO OYJ	10,106	32.23	325,716.38
MTU AERO ENGINES AG	6,377	178.45	1,137,975.65
PRYSMIAN SPA	25,910	20.26	524,936.60

SAFRAN SA	38,627	101.95	3,938,022.65
SCHNEIDER ELECTRIC SE	65,633	98.38	6,456,974.54
SIEMENS AG-REG	91,035	108.54	9,880,938.90
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32,327	15.54	502,523.21
THALES SA	11,782	78.02	919,231.64
VINCI SA	61,227	90.32	5,530,022.64
WARTSILA OYJ ABP	46,974	8.13	381,898.62
BUREAU VERITAS SA	36,539	19.68	719,087.52
RANDSTAD NV	13,562	43.89	595,236.18
TELEPERFORMANCE	7,116	226.50	1,611,774.00
WOLTERS KLUWER	32,590	67.76	2,208,298.40
ADP	3,116	110.40	344,006.40
AENA SME SA	7,622	143.60	1,094,519.20
ATLANTIA SPA	55,267	16.00	884,272.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,676	10.87	246,488.12
DEUTSCHE POST AG-REG	117,907	31.69	3,736,472.83
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3,842	49.14	188,795.88
GETLINK SE	48,257	14.16	683,319.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	38,587	59.50	2,295,926.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	8,200	46.44	380,808.00
CONTINENTAL AG	12,559	98.64	1,238,819.76
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	102,209	39.82	4,070,473.42
FAURECIA	10,504	38.71	406,609.84
FERRARI NV	14,987	153.90	2,306,499.30
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	127,348	9.31	1,185,864.57
MICHELIN (CGDE)	20,774	101.80	2,114,793.20
PEUGEOT SA	68,017	15.43	1,049,502.31
PIRELLI & C SPA	35,183	4.43	156,001.42
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	19,096	55.16	1,053,335.36
RENAULT SA	21,400	25.93	554,902.00
VALEO SA	27,895	24.57	685,380.15
VOLKSWAGEN AG	3,869	156.70	606,272.30
VOLKSWAGEN AG-PREF	22,096	148.98	3,291,862.08
ADIDAS AG	22,619	264.50	5,982,725.50
ESSILORLUXOTTICA	33,772	125.30	4,231,631.60
HERMES INTERNATIONAL	3,761	786.20	2,956,898.20
KERING	9,007	536.10	4,828,652.70
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	33,009	404.25	13,343,888.25
MONCLER SPA	24,687	35.70	881,325.90
PUMA SE	10,166	72.14	733,375.24
SEB SA	3,250	128.70	418,275.00
ACCOR SA	24,398	28.62	698,270.76

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,385	128.60	1,592,711.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,150	31.26	317,289.00
SODEXO SA	11,214	71.70	804,043.80
ALTICE EUROPE NV	63,237	4.15	262,433.55
BOLLORE	130,932	3.02	395,938.36
JCDECAUX SA	12,164	20.16	245,226.24
PUBLICIS GROUPE	26,010	31.95	831,019.50
SCOUT24 AG	12,799	70.10	897,209.90
SES	37,523	7.40	277,820.29
TELENET GROUP HOLDING NV	6,451	39.30	253,524.30
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,402	67.40	768,494.80
VIVENDI	99,590	22.69	2,259,697.10
DELIVERY HERO SE	15,206	85.46	1,299,504.76
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	129,844	26.90	3,492,803.60
JUST EAT TAKEAWAY	14,433	99.00	1,428,867.00
PROSUS NV	58,046	75.56	4,385,955.76
ZALANDO SE	18,097	64.14	1,160,741.58
CARREFOUR SA	75,124	14.86	1,116,718.26
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,881	35.25	242,555.25
COLRUYT SA	5,890	53.06	312,523.40
JERONIMO MARTINS	26,811	15.49	415,436.44
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	130,905	23.52	3,078,885.60
METRO AG	28,725	9.11	261,799.65
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	90,738	51.17	4,643,063.46
DANONE	73,373	63.50	4,659,185.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	63,159	7.39	467,123.96
HEINEKEN HOLDING NV	14,542	79.15	1,150,999.30
HEINEKEN NV	30,979	86.60	2,682,781.40
KERRY GROUP PLC-A	18,458	107.40	1,982,389.20
PERNOD RICARD SA	25,237	146.70	3,702,267.90
REMY COINTREAU	3,239	121.50	393,538.50
BEIERSDORF AG	12,488	99.08	1,237,311.04
HENKEL AG & CO KGAA	11,629	77.35	899,503.15
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21,769	86.30	1,878,664.70
L'OREAL	29,789	269.70	8,034,093.30
UNILEVER NV	173,920	47.85	8,322,072.00
BIOMERIEUX	5,151	112.90	581,547.90
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,177	93.15	389,087.55
DIASORIN SPA	2,987	166.00	495,842.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	25,634	78.20	2,004,578.80
FRESENIUS SE & CO KGAA	50,099	45.00	2,254,455.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	107,157	41.96	4,496,843.50

ORPEA	6,192	106.00	656,352.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	4,113	301.80	1,241,303.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	18,937	43.73	828,209.69	
BAYER AG-REG	116,840	66.15	7,728,966.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,567	588.60	922,336.20	
GALAPAGOS NV	5,261	176.80	930,144.80	
GRIFOLS SA	36,630	27.66	1,013,185.80	
IPSEN	5,229	72.70	380,148.30	
MERCK KGAA	15,225	105.30	1,603,192.50	
ORION OYJ-CLASS B	13,364	44.19	590,555.16	
QIAGEN N.V.	26,248	39.23	1,029,709.04	
RECORDATI SPA	13,831	41.35	571,911.85	
SANOFI	134,126	89.16	11,958,674.16	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,071	213.40	655,351.40	
UCB SA	14,468	88.76	1,284,179.68	
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,526	9.00	409,916.10	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	802,425	3.52	2,830,152.97	
BANCO SANTANDER SA	1,972,413	2.52	4,984,287.65	
BANKINTER SA	67,617	4.54	307,319.26	
BNP PARIBAS	133,621	39.11	5,226,585.41	
CAIXABANK SA	460,676	2.05	944,385.80	
COMMERZBANK AG	107,139	4.42	474,304.35	
CREDIT AGRICOLE SA	141,461	9.09	1,286,729.25	
ERSTE GROUP BANK AG	33,121	24.83	822,394.43	
FINECOBANK SPA	78,317	11.27	882,632.59	
ING GROEP NV	465,881	7.13	3,321,731.53	
INTESA SANPAOLO	1,776,759	1.77	3,149,838.35	
IRISH BANK RESOLUTION CO/OLD	47,248	—	—	
KBC GROUP NV	29,619	53.14	1,573,953.66	
MEDIOBANCA SPA	66,255	7.10	470,940.54	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	21,019	18.61	391,163.59	
SOCIETE GENERALE SA	93,727	16.84	1,579,112.49	
UNICREDIT SPA	253,607	8.91	2,261,920.83	
AMUNDI SA	6,336	71.70	454,291.20	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	242,230	8.70	2,109,581.07	
DEUTSCHE BOERSE AG	22,610	155.75	3,521,507.50	
EURAZEO SE	4,128	50.30	207,638.40	
EXOR NV	12,940	55.24	714,805.60	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,040	79.66	720,126.40	
NATIXIS	93,734	2.46	231,241.77	
SOFINA	1,799	244.00	438,956.00	
WENDEL	2,701	94.10	254,164.10	

AEGON NV	203,530	3.04	618,731.20
AGEAS	22,090	36.68	810,261.20
ALLIANZ SE-REG	49,663	193.20	9,594,891.60
ASSICURAZIONI GENERALI	134,002	14.38	1,927,618.77
AXA SA	230,668	20.04	4,622,586.72
CNP ASSURANCES	17,599	12.18	214,355.82
HANNOVER RUECK SE	6,881	165.70	1,140,181.70
MAPFRE SA	152,207	1.87	285,388.12
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17,180	242.30	4,162,714.00
NN GROUP NV	34,199	31.53	1,078,294.47
POSTE ITALIANE SPA	57,979	8.77	508,475.83
SAMPO OYJ-A SHS	56,008	32.89	1,842,103.12
SCOR SE	17,251	27.46	473,712.46
AROUNDTOWN SA	136,350	5.95	811,827.90
DEUTSCHE WOHNEN SE	39,149	41.67	1,631,338.83
LEG IMMOBILIEN AG	8,173	118.80	970,952.40
VONOVIA SE	61,198	54.84	3,356,098.32
ADYEN NV	2,148	1,151.00	2,472,348.00
AMADEUS IT GROUP SA	51,418	53.58	2,754,976.44
ATOS SE	11,305	70.86	801,072.30
CAPGEMINI SE	18,706	97.76	1,828,698.56
DASSAULT SYSTEMES SA	15,642	153.40	2,399,482.80
EDENRED	29,663	43.21	1,281,738.23
NEMETSCHEK SE	6,883	65.90	453,589.70
NEXI SPA	37,287	14.82	552,779.77
SAP SE	124,176	121.14	15,042,680.64
TEAMVIEWER AG	15,450	43.52	672,461.25
WIRECARD AG	13,794	95.88	1,322,568.72
WORLDLINE SA	16,284	70.18	1,142,811.12
INGENICO GROUP	7,292	130.95	954,887.40
NOKIA OYJ	672,418	3.94	2,653,361.42
CELLNEX TELECOM SA	29,957	48.55	1,454,412.35
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	396,112	15.21	6,024,863.52
ELISA OYJ	16,663	54.20	903,134.60
ILIAD SA	2,083	161.00	335,363.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,455	9.11	259,225.05
KONINKLIJKE KPN NV	440,182	2.31	1,018,581.14
ORANGE	237,356	11.53	2,737,901.46
PROXIMUS	15,459	20.30	313,817.70
TELECOM ITALIA SPA	949,339	0.36	342,901.24
TELECOM ITALIA-RSP	874,887	0.37	325,895.40
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	128,092	2.88	369,673.51

TELEFONICA SA	555,766	4.86	2,704,357.35	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,661	38.00	481,118.00	
E.ON SE	267,086	10.05	2,684,214.30	
EDF	78,714	8.60	676,940.40	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	314,461	4.24	1,336,144.78	
ELIA GROUP SA/NV	3,662	98.70	361,439.40	
ENAGAS SA	27,149	22.06	598,906.94	
ENDESA SA	38,160	22.62	863,179.20	
ENEL SPA	968,264	7.57	7,337,504.59	
ENGIE	221,060	11.69	2,584,191.40	
FORTUM OYJ	56,155	17.78	998,716.67	
IBERDROLA SA	691,710	10.03	6,937,851.30	
NATURGY ENERGY GROUP SA	33,187	17.39	577,287.86	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51,197	16.55	847,310.35	
RWE AG	70,600	30.40	2,146,240.00	
SNAM SPA	252,963	4.51	1,140,863.13	
SUEZ	36,596	11.18	409,143.28	
TERNA SPA	170,594	6.26	1,069,283.19	
UNIPER SE	21,847	28.66	626,135.02	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	64,821	21.98	1,424,765.58	
VERBUND AG	6,650	40.58	269,857.00	
ASML HOLDING NV	50,631	320.50	16,227,235.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	148,881	21.65	3,223,273.65	
STMICROELECTRONICS NV	77,176	25.06	1,934,030.56	
ユーロ 小計	22,458,587		459,881,408.59 (56,882,731,428)	
合 計	128,066,863		503,161,878,494 (503,161,878,494)	

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,460	2,293,211.40	
		AMERICAN TOWER CORP	52,620	13,938,511.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,643	2,874,079.67	
		BOSTON PROPERTIES INC	17,637	1,799,679.48	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	12,222	1,193,233.86	
		CROWN CASTLE INTL CORP	49,377	8,324,962.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	31,190	4,406,523.20	

		DUKE REALTY CORP	45,008	1,656,744.48	
		EQUINIX INC	10,145	6,832,657.50	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,082	1,298,903.76	
		EQUITY RESIDENTIAL	44,197	2,934,680.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,829	2,055,269.08	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,779	1,630,601.86	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,861	785,785.56	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	61,175	1,795,486.25	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	82,386	1,154,227.86	
		INVITATION HOMES INC	63,828	1,829,310.48	
		IRON MOUNTAIN INC	35,512	1,055,061.52	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	64,571	1,294,002.84	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,604	1,692,881.76	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	21,947	875,465.83	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27,133	930,119.24	
		PROLOGIS INC	87,665	8,390,417.15	
		PUBLIC STORAGE	18,625	3,843,641.25	
		REALTY INCOME CORP	39,210	2,439,254.10	
		REGENCY CENTERS CORP	21,265	1,080,262.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	13,282	3,947,144.76	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	36,390	3,224,154.00	
		SUN COMMUNITIES INC	10,995	1,551,724.35	
		UDR INC	34,256	1,428,475.20	
		VENTAS INC	44,279	1,915,952.33	
		VEREIT INC	138,343	951,799.84	
		VICI PROPERTIES INC	53,020	1,218,929.80	
		VORNADO REALTY TRUST	18,373	804,002.48	
		WELLTOWER INC	48,684	2,998,934.40	
		WEYERHAEUSER CO	91,648	2,146,396.16	
		WP CAREY INC	21,151	1,455,400.31	
アメリカドル合計			1,392,392	100,047,888.56 (10,953,242,839)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,400	407,736.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15,000	229,050.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,200	279,450.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,100	233,512.00	
カナダドル合計			49,700	1,149,748.00 (93,865,426)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	139,617	1,348,700.22	
		GOODMAN GROUP	199,751	3,006,252.55	
		GPT GROUP	232,503	988,137.75	
		MIRVAC GROUP	490,725	1,221,905.25	

		SCENTRE GROUP	620,280	1,556,902.80	
		STOCKLAND	294,287	1,165,376.52	
		VICINITY CENTRES	348,844	606,988.56	
オーストラリアドル合計			2,326,007	9,894,263.65 (756,416,456)	
イギリス ポンド	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	106,428	491,058.79	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	81,488	563,733.98	
		SEGRO PLC	125,994	1,124,874.43	
イギリスポンド合計			313,910	2,179,667.20 (303,213,504)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	240,100	15,906,625.00	
香港ドル合計			240,100	15,906,625.00 (224,760,611)	
シンガ ポールド ル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	381,000	1,234,440.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	363,300	661,206.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	262,800	557,136.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	216,300	458,556.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	306,800	610,532.00	
		SUNTEC REIT	194,300	310,880.00	
シンガポールドル合計			1,724,500	3,832,750.00 (301,369,132)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	4,912	346,787.20	
		GECINA SA	5,521	700,614.90	
		ICADE	3,010	221,987.50	
		KLEPIERRE	21,105	478,028.25	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,452	1,163,485.44	
ユーロ合計			51,000	2,910,903.29 (360,049,627)	
合計				12,992,917,595 (12,992,917,595)	

(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 591銘柄	97.01%	—	68.96%
	投資証券 37銘柄	—	2.99%	2.12%
カナダドル	株式 81銘柄	99.47%	—	3.41%
	投資証券 4銘柄	—	0.53%	0.02%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	93.60%	—	2.14%

