

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年2月27日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	外国株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

外国株式インデックス・オープン

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（１）に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）（２）を加えた価額（販売基準価額）とします。

1「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の販売基準価額に、1.08%（税抜 1.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

（ 6 ） 【 申込単位 】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（ 7 ） 【 申込期間 】

平成27年 2月28日から平成27年 8月28日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の

振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目指します。

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般						
大型株	年2回	(日本を 除く)	ファンド・	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株			オブ・ファン ズ			
債券	年4回	日本			その他 (MSCI コク サイ・イン デックス (除く日 本、円ペー ス))	ロング・ ショート型/絶 対収益追求型
一般	年6回	北米				
公債	(隔月)					
社債		欧州				その他 ()
その他債券	年12回	アジア				
クレジット属 性 ()	(毎月)	オセアニア				
不動産投信	日々	中南米				
	その他 ()	アフリカ				
その他資産 (投資信託証券 (株式一 般))		中近東 (中東)				
資産複合 ()		エマージ ング				
資産配分 固定型						
資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分表に記載している「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おります。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

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」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...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う。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、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及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う。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる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う。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) 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号及び第2号に規定する証券投資信託並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う。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資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う。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記す

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 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う。

大型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株... 目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 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う。

公債... 目論見書又は投資信託約款において、日本国又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、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債... 目論見書又は投資信託約款において、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う。

その他債券... 目論見書又は投資信託約款において、公債又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う。

格付等クレジットによる属性... 目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合... 以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型... 目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1) 年1回... 目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回... 目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回... 目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)... 目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5) 年12回(毎月)... 目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6) 日々... 目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、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う。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、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))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「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・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又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う。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

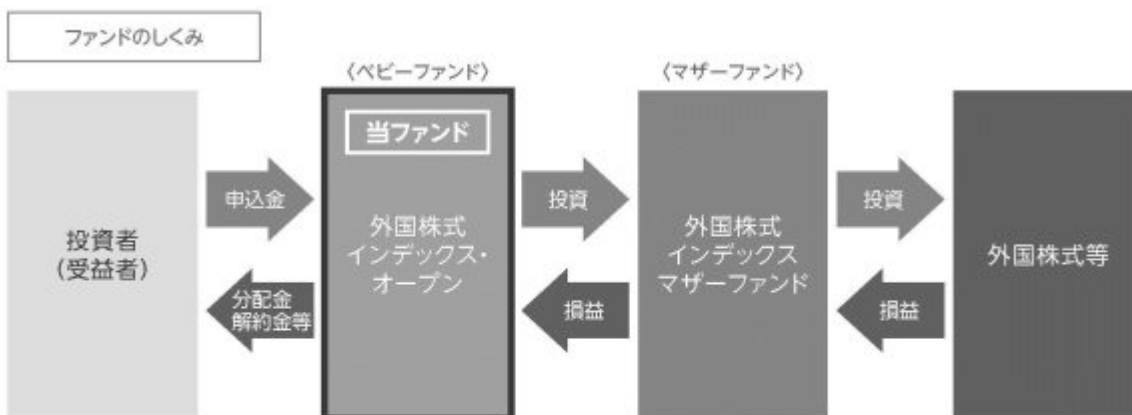
〔特殊型〕

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、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・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、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う。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)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う。

<ファンドの特色>

1. 日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 原則として、為替ヘッジは行いません。



※マザーファンドの運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

? ファミリーファンド方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

<マザーファンドの概要>

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)を構成している国の株式	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指します。

? MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)とは

インデックスの概要 (2014年12月末現在)		地域別構成比	
構成国	22カ国	北米(67.8%)	米国/カナダ
構成銘柄数	1,322銘柄	欧州(26.9%)	英国/スイス/スウェーデン/デンマーク ノルウェー/ドイツ/フランス/オランダ ベルギー/オーストリア/イタリア/ポルトガル スペイン/フィンランド/アイルランド
時価総額	約3,670兆円	アジア・オセアニア(5.0%)	オーストラリア/香港/ニュージーランド シンガポール
		中東(0.2%)	イスラエル

(出所)MSCI社のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※時価総額は当該日の為替データをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメントが円換算しています。