	投資証券	7銘柄	—	6.40%	0.15%
イギリスポンド	株式	85銘柄	98.83%	—	4.98%
	投資証券	3銘柄	—	1.17%	0.06%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.00%	—	3.39%
香港ドル	株式	34銘柄	95.89%	—	1.02%
	投資証券	1銘柄	—	4.11%	0.04%
シンガポールドル	株式	16銘柄	85.13%	—	0.33%
	投資証券	6銘柄	—	14.87%	0.06%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.00%	—	0.10%
スウェーデンクローネ	株式	36銘柄	100.00%	—	1.07%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.00%	—	0.19%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.00%	—	0.77%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.00%	—	0.10%
ユーロ	株式	242銘柄	99.37%	—	11.02%
	投資証券	5銘柄	—	0.63%	0.07%

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）

[令和 2年 6月 8日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	1,330,795,481
コール・ローン	338,940,558
株式	118,642,063,624
投資証券	119,388,688
派生商品評価勘定	256,509,349
未収入金	2,604,400
未収配当金	258,589,776
差入委託証拠金	1,555,376,400
流動資産合計	122,504,268,276
資産合計	122,504,268,276
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,153
未払金	317,012,380
未払解約金	272,916,002
未払利息	602

[令和 2年 6月 8日現在]

流動負債合計	589,944,137
負債合計	589,944,137
純資産の部	
元本等	
元本	51,063,621,771
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,850,702,368
元本等合計	121,914,324,139
純資産合計	121,914,324,139
負債純資産合計	122,504,268,276

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。 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）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1. 期首	令和 2年 1月 8日
期首元本額	43,660,405,611円
期中追加設定元本額	11,421,203,886円
期中一部解約元本額	4,017,987,726円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	139,993,459円
eMAXIS 新興国株式インデックス	12,007,699,806円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	1,664,127,349円
eMAXIS バランス（波乗り型）	72,807,790円
三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）	393,535,234円
コアバランス	202,792円
海外株式セレクション（ラップ向け）	94,678,356円
eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）	3,002,736,447円
eMAXIS Slim 新興国株式インデックス	12,444,199,692円

	[令和 2年 6月 8日現在]
つみたて新興国株式	2,219,551,863円
つみたて8資産均等バランス	1,222,206,323円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	791,977円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,142,836円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	2,724,466円
eMAXIS Slim 全世界株式（除く日本）	1,100,921,787円
eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）	258,756,008円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	1,611,481,894円
新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）	652,805,833円
つみたて全世界株式	150,404円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国株式インデックスファンド	10,788,546,024円
新興国株式インデックスオープン	416,784,660円
eMAXIS 全世界株式インデックス	482,088,978円
新興国株式インデックスファンド（ラップ向け）	911,825円
eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）	24,249,790円
eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）	142,954,120円
eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）	119,685,050円
eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）	496,106,618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）	1,493,968,613円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	2,287,022円
アドバンスト・バランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）	11,673,338円
世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）	13,708,878円
MUKAM バランスファンド2019 - 12（適格機関投資家限定）	90,578,444円
MUKAM バランスファンド2020 - 04（適格機関投資家限定）	89,564,095円
合計	51,063,621,771円
2. 受益権の総数	51,063,621,771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 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
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、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。 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。 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。 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。
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	[令和 2年 6月 8日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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	[令和 2年 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,193,760,617
投資証券	12,876,739
合計	8,206,637,356

(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

[令和 2年 6月 8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	2,953,977,317	—	3,210,479,104	256,501,787
合計		2,953,977,317	—	3,210,479,104	256,501,787

（注）時価の算定方法

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

通貨関連

[令和 2年 6月 8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 売建 オフショア元	91,774,121 906,551	— —	91,774,213 914,234	92 7,683
合計		92,680,672	—	92,688,447	7,591

（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）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	2.3875円
(1万口当たり純資産額)	(23,875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 PJSC-SPON ADR	1,111,709	5.90	6,563,529.93	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	156,900	0.61	96,336.60	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	76,498	80.18	6,133,609.64	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	17,106	159.10	2,721,564.60	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	227,420	5.85	1,332,333.24	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,337,800	0.58	786,475.89	
	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	1,299,900	0.50	655,443.76	
	TATNEFT PJSC	263,380	8.30	2,187,729.54	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	29,046	5.74	166,724.04	
	ALROSA PJSC	485,760	0.94	460,554.69	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	35,491	8.67	307,706.97	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	28,772	8.14	234,204.08	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	11,917	297.33	3,543,311.13	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	243,290	2.06	503,529.33	

PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,499	14.00	370,986.00
POLYUS PJSC-REG S-GDR	11,745	74.85	879,113.25
SEVERSTAL PJSC	43,990	13.83	608,460.45
SOUTHERN COPPER CORP	16,381	38.95	638,039.95
51JOB INC-ADR	4,511	69.19	312,116.09
BEST INC - ADR	46,618	5.44	253,601.92
DP WORLD PLC	29,672	16.13	478,609.36
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	70,291	34.56	2,429,256.96
NIO INC - ADR	156,962	5.59	877,417.58
GSX TECHEDU INC- ADR	13,900	40.52	563,228.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	25,623	38.33	982,129.59
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	26,716	130.58	3,488,575.28
TAL EDUCATION GROUP- ADR	71,682	65.84	4,719,542.88
YUM CHINA HOLDINGS INC	66,862	49.72	3,324,378.64
58.COM INC-ADR	18,576	51.03	947,933.28
AUTOHOME INC-ADR	10,694	90.70	969,945.80
BAIDU INC - SPON ADR	51,229	114.40	5,860,597.60
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	17,270	34.50	595,815.00
HUYA INC-ADR	9,100	16.68	151,788.00
IQIYI INC-ADR	40,409	18.06	729,786.54
JOYY INC	10,716	75.10	804,771.60
MOMO INC-SPON ADR	26,548	20.81	552,463.88
NETEASE INC-ADR	13,272	425.37	5,645,510.64
SINA CORP	11,600	34.29	397,764.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	66,284	12.26	812,641.84
WEIBO CORP-SPON ADR	9,514	34.40	327,281.60
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	350,024	219.55	76,847,769.20
BAOZUN INC-SPN ADR	8,747	34.55	302,208.85
JD.COM INC-ADR	138,980	59.04	8,205,379.20
PINDUODUO INC-ADR	48,108	69.70	3,353,127.60
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	86,974	29.08	2,529,203.92
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	82,033	17.97	1,474,133.01
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	67,457	12.44	839,165.08
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	23,091	31.34	723,671.94
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	15,480	22.99	355,885.20
ZAI LAB LTD-ADR	9,300	70.12	652,116.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	257,202	4.05	1,042,954.11
CREDICORP LTD	13,150	166.35	2,187,502.50
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	498,104	12.89	6,420,560.56
VTB BANK PJSC	658,130,000	0.00	360,589.42
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	274,310	1.72	472,895.43
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	5,699	27.52	156,836.48

	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	196,860	0.73	145,085.82	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	14,157	60.38	854,799.66	
	GLOBANT SA	6,184	138.17	854,443.28	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	83,893	9.41	789,433.13	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	14,804	10.02	148,336.08	
	INTER RAO UES PJSC	7,192,000	0.07	528,837.82	
	アメリカドル 小計	673,738,210		172,659,743.46 (18,902,788,714)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	43,353	14.15	613,444.95	
	イギリスポンド 小計	43,353		613,444.95 (85,336,326)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	394,000	7.65	3,014,100.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,626,000	3.59	16,607,340.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	625,000	13.10	8,187,500.00	
	CNOOC LTD	3,347,000	9.33	31,227,510.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	236,000	3.84	906,240.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,749,000	2.81	10,534,690.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	280,000	6.30	1,764,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	858,000	1.58	1,355,640.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	229,000	55.45	12,698,050.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	304,000	3.42	1,039,680.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	372,000	2.55	948,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	768,000	8.96	6,881,280.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	440,000	9.65	4,246,000.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	257,000	7.95	2,043,150.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	247,000	4.36	1,076,920.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	315,000	6.99	2,201,850.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	531,000	2.04	1,083,240.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	242,500	8.96	2,172,800.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,062,000	3.14	3,334,680.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	406,000	4.01	1,628,060.00	
	BOC AVIATION LTD	32,800	51.60	1,692,480.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	854,000	5.02	4,287,080.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	404,000	5.26	2,125,040.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	297,500	35.25	10,486,875.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	228,000	10.72	2,444,160.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	339,000	7.21	2,444,190.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	752,000	4.30	3,233,600.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	414,000	5.12	2,119,680.00	
	CITIC LTD	1,072,000	8.05	8,629,600.00	
	CRRC CORP LTD - H	816,550	3.82	3,119,221.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	457,000	10.50	4,798,500.00	

HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	118,000	15.94	1,880,920.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	428,000	2.40	1,027,200.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	80,000	12.36	988,800.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	431,500	3.37	1,454,155.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	116,000	19.94	2,313,040.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	400,800	14.40	5,771,520.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	117,200	7.64	895,408.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	105,900	22.35	2,366,865.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	219,400	6.24	1,369,056.00
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	76,250	41.50	3,164,375.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	749,111	4.30	3,221,177.30
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	247,000	36.80	9,089,600.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	232,000	10.22	2,371,040.00
AIR CHINA LTD-H	280,000	5.41	1,514,800.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	310,000	5.68	1,760,800.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	410,000	3.08	1,262,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	258,000	10.12	2,610,960.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	280,000	3.82	1,069,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	440,500	2.21	973,505.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	360,000	4.30	1,548,000.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	268,000	9.12	2,444,160.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	106,000	8.27	876,620.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	189,500	13.30	2,520,350.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	238,000	5.56	1,323,280.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	262,000	3.52	922,240.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	562,000	7.28	4,091,360.00
BYD CO LTD-H	116,000	51.75	6,003,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	580,000	5.37	3,114,600.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	118,800	19.10	2,269,080.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	940,000	11.76	11,054,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	619,000	5.28	3,268,320.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	528,945	6.80	3,596,826.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	202,000	76.90	15,533,800.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	492,000	2.09	1,028,280.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	222,000	22.65	5,028,300.00
LI NING CO LTD	397,500	27.30	10,851,750.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	157,900	102.00	16,105,800.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	104,500	15.50	1,619,750.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	137,000	13.40	1,835,800.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	200,000	7.05	1,410,000.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	143,000	38.55	5,512,650.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	41,500	33.50	1,390,250.00

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	2,400,000	1.07	2,568,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	55,600	46.30	2,574,280.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	1,068,000	434.20	463,725,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,572,000	1.31	2,059,320.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	662,900	159.00	105,401,100.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	154,000	14.48	2,229,920.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	213,000	11.68	2,487,840.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	112,000	40.10	4,491,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	449,500	11.22	5,043,390.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	20,400	82.50	1,683,000.00	
CHINA FEIHE LTD	161,000	14.96	2,408,560.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	372,000	—	—	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	529,000	29.65	15,684,850.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	266,000	44.95	11,956,700.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	336,000	4.96	1,666,560.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	354,000	13.30	4,708,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	76,000	55.55	4,221,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	301,000	7.77	2,338,770.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	892,000	5.92	5,280,640.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	87,000	71.70	6,237,900.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	117,500	62.75	7,373,125.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	24.65	1,577,600.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	66,000	23.30	1,537,800.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	660,000	19.68	12,988,800.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	67,300	105.60	7,106,880.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	444,000	15.40	6,837,600.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	156,600	12.62	1,976,292.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	258,400	20.15	5,206,760.00	
3SBIO INC	260,000	10.30	2,678,000.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,600	184.60	1,956,760.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	281,000	8.94	2,512,140.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	235,000	4.71	1,106,850.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	596,000	3.45	2,056,200.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	862,000	16.06	13,843,720.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	200,000	19.20	3,840,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	92,000	36.50	3,358,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	178,000	46.35	8,250,300.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	412,500	4.03	1,662,375.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	115,000	25.75	2,961,250.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,276,000	13.70	17,481,200.00	
SSY GROUP LTD	328,000	4.97	1,630,160.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	39,984	89.85	3,592,562.40	

WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	170,500	131.10	22,352,550.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,279,000	3.23	17,051,170.00
BANK OF CHINA LTD-H	14,921,000	2.97	44,315,370.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,558,900	4.98	7,763,322.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,794,000	3.52	6,314,880.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	17,956,550	6.39	114,742,354.50
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	626,000	3.23	2,021,980.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,050	38.70	28,059,435.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,121,820	5.56	6,237,319.20
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	570,000	3.10	1,767,000.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	11,340,350	5.23	59,310,030.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,931,000	4.95	9,558,450.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,673,000	1.50	2,509,500.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	186,000	11.22	2,086,920.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	657,500	4.00	2,630,000.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,024,000	0.83	1,679,920.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	249,200	14.34	3,573,528.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	414,500	15.12	6,267,240.00
FAR EAST HORIZON LTD	373,000	7.03	2,622,190.00
GF SECURITIES CO LTD-H	227,800	8.34	1,899,852.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	56,000	11.10	621,600.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	397,200	6.28	2,494,416.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	222,800	12.60	2,807,280.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,404,000	15.78	22,155,120.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	497,200	22.70	11,286,440.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	783,000	0.86	673,380.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	309,200	12.50	3,865,000.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151,700	26.35	3,997,295.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,665,000	2.51	4,179,150.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,262,000	7.23	9,124,260.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,109,500	81.35	90,257,825.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	60,200	29.20	1,757,840.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	198,000	9.23	1,827,540.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	264,000	8.72	2,302,080.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	366,000	17.96	6,573,360.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	962,000	5.77	5,550,740.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	708,000	25.00	17,700,000.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	220,000	8.20	1,804,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	592,000	32.65	19,328,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	289,051	26.50	7,659,851.50
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	632,000	6.36	4,019,520.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,395,232	10.18	14,203,461.76

GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	211,200	8.99	1,898,688.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	406,000	3.27	1,327,620.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	209,000	12.94	2,704,460.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	270,000	12.70	3,429,000.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	323,000	37.10	11,983,300.00
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	20,400	87.60	1,787,040.00
SEAZEN GROUP LTD	370,000	7.53	2,786,100.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	542,000	2.45	1,327,900.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	226,000	35.20	7,955,200.00
SHUI ON LAND LTD	717,000	1.31	939,270.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	497,500	1.92	955,200.00
SOHO CHINA LTD	317,500	2.78	882,650.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	480,000	35.90	17,232,000.00
WHARF HOLDINGS LTD	200,000	15.28	3,056,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,500,000	1.44	2,160,000.00
YUZHOU PROPERTIES CO	336,000	3.58	1,202,880.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	386,000	5.10	1,968,600.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	429,000	14.04	6,023,160.00
KINGSOFT CORP LTD	149,000	25.65	3,821,850.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	178,000	16.66	2,965,480.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	143,000	43.40	6,206,200.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	126,000	16.10	2,028,600.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	237,000	3.61	855,570.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	149,500	20.15	3,012,425.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	183,500	7.37	1,352,395.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	136,200	9.81	1,336,122.00
LENOVO GROUP LTD	1,276,000	4.25	5,423,000.00
SUNNY OPTICAL TECH	136,200	114.00	15,526,800.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,963,600	13.02	25,566,072.00
ZTE CORP-H	144,931	21.90	3,173,988.90
CHINA MOBILE LTD	1,146,500	54.65	62,656,225.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	2,628,000	2.45	6,438,600.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	8,338,000	1.57	13,090,660.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	1,074,000	4.62	4,961,880.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	96,500	27.40	2,644,100.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	812,000	3.17	2,574,040.00
CGN POWER CO LTD-H	1,943,000	1.73	3,361,390.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	489,600	27.45	13,439,520.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	562,000	4.21	2,366,020.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	705,000	1.74	1,226,700.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	176,000	42.00	7,392,000.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	394,000	9.20	3,624,800.00