※地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

分配方針

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

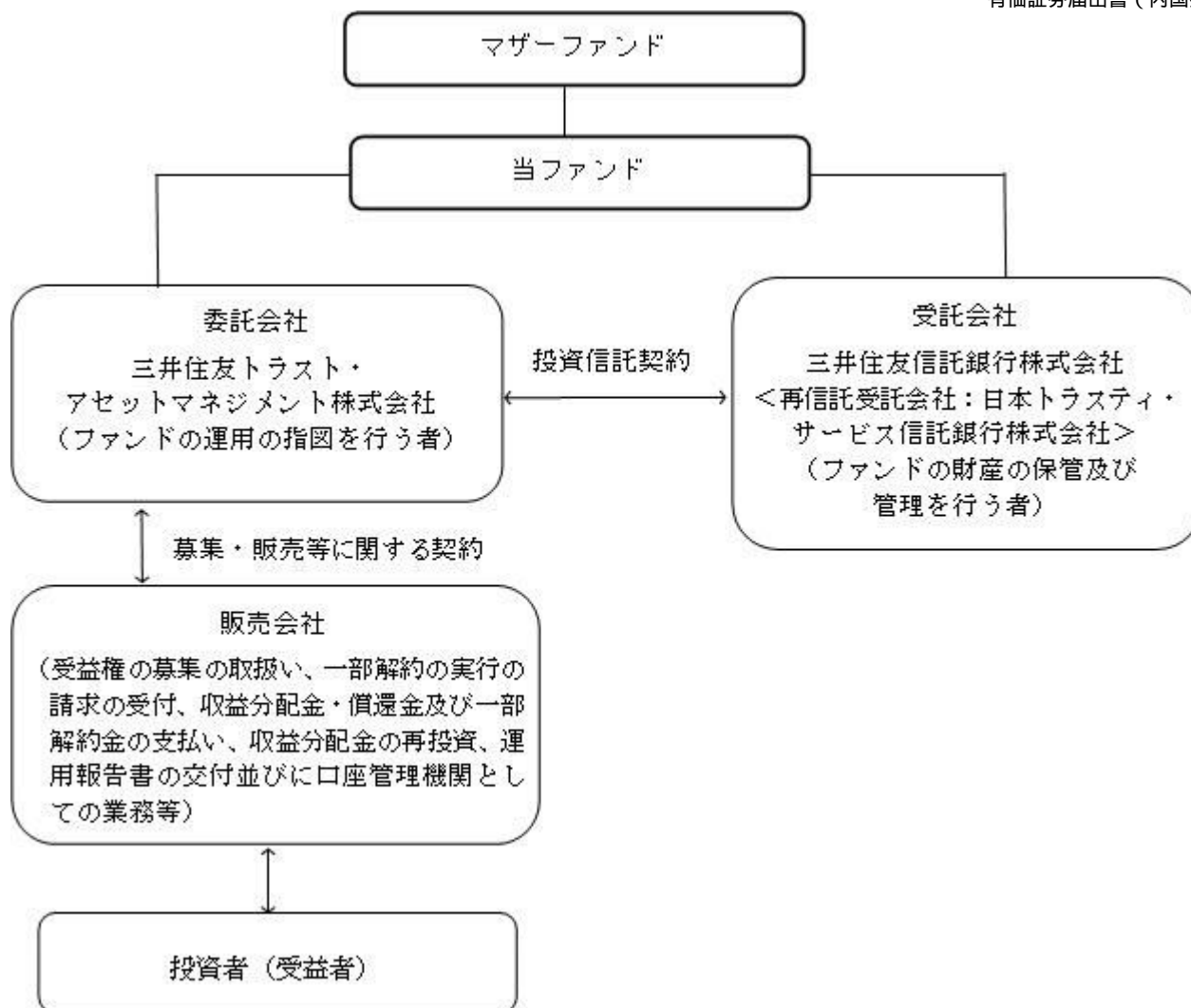
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年5月30日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
平成24年4月 1日	当ファンドの名称を「すみしん 外国株式インデックス・オープン」から「外国株式インデックス・オープン」に変更 当ファンドの主要投資対象である「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成26年12月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

- 昭和61年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 昭和62年2月20日： 投資顧問業の登録
- 昭和62年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 平成2年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 平成11年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 平成11年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 平成19年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 平成24年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資対象

外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- 1)主として、外国株式インデックス マザーファンド受益証券に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- 4)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 5)有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 7)投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 8)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国株式インデックス マザーファンドの受益証券並びに次に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。

- 1.株券又は新株引受権証書
- 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.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又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. コマーシャル・ペーパー
11. 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。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又は外国証券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。）
14. 投資証券又は外国投資証券（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。）
15. 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。）
16. オプションを表示する証券又は証書（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。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 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。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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。）により運用することを指図することができます。

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号に規定す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前号の権利の性質を有するもの

ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. 第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)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」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

原則として、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第

1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

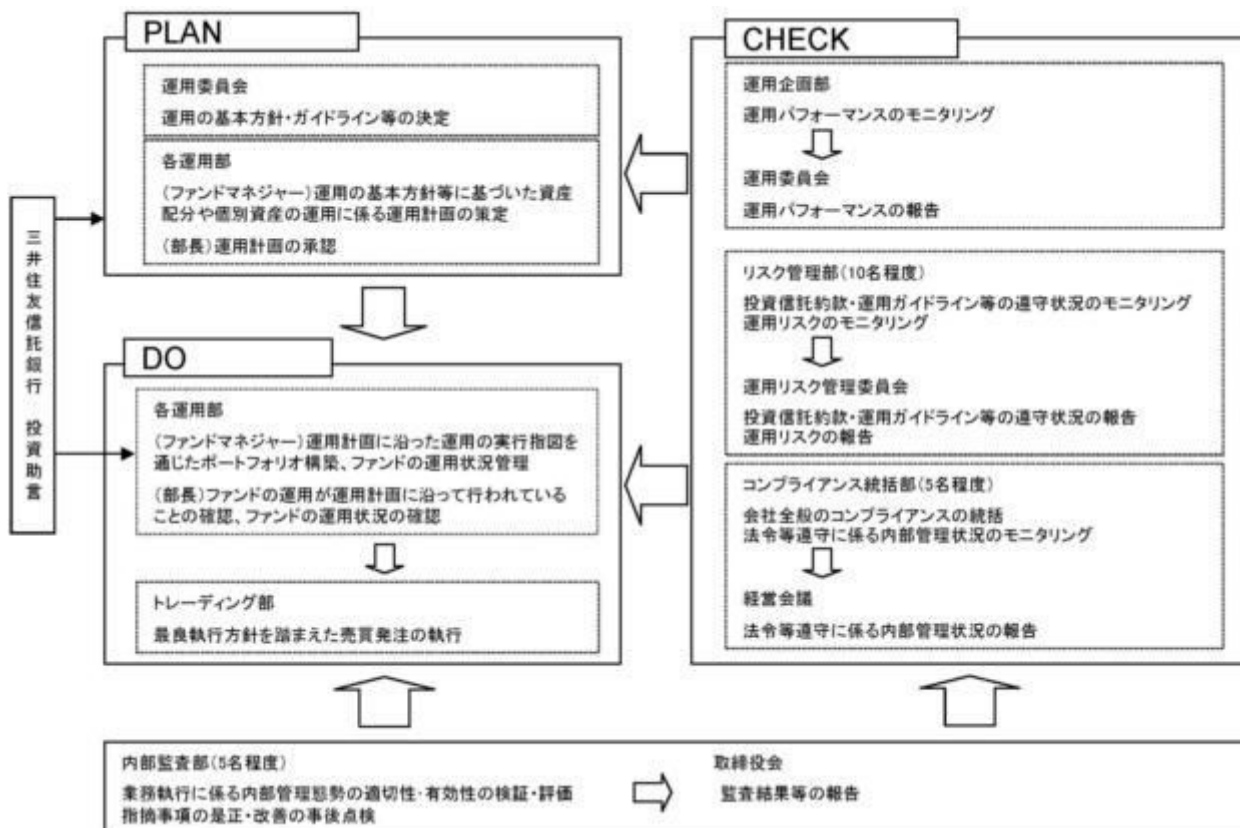
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（繰越分及びマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