	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	149,900	93.80	14,060,620.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	558,000	15.50	8,649,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	678,000	3.01	2,040,780.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	708,000	4.86	3,440,880.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	960,000	3.91	3,753,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	89,000	18.02	1,603,780.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	613,400	19.70	12,083,980.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	806,000	6.07	4,892,420.00	
	香港ドル 小計	166,575,624		1,957,228,534.06 (27,655,639,186)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	782,180	3.80	2,972,284.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	56,300	21.90	1,232,970.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	461,900	6.70	3,094,730.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	241,700	4.55	1,099,735.00	
	GAMUDA BHD	282,700	3.80	1,074,260.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	133,100	9.10	1,211,210.00	
	IJM CORP BHD	457,600	1.92	878,592.00	
	SIME DARBY BERHAD	493,200	2.19	1,080,108.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	241,800	5.50	1,329,900.00	
	MISC BHD	228,100	8.30	1,893,230.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	148,400	3.86	572,824.00	
	GENTING BHD	441,700	4.39	1,939,063.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	628,000	2.60	1,632,800.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	27,500	25.00	687,500.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	24,500	31.52	772,240.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	39,200	10.14	397,488.00	
	IOI CORP BHD	455,200	4.40	2,002,880.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	82,700	22.04	1,822,708.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	14,400	137.30	1,977,120.00	
	PPB GROUP BERHAD	108,340	17.34	1,878,615.60	
	QL RESOURCES BHD	150,100	9.17	1,376,417.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	390,700	4.96	1,937,872.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	319,600	12.20	3,899,120.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	436,300	5.55	2,421,465.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	290,400	16.38	4,756,752.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	271,500	3.24	879,660.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,160,000	3.96	4,593,600.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	123,700	15.12	1,870,344.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	33,300	14.90	496,170.00	
	MALAYAN BANKING BHD	747,500	8.08	6,039,800.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	552,300	17.32	9,565,836.00	
	RHB BANK BHD	319,249	5.41	1,727,137.09	

	AXIATA GROUP BERHAD	545,100	3.74	2,038,674.00	
	DIGI.COM BHD	567,300	4.39	2,490,447.00	
	MAXIS BHD	474,300	5.29	2,509,047.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	214,800	4.28	919,344.00	
	PETRONAS GAS BHD	137,800	17.90	2,466,620.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	401,400	11.96	4,800,744.00	
	YTL CORP BHD	769,263	0.90	696,183.01	
	マレーシアリングット 小計	13,253,132		85,035,489.70 (2,182,010,665)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	2,038,500	3.06	6,237,810.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	243,400	98.75	24,035,750.00	
	PTT PCL-NVDR	2,136,200	39.50	84,379,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	238,100	50.50	12,024,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	293,000	33.25	9,742,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	386,861	51.00	19,729,911.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	149,650	368.00	55,071,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	818,700	67.00	54,852,900.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	1,300,300	10.10	13,133,030.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,517,200	12.00	18,206,400.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	1,173,700	4.80	5,633,760.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	509,900	22.10	11,268,790.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	385,017	37.00	14,245,629.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,156,301	15.50	17,922,665.50	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	243,700	45.00	10,966,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	1,086,900	72.75	79,071,975.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	744,400	33.00	24,565,200.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	110,500	42.25	4,668,625.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	552,100	13.80	7,618,980.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,743,000	23.50	40,960,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	65,100	123.50	8,039,850.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	72,800	126.50	9,209,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	308,100	117.00	36,047,700.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	791,400	11.90	9,417,660.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	176,700	89.25	15,770,475.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	3,393,200	1.28	4,343,296.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	315,500	24.80	7,824,400.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	135,500	39.50	5,352,250.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	154,600	57.00	8,812,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	142,800	59.00	8,425,200.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	398,900	54.50	21,740,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	1,350,100	8.15	11,003,315.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	232,000	201.00	46,632,000.00	

	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	411,500	56.25	23,146,875.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	118,000	46.50	5,487,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	2,045,076	3.98	8,139,402.48	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	167,500	55.25	9,254,375.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	58,900	275.00	16,197,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	274,600	43.00	11,807,800.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	145,900	80.50	11,744,950.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	372,900	38.75	14,449,875.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	154,300	69.00	10,646,700.00	
	タイバーツ 小計	28,112,805		817,827,898.98 (2,846,041,088)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	342,280	50.60	17,319,368.00	
	AYALA CORPORATION	50,525	793.00	40,066,325.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	15,054	480.00	7,225,920.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	508,020	62.50	31,751,250.00	
	SM INVESTMENTS CORP	42,760	967.50	41,370,300.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	211,940	100.00	21,194,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	85,240	130.00	11,081,200.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	183,600	46.40	8,519,040.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	174,900	134.00	23,436,600.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	138,291	78.00	10,786,698.00	
	BDO UNIBANK INC	389,750	114.00	44,431,500.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	402,156	41.50	16,689,474.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,266,500	3.38	7,660,770.00	
	AYALA LAND INC	1,581,520	38.00	60,097,760.00	
	MEGAWORLD CORP	1,793,000	3.18	5,701,740.00	
	ROBINSONS LAND CO	304,700	18.24	5,557,728.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,855,900	32.90	61,059,110.00	
	GLOBE TELECOM INC	6,260	2,170.00	13,584,200.00	
	PLDT INC	14,760	1,180.00	17,416,800.00	
	ABOITIZ POWER CORP	249,500	29.00	7,235,500.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	50,740	288.40	14,633,416.00	
	フィリピンペソ 小計	10,667,396		466,818,699.00 (1,027,001,137)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	2,113,600	1,100.00	2,324,960,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	328,100	17,100.00	5,610,510,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	5,284,700	1,315.00	6,949,380,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	438,900	5,925.00	2,600,482,500.00	
	INDOCEMENT TUNGAL PRAKARSA	310,600	12,900.00	4,006,740,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	483,200	9,425.00	4,554,160,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,777,200	5,000.00	18,886,000,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	1,063,000	1,505.00	1,599,815,000.00	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,481,700	5,750.00	8,519,775,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	96,000	48,400.00	4,646,400,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	1,631,300	1,795.00	2,928,183,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	385,700	8,625.00	3,326,662,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	743,900	6,150.00	4,574,985,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,405,600	8,050.00	11,315,080,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	3,583,600	1,410.00	5,052,876,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,863,700	28,625.00	53,348,412,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,450,600	4,850.00	16,735,410,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,612,700	4,250.00	6,853,975,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	10,201,000	3,110.00	31,725,110,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	9,517,900	3,230.00	30,742,817,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	514,700	2,730.00	1,405,131,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,707,300	1,030.00	1,758,519,000.00	
	インドネシアルピア 小計	51,995,000		229,465,384,500.00 (1,812,776,537)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	3,002,268	6.46	19,394,651.28	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	561,570	52.69	29,589,123.30	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	22,650	211.91	4,799,761.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	198,398	34.77	6,898,298.46	
	ALFA S.A.B. -A	661,400	13.08	8,651,112.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	72,700	53.10	3,860,370.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	77,800	170.31	13,250,118.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	41,515	290.33	12,053,049.95	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	38,620	177.52	6,855,822.40	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	420,800	30.01	12,628,208.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	51,600	69.58	3,590,328.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	958,800	55.36	53,079,168.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	89,966	99.79	8,977,707.14	
	BECLE SAB DE CV	104,800	40.13	4,205,624.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	106,000	100.03	10,603,180.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	355,900	156.13	55,566,667.00	
	GRUMA S.A.B. -B	46,275	221.98	10,272,124.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	327,600	35.27	11,554,452.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	316,600	36.53	11,565,398.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	466,200	80.44	37,501,128.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	367,500	18.12	6,659,100.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	6,227,800	15.65	97,465,070.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	99,600	67.41	6,714,036.00	
	メキシコペソ 小計	14,616,362		435,734,497.53 (2,217,888,592)	
ブラジルリアル	COSAN SA	33,600	69.22	2,325,792.00	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	701,600	22.85	16,031,560.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	881,500	22.10	19,481,150.00
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	121,200	18.68	2,264,016.00
BRASKEM SA-PREF A	32,300	27.24	879,852.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	149,600	10.63	1,590,248.00
GERDAU SA-PREF	187,000	15.17	2,836,790.00
KLABIN SA - UNIT	117,400	19.10	2,242,340.00
SUZANO SA	96,322	38.30	3,689,132.60
VALE SA	687,730	54.61	37,556,935.30
WEG SA	155,844	44.33	6,908,564.52
CCR SA	215,600	14.60	3,147,760.00
LOCALIZA RENT A CAR	116,513	40.84	4,758,390.92
RUMO SA	211,400	23.11	4,885,454.00
COGNA EDUCACAO	294,292	6.90	2,030,614.80
B2W CIA DIGITAL	38,000	86.33	3,280,540.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	133,761	29.70	3,972,701.70
LOJAS RENNER S.A.	153,620	45.98	7,063,447.60
MAGAZINE LUIZA SA	133,200	59.45	7,918,740.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	138,000	22.92	3,162,960.00
ATACADAO SA	74,700	18.25	1,363,275.00
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	30,300	66.84	2,025,252.00
RAIA DROGASIL SA	39,700	111.00	4,406,700.00
AMBEV SA	874,300	14.05	12,283,915.00
BRF SA	115,200	22.70	2,615,040.00
JBS SA	209,300	20.95	4,384,835.00
NATURA &CO HOLDING SA	138,400	40.14	5,555,376.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	45,600	59.55	2,715,480.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	93,200	64.10	5,974,120.00
HYPERA SA	73,900	34.50	2,549,550.00
BANCO BRADESCO S.A.	252,241	20.45	5,158,328.45
BANCO BRADESCO SA-PREF	836,158	22.30	18,646,323.40
BANCO DO BRASIL S.A.	158,400	35.20	5,575,680.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	74,100	31.13	2,306,733.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	905,830	27.26	24,692,925.80
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	806,207	10.04	8,094,318.28
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	384,575	49.07	18,871,095.25
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	48,400	60.24	2,915,616.00
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	127,100	28.49	3,621,079.00
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	119,900	10.75	1,288,925.00
PORTO SEGURO SA	15,400	52.15	803,110.00
SUL AMERICA SA - UNITS	56,658	46.10	2,611,933.80
BR MALLS PARTICIPACOES SA	127,554	10.90	1,390,338.60

	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	45,300	23.09	1,045,977.00	
	CIELO SA	207,121	4.50	932,044.50	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	89,375	47.77	4,269,443.75	
	TIM PARTICIPACOES SA	149,377	14.60	2,180,904.20	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	49,300	31.31	1,543,583.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	62,200	29.61	1,841,742.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	163,773	11.40	1,867,012.20	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	18,700	64.00	1,196,800.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	60,800	52.99	3,221,792.00	
	CPFL ENERGIA SA	44,600	32.40	1,445,040.00	
	ENERGISA SA-UNITS	40,100	47.37	1,899,537.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	42,050	42.68	1,794,694.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	163,800	20.56	3,367,728.00	
	ブラジルリアル 小計	11,342,101		302,483,236.67 (6,675,805,033)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	78,409	5,605.00	439,482,445.00	
	EMPRESAS CMPC SA	237,271	1,727.90	409,980,560.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,539	21,770.00	468,904,030.00	
	FALABELLA SA	141,135	2,330.00	328,844,550.00	
	CENCOSUD SA	308,874	1,046.00	323,082,204.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	22,576	6,020.00	135,907,520.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	57,088	1,960.00	111,892,480.00	
	BANCO DE CHILE	8,408,646	77.01	647,549,828.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	9,439	29,867.00	281,914,613.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,826,505	36.40	430,484,782.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	94,600	1,494.90	141,417,540.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	26,107	5,398.00	140,925,586.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	472,237	275.04	129,884,064.00	
	COLBUN SA	1,351,330	130.21	175,956,679.00	
	ENEL AMERICAS SA	6,152,217	130.00	799,788,210.00	
	ENEL CHILE SA	4,608,336	64.99	299,495,756.00	
	チリペソ 小計	33,816,309		5,265,510,847.00 (749,282,193)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	10,450	40,250.00	420,612,500.00	
	S-OIL CORP	8,232	76,300.00	628,101,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,785	126,500.00	1,237,802,500.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	16,472	16,900.00	278,376,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	17,295	24,550.00	424,592,250.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,657	386,500.00	640,430,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2,964	76,400.00	226,449,600.00	
	LG CHEM LTD	8,590	434,000.00	3,728,060,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	1,367	197,000.00	269,299,000.00	

LOTTE CHEMICAL CORP	3,322	193,000.00	641,146,000.00	
POSCO	13,990	200,500.00	2,804,995,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,967	61,000.00	241,987,000.00	
CJ CORP	3,215	91,600.00	294,494,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	5,856	94,900.00	555,734,400.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	26,032	4,100.00	106,731,200.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	6,507	27,100.00	176,339,700.00	
DOOSAN BOBCAT INC	8,098	27,050.00	219,050,900.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	10,115	29,450.00	297,886,750.00	
HANWHA CORPORATION	10,143	21,200.00	215,031,600.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	15,811	37,200.00	588,169,200.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	2,060	281,000.00	578,860,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	12,156	26,850.00	326,388,600.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	7,446	102,500.00	763,215,000.00	
LG CORP	18,503	73,600.00	1,361,820,800.00	
LOTTE CORP	3,952	36,400.00	143,852,800.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	7,531	15,900.00	119,742,900.00	
SAMSUNG C&T CORP	15,837	112,000.00	1,773,744,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	25,856	13,500.00	349,056,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	84,388	6,730.00	567,931,240.00	
SK HOLDINGS CO LTD	6,564	257,000.00	1,686,948,000.00	
S-1 CORPORATION	3,622	93,500.00	338,657,000.00	
CJ LOGISTICS	1,801	164,000.00	295,364,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	3,021	126,000.00	380,646,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	9,503	20,600.00	195,761,800.00	
PAN OCEAN CO LTD	39,939	3,955.00	157,958,745.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	16,564	25,750.00	426,523,000.00	
HANON SYSTEMS	29,646	10,200.00	302,389,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	12,695	219,000.00	2,780,205,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	27,993	111,000.00	3,107,223,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	7,722	67,900.00	524,323,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	3,585	62,400.00	223,704,000.00	
KIA MOTORS CORP	47,988	36,550.00	1,753,961,400.00	
COWAY CO LTD	9,531	73,000.00	695,763,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	7,687	42,800.00	329,003,600.00	
HLB INC	7,154	117,000.00	837,018,000.00	
HLB INC-NEW	715	117,000.00	83,655,000.00	
LG ELECTRONICS INC	20,535	63,000.00	1,293,705,000.00	
KANGWON LAND INC	19,369	25,650.00	496,814,850.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	10,116	18,200.00	184,111,200.00	
KAKAO CORP	10,559	251,000.00	2,650,309,000.00	
NAVER CORP	22,982	231,000.00	5,308,842,000.00	