・ 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、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て、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又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るものとします。

委託会社は、投資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、株券の引渡し又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。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及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. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及び先物オプション取引を行うことを指図することができます。

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨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。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、原則として当ファンドの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。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。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当ファンドの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可能なものについてはこの限りではありません。為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付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、投資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、投資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。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ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。当該資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。また、借入金の利息は、投資信託財産中より支弁します。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、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、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

委託会社は、運用財産に関し、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あらかじめ委託会社等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。

同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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全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)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は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。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超え

て支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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。

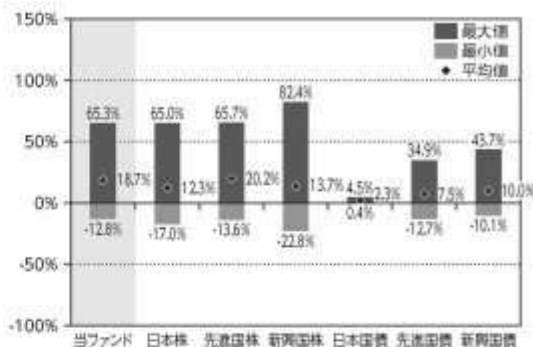
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*2010年1月～2014年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*各資産クラスの指数

日本株… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{*1}
 先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{*2}
 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、円ベース)^{*3}
 日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}
 先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{*5}
 新興国債… JPモルガン・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)^{*6}

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

*1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は運用に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

*2 MSCIロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

*3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

*4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す指数収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

*5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの認定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

*6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）（1）を加えた価額（販売基準価額）に、1.08%（税抜 1.0%）（2）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財

産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。

2：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

「分配金再投資コース」（3）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

3：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.864%（税抜0.8%）を乗じて得た額とします（信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.3888% (税抜 0.36%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.3996% (税抜 0.37%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0756% (税抜 0.07%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。

また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、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

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成26年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金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】

以下は、平成26年12月30日現在の状況について記載してあります。

【外国株式インデックス・オープン】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,993,373,336	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		64,025	0.00
合計(純資産総額)		1,993,437,361	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本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】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	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	966,530,904	1.7059	1,648,805,070	2.0624	1,993,373,336	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

【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】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末 （平成17年 5月30日）	775,806,504	783,831,853	9,070	9,164
第6期計算期間末 （平成18年 5月29日）	916,491,244	932,547,578	10,676	10,863
第7期計算期間末 （平成19年 5月29日）	1,398,185,125	1,425,970,725	14,071	14,350
第8期計算期間末 （平成20年 5月29日）	1,492,120,806	1,504,397,266	11,626	11,722
第9期計算期間末 （平成21年 5月29日）	1,003,204,349	1,018,126,762	6,701	6,801
第10期計算期間末 （平成22年 5月31日）	1,165,423,839	1,189,767,470	7,181	7,331
第11期計算期間末 （平成23年 5月30日）	1,382,676,461	1,408,612,396	7,997	8,147
第12期計算期間末 （平成24年 5月29日）	1,179,478,476	1,196,307,486	7,009	7,109
第13期計算期間末 （平成25年 5月29日）	1,667,566,942	1,697,012,386	11,326	11,526
第14期計算期間末 （平成26年 5月29日）	1,758,035,378	1,791,997,838	12,941	13,191
平成25年12月末日	1,719,174,187		13,034	
平成26年 1月末日	1,676,414,292		12,381	
2月末日	1,763,306,497		12,801	
3月末日	1,779,406,605		12,930	
4月末日	1,798,220,404		13,099	
5月末日	1,792,108,941		12,984	
6月末日	1,794,930,943		13,140	
7月末日	1,809,833,696		13,316	
8月末日	1,795,191,634		13,512	
9月末日	1,846,364,770		13,897	
10月末日	1,870,860,777		13,814	
11月末日	1,990,579,768		15,476	
12月末日	1,993,437,361		15,668	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	平成16年 6月 1日～平成17年 5月30日	100
第6期計算期間	平成17年 5月31日～平成18年 5月29日	200
第7期計算期間	平成18年 5月30日～平成19年 5月29日	300
第8期計算期間	平成19年 5月30日～平成20年 5月29日	100
第9期計算期間	平成20年 5月30日～平成21年 5月29日	100
第10期計算期間	平成21年 5月30日～平成22年 5月31日	150
第11期計算期間	平成22年 6月 1日～平成23年 5月30日	150

第12期計算期間	平成23年 5月31日～平成24年 5月29日	100
第13期計算期間	平成24年 5月30日～平成25年 5月29日	200
第14期計算期間	平成25年 5月30日～平成26年 5月29日	250

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第5期計算期間	平成16年 6月 1日～平成17年 5月30日	9.9
第6期計算期間	平成17年 5月31日～平成18年 5月29日	19.8
第7期計算期間	平成18年 5月30日～平成19年 5月29日	34.4
第8期計算期間	平成19年 5月30日～平成20年 5月29日	16.7
第9期計算期間	平成20年 5月30日～平成21年 5月29日	41.5
第10期計算期間	平成21年 5月30日～平成22年 5月31日	9.4
第11期計算期間	平成22年 6月 1日～平成23年 5月30日	13.5
第12期計算期間	平成23年 5月31日～平成24年 5月29日	11.1
第13期計算期間	平成24年 5月30日～平成25年 5月29日	64.4
第14期計算期間	平成25年 5月30日～平成26年 5月29日	16.5
第15期中間計算期間	平成26年 5月30日～平成26年11月29日	19.6

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5期計算期間	平成16年 6月 1日～平成17年 5月30日	256,044,093	116,122,869	855,332,490
第6期計算期間	平成17年 5月31日～平成18年 5月29日	304,907,982	301,747,553	858,492,919
第7期計算期間	平成18年 5月30日～平成19年 5月29日	322,713,439	187,523,245	993,683,113
第8期計算期間	平成19年 5月30日～平成20年 5月29日	392,159,422	102,448,985	1,283,393,550
第9期計算期間	平成20年 5月30日～平成21年 5月29日	381,440,574	167,780,108	1,497,054,016
第10期計算期間	平成21年 5月30日～平成22年 5月31日	287,821,279	161,966,526	1,622,908,769
第11期計算期間	平成22年 6月 1日～平成23年 5月30日	272,270,796	166,117,168	1,729,062,397
第12期計算期間	平成23年 5月31日～平成24年 5月29日	176,510,360	222,671,729	1,682,901,028
第13期計算期間	平成24年 5月30日～平成25年 5月29日	356,957,503	567,586,301	1,472,272,230
第14期計算期間	平成25年 5月30日～平成26年 5月29日	629,763,336	743,537,133	1,358,498,433
第15期中間計算期間	平成26年 5月30日～平成26年11月29日	252,458,852	324,735,529	1,286,221,756

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	131,680,524,410	55.94
	イギリス	18,222,934,500	7.74
	カナダ	9,453,944,331	4.02
	スイス	9,007,081,680	3.83
	ドイツ	8,354,011,963	3.55
	フランス	8,115,167,301	3.45
	オーストラリア	6,103,176,191	2.59
	オランダ	3,297,747,533	1.40
	スペイン	3,180,033,069	1.35
	アイルランド	2,867,070,080	1.22
	スウェーデン	2,768,488,813	1.18
	香港	2,358,354,016	1.00
	イタリア	1,882,283,691	0.80
	シンガポール	1,454,929,153	0.62
	デンマーク	1,391,971,544	0.59
	ベルギー	1,198,580,733	0.51
	ジャージー	1,188,302,755	0.50
	バミューダ	839,543,518	0.36
	フィンランド	822,178,501	0.35
	キュラソー	817,963,171	0.35
	ノルウェー	539,102,118	0.23
	イスラエル	517,069,603	0.22
	ルクセンブルク	350,696,771	0.15
	ケイマン	196,675,490	0.08
	オーストリア	188,984,520	0.08
	ニュージーランド	155,774,376	0.07
	ポルトガル	143,521,025	0.06
	パナマ	132,964,697	0.06
	英ヴァージン諸島	116,035,497	0.05
	リベリア	98,686,729	0.04
	ガンジー	59,015,416	0.03
	マン島	42,031,544	0.02
	モーリシャス	17,186,333	0.01
小計		217,562,031,072	92.43
投資信託受益証券	オーストラリア	117,827,443	0.05
	シンガポール	27,167,750	0.01
	香港	20,242,404	0.01
	小計		165,237,597

投資証券	アメリカ	3,698,222,171	1.57
	オーストラリア	521,375,090	0.22
	イギリス	306,210,429	0.13
	フランス	293,127,040	0.12
	香港	103,632,375	0.04
	シンガポール	98,988,444	0.04
	カナダ	46,383,649	0.02
	オランダ	29,775,788	0.01
	小計	5,097,714,986	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,562,887,809	5.34
合計(純資産総額)		235,387,871,464	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,857,599,687	3.34
	買建	カナダ	655,667,010	0.28
	買建	ドイツ	2,257,107,838	0.96
	買建	イギリス	1,637,520,591	0.70
	買建	オーストラリア	616,458,213	0.26

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		787,124,080	0.33

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

(注2)投資比率とは、マザー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

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	359,702	10,933.88	3,932,940,303	13,731.85	4,939,374,089	2.10
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	255,748	12,103.22	3,095,374,309	11,219.58	2,869,387,320	1.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	470,161	4,908.79	2,307,924,436	5,720.09	2,689,366,761	1.14
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	169,108	12,150.23	2,054,701,856	12,697.53	2,147,254,157	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	297,365	6,095.00	1,812,442,054	6,715.84	1,997,055,910	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	601,573	3,195.78	1,922,495,262	3,098.13	1,863,754,366	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	162,325	9,724.76	1,578,573,046	11,167.75	1,812,805,343	0.77
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	193,209	8,501.64	1,642,593,363	8,921.85	1,723,781,717	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	225,503	6,736.33	1,519,063,526	7,589.82	1,711,528,983	0.73
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,800	9,901.12	1,364,374,612	11,321.31	1,560,076,518	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	113,841	14,737.23	1,677,701,855	13,660.72	1,555,150,709	0.66
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	380,110	3,567.07	1,355,880,688	3,784.06	1,438,360,757	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	248,485	5,992.54	1,489,056,426	5,732.15	1,424,353,914	0.61
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	42,085	32,473.09	1,366,630,329	32,886.00	1,384,007,310	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	630,300	1,845.62	1,163,294,601	2,183.16	1,376,046,063	0.58
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,168,491	1,176.41	1,374,634,663	1,159.39	1,354,747,260	0.58
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	297,238	3,346.46	994,697,456	4,482.04	1,332,235,281	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	310,850	4,248.18	1,320,547,374	4,111.96	1,278,202,921	0.54
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	69,298	15,537.12	1,076,691,759	18,329.62	1,270,206,526	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	236,591	4,910.00	1,161,662,165	5,166.77	1,222,411,991	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	172,925	6,809.86	1,177,596,683	6,959.35	1,203,445,858	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	181,707	5,775.55	1,049,457,954	6,597.70	1,198,848,546	0.51
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	213,913	4,971.48	1,063,464,629	5,498.28	1,176,154,746	0.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	118,477	7,905.66	936,639,946	9,646.41	1,142,877,836	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	97,740	10,145.48	991,619,998	11,512.52	1,125,234,194	0.48

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	17,255	67,610.46	1,166,618,616	63,931.28	1,103,134,262	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	17,006	68,689.39	1,168,131,767	64,772.72	1,101,524,885	0.47
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	56,900	21,971.44	1,250,175,106	19,349.48	1,100,985,440	0.47
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	90,617	10,264.83	930,168,327	11,729.51	1,062,893,461	0.45
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	307,429	2,984.81	917,619,613	3,430.85	1,054,743,707	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.12
		素材	4.74
		資本財	6.79
		商業・専門サービス	0.82
		運輸	2.02
		自動車・自動車部品	1.60
		耐久消費財・アパレル	1.59
		消費者サービス	1.57
		メディア	2.95
		小売	3.14
		食品・生活必需品小売り	2.10
		食品・飲料・タバコ	5.80
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	3.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.30
		銀行	9.08
		各種金融	3.90
		保険	4.08
		不動産	0.66
		ソフトウェア・サービス	6.79
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.35		
電気通信サービス	3.00		
公益事業	3.31		
半導体・半導体製造装置	1.76		
	小計	92.43	