NCSOFT CORP	3,118	805,000.00	2,509,990,000.00	
NETMARBLE CORP	3,622	97,000.00	351,334,000.00	
PEARL ABYSS CORP	1,102	207,000.00	228,114,000.00	
CJ ENM CO LTD	1,662	123,500.00	205,257,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	6,730	83,200.00	559,936,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	2,000	66,100.00	132,200,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	2,198	93,300.00	205,073,400.00	
SHINSEGAE INC	1,181	252,500.00	298,202,500.00	
BGF RETAIL CO LTD	1,349	154,500.00	208,420,500.00	
E-MART INC	3,358	118,000.00	396,244,000.00	
GS RETAIL CO LTD	4,031	41,400.00	166,883,400.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,368	299,000.00	409,032,000.00	
KT&G CORP	22,508	88,300.00	1,987,456,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	4,722	130,500.00	616,221,000.00	
OTTOGI CORPORATION	187	571,000.00	106,777,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	6,519	175,000.00	1,140,825,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,222	61,500.00	75,153,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	4,695	59,100.00	277,474,500.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1,764	1,401,000.00	2,471,364,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	343	728,000.00	249,704,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	12,192	95,200.00	1,160,678,400.00	
CELLTRION INC	17,676	256,500.00	4,533,894,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,819	130,500.00	367,879,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,079	260,500.00	281,079,500.00	
HELIXMITH CO LTD	3,937	72,300.00	284,645,100.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,061	665,000.00	2,035,565,000.00	
YUHAN CORP	9,295	51,800.00	481,481,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	48,834	5,800.00	283,237,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	55,632	31,250.00	1,738,500,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	54,119	9,730.00	526,577,870.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	74,211	38,050.00	2,823,728,550.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	86,148	35,000.00	3,015,180,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	105,445	10,050.00	1,059,722,250.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	8,663	55,600.00	481,662,800.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	58,500	3,610.00	211,185,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	47,617	6,960.00	331,414,320.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	20,867	10,800.00	225,363,600.00	
SAMSUNG CARD CO	4,545	30,900.00	140,440,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	9,939	30,900.00	307,115,100.00	
DB INSURANCE CO LTD	9,631	47,800.00	460,361,800.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	10,238	25,850.00	264,652,300.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,018	202,000.00	1,215,636,000.00	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	13,439	50,400.00	677,325,600.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	3,400	105,500.00	358,700,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	6,817	184,500.00	1,257,736,500.00	
	KMW CO LTD	6,037	61,400.00	370,671,800.00	
	LG DISPLAY CO LTD	45,899	12,100.00	555,377,900.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,514	153,500.00	385,899,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	10,498	131,500.00	1,380,487,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	889,041	55,500.00	49,341,775,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	153,553	47,750.00	7,332,155,750.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,394	371,500.00	3,861,371,000.00	
	LG UPLUS CORP	36,213	13,300.00	481,632,900.00	
	SK TELECOM	3,819	223,500.00	853,546,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	49,082	22,300.00	1,094,528,600.00	
	KOREA GAS CORPORATION	3,688	31,350.00	115,618,800.00	
	SK HYNIX INC	101,727	90,400.00	9,196,120,800.00	
	韓国ウォン 小計	2,741,154		156,121,397,575.00 (14,207,047,179)	
ニュー台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	219,150	94.30	20,665,845.00	
	ASIA CEMENT CORP	397,281	45.20	17,957,101.20	
	CHINA STEEL CORP	2,231,947	21.00	46,870,887.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	662,430	75.60	50,079,708.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	719,600	87.60	63,036,960.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	931,557	65.30	60,830,672.10	
	TAIWAN CEMENT	896,563	43.65	39,134,974.95	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	25,000	493.00	12,325,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	587,138	27.80	16,322,436.40	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	47,405	310.50	14,719,252.50	
	CHINA AIRLINES LTD	405,000	8.77	3,551,850.00	
	EVA AIRWAYS CORP	338,365	12.10	4,094,216.50	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	439,883	11.40	5,014,666.20	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	386,000	38.65	14,918,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	306,413	34.75	10,647,851.75	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	31,728	326.50	10,359,192.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	54,318	187.50	10,184,625.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	131,000	37.50	4,912,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	62,000	252.00	15,624,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	28,000	259.50	7,266,000.00	
	POU CHEN	419,500	30.20	12,668,900.00	
	TATUNG CO LTD	297,000	21.80	6,474,600.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	57,000	582.00	33,174,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	110,000	294.00	32,340,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	61,023	65.70	4,009,211.10	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	913,624	73.90	67,516,813.60
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	989,563	19.90	19,692,303.70
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	3,298,955	20.80	68,618,264.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,970,106	28.00	55,162,968.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,845,816	23.15	42,730,640.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,500,878	20.20	30,317,735.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,024,754	31.50	63,779,751.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,861,018	12.20	22,704,419.60
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,732,316	13.40	23,213,034.40
TAIWAN BUSINESS BANK	1,190,859	11.20	13,337,620.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,678,824	21.25	35,675,010.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	641,000	45.20	28,973,200.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	218,478	123.50	26,982,033.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,822,321	17.50	31,890,617.50
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,438,366	41.60	59,836,025.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,557,255	9.40	24,038,197.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	455,056	22.00	10,011,232.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,248,087	43.50	54,291,784.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,909,852	8.72	16,653,909.44
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	105,000	47.25	4,961,250.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	108,720	48.75	5,300,100.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	93,000	223.50	20,785,500.00
ACER INC	573,168	17.45	10,001,781.60
ADVANTECH CO LTD	64,676	294.50	19,047,082.00
ASUSTEK COMPUTER INC	125,774	219.00	27,544,506.00
AU OPTRONICS CORP	1,428,000	8.97	12,809,160.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	130,000	226.00	29,380,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	101,766	86.00	8,751,876.00
COMPAL ELECTRONICS	806,775	19.10	15,409,402.50
DELTA ELECTRONICS INC	372,220	153.50	57,135,770.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	163,042	55.50	9,048,831.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,320,272	78.50	182,141,352.00
INNOLUX CORP	1,733,112	7.60	13,171,651.20
INVENTEC CORP	488,429	25.50	12,454,939.50
LARGAN PRECISION CO LTD	18,820	4,270.00	80,361,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	391,160	50.40	19,714,464.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	140,000	111.50	15,610,000.00
PEGATRON CORP	348,976	66.30	23,137,108.80
QUANTA COMPUTER INC	556,150	72.00	40,042,800.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	237,193	45.25	10,732,983.25
WALSIN TECHNOLOGY CORP	65,000	198.50	12,902,500.00
WISTRON CORP	525,865	29.80	15,670,777.00

	WIWYNN CORP	15,000	751.00	11,265,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	335,168	40.30	13,507,270.40	
	YAGEO CORPORATION	51,952	387.50	20,131,400.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	110,000	129.50	14,245,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	705,000	112.50	79,312,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	291,000	66.70	19,409,700.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	308,400	107.50	33,153,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	625,294	68.20	42,645,050.80	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	383.50	16,107,000.00	
	MEDIATEK INC	281,236	494.00	138,930,584.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	217,000	64.20	13,931,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	102,000	215.00	21,930,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	23,000	292.00	6,716,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	147,300	101.00	14,877,300.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	92,703	269.50	24,983,458.50	
	SILERGY CORP	13,000	1,570.00	20,410,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,587,000	311.50	1,428,850,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,117,000	16.50	34,930,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	185,000	74.40	13,764,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	61,000	278.00	16,958,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	460,000	13.85	6,371,000.00	
	ニュー台湾ドル 小計	60,809,600		3,851,152,808.39 (14,172,242,334)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	115,594	369.60	42,723,542.40	
	COAL INDIA LTD	238,400	144.85	34,532,240.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	105,207	204.60	21,525,352.20	
	INDIAN OIL CORP LTD	373,789	89.40	33,416,736.60	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	489,850	86.95	42,592,457.50	
	PETRONET LNG LTD	102,670	256.10	26,293,787.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	532,039	1,581.70	841,526,086.30	
	AMBUJA CEMENTS LTD	135,329	195.10	26,402,687.90	
	ASIAN PAINTS LTD	53,729	1,638.55	88,037,652.95	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	44,660	510.85	22,814,561.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	54,756	627.15	34,340,225.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	240,897	149.25	35,953,877.25	
	JSW STEEL LTD	140,009	197.05	27,588,773.45	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	20,574	1,508.30	31,031,764.20	
	SHREE CEMENT LTD	1,824	22,089.60	40,291,430.40	
	TATA STEEL LTD	54,834	338.95	18,585,984.30	
	ULTRATECH CEMENT LTD	20,922	3,869.55	80,958,725.10	
	UPL LTD	85,811	439.40	37,705,353.40	
	VEDANTA LTD	332,594	105.30	35,022,148.20	

HAVELLS INDIA LTD	51,739	567.85	29,379,991.15
LARSEN & TOUBRO LTD	88,309	955.25	84,357,172.25
SIEMENS LTD	10,672	1,150.60	12,279,203.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	92,656	341.15	31,609,594.40
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	32,335	402.60	13,018,071.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	15,619	1,189.95	18,585,829.05
BAJAJ AUTO LTD	14,978	2,776.30	41,583,421.40
BHARAT FORGE LTD	31,725	349.05	11,073,611.25
BOSCH LTD	1,117	11,487.90	12,831,984.30
EICHER MOTORS LTD	2,432	17,495.35	42,548,691.20
HERO MOTOCORP LTD	18,137	2,340.65	42,452,369.05
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	142,365	484.20	68,933,133.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23,024	5,746.20	132,300,508.80
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	151,457	104.00	15,751,528.00
TATA MOTORS LTD	290,994	110.75	32,227,585.50
PAGE INDUSTRIES LTD	1,074	19,720.65	21,179,978.10
TITAN CO LTD	54,997	990.95	54,499,277.15
JUBILANT FOODWORKS LTD	13,156	1,685.60	22,175,753.60
INFO EDGE INDIA LTD	12,518	2,500.10	31,296,251.80
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	147,513	206.20	30,417,180.60
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,138	2,499.00	70,316,862.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,326	3,466.70	39,263,844.20
ITC LTD	652,664	200.00	130,532,800.00
NESTLE INDIA LTD	4,245	17,096.85	72,576,128.25
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	77,000	379.75	29,240,750.00
UNITED SPIRITS LTD	53,355	586.05	31,268,697.75
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	13,677	1,360.05	18,601,403.85
DABUR INDIA LTD	94,514	462.85	43,745,804.90
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	81,841	649.90	53,188,465.90
HINDUSTAN UNILEVER LTD	153,275	2,087.60	319,976,890.00
MARICO LTD	94,747	326.40	30,925,420.80
AUROBINDO PHARMA LTD	52,503	744.00	39,062,232.00
BIOCON LTD	50,755	389.60	19,774,148.00
CIPLA LTD	65,246	650.90	42,468,621.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,924	2,460.05	34,253,736.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	22,330	4,024.90	89,876,017.00
LUPIN LTD	43,303	902.35	39,074,462.05
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	15,818	1,127.10	17,828,467.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	161,560	494.25	79,851,030.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	8,990	2,367.75	21,286,072.50
AXIS BANK LTD	394,911	405.30	160,057,428.30
BANDHAN BANK LTD	73,800	247.70	18,280,260.00

	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	307,504	1,766.60	543,236,566.40	
	ICICI BANK LTD	900,071	357.20	321,505,361.20	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	50,241	261.85	13,155,605.85	
	STATE BANK OF INDIA	347,235	187.80	65,210,733.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	33,410	2,390.35	79,861,593.50	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,941	2,729.80	24,407,141.80	
	REC LTD	126,676	99.80	12,642,264.80	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,379	614.90	9,456,547.10	
	BAJAJ FINSERV LTD	7,537	5,236.40	39,466,746.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	127,300	516.25	65,718,625.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	41,277	1,302.75	53,773,611.75	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	63,100	387.55	24,454,405.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	71,900	796.70	57,282,730.00	
	DLF LTD	138,319	157.20	21,743,746.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	210,747	575.95	121,379,734.65	
	INFOSYS LTD	635,831	703.55	447,338,900.05	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	168,163	2,048.25	344,439,864.75	
	TECH MAHINDRA LTD	82,825	579.85	48,026,076.25	
	WIPRO LTD	220,999	218.75	48,343,531.25	
	BHARTI AIRTEL LTD	458,874	584.35	268,143,021.90	
	BHARTI INFRATEL LTD	49,169	236.25	11,616,176.25	
	GAIL INDIA LTD	325,150	97.85	31,815,927.50	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	36,632	488.75	17,903,890.00	
	NTPC LTD	428,056	97.95	41,928,085.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	321,937	171.45	55,196,098.65	
	インドルピー 小計	11,685,500		6,439,341,048.70 (9,401,437,931)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	12,401	597.00	7,403,397.00	
	MONETA MONEY BANK AS	101,820	59.70	6,078,654.00	
	CEZ AS	30,444	498.50	15,176,334.00	
	チェココルナ 小計	144,665		28,658,385.00 (133,261,490)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	1,058,563	2,345.00	2,482,330,235.00	
	BANCOLOMBIA SA	39,604	28,600.00	1,132,674,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	87,511	28,980.00	2,536,068,780.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	38,050	21,320.00	811,226,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	91,762	19,080.00	1,750,818,960.00	
	コロンビアペソ 小計	1,315,490		8,713,118,375.00 (266,621,422)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	76,580	2,000.00	153,160,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	26,853	7,025.00	188,642,325.00	
	OTP BANK PLC	43,226	11,580.00	500,557,080.00	