投資信託受益証券		0.07
投資証券		2.17
合計		94.66

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

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

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 FUTU	買建	125	アメリカドル	62,069,137.5	7,482,434,525	65,181,250	7,857,599,687	3.34
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	37	カナダドル	6,011,894.5	623,012,627	6,327,000	655,667,010	0.28
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	71	スイスフラン	6,215,647	757,065,805	6,349,530	773,372,754	0.33
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	318	ユーロ	9,779,771	1,433,127,642	10,125,120	1,483,735,084	0.63
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	46	オーストラリアドル	5,921,722	580,743,277	6,285,900	616,458,213	0.26
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	133	イギリスポンド	8,433,393.75	1,577,297,632	8,755,390	1,637,520,591	0.70

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場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、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,200,000.00	506,250,000	506,268,000	0.21
	カナダドル	買建	300,000.00	31,086,600	31,080,000	0.01
	ユーロ	買建	700,000.00	102,662,200	102,571,000	0.04
	イギリスポンド	買建	330,000.00	61,761,540	61,710,000	0.02
	スイスフラン	買建	302,000.00	36,841,122	36,783,600	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	750,000.00	11,558,250	11,557,500	0.00
	オーストラリアドル	買建	284,000.00	27,824,664	27,835,980	0.01
	香港ドル	買建	600,000.00	9,327,600	9,318,000	0.00

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。発表されていない場合は、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。

(注2)投資比率とは、マザー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。

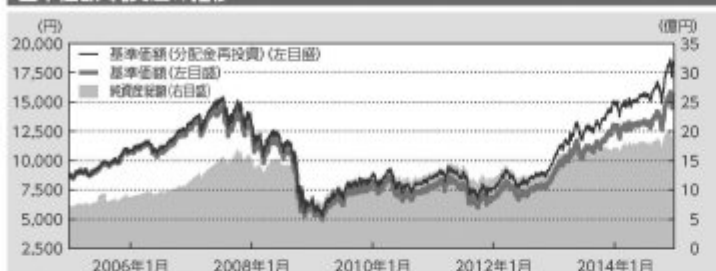
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2000年5月30日
作成基準日：2014年12月30日

基準価額・純資産の推移



基準価額	15,668円
純資産総額	19.93億円

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:1,650円

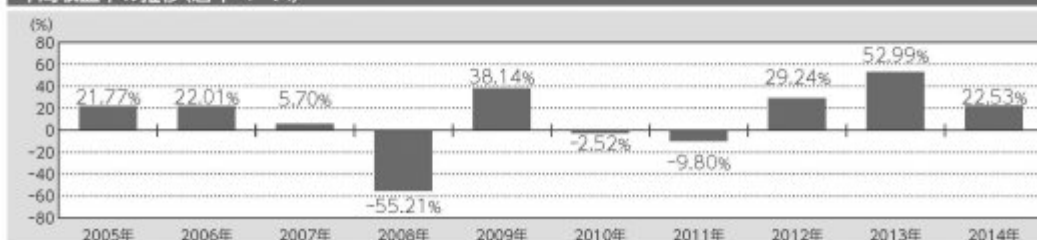
決算期	2010年5月	2011年5月	2012年5月	2013年5月	2014年5月
分配金	150円	150円	100円	200円	250円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.1%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.1%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.9%
WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	銀行	0.8%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	0.8%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	0.8%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.7%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	0.7%
NOVARTIS	スイス	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.7%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

< 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

販売基準価額 = 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + 追加設定時信託財産留保額
= 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + （取得申込受付日の翌営業日の基準価額
× 0.1%）

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の販売基準価額とします。

< 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）で

ご覧いただけます。

<一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

<受付不可日>

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとしします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

<一部解約受付の中止等>

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

<問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外貨建資産の円換算については、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って計算し、為替予約の評価は、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って計算します。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。（平成12年 5月30日設定）

ただし、下記「(5)その他 < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・ 受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資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、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のう

え、この投資信託約款を変更することができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及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、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >に従い、新受託会社を選任します。

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。

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資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。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した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、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、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、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則とし

て取得申込者とします。)に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

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)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(平成25年 5月30日から平成26年 5月29日まで)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【財務諸表】

【外国株式インデックス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第13期 (平成25年 5月29日現在)	第14期 (平成26年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,501,468	8,565,164
親投資信託受益証券	1,667,022,005	1,791,935,761
未収入金	26,384,704	85,226
未収利息	22	11
流動資産合計	1,709,908,199	1,800,586,162
資産合計	1,709,908,199	1,800,586,162
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	29,445,444	33,962,460
未払解約金	6,483,818	1,217,962
未払受託者報酬	554,730	637,164
未払委託者報酬	5,785,016	6,644,674
その他未払費用	72,249	88,524
流動負債合計	42,341,257	42,550,784
負債合計	42,341,257	42,550,784
純資産の部		
元本等		
元本	1,472,272,230	1,358,498,433
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	195,294,712	399,536,945
(分配準備積立金)	305,111,408	348,271,630
元本等合計	1,667,566,942	1,758,035,378
純資産合計	1,667,566,942	1,758,035,378
負債純資産合計	1,709,908,199	1,800,586,162

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成24年 5月30日 至 平成25年 5月29日	自	平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日
営業収益				
受取利息		2,349		3,410
有価証券売買等損益		721,326,500		273,225,751
営業収益合計		721,328,849		273,229,161
営業費用				
受託者報酬		1,013,209		1,241,005
委託者報酬		10,566,264		12,941,825
その他費用		72,249		88,524
営業費用合計		11,651,722		14,271,354
営業利益又は営業損失（ ）		709,677,127		258,957,807
経常利益又は経常損失（ ）		709,677,127		258,957,807
当期純利益又は当期純損失（ ）		709,677,127		258,957,807
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（ ）		125,469,269		55,795,115
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		503,422,552		195,294,712
剰余金増加額又は欠損金減少額		158,986,174		139,679,713
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		158,986,174		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		139,679,713
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,031,324		104,637,712
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		104,637,712
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,031,324		-
分配金		29,445,444		33,962,460
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		195,294,712		399,536,945

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (平成25年 5月29日現在)	第14期 (平成26年 5月29日現在)
1. 期首元本額	1,682,901,028円	1,472,272,230円
期中追加設定元本額	356,957,503円	629,763,336円
期中一部解約元本額	567,586,301円	743,537,133円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	1,472,272,230口	1,358,498,433口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1326円 (11,326円)	1.2941円 (12,941円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第13期 自 平成24年 5月30日 至 平成25年 5月29日	第14期 自 平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日
費用控除後の配当等収益額	A	31,844,861円 (32,477,815円)	36,428,602円 (38,984,306円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の 有価証券売買等損益額	B	145,708,171円	166,734,090円
収益調整金額	C	544,150,156円	606,402,426円
分配準備積立金額	D	157,003,820円	179,071,398円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	878,707,008円	988,636,516円
当ファンドの期末残存口数	F	1,472,272,230口	1,358,498,433口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,968.37円	7,277.42円
1万口当たり分配金額	H	200円	250円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	29,445,444円	33,962,460円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
-----------------	---

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 (平成25年 5月29日現在)	第14期 (平成26年 5月29日現在)
	計算期間(自 平成24年5月30日 至 平成25年 5月29日)の損益に含 まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日)の損益に含 まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	626,200,376	244,507,790
合計	626,200,376	244,507,790

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,056,815,146	1,791,935,761	
親投資信託受益証券 小計		1,056,815,146	1,791,935,761	
合計		1,056,815,146	1,791,935,761	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

(参考)

「外国株式インデックス・オープン」は、「外国株式インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成26年 5月29日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見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

項目	平成26年 5月29日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,197,887,945
コール・ローン	509,347,574
株式	157,882,295,732
投資信託受益証券	120,578,621
投資証券	3,456,472,294
派生商品評価勘定	208,810,212
未収入金	452,865,031
未収配当金	398,695,092
未収利息	664
差入委託証拠金	940,386,800
流動資産合計	170,167,339,965
資産合計	170,167,339,965
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,373,965
未払金	1,946,801,130
未払解約金	182,630,167
流動負債合計	2,130,805,262
負債合計	2,130,805,262
純資産の部	
元本等	
元本	99,099,801,608
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,936,733,095
元本等合計	168,036,534,703
純資産合計	168,036,534,703
負債純資産合計	170,167,339,965

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

<p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 5月29日現在
<p>1. 計算期間の期首元本額 計算期間中の追加設定元本額 計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額</p>	<p>118,211,342,839円 19,123,687,639円 38,235,228,870円 99,099,801,608円</p>
<p>計算日の元本額の内訳 SBI資産設計オープン(資産成長型) SBI資産設計オープン(分配型)</p>	<p>1,168,115,213円 13,455,530円</p>

SMT グローバル株式インデックス・オープン	18,884,410,629円
世界経済インデックスファンド	1,013,297,944円
マイセレクション25	10,784,383円
マイセレクション50	27,195,591円
マイセレクション75	32,382,592円
外国株式インデックス・オープン	1,056,815,146円
DCマイセレクション25	863,357,490円
DCマイセレクション50	4,460,447,623円
DCマイセレクション75	4,662,162,370円
DC外国株式インデックス・オープン	5,688,183,042円
DCマイセレクションS25	323,805,175円
DCマイセレクションS50	1,494,328,548円
DCマイセレクションS75	1,049,097,262円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	4,054,054円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	140,476,330円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	144,827,453円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	69,231,092円
DC世界経済インデックスファンド	922,877,856円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	13,523,667,193円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	79,169,716円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,360,653円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	255,630,546円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	516,743,767円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,815,833,979円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,352,489,862円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,473,086,475円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,851,979,715円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	945,432,630円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,949,359,188円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	7,790,470,552円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,331,306,808円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	943,975,486円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,015,589,479円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	327,785,090円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,690,953,929円
FOfs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,664,245,007円
外国株式ファンド・シリーズ1	802,772,819円
コア投資戦略ファンド(安定型)	974,910,921円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,035,447,290円
分散投資コア戦略ファンドA	65,229,958円
分散投資コア戦略ファンドS	217,689,273円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	462,223円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,520,645円
コア投資戦略ファンド(切替型)	264,957,995円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	112,730,720円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,694,366円

2. 計算日における受益権総数 99,099,801,608口

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6956円 (16,956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

	平成26年 5月29日現在
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第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成26年 5月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	18,072,154,088	
投資信託受益証券	12,824,196	
投資証券	25,783,759	
合計	18,110,762,043	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成26年5月29日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成26年 5月29日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	6,565,688,917	-	6,774,104,253	208,415,336
	合計	6,565,688,917	-	6,774,104,253	208,415,336

(注)1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成26年 5月29日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				

アメリカドル	292,326,305	-	291,993,800	332,505
カナダドル	18,711,500	-	18,710,000	1,500
イギリスポンド	42,695,304	-	42,523,800	171,504
スイスフラン	16,996,950	-	16,996,500	450
デンマーククローネ	80,070,300	-	79,722,000	348,300
ユーロ	56,844,230	-	56,719,400	124,830
計	507,644,589	-	506,665,500	979,089
合計	507,644,589	-	506,665,500	979,089

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のよう
に評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表さ
れていない場合は、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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月29日現在
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)

平成26年 5月29日現在
該当事項はありません。

附属明細表

(平成26年5月29日現在)