ハンガリーフォリント 小計		146,659		842,359,405.00 (303,249,385)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	500,409	5.25	2,627,147.25	
	DUBAI ISLAMIC BANK	378,667	4.03	1,526,028.01	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	502,753	12.02	6,043,091.06	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	820,642	1.80	1,477,155.60	
	EMAAR MALLS PJSC	427,406	1.41	602,642.46	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	620,849	2.77	1,719,751.73	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	318,899	16.40	5,229,943.60	
アラブディルハム 小計		3,569,625		19,225,759.71 (574,081,184)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	15,889	65.90	1,047,085.10	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	57,472	72.68	4,177,064.96	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	274,542	4.33	1,188,766.86	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	26,966	91.52	2,467,928.32	
	LPP SA	260	7,700.00	2,002,000.00	
	CD PROJEKT SA	12,909	390.60	5,042,255.40	
	CYFROWY POLSAT SA	48,046	28.00	1,345,288.00	
	DINO POLSKA SA	10,080	191.80	1,933,344.00	
	BANK PEKAO SA	37,668	57.30	2,158,376.40	
	MBANK SA	2,305	247.60	570,718.00	
	PKO BANK POLSKI SA	164,806	23.57	3,884,477.42	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	6,517	184.80	1,204,341.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	114,089	32.22	3,675,947.58	
	ORANGE POLSKA SA	110,607	6.64	734,983.51	
	PGE SA	148,359	6.25	927,243.75	
ポーランドズロチ 小計		1,030,515		32,359,820.90 (902,839,003)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	53,022	135.00	7,157,970.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	9,699	1,142.63	11,082,368.37	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	77,932	386.37	30,110,586.84	
	GOLD FIELDS LTD	159,789	120.00	19,174,680.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,665	129.00	19,435,785.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	10,081	495.30	4,993,119.30	
	NORTHAM PLATINUM LTD	73,043	115.95	8,469,335.85	
	SASOL LTD	111,300	150.00	16,695,000.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	435,901	34.39	14,990,635.39	
	BIDVEST GROUP LTD	51,937	168.57	8,755,020.09	
	MULTICHOICE GROUP LTD	81,412	95.94	7,810,667.28	
	MR PRICE GROUP LTD	41,305	149.79	6,187,075.95	
	NASPERS LTD-N SHS	82,826	2,923.20	242,116,963.20	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	123,600	13.27	1,640,172.00	

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	207,846	35.12	7,299,551.52	
	BID CORP LTD	64,043	263.71	16,888,779.53	
	CLICKS GROUP LTD	45,600	234.43	10,690,008.00	
	PICK N PAY STORES LTD	55,770	55.00	3,067,350.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	101,866	114.41	11,654,489.06	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	32,210	189.29	6,097,030.90	
	TIGER BRANDS LTD	26,414	169.20	4,469,248.80	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	230,622	18.96	4,372,593.12	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	75,342	150.27	11,321,642.34	
	ABSA GROUP LTD	132,975	102.00	13,563,450.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,709	1,057.06	9,205,935.54	
	NEDBANK GROUP LTD	65,739	126.10	8,289,687.90	
	STANDARD BANK GROUP LTD	245,339	119.73	29,374,438.47	
	FIRSTRAND LTD	619,682	46.23	28,647,898.86	
	PSG GROUP LTD	33,344	189.63	6,323,022.72	
	REINET INVESTMENTS SCA	26,395	310.59	8,198,023.05	
	REMGRO LTD	101,024	117.10	11,829,910.40	
	RMB HOLDINGS LTD	137,206	61.47	8,434,052.82	
	DISCOVERY LTD	80,303	111.02	8,915,239.06	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	144,183	19.13	2,758,220.79	
	OLD MUTUAL LTD	836,494	13.20	11,041,720.80	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	139,332	30.60	4,263,559.20	
	SANLAM LTD	346,686	62.13	21,539,601.18	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	82,474	98.20	8,098,946.80	
	MTN GROUP LTD	313,960	58.20	18,272,472.00	
	VODACOM GROUP LTD	115,758	130.80	15,141,146.40	
	南アフリカランド 小計	5,731,828		688,377,398.53 (4,495,104,412)	
オフショア元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	5.85	337,545.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	242,225	4.23	1,024,611.75	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,728	16.38	683,504.64	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	26,000	6.57	170,820.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	331,200	2.68	887,616.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	42,000	4.71	197,820.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	308,400	4.30	1,326,120.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	79,200	7.13	564,696.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	28,400	5.58	158,472.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	39,000	6.42	250,380.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	29,900	4.83	144,417.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	9,100	28.91	263,081.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	21,055	8.58	180,651.90	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	124,400	2.82	350,808.00	

ANGANG STEEL CO LTD-A	50,680	2.51	127,206.80
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	49,000	56.14	2,750,860.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	176,396	4.56	804,365.76
BBMG CORPORATION-A	79,100	3.14	248,374.00
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	14,200	38.24	543,008.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	33,200	8.85	293,820.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	365,201	3.61	1,318,375.61
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	34,500	9.68	333,960.00
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	10,308	50.19	517,358.52
GEM CO LTD-A	39,400	4.54	178,876.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	28,700	6.66	191,142.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	9,000	34.34	309,060.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	55,700	14.46	805,422.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	35,148	9.18	322,658.64
HESTEEL CO LTD-A	100,800	2.03	204,624.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	12,900	24.99	322,371.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	40,200	3.79	152,358.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	433,400	1.08	468,072.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	80,316	2.52	202,396.32
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	48,700	13.33	649,171.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	2,900	82.55	239,395.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	19,700	13.05	257,085.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	25,500	6.08	155,040.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	19,300	16.99	327,907.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	56,600	2.59	146,594.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	81,700	1.99	162,583.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	90,700	12.35	1,120,145.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	23,300	7.01	163,333.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	24,660	36.12	890,719.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,500	18.88	292,640.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	113,700	2.05	233,085.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	9,200	27.07	249,044.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	24,600	9.47	232,962.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	8,600	95.21	818,806.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	54,100	3.33	180,153.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	58,100	3.67	213,227.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	12,800	17.58	225,024.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	26,600	23.00	611,800.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	17,600	12.73	224,048.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	100,100	1.91	191,191.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	30,906	5.67	175,237.02
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	29,800	48.81	1,454,538.00

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	4,900	57.92	283,808.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	13,400	12.00	160,800.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	18,900	15.41	291,249.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	6,400	64.06	409,984.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	10,250	35.03	359,057.50	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	26,100	6.72	175,392.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	30,900	12.39	382,851.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	32,700	8.81	288,087.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	281,300	3.82	1,074,566.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10,900	13.28	144,752.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	21,400	23.66	506,324.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	26,300	17.30	454,990.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	34,300	7.89	270,627.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	8,800	32.56	286,528.00	
AVICOPTER PLC-A	5,500	41.25	226,875.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	16,100	22.02	354,522.00	
BOHAI LEASING CO LTD-A	58,800	3.05	179,340.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	25,900	6.46	167,314.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	13,900	13.22	183,758.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,000	7.73	200,980.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	43,700	6.04	263,948.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	10,200	13.49	137,598.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	46,800	5.58	261,144.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	109,300	8.75	956,375.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	291,100	5.30	1,542,830.00	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	21,100	9.32	196,652.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	217,404	4.10	891,356.40	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	11,200	33.03	369,936.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	533,680	5.04	2,689,747.20	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	25,508	151.20	3,856,809.60	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	75,100	1.90	142,690.00	
CRRC CORP LTD-A	231,325	5.88	1,360,191.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	26,100	9.31	242,991.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	9,200	73.39	675,188.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	36,143	6.49	234,568.07	
GUOCHENG MINING CO LTD-A	37,800	18.26	690,228.00	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	10,800	28.05	302,940.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6,400	46.69	298,816.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	7,100	35.70	253,470.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	16,100	9.88	159,068.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	8,400	74.60	626,640.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	29,200	11.75	343,100.00	

METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	169,634	2.55	432,566.70
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	26,700	26.27	701,409.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	43,900	19.00	834,100.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	121,200	3.45	418,140.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	79,516	18.79	1,494,105.64
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	84,500	3.11	262,795.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	77,300	4.86	375,678.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	29,774	6.02	179,239.48
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15,900	34.35	546,165.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	14,800	13.16	194,768.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	14,700	16.59	243,873.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	25,400	7.92	201,168.00
TBEA CO LTD-A	35,200	7.05	248,160.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	56,851	13.73	780,564.23
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	74,400	5.92	440,448.00
XIAMEN C & D INC-A	26,900	8.64	232,416.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	32,800	9.74	319,472.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,500	25.00	512,500.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	4,620	70.00	323,400.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	34,113	18.80	641,324.40
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	15,000	12.16	182,400.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	21,000	11.83	248,430.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	60,900	6.35	386,715.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	30,000	8.05	241,500.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	15,800	18.14	286,612.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8,800	54.04	475,552.00
AIR CHINA LTD-A	142,600	7.18	1,023,868.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	88,800	4.50	399,600.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	81,800	5.47	447,446.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	276,200	3.40	939,080.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	141,289	6.96	983,371.44
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	19,688	16.70	328,789.60
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	443,900	1.65	732,435.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	15,600	9.82	153,192.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	83,600	3.45	288,420.00
S F HOLDING CO LTD-A	30,700	50.38	1,546,666.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	9,100	74.28	675,948.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	80,900	4.25	343,825.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	19,500	8.15	158,925.00
SINOTRANS LIMITED-A	41,600	3.36	139,776.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,700	39.13	340,431.00
STO EXPRESS CO LTD-A	37,900	18.61	705,319.00

YUNDA HOLDING CO LTD-A	14,200	36.26	514,892.00
BYD CO LTD -A	17,200	63.20	1,087,040.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,600	113.50	295,100.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	37,000	10.29	380,730.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,938	21.37	404,705.06
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	29,900	20.76	620,724.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12,360	22.68	280,324.80
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	31,200	25.33	790,296.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	97,044	18.23	1,769,112.12
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	11,400	19.55	222,870.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	7,900	23.87	188,573.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	20,800	6.83	142,064.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	40,593	60.17	2,442,480.81
HAIER SMART HOME CO LTD-A	57,929	16.75	970,310.75
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,000	33.98	305,820.00
JOYOUNG CO LTD -A	21,300	33.94	722,922.00
NAVINFO CO LTD-A	18,600	16.12	299,832.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	2,655	113.09	300,253.95
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	8,700	23.40	203,580.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	128,600	5.77	742,022.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	13,800	48.49	669,162.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	17,100	7.45	127,395.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	5,200	67.50	351,000.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	9,400	16.28	153,032.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	25,100	28.37	712,087.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6,400	27.27	174,528.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	78,000	6.02	469,560.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	24,843	19.56	485,929.08
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	27,900	12.10	337,590.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	31,200	22.48	701,376.00
CHINA FILM CO LTD-A	14,700	13.86	203,742.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	17,000	11.14	189,380.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHIN-A	13,000	11.78	153,140.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,502	5.48	764,470.96
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	700	399.96	279,972.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	12,800	16.63	212,864.00
LEO GROUP CO LTD-A	173,000	3.96	685,080.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	25,280	53.53	1,353,238.40
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	23,400	18.58	434,772.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	32,600	9.91	323,066.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	12,200	46.81	571,082.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	19,800	17.75	351,450.00

WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	20,000	33.84	676,800.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	8,400	20.97	176,148.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	50,600	13.39	677,534.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	77,600	3.32	257,632.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	26,299	106.41	2,798,476.59
HLA CORP LTD -A	28,000	6.15	172,200.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	14,500	17.31	250,995.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	30,800	9.12	280,896.00
SUNING.COM CO LTD-A	166,680	8.84	1,473,451.20
MUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	48,200	4.60	221,720.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2,700	81.47	219,969.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	5,040	78.27	394,480.80
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	91,000	9.10	828,100.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	7,800	39.30	306,540.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,600	148.00	532,800.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5,625	49.78	280,012.50
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	40,300	8.06	324,818.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	7,000	57.75	404,250.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	26,800	6.82	182,776.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	12,500	55.93	699,125.00
CHONGQING BREWERY CO-A	4,600	60.83	279,818.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7,500	34.04	255,300.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	31,586	115.37	3,644,076.82
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9,800	26.09	255,682.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	15,000	46.00	690,000.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	16,900	14.65	247,585.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	26,200	39.40	1,032,280.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	82,100	28.48	2,338,208.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,890	37.82	449,679.80
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	14,281	109.30	1,560,913.30
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	23,200	15.91	369,112.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	7,600	52.27	397,252.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	5,500	64.00	352,000.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,378	1,425.00	19,063,650.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	13,900	93.59	1,300,901.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	38,760	69.18	2,681,416.80
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	40,000	27.93	1,117,200.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,300	134.60	1,117,180.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4,600	52.70	242,420.00
TOLY BREAD CO LTD-A	5,200	50.32	261,664.00
TONGWEI CO LTD-A	37,000	13.96	516,520.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	65.54	432,564.00

WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	50,450	26.91	1,357,609.50
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,100	160.09	6,579,699.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	12,500	16.16	202,000.00
BY-HEALTH CO LTD-A	15,000	19.31	289,650.00
C&S PAPER CO LTD-A	35,999	20.16	725,739.84
PROYA COSMETICS CO LTD-A	4,500	165.81	746,145.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6,400	40.74	260,736.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	38,252	40.50	1,549,206.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	2,700	153.00	413,100.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	3,600	40.73	146,628.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	7,200	30.75	221,400.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	4,400	77.95	342,980.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	7,700	85.32	656,964.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	16,640	22.40	372,736.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7,600	62.42	474,392.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	9,500	31.41	298,395.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	17,800	17.91	318,798.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,960	34.42	583,763.20
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	35,560	11.55	410,718.00
OVCTEK CHINA INC-A	5,700	62.49	356,193.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	18,300	18.04	330,132.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	10,600	273.83	2,902,598.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,000	145.54	436,620.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	15,400	22.03	339,262.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	15,000	19.89	298,350.00
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	2,200	222.00	488,400.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	9,900	41.70	412,830.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	26.10	339,300.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3,800	112.70	428,260.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,800	123.50	469,300.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,600	680.39	1,769,014.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6,900	35.98	248,262.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,300	27.92	259,656.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	21,098	86.96	1,834,682.08
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	11,000	22.30	245,300.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	6,200	35.18	218,116.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,400	31.72	425,048.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	7,089	84.72	600,580.08
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	17,290	41.13	711,137.70
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7,800	22.08	172,224.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	57,636	82.30	4,743,442.80
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	11,100	15.57	172,827.00

JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	10,700	24.10	257,870.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	18,400	14.48	266,432.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5,800	40.46	234,668.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	5,700	61.00	347,700.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	10,780	25.61	276,075.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	19,200	31.20	599,040.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	57,900	8.30	480,570.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9,900	21.65	214,335.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,041	139.60	843,323.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	8,200	20.31	166,542.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	11,500	27.10	311,650.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	13,600	21.07	286,552.00
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	14,300	14.61	208,923.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	132,800	5.33	707,824.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,300	15.80	304,940.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,680	46.18	677,922.40
WUXI APPTTEC CO LTD-A	19,460	81.77	1,591,244.20
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	11,700	19.37	226,629.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,100	86.49	1,046,529.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	5,800	151.50	878,700.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	25,300	5.42	137,126.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	12,600	31.30	394,380.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	20,400	26.35	537,540.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	5,000	60.55	302,750.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	708,100	3.42	2,421,702.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	200,800	4.92	987,936.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	34,393	7.94	273,080.42
BANK OF CHINA LTD-A	333,900	3.50	1,168,650.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	506,033	5.16	2,611,130.28
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	30,480	7.77	236,829.60
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	48,700	9.01	438,787.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	109,620	5.96	653,335.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	169,500	7.89	1,337,355.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	80,011	27.42	2,193,901.62
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,969	8.11	1,094,598.59
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	53,900	5.11	275,429.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	91,200	6.43	586,416.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	378,310	3.85	1,456,493.50
CHINA MERCHANTS BANK-A	235,999	35.24	8,316,604.76
CHINA MINSHENG BANKING-A	430,928	5.76	2,482,145.28
HUAXIA BANK CO LTD-A	198,750	6.39	1,270,012.50
IND & COMM BK OF CHINA-A	646,128	5.21	3,366,326.88

INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	228,374	16.21	3,701,942.54
JIANGSU CHANGSHU RURAL COM-A	26,000	7.70	200,200.00
PING AN BANK CO LTD-A	203,161	13.59	2,760,957.99
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	156,900	4.41	691,929.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	327,937	10.67	3,499,087.79
ANXIN TRUST CO LTD-A	52,000	1.99	103,480.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	85,300	3.91	333,523.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	34,125	10.36	353,535.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	52,500	6.28	329,700.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	70,200	10.01	702,702.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	58,000	12.07	700,060.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	54,300	17.15	931,245.00
CITIC SECURITIES CO-A	119,445	22.84	2,728,123.80
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26,300	34.04	895,252.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	26,200	10.66	279,292.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	76,597	15.37	1,177,295.89
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	37,200	11.13	414,036.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	33,200	6.88	228,416.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	78,300	7.06	552,798.00
GF SECURITIES CO LTD-A	56,200	13.74	772,188.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	39,000	10.84	422,760.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	114,300	15.96	1,824,228.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	31,900	8.12	259,028.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	133,879	12.05	1,613,241.95
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,130	112.96	579,484.80
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	34,400	7.23	248,712.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	108,940	17.90	1,950,026.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	24,900	10.33	257,217.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	63,600	5.85	372,060.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	31,300	14.52	454,476.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	22,200	8.28	183,816.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	56,800	9.38	532,784.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	64,800	3.21	208,008.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	33,500	12.15	407,025.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	40,000	4.32	172,800.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	26,900	7.01	188,569.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	214,214	4.49	961,820.86
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	28,700	10.85	311,395.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	28,500	7.79	222,015.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	53,700	4.58	245,946.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	115,900	6.15	712,785.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	33,200	8.07	267,924.00

ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	26,400	10.12	267,168.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	26,400	27.83	734,712.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	75,700	29.26	2,214,982.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	47,000	5.01	235,470.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	19,786	45.30	896,305.80
PICC HOLDING CO-A	81,000	6.29	509,490.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	122,522	75.30	9,225,906.60
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	24,500	6.24	152,880.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	38,700	4.24	164,088.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	28,500	22.36	637,260.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	21,688	32.00	694,016.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	75,223	16.03	1,205,824.69
CHINA VANKE CO LTD -A	111,356	26.41	2,940,911.96
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	28,300	6.63	187,629.00
GEMDALE CORP-A	42,900	13.67	586,443.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	31,100	5.09	158,299.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	77,200	5.49	423,828.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	35,200	8.14	286,528.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	50,700	7.78	394,446.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	32,901	3.64	119,759.64
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	113,000	14.86	1,679,180.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	41,300	7.99	329,987.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	21,500	32.47	698,105.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	14,800	17.57	260,036.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	28,600	5.19	148,434.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	81,700	3.01	245,917.00
YANGO GROUP CO LTD-A	38,500	6.75	259,875.00
YOUNGOR GROUP CO-A	106,400	6.16	655,424.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	229,500	3.08	706,860.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	51,100	17.96	917,756.00
AISINO CORP-A	17,800	16.35	291,030.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	14,300	47.84	684,112.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	8,400	30.04	252,336.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	14,700	25.08	368,676.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	26,700	25.94	692,598.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	4,700	77.86	365,942.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	14,100	22.76	320,916.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	29,500	11.38	335,710.00
GLODON CO LTD-A	10,700	58.47	625,629.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	10,049	83.86	842,709.14
IFLYTEK CO LTD - A	21,000	33.38	700,980.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	9,900	16.08	159,192.00

SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,200	178.50	571,200.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	54,860	2.90	159,094.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	8,000	55.63	445,040.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	8,200	18.57	152,274.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	11,800	60.45	713,310.00
VENUSTECH GROUP INC-A	8,500	38.25	325,125.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	23,200	7.95	184,440.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	32,300	19.75	637,925.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	30,615	35.86	1,097,853.90
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6,400	29.75	190,400.00
ADDSINO CO LTD -A	15,000	14.15	212,250.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	10,000	35.74	357,400.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	321,800	4.34	1,396,612.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	16,597	20.96	347,873.12
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	27,800	13.52	375,856.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	12,040	38.20	459,928.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11,100	29.85	331,335.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	88,700	14.08	1,248,896.00
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	8,000	33.19	265,520.00
GOERTEK INC -A	30,800	23.66	728,728.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	22,900	11.50	263,350.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	21,800	12.44	271,192.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	8,400	89.95	755,580.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	102,910	28.77	2,960,720.70
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	18,000	16.64	299,520.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	29,600	5.10	150,960.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	33,500	21.18	709,530.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	9,500	14.00	133,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	12,300	38.30	471,090.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	31,100	20.06	623,866.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	24,200	5.94	143,748.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	54,200	11.00	596,200.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	50,780	51.85	2,632,943.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	154.13	678,172.00
NINESTAR CORP-A	10,100	31.29	316,029.00
OFILM GROUP CO LTD-A	25,700	16.71	429,447.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	21,600	27.86	601,776.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,480	158.33	709,318.40
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	29,600	24.28	718,688.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9,200	46.92	431,664.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	15,300	28.69	438,957.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	9,000	30.39	273,510.00

TIANMA MICROELECTRONICS-A	19,400	14.80	287,120.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	16,120	39.68	639,641.60
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13,800	19.60	270,480.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	8,000	20.77	166,160.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	10,000	108.71	1,087,100.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	15,130	26.89	406,845.70
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	20,000	10.00	200,000.00
MUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16,400	24.15	396,060.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	8,400	44.16	370,944.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,050	61.41	432,940.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,500	16.85	480,225.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5,700	58.31	332,367.00
ZTE CORP-A	44,200	38.17	1,687,114.00
CHINA UNITED NETWORK-A	295,000	5.04	1,486,800.00
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	28,400	4.75	134,900.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	123,205	4.12	507,604.60
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	241,064	17.75	4,278,886.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	186,400	1.84	342,976.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	64,400	3.59	231,196.00
HUANENG POWER INTL INC-A	157,200	4.30	675,960.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	41,300	3.54	146,202.00
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	55,000	2.58	141,900.00
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	15,000	14.72	220,800.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	64,500	7.69	496,005.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	24,800	7.45	184,760.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	46,600	5.40	251,640.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	31,300	5.51	172,463.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	41,800	8.93	373,274.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	48,300	2.67	128,961.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4,340	226.23	981,838.20
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	12,500	14.79	184,875.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	50,434	31.31	1,579,088.54
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	38,800	25.26	980,088.00
SG MICRO CORP-A	2,700	219.81	593,487.00
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	3,600	231.45	833,220.00
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	26,500	19.49	516,485.00
TIANSUI HUATIAN TECHNOLOG-A	51,100	14.18	724,598.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	29,100	24.43	710,913.00
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	5,700	72.90	415,530.00
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	13,000	13.17	171,210.00
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,500	186.50	1,025,750.00
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	58,800	11.85	696,780.00

	ZHEJIANG JINGSHENG MECHAN-I-A	29,700	22.49	667,953.00	
	オフショア元 小計	25,238,209		336,683,872.70 (5,211,866,349)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	32,700	14.10	461,070.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	226,598	32.40	7,341,775.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	17,512	50.90	891,360.80	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	48,940	10.28	503,103.20	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	77,416	14.16	1,096,210.56	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	36,428	79.40	2,892,383.20	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	76,154	37.60	2,863,390.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	161,668	89.10	14,404,618.80	
	SAUDI CEMENT	11,200	47.95	537,040.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	32,930	19.26	634,231.80	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	144,273	8.47	1,221,992.31	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,276	51.40	2,635,586.40	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	6,030	77.00	464,310.00	
	JARIR MARKETING CO	9,884	139.40	1,377,829.60	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	8,000	112.80	902,400.00	
	ALMARAI CO	46,959	53.90	2,531,090.10	
	SAVOLA	43,587	45.20	1,970,132.40	
	AL RAJHI BANK	227,045	58.70	13,327,541.50	
	ALINMA BANK	173,821	14.96	2,600,362.16	
	ARAB NATIONAL BANK	106,309	20.98	2,230,362.82	
	BANK AL-JAZIRA	81,590	11.40	930,126.00	
	BANK ALBILAD	63,262	22.14	1,400,620.68	
	BANQUE SAUDI FRANSI	106,555	30.35	3,233,944.25	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	263,870	39.55	10,436,058.50	
	RIYAD BANK	242,739	17.70	4,296,480.30	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	181,351	24.00	4,352,424.00	
	SAUDI BRITISH BANK	125,096	23.42	2,929,748.32	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	10,773	112.60	1,213,039.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	14,550	71.60	1,041,780.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	117,066	7.33	858,093.78	
	EMAAR ECONOMIC CITY	57,120	7.23	412,977.60	
	ETIHAD ETISALAT CO	64,529	27.45	1,771,321.05	
	SAUDI TELECOM CO	111,556	99.50	11,099,822.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	150,064	15.96	2,395,021.44	
	サウジアラビアリアル 小計	3,128,851		107,258,248.97 (3,131,940,869)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,156	89.35	1,800,938.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	294,834	8.67	2,556,210.78	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	55,382	31.88	1,765,578.16	

	KOC HOLDING AS	155,842	17.85	2,781,779.70	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	26,912	20.20	543,622.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,226	12.72	1,096,794.72	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	14,221	67.30	957,073.30	
	BIM BIRLESİK MAGAZALAR AS	89,057	66.40	5,913,384.80	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	50,431	19.91	1,004,081.21	
	AKBANK T.A.S.	562,940	5.92	3,332,604.80	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	460,073	8.29	3,814,005.17	
	TURKIYE IS BANKASI-C	268,383	5.14	1,379,488.62	
	YAPI VE KREDİ BANKASI	515,884	2.43	1,253,598.12	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	136,771	9.12	1,247,351.52	
	TURKCELL İLETİŞİM HİZMET AS	215,914	14.57	3,145,866.98	
	トルコリラ 小計	2,953,026		32,592,378.88 (526,692,842)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	9,079	14.85	134,823.15	
	FF GROUP	5,889	4.80	28,267.20	
	OPAP SA	39,461	8.95	353,175.95	
	JUMBO SA	22,412	16.44	368,453.28	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	42,454	12.38	525,580.52	
	ユーロ 小計	119,295		1,410,300.10 (174,440,019)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	83,268	17.10	1,423,882.80	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	775,129	2.18	1,691,331.47	
	INDUSTRIES QATAR	308,520	8.77	2,706,028.92	
	COMMERCIAL BANK PSQC	335,235	3.96	1,327,530.60	
	MASRAF AL RAYAN	681,547	3.90	2,662,122.58	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	144,077	8.29	1,195,406.86	
	QATAR ISLAMIC BANK	222,208	16.20	3,599,769.60	
	QATAR NATIONAL BANK	834,617	18.13	15,131,606.21	
	BARWA REAL ESTATE CO	334,664	2.96	990,605.44	
	QOOREDOO QPSC	128,720	6.73	866,543.04	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	88,613	16.22	1,437,302.86	
	カタールリアル 小計	3,936,598		33,032,130.38 (986,669,734)	
	合 計	1,126,711,307		118,642,063,624 (118,642,063,624)	

(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	621,800	13,182,160.00	
メキシコペソ合計			621,800	13,182,160.00 (67,097,194)	
南アフリカランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	537,442	8,007,885.80	
南アフリカランド合計			537,442	8,007,885.80 (52,291,494)	
合 計				119,388,688 (119,388,688)	

(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 62銘柄	100.00%	—	15.92%
イギリスポンド	株式 1銘柄	100.00%	—	0.07%
香港ドル	株式 207銘柄	100.00%	—	23.29%
マレーシアリングgit	株式 39銘柄	100.00%	—	1.84%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.00%	—	2.40%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.00%	—	0.86%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.00%	—	1.53%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.06%	—	1.87%
	投資証券 1銘柄	—	2.94%	0.06%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.00%	—	5.62%
チリペソ	株式 16銘柄	100.00%	—	0.63%
韓国ウォン	株式 108銘柄	100.00%	—	11.96%
ニュー台湾ドル	株式 88銘柄	100.00%	—	11.93%
インドルピー	株式 86銘柄	100.00%	—	7.92%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	—	0.11%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.00%	—	0.22%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%	—	0.26%
アラブディルハム	株式 7銘柄	100.00%	—	0.48%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.00%	—	0.76%
南アフリカランド	株式 40銘柄	98.85%	—	3.78%
	投資証券 1銘柄	—	1.15%	0.04%
オフショア元	株式 477銘柄	100.00%	—	4.39%
サウジアラビアリヤル	株式 34銘柄	100.00%	—	2.64%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.00%	—	0.44%

ユーロ	株式	5銘柄	100.00%	—	0.15%
カタルリアル	株式	11銘柄	100.00%	—	0.83%

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。

日本株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

[令和 2年 6月 8日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	17,681,652
株式	2,415,097,010
投資証券	35,756,200
派生商品評価勘定	198,900
未収入金	7,244,643
未収配当金	13,740,835
差入委託証拠金	1,230,000
流動資産合計	2,490,949,240
資産合計	2,490,949,240
負債の部	
流動負債	
前受金	4,220,000
未払金	1,581,670
未払解約金	3,207,349
未払利息	31
流動負債合計	9,009,050
負債合計	9,009,050
純資産の部	
元本等	
元本	2,373,710,737
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	108,229,453
元本等合計	2,481,940,190
純資産合計	2,481,940,190
負債純資産合計	2,490,949,240

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。

（貸借対照表に関する注記）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1. 期首	令和 2年 1月 8日
期首元本額	779,908,890円
期中追加設定元本額	1,639,000,399円
期中一部解約元本額	45,198,552円
元本の内訳	
MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信	191,497,350円
eMAXIS Slim 全世界株式（オール・カントリー）	2,182,009,548円
つみたて全世界株式	203,839円
合計	2,373,710,737円
2. 受益権の総数	2,373,710,737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 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
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、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。 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。

区分	自 令和 2年 1月 8日 至 令和 2年 6月 8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	[令和 2年 6月 8日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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	[令和 2年 6月 8日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	257,825,239
投資証券	2,771,165
合計	260,596,404

(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

[令和 2年 6月 8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	32,360,000	—	32,560,000	200,000
合計		32,360,000	—	32,560,000	200,000