有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	26,439	102.00	2,696,778.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,745	62.00	170,190.00	
	APACHE CORP	20,605	91.76	1,890,714.80	
	BAKER HUGHES	23,207	69.99	1,624,257.93	
	CABOT OIL & GAS CORP	21,935	35.96	788,782.60	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,374	63.38	720,884.12	
	CHENIERE ENERGY INC	11,868	58.33	692,260.44	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	27,697	28.41	786,871.77	
	CHEVRON CORP	100,148	122.52	12,270,132.96	
	CIMAREX ENERGY CO	4,370	129.69	566,745.30	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,569	18.09	263,553.21	
	CONCHO RESOURCES INC	5,666	129.98	736,466.68	
	CONOCOPHILLIPS	64,364	79.57	5,121,443.48	
	CONSOL ENERGY INC	11,490	45.27	520,152.30	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,577	139.02	358,254.54	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,348	158.41	371,946.68	
DENBURY RESOURCES INC	18,996	16.78	318,752.88		

DEVON ENERGY CORPORATION	20,190	73.44	1,482,753.60
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,474	50.15	174,221.10
ENERGEN CORP	3,649	84.51	308,376.99
ENSCO PLC-CL A	12,142	51.42	624,341.64
EOG RESOURCES INC	28,287	105.19	2,975,509.53
EQT CORPORATION	7,819	104.33	815,756.27
EXXON MOBIL	226,856	101.06	22,926,067.36
FMC TECHNOLOGIES INC	12,792	57.30	732,981.60
HALLIBURTON CO	44,663	63.44	2,833,420.72
HELMERICH & PAYNE	5,415	108.84	589,368.60
HESS CORP	15,366	89.97	1,382,479.02
HOLLYFRONTIER CORP	9,792	48.91	478,926.72
KINDER MORGAN INC	35,252	33.59	1,184,114.68
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,360	72.39	388,010.40
MARATHON OIL CORP	37,186	36.55	1,359,148.30
MARATHON PETROLEUM CORP	15,480	87.37	1,352,487.60
MURPHY OIL CORP	8,962	60.59	543,007.58
NABORS INDUSTRIES LTD	13,930	26.12	363,851.60
NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,453	81.87	1,838,227.11
NOBLE CORP PLC	12,624	30.49	384,905.76
NOBLE ENERGY INC	18,804	70.77	1,330,759.08
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	41,846	99.05	4,144,846.30
OCEANEERING INTL INC	5,388	71.93	387,558.84
ONEOK INC	10,691	64.85	693,311.35
PEABODY ENERGY CORP	14,207	16.76	238,109.32
PHILLIPS 66	30,845	82.99	2,559,826.55
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,501	202.96	1,522,402.96
QEP RESOURCES INC	9,981	31.50	314,401.50
RANGE RESOURCES CORP	8,831	90.32	797,615.92
SCHLUMBERGER	68,499	101.87	6,977,993.13
SOUTHWESTERN ENERGY CO	19,018	45.29	861,325.22
SPECTRA ENERGY CORP	35,024	40.80	1,428,979.20
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	7,710	33.24	256,280.40
TESORO CORP	7,212	55.42	399,689.04
VALERO ENERGY CORP	28,403	55.69	1,581,763.07
WEATHERFORD INTL LTD	39,815	20.98	835,318.70
WHITING PETROLEUM CORP	5,932	71.52	424,256.64
WILLIAMS COS	35,775	46.71	1,671,050.25
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,901	118.31	1,289,697.31
AIRGAS INC	3,393	105.11	356,638.23
ALBEMARLE CORP	4,304	68.44	294,565.76
ALCOA	57,641	13.37	770,660.17
ASHLAND INC	3,915	102.76	402,305.40
AVERY DENNISON CORP	4,954	48.82	241,854.28
BALL CORP	7,358	60.10	442,215.80
CELANESE CORP-SERIES A	8,241	61.22	504,514.02
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,922	241.87	706,744.14
CROWN HOLDINGS INC	7,486	48.50	363,071.00

DOW CHEMICAL CO	64,074	51.77	3,317,110.98
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	48,890	68.41	3,344,564.90
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,354	86.55	723,038.70
ECOLAB INC	14,258	108.13	1,541,717.54
FMC CORP	7,358	76.49	562,813.42
FREEMONT-MCMOR-B	54,643	33.83	1,848,572.69
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,194	98.64	413,696.16
INT'L PAPER CO	21,652	46.76	1,012,447.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,390	98.99	2,414,366.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,327	123.64	287,710.28
MEADWESTVACO CORP	8,828	40.14	354,355.92
MONSANTO CO	27,360	120.28	3,290,860.80
MOSAIC CO/THE	17,024	49.33	839,793.92
NEWMONT MINING CORP	27,014	22.48	607,274.72
NUCOR CORP	16,622	51.27	852,209.94
OWENS-ILLINOIS INC	8,238	32.91	271,112.58
PPG INDUSTRIES INC	7,507	200.25	1,503,276.75
PRAXAIR INC	15,527	130.17	2,021,149.59
ROCK-TENN COMPANY -CL A	3,687	100.00	368,700.00
SEALED AIR CORP	9,873	32.95	325,315.35
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,412	201.71	889,944.52
SIGMA-ALDRICH	6,492	98.12	636,995.04
VULCAN MATERIALS CO	6,674	61.41	409,850.34
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,454	79.14	194,209.56
3 M COMPANY	33,222	141.43	4,698,587.46
AGCO CORP	4,746	54.24	257,423.04
AMETEK INC	13,197	52.84	697,329.48
B/E AEROSPACE INC	5,493	94.37	518,374.41
BOEING CO	37,084	134.33	4,981,493.72
CATERPILLAR	33,481	102.91	3,445,529.71
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,158	81.10	418,313.80
CUMMINS INC	9,312	152.23	1,417,565.76
DANAHER CORP	32,997	78.68	2,596,203.96
DEERE&CO	18,434	90.91	1,675,834.94
DOVER CORP	9,268	86.80	804,462.40
EATON CORP	24,885	73.98	1,840,992.30
EMERSON ELECTRIC CO	36,439	66.65	2,428,659.35
FASTENAL CO	14,654	48.50	710,719.00
FLOWSERVE CORP	7,263	74.23	539,132.49
FLUOR CORP	8,820	75.34	664,498.80
GENERAL DYNAMICS CORP	15,440	117.56	1,815,126.40
GENERAL ELECTRIC CO	526,964	26.66	14,048,860.24
GRAINGER (WW) INC	3,249	254.51	826,902.99
HONEYWELL INTL INC	38,678	92.51	3,578,101.78
ILLINOIS TOOL WORKS	21,185	86.52	1,832,926.20
INGERSOLL-RAND PLC	14,843	59.84	888,205.12
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,748	54.62	368,575.76
JOY GLOBAL INC	5,239	57.68	302,185.52