（注）時価の算定方法

- 1 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。
- 2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 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。

（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）

	[令和 2年 6月 8日現在]
1口当たり純資産額	1.0456円
(1万口当たり純資産額)	(10,456円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1605	国際石油開発帝石	6,700	805.00	5,393,500	
1801	大成建設	1,200	4,160.00	4,992,000	
1802	大林組	4,200	1,100.00	4,620,000	
1803	清水建設	3,600	945.00	3,402,000	
1812	鹿島建設	2,900	1,300.00	3,770,000	
1878	大東建託	400	11,760.00	4,704,000	
1925	大和ハウス工業	3,700	2,959.00	10,948,300	
1928	積水ハウス	4,100	2,161.50	8,862,150	
1963	日揮ホールディングス	1,400	1,291.00	1,807,400	

2002	日清製粉グループ本社	1,300	1,751.00	2,276,300	
2212	山崎製パン	800	1,880.00	1,504,000	
2229	カルビー	600	3,060.00	1,836,000	
2267	ヤクルト本社	800	6,850.00	5,480,000	
2269	明治ホールディングス	700	8,150.00	5,705,000	
2282	日本ハム	500	4,295.00	2,147,500	
2502	アサヒグループホールディングス	2,500	4,486.00	11,215,000	
2503	キリンホールディングス	5,400	2,390.00	12,906,000	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	800	2,334.00	1,867,200	
2587	サントリー食品インターナショナル	900	4,415.00	3,973,500	
2593	伊藤園	300	6,030.00	1,809,000	
2801	キッコーマン	900	5,380.00	4,842,000	
2802	味の素	3,000	1,820.00	5,460,000	
2875	東洋水産	600	5,390.00	3,234,000	
2897	日清食品ホールディングス	400	8,650.00	3,460,000	
2914	日本たばこ産業	7,800	2,204.50	17,195,100	
3401	帝人	1,200	1,836.00	2,203,200	
3402	東レ	9,100	563.20	5,125,120	
3861	王子ホールディングス	5,600	533.00	2,984,800	
3405	クラレ	2,100	1,261.00	2,648,100	
3407	旭化成	8,200	952.90	7,813,780	
4004	昭和電工	900	2,664.00	2,397,600	
4005	住友化学	9,700	373.00	3,618,100	
4021	日産化学	800	5,370.00	4,296,000	
4042	東ソー	1,700	1,590.00	2,703,000	
4063	信越化学工業	2,300	12,750.00	29,325,000	
4088	エア・ウォーター	1,200	1,600.00	1,920,000	
4091	大陽日酸	1,000	2,081.00	2,081,000	
4182	三菱瓦斯化学	1,000	1,703.00	1,703,000	
4183	三井化学	1,200	2,486.00	2,983,200	
4185	J S R	1,300	2,019.00	2,624,700	
4188	三菱ケミカルホールディングス	8,400	671.30	5,638,920	
4202	ダイセル	1,600	933.00	1,492,800	
4204	積水化学工業	2,400	1,620.00	3,888,000	
4452	花王	3,100	8,911.00	27,624,100	
4612	日本ペイントホールディングス	1,000	7,510.00	7,510,000	
4613	関西ペイント	1,200	2,330.00	2,796,000	
4901	富士フイルムホールディングス	2,400	5,011.00	12,026,400	
4911	資生堂	2,600	7,156.00	18,605,600	
4912	ライオン	1,500	2,334.00	3,501,000	
4922	コーセー	200	14,660.00	2,932,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	600	2,234.00	1,340,400	

4967	小林製薬	300	9,480.00	2,844,000	
6988	日東電工	1,000	6,200.00	6,200,000	
8113	ユニ・チャーム	2,600	3,960.00	10,296,000	
4151	協和キリン	1,800	2,851.00	5,131,800	
4502	武田薬品工業	10,300	4,057.00	41,787,100	
4503	アステラス製薬	12,200	1,852.50	22,600,500	
4506	大日本住友製薬	1,200	1,650.00	1,980,000	
4507	塩野義製薬	1,800	6,472.00	11,649,600	
4516	日本新薬	300	8,680.00	2,604,000	
4519	中外製薬	1,500	15,680.00	23,520,000	
4523	エーザイ	1,600	8,910.00	14,256,000	
4528	小野薬品工業	2,400	2,937.50	7,050,000	
4530	久光製薬	300	5,500.00	1,650,000	
4536	参天製薬	2,400	2,039.00	4,893,600	
4568	第一三共	3,700	9,215.00	34,095,500	
4578	大塚ホールディングス	2,500	4,931.00	12,327,500	
4581	大正製薬ホールディングス	200	6,930.00	1,386,000	
4587	ペプチドリーム	600	4,715.00	2,829,000	
5019	出光興産	1,300	2,469.00	3,209,700	
5020	J X T Gホールディングス	20,000	428.00	8,560,000	
5101	横浜ゴム	800	1,768.00	1,414,400	
5108	ブリヂストン	3,500	3,748.00	13,118,000	
5110	住友ゴム工業	1,100	1,204.00	1,324,400	
5201	A G C	1,300	3,505.00	4,556,500	
5233	太平洋セメント	800	2,737.00	2,189,600	
5332	T O T O	900	4,545.00	4,090,500	
5333	日本碍子	1,700	1,717.00	2,918,900	
5334	日本特殊陶業	1,000	1,755.00	1,755,000	
5401	日本製鉄	5,300	1,176.00	6,232,800	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	3,200	936.00	2,995,200	
5463	丸一鋼管	400	2,915.00	1,166,000	
5486	日立金属	1,400	1,374.00	1,923,600	
5711	三菱マテリアル	700	2,560.00	1,792,000	
5713	住友金属鉱山	1,500	3,241.00	4,861,500	
5802	住友電気工業	4,900	1,377.50	6,749,750	
3436	S U M C O	1,700	1,712.00	2,910,400	
5938	L I X I Lグループ	1,700	1,643.00	2,793,100	
5947	リンナイ	200	9,350.00	1,870,000	
6005	三浦工業	600	4,465.00	2,679,000	
6113	アマダ	2,200	1,004.00	2,208,800	
6146	ディスコ	200	26,340.00	5,268,000	
6268	ナブテスコ	700	3,465.00	2,425,500	

6273	S M C	400	56,690.00	22,676,000	
6301	小松製作所	5,700	2,342.50	13,352,250	
6302	住友重機械工業	700	2,750.00	1,925,000	
6305	日立建機	700	3,090.00	2,163,000	
6326	クボタ	6,800	1,585.00	10,778,000	
6367	ダイキン工業	1,600	16,680.00	26,688,000	
6370	栗田工業	600	3,060.00	1,836,000	
6383	ダイフク	700	8,660.00	6,062,000	
6460	セガサミーホールディングス	1,100	1,385.00	1,523,500	
6465	ホシザキ	300	9,060.00	2,718,000	
6471	日本精工	2,300	921.00	2,118,300	
6473	ジェイテクト	1,300	999.00	1,298,700	
6481	T H K	800	2,965.00	2,372,000	
6586	マキタ	1,500	3,935.00	5,902,500	
7011	三菱重工業	2,100	2,991.00	6,281,100	
6448	ブラザー工業	1,500	2,138.00	3,207,000	
6479	ミネベアミツミ	2,400	2,163.00	5,191,200	
6501	日立製作所	6,300	3,753.00	23,643,900	
6502	東芝	2,500	3,335.00	8,337,500	
6503	三菱電機	11,900	1,476.50	17,570,350	
6504	富士電機	800	3,120.00	2,496,000	
6506	安川電機	1,600	3,990.00	6,384,000	
6594	日本電産	2,900	7,041.00	20,418,900	
6645	オムロン	1,200	7,440.00	8,928,000	
6701	日本電気	1,600	5,010.00	8,016,000	
6702	富士通	1,300	11,565.00	15,034,500	
6723	ルネサスエレクトロニクス	5,000	663.00	3,315,000	
6724	セイコーエプソン	1,800	1,448.00	2,606,400	
6752	パナソニック	14,400	1,008.00	14,515,200	
6753	シャープ	1,400	1,305.00	1,827,000	
6758	ソニー	8,300	7,396.00	61,386,800	
6762	T D K	800	11,220.00	8,976,000	
6806	ヒロセ電機	200	12,310.00	2,462,000	
6841	横河電機	1,500	1,723.00	2,584,500	
6857	アドバンテスト	1,300	6,150.00	7,995,000	
6861	キーエンス	1,200	44,440.00	53,328,000	
6869	シスメックス	1,100	8,200.00	9,020,000	
6920	レーザーテック	500	9,660.00	4,830,000	
6923	スタンレー電気	900	2,894.00	2,604,600	
6952	カシオ計算機	1,300	1,958.00	2,545,400	
6954	ファナック	1,300	20,755.00	26,981,500	
6963	ローム	600	8,010.00	4,806,000	

6965	浜松ホトニクス	900	4,705.00	4,234,500	
6971	京セラ	2,100	6,218.00	13,057,800	
6981	村田製作所	3,800	6,465.00	24,567,000	
7276	小糸製作所	700	4,800.00	3,360,000	
7751	キヤノン	6,500	2,353.50	15,297,750	
7752	リコー	4,400	935.00	4,114,000	
8035	東京エレクトロン	1,000	24,190.00	24,190,000	
6201	豊田自動織機	1,000	6,010.00	6,010,000	
6902	デンソー	2,800	4,370.00	12,236,000	
7012	川崎重工業	900	1,980.00	1,782,000	
7201	日産自動車	15,200	487.60	7,411,520	
7202	いすゞ自動車	3,600	1,095.50	3,943,800	
7203	トヨタ自動車	13,900	7,167.00	99,621,300	
7205	日野自動車	1,900	850.00	1,615,000	
7211	三菱自動車工業	4,400	348.00	1,531,200	
7259	アイシン精機	1,100	3,735.00	4,108,500	
7261	マツダ	3,700	841.00	3,111,700	
7267	本田技研工業	10,600	3,040.00	32,224,000	
7269	スズキ	2,400	4,166.00	9,998,400	
7270	S U B A R U	4,000	2,655.50	10,622,000	
7272	ヤマハ発動機	1,800	1,835.00	3,303,000	
7282	豊田合成	400	2,470.00	988,000	
7309	シマノ	500	19,870.00	9,935,000	
4543	テルモ	4,200	4,103.00	17,232,600	
7701	島津製作所	1,400	2,936.00	4,110,400	
7731	ニコン	2,000	1,056.00	2,112,000	
7733	オリンパス	7,600	1,945.50	14,785,800	
7741	H O Y A	2,500	10,085.00	25,212,500	
7747	朝日インテック	1,300	3,005.00	3,906,500	
7832	バンダイナムコホールディングス	1,300	6,407.00	8,329,100	
7911	凸版印刷	1,700	1,923.00	3,269,100	
7912	大日本印刷	1,600	2,596.00	4,153,600	
7951	ヤマハ	900	5,720.00	5,148,000	
7956	ビジョン	800	4,220.00	3,376,000	
7974	任天堂	700	45,070.00	31,549,000	
9501	東京電力ホールディングス	9,400	385.00	3,619,000	
9502	中部電力	4,200	1,437.50	6,037,500	
9503	関西電力	4,600	1,111.00	5,110,600	
9504	中国電力	1,900	1,463.00	2,779,700	
9506	東北電力	2,800	1,082.00	3,029,600	
9508	九州電力	2,500	917.00	2,292,500	
9513	電源開発	900	2,056.00	1,850,400	

9531	東京瓦斯	2,500	2,549.50	6,373,750	
9532	大阪瓦斯	2,400	2,118.00	5,083,200	
9533	東邦瓦斯	500	5,230.00	2,615,000	
9001	東武鉄道	1,200	3,830.00	4,596,000	
9005	東急	3,300	1,742.00	5,748,600	
9006	京浜急行電鉄	1,400	1,788.00	2,503,200	
9007	小田急電鉄	1,900	2,654.00	5,042,600	
9008	京王電鉄	700	6,290.00	4,403,000	
9009	京成電鉄	800	3,715.00	2,972,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,000	8,804.00	17,608,000	
9021	西日本旅客鉄道	1,100	7,002.00	7,702,200	
9022	東海旅客鉄道	900	18,955.00	17,059,500	
9024	西武ホールディングス	1,400	1,442.00	2,018,800	
9041	近鉄グループホールディングス	1,100	5,240.00	5,764,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	1,500	4,025.00	6,037,500	
9045	京阪ホールディングス	600	5,040.00	3,024,000	
9048	名古屋鉄道	1,200	3,210.00	3,852,000	
9062	日本通運	500	5,960.00	2,980,000	
9064	ヤマトホールディングス	2,000	2,338.00	4,676,000	
9142	九州旅客鉄道	1,000	3,105.00	3,105,000	
9143	S Gホールディングス	1,000	3,390.00	3,390,000	
9101	日本郵船	1,000	1,655.00	1,655,000	
9201	日本航空	700	2,448.00	1,713,600	
9202	A N Aホールディングス	800	2,854.00	2,283,200	
9364	上組	600	2,240.00	1,344,000	
3626	T I S	1,500	2,247.00	3,370,500	
3659	ネクソン	3,200	2,213.00	7,081,600	
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	300	11,040.00	3,312,000	
3938	L I N E	400	5,360.00	2,144,000	
4307	野村総合研究所	2,100	2,705.00	5,680,500	
4385	メルカリ	600	3,220.00	1,932,000	
4684	オービック	500	17,960.00	8,980,000	
4689	Zホールディングス	17,300	445.00	7,698,500	
4704	トレンドマイクロ	900	6,190.00	5,571,000	
4716	日本オラクル	300	11,860.00	3,558,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	600	3,645.00	2,187,000	
4768	大塚商会	700	5,280.00	3,696,000	
9432	日本電信電話	8,400	2,532.00	21,268,800	
9433	K D D I	10,800	3,228.00	34,862,400	
9434	ソフトバンク	12,500	1,367.00	17,087,500	
9435	光通信	100	24,490.00	2,449,000	
9437	N T T ドコモ	7,600	2,899.50	22,036,200	

9602	東宝	700	3,990.00	2,793,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	4,100	1,333.00	5,465,300	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	600	5,310.00	3,186,000	
9719	S C S K	300	5,400.00	1,620,000	
9766	コナミホールディングス	600	4,000.00	2,400,000	
9984	ソフトバンクグループ	10,200	5,324.00	54,304,800	
2784	アルフレッサ ホールディングス	1,200	2,258.00	2,709,600	
3038	神戸物産	400	6,100.00	2,440,000	
7459	メディパルホールディングス	1,200	2,183.00	2,619,600	
8001	伊藤忠商事	8,800	2,399.00	21,111,200	
8002	丸紅	10,800	577.30	6,234,840	
8015	豊田通商	1,400	3,065.00	4,291,000	
8031	三井物産	10,800	1,782.00	19,245,600	
8053	住友商事	7,800	1,361.00	10,615,800	
8058	三菱商事	8,800	2,543.50	22,382,800	
9962	ミスミグループ本社	1,900	2,933.00	5,572,700	
9987	スズケン	400	4,050.00	1,620,000	
2651	ローソン	300	5,990.00	1,797,000	
2670	エービーシー・マート	200	6,610.00	1,322,000	
2702	日本マクドナルドホールディングス	400	5,860.00	2,344,000	
3064	M o n o t a R O	800	3,970.00	3,176,000	
3092	Z O Z O	700	2,229.00	1,560,300	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	2,200	768.00	1,689,600	
3141	ウエルシアホールディングス	300	8,570.00	2,571,000	
3349	コスモス薬品	100	15,480.00	1,548,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	4,900	3,900.00	19,110,000	
3391	ツルハホールディングス	200	15,490.00	3,098,000	
7453	良品計画	1,600	1,629.00	2,606,400	
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	2,700	2,115.00	5,710,500	
8028	ファミリーマート	1,700	2,143.00	3,643,100	
8227	しまむら	100	7,740.00	774,000	
8252	丸井グループ	1,200	2,170.00	2,604,000	
8267	イオン	4,300	2,447.00	10,522,100	
9831	ヤマダ電機	4,700	563.00	2,646,100	
9843	ニトリホールディングス	500	19,145.00	9,572,500	
9983	ファーストリテイリング	400	65,030.00	26,012,000	
9989	サンドラッグ	500	3,540.00	1,770,000	
7167	めぶきフィナンシャルグループ	6,200	257.00	1,593,400	
7182	ゆうちょ銀行	2,600	925.00	2,405,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,900	379.00	2,615,100	

8303	新生銀行	1,000	1,532.00	1,532,000	
8304	あおぞら銀行	800	2,153.00	1,722,400	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	79,800	483.20	38,559,360	
8308	りそなホールディングス	13,700	407.20	5,578,640	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	2,200	3,389.00	7,455,800	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	8,500	3,425.00	29,112,500	
8331	千葉銀行	3,500	550.00	1,925,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	1,100	1,914.00	2,105,400	
8355	静岡銀行	2,800	743.00	2,080,400	
8369	京都銀行	400	4,175.00	1,670,000	
8410	セブン銀行	3,800	302.00	1,147,600	
8411	みずほフィナンシャルグループ	157,500	145.80	22,963,500	
8473	ＳＢＩホールディングス	1,500	2,354.00	3,531,000	
8601	大和証券グループ本社	9,400	489.00	4,596,600	
8604	野村ホールディングス	20,500	516.30	10,584,150	
7181	かんぽ生命保険	1,500	1,531.00	2,296,500	
8630	ＳＯＭＰＯホールディングス	2,200	3,840.00	8,448,000	
8725	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループ ホール	2,900	3,318.00	9,622,200	
8729	ソニーフィナンシャルホールディング ス	1,000	2,596.00	2,596,000	
8750	第一生命ホールディングス	7,000	1,582.50	11,077,500	
8766	東京海上ホールディングス	4,200	5,064.00	21,268,800	
8795	Ｔ＆Ｄホールディングス	3,500	1,131.00	3,958,500	
8439	東京センチュリー	300	5,240.00	1,572,000	
8572	アコム	1,900	450.00	855,000	
8591	オリックス	8,600	1,585.00	13,631,000	
8593	三菱ＵＦＪリース	2,600	577.00	1,500,200	
8697	日本取引所グループ	3,300	2,374.00	7,834,200	
3003	ヒューリック	2,000	1,135.00	2,270,000	
3231	野村不動産ホールディングス	800	2,234.00	1,787,200	
3289	東急不動産ホールディングス	4,000	612.00	2,448,000	
3291	飯田グループホールディングス	1,000	1,720.00	1,720,000	
4666	パーク２４	700	2,196.00	1,537,200	
8801	三井不動産	6,100	2,333.00	14,231,300	
8802	三菱地所	7,700	1,840.50	14,171,850	
8830	住友不動産	2,000	3,344.00	6,688,000	
8905	イオンモール	700	1,600.00	1,120,000	
9706	日本空港ビルデング	300	5,030.00	1,509,000	
2127	日本Ｍ＆Ａセンター	1,000	4,495.00	4,495,000	
2181	パーソルホールディングス	1,200	1,576.00	1,891,200	
2331	総合警備保障	500	5,320.00	2,660,000	
2371	カカクコム	900	2,803.00	2,522,700	

2413	エムスリー	2,900	4,465.00	12,948,500	
2433	博報堂ＤＹホールディングス	1,500	1,388.00	2,082,000	
4324	電通グループ	1,400	3,105.00	4,347,000	
4661	オリエンタルランド	1,300	15,465.00	20,104,500	
4732	ユー・エス・エス	1,400	1,922.00	2,690,800	
4751	サイバーエージェント	700	5,140.00	3,598,000	
4755	楽天	5,600	978.00	5,476,800	
6098	リクルートホールディングス	8,300	4,002.00	33,216,600	
6178	日本郵政	10,300	852.10	8,776,630	
9735	セコム	1,400	9,400.00	13,160,000	
9783	ベネッセホールディングス	500	2,953.00	1,476,500	
合 計		1,096,800		2,415,097,010	

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	G L P 投資法人	24	3,345,600	
	日本プロロジスリート投資法人	14	4,043,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	28	4,130,000	
	日本ビルファンド投資法人	8	5,432,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	9	5,346,000	
	日本リテールファンド投資法人	17	2,776,100	
	オリックス不動産投資法人	17	2,895,100	
	日本プライムリアルティ投資法人	5	1,842,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	19	2,513,700	
	大和ハウスリート投資法人	13	3,432,000	
合計		154	35,756,200	

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。

２【ファンドの現況】

【ＭＡＸＩＳ全世界株式（オール・カントリー）上場投信】

【純資産額計算書】

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	2,502,508,031
負債総額	11,822,335
純資産総額（ - ）	2,490,685,696
発行済口数	272,000口
1口当たり純資産価額（ / ）	9,157

（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

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	476,214,098,585
負債総額	3,718,388,351
純資産総額（ - ）	472,495,710,234
発行済口数	165,513,521,550口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.8547
（10,000口当たり）	（28,547）

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

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	123,905,628,121
負債総額	393,692,482
純資産総額（ - ）	123,511,935,639
発行済口数	52,964,490,441口
1口当たり純資産価額（ / ）	2.3320

（ 10,000口当たり ）	（ 23,320 ）
----------------	------------

日本株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

令和 2年 6月30日現在

（単位：円）

資産総額	2,503,838,104
負債総額	50,878,245
純資産総額（ - ）	2,452,959,859
発行済口数	2,448,949,152口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.0016
（ 10,000口当たり ）	（ 10,016 ）

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められ、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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2020年6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。

2020年 6月30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	872	13,948,829
追加型公社債投資信託	16	1,318,010
単位型株式投資信託	64	334,950
単位型公社債投資信託	20	101,305
合 計	972	15,703,095

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。

なお、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35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2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。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)		第35期 (令和2年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	53,969,686	2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	2	560,483	2	638,994
金銭の信託	2	100,000	2	100,000

その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	617,032	1	584,048
器具備品	1	665,247	1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365
投資その他の資産				
投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	1	824,268	1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		25,079,767		20,718,993
固定資産合計		31,213,401		27,563,734
資産合計		97,912,673		97,802,752

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	293,258	687,565
未払金		
未払収益分配金	170,281	131,478
未払償還金	448,695	395,400
未払手数料	2 3,990,054	2 4,026,078
その他未払金	2 3,961,765	2 3,818,195
未払費用	2 3,803,995	2 4,402,578
未払消費税等	194,852	629,469
未払法人税等	573,657	617,341
賞与引当金	901,135	933,517
役員賞与引当金	140,100	124,590
その他	868,992	701,285
流動負債合計	15,346,788	16,467,499
固定負債		
長期未払金	43,200	32,400
退職給付引当金	860,851	1,010,401
役員退職慰労引当金	144,303	130,784

時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(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	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2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	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	70,375,414	67,967,489
投資顧問料	2,505,299	2,385,084
その他営業収益	18,844	16,085
営業収益合計	72,899,557	70,368,658
営業費用		
支払手数料	2 28,533,952	2 27,106,451
広告宣伝費	739,643	696,418
公告費	500	1,000
調査費		
調査費	1,794,755	1,857,271
委託調査費	12,194,996	11,579,175
事務委託費	1,016,816	847,769
営業雑経費		

通信費	170,794	153,731
印刷費	427,442	427,118
協会費	48,375	52,053
諸会費	16,175	15,990
事務機器関連費	1,841,631	1,953,926
営業費用合計	46,785,083	44,690,907
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,083	331,987
給料・手当	6,453,717	6,611,427
賞与引当金繰入	901,135	933,517
役員賞与引当金繰入	140,100	124,590
福利厚生費	1,234,293	1,276,950
交際費	13,011	11,871
旅費交通費	200,426	165,891
租税公課	373,201	360,165
不動産賃借料	654,886	647,402
退職給付費用	428,912	422,919
役員退職慰労引当金繰入	51,159	48,183
固定資産減価償却費	1,252,321	1,307,555
諸経費	523,213	427,212
一般管理費合計	12,575,461	12,669,674
営業利益	13,539,012	13,008,076

(単位：千円)

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	181,073	90,965
受取利息	2 1,913	2 4,169
投資有価証券償還益	416,706	585,179
収益分配金等時効完成分	44,392	101,734
受取賃貸料	2 38,388	2 65,808
その他	11,871	19,987
営業外収益合計	694,346	867,845
営業外費用		
投資有価証券償還損	118,173	96,379
時効後支払損引当金繰入	1,166	-
事務過誤費	420	3,483
賃貸関連費用	35,994	20,339
その他	1,481	1,920
営業外費用合計	157,235	122,122
経常利益	14,076,123	13,753,799
特別利益		
投資有価証券売却益	501,778	174,842
特別利益合計	501,778	174,842
特別損失		
投資有価証券売却損	135,399	75,963
投資有価証券評価損	62,310	163,865
固定資産除却損	1 4,848	1 8,832

固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		-
商標使用料		90,000		-
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	2	4,420,179	2	4,146,534
法人税等調整額		100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

（３）【株主資本等変動計算書】

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 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	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	1,721,316	1,721,316	1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	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	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	358,179	358,179	358,179
当期変動額合計	358,179	358,179	2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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			利益剰余金				
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 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	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当期変動額									
剰余金の配当							9,675,175	9,675,175	9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	221,989	221,989	221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	1,124,917	1,124,917	1,124,917
当期変動額合計	1,124,917	1,124,917	1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

[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. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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
投資不動産	3年～47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. 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。

4. 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。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

5. 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。

(3) 「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

(損益計算書関係)

1.固定資産除却損の内訳

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
建物	2,547千円	—
器具備品	2,301千円	8,832千円
計	4,848千円	8,832千円

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円

法人税、住民税及び事業税

3,216,517千円

3,030,180千円

（株主資本等変動計算書関係）

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31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30年6月27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	11,363,380千円
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28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

令和元年6月26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	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27日

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

令和元年6月26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	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
効力発生日	令和 元年6月27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

令和2年6月26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	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	—
合計	1,351,912千円	675,956千円

(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。

(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。

(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。

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34期(平成31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	53,969,686	53,969,686	-
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	-
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	-
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	-
資産計	86,722,080	86,722,080	-
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	-
負債計	3,990,054	3,990,054	-

第35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	-
(2) 有価証券	1,960,318	1,960,318	-
(3) 未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	-
(4) 投資有価証券	16,673,396	16,673,396	-
資産計	85,328,625	85,328,625	-
(1) 未払手数料	4,026,078	4,026,078	-
負債計	4,026,078	4,026,078	-

(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

これらはすべて投資信託であり、時価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

（単位：千円）

区分	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
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34期(平成31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	53,969,686	-	-	-
未収委託者報酬	9,995,458	-	-	-
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	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

第35期(令和2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	56,398,457	-	-	-
未収委託者報酬	10,296,453	-	-	-
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

（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34期(平成31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	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
貸借対照表計	株式	-	-	-

上額が取得原価を超えないもの	債券	-	-	-
	その他	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,774,369	9,937,087	1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

3.売却したその他有価証券

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31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	140,240	58,440	-
債券	-	-	-
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	-	15,060
債券	-	-	-
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）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163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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。

（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す。

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円

勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	15,898	52,430
退職給付の支払額	218,947	162,904
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	4,606	164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	203,077	140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	2,666,937	2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	114,968	203,136
未認識過去勤務費用	484,766	419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	415,234	375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円
利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9 %	64.7 %
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035～0.49%	0.095～0.52%
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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産 小計	2,122,023	2,029,829
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	127,144	114,834
連結納税適用による時価評価	1,320	1,260
その他有価証券評価差額金	497,269	801
その他	108	109
繰延税金負債 合計	625,842	117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2年3月31日現在）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2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34期（自平成30年4月1日至平成31年3月31日）及び第35期（自平成31年4月1日至令和2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34期（自平成30年4月1日至平成31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 (注4)	科目	期末残高 (注4)
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	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 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 100.0%	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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,298,064 千円 695,834 千円	未払手数料 未払費用	671,568 千円 365,510 千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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 (注4)	科目	期末残高 (注4)
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	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,030,180 千円	その他未払金	3,029,426 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 100.0%	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 投資の助言 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2) 投資助言料 (注3)	5,234,629 千円 583,270 千円	未払手数料 未払費用	712,210 千円 302,681 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 1. 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。

2. 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。

3. 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。

4. 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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31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 (注4)	科目	期末残高 (注4)
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	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 (注2) コーラブル預 金の預入 (注3) コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	4,629,670 千円 20,000,000 千円 1,578 千円	未払手数料 現金及び 預金 未収収益	734,633 千円 20,000,000 千円 1,578 千円
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(株)	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 (注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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 (注4)	科目	期末残高 (注4)
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	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（注2）	4,073,855 千円	未払手数料	697,109 千円
						取引銀行	コーラブル預金の払戻（注3）	20,000,000 千円		
							コーラブル預金の預入（注3）	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息（注3）	4,126 千円	未収収益	997 千円
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（注2）	5,714,501 千円	未払手数料	944,351 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. ㈱三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを㈱三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、㈱三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。
- なお、㈱三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行㈱に対して承継させております。
2. 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。
3. 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。
4. 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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
1株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
1株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80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、記載していません。

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34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)	第35期 (自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日)
当期純利益金額（千円）	9,642,064	9,453,186

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）	9,642,064	9,453,186
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

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（2020年3月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

名称	資本金の額 （2020年3月末現在）	事業の内容
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

野村證券株式会社	10,000 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＢＮＰパリバ証券株式会社	102,025 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

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

（２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い等を行います。

３【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（2020年6月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の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【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は提出されておりません。

独立監査人の監査報告書

令和2年6月26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
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 青木 裕晃 印

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄也 印

監査意見

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31年4月1日から令和2年3月31日までの第35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。

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令和2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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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

令和２年７月８日

三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
取締役会 御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員**監査意見**

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MAXIS全世界株式（オール・カントリー）上場投信の令和２年６月８日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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。