KBR INC	8,182	24.38	199,477.16
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,812	118.97	572,483.64
LOCKHEED MARTIN CORP	14,335	162.10	2,323,703.50
MASCO CORP	19,054	21.27	405,278.58
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,844	120.27	1,304,207.88
PACCAR INC	18,186	63.86	1,161,357.96
PALL CORP	5,994	86.77	520,099.38
PARKER HANNIFIN CORP	7,784	124.39	968,251.76
PENTAIR LTD	10,793	74.61	805,265.73
PRECISION CASTPARTS CORP	7,647	251.00	1,919,397.00
QUANTA SERVICES INC	10,558	34.12	360,238.96
RAYTHEON COMPANY	16,911	96.61	1,633,771.71
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,082	121.14	857,913.48
ROCKWELL COLLIN	6,615	77.61	513,390.15
ROPER INDUSTRIES INC	5,151	141.08	726,703.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,385	43.11	361,477.35
SPX CORP	1,919	105.09	201,667.71
STANLEY BLACK&DECKER	7,456	87.40	651,654.40
TEXTRON	14,466	39.09	565,475.94
TRANSDIGM GROUP INC	2,505	188.03	471,015.15
UNITED RENTALS INC	5,070	100.93	511,715.10
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,305	115.95	5,253,114.75
XYLEM INC	10,093	38.16	385,148.88
ADT CORPORATION	10,721	32.41	347,467.61
CINTAS CORP	5,599	61.89	346,522.11
DUN & BRADSTREET CORP	2,027	103.72	210,240.44
EQUIFAX INC	6,491	70.34	456,576.94
IHS INC-CLASS A	3,569	124.76	445,268.44
IRON MOUNTAIN INC	8,532	30.84	263,126.88
MANPOWER GROUP	4,455	82.81	368,918.55
NIELSEN NV	14,338	47.69	683,779.22
REPUBLIC SERVICES INC	15,596	35.18	548,667.28
ROBERT HALF INTL INC	7,318	45.80	335,164.40
STERICYCLE INC	4,626	112.70	521,350.20
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,488	112.87	393,690.56
TYCO INTERNATIONAL LTD	23,821	43.72	1,041,454.12
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,126	60.54	491,948.04
WASTE MANAGEMENT INC	23,275	44.25	1,029,918.75
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,442	39.80	375,791.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,554	59.71	451,049.34
CSX CORP	53,420	29.59	1,580,697.80
DELTA AIR LINES INC	10,604	40.27	427,023.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	11,078	45.95	509,034.10
FEDEX CORP	15,790	143.47	2,265,391.30
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	24,316	29.17	709,297.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,793	77.59	371,888.87
KANSAS CITY SOUTHERN	5,728	107.77	617,306.56
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,355	100.14	1,637,789.70

SOUTHWEST AIRLINES CO	8,298	26.43	219,316.14
UNION PACIFIC CORP	23,922	196.37	4,697,563.14
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	44.89	242,001.99
UNITED PARCEL SERVICE B	37,142	103.41	3,840,854.22
AUTOLIV INC	4,931	105.22	518,839.82
BORGWARNER INC	12,370	62.63	774,733.10
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,093	69.43	1,117,336.99
FORD MOTOR COMPANY	190,899	16.31	3,113,562.69
GENERAL MOTORS CO	66,816	34.59	2,311,165.44
HARLEY-DAVIDSON	11,611	71.15	826,122.65
JOHNSON CONTROLS INC	34,883	48.56	1,693,918.48
TESLA MOTORS INC	4,393	210.24	923,584.32
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,284	85.31	536,088.04
COACH INC	14,691	40.81	599,539.71
DR HORTON INC	16,578	23.33	386,764.74
FOSSIL GROUP INC	2,424	103.19	250,132.56
GARMIN LTD	5,787	58.19	336,745.53
HASBRO INC	5,948	53.39	317,563.72
LEGGETT & PLATT INC	7,102	33.76	239,763.52
LENNAR CORP-CL A	8,045	40.37	324,776.65
LULULEMON ATHLETICA INC	5,197	44.69	232,253.93
MATTEL INC	17,952	38.47	690,613.44
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	9,899	97.01	960,301.99
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,306	137.90	455,897.40
NEWELL RUBBERMAID	14,823	29.21	432,979.83
NIKE B	36,883	76.27	2,813,066.41
POLARIS INDUSTRIES INC	3,368	130.89	440,837.52
PULTE GROUP INC	17,827	19.76	352,261.52
PVH CORP	4,194	130.95	549,204.30
RALPH LAUREN CORPORATION	3,265	152.60	498,239.00
TOLL BROTHERS INC	8,144	36.38	296,278.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,246	50.15	413,536.90
VF CORP	18,074	62.68	1,132,878.32
WHIRLPOOL CORP	4,283	143.26	613,582.58
BLOCK H & R INC	14,023	29.44	412,837.12
CARNIVAL CORPORATION	19,994	39.52	790,162.88
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,609	538.26	866,060.34
DARDEN RESTAURANTS INC	6,661	50.18	334,248.98
LAS VEGAS SANDS CORP	21,614	75.97	1,642,015.58
MARRIOTT INTL A	12,563	59.44	746,744.72
MCDONALD'S CORP	51,740	101.30	5,241,262.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	20,081	25.71	516,282.51
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,710	54.23	472,343.30
STARBUCKS CORP	39,713	73.27	2,909,771.51
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,144	78.96	800,970.24
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,142	72.88	520,508.96
WYNN RESORTS LTD	4,136	218.00	901,668.68
YUM BRANDS INC	23,434	76.94	1,803,011.96

CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	17.44	184,881.44
CBS CORP-CL B	29,691	60.48	1,795,711.68
CHARTER COMMUNICATION-A	3,898	143.59	559,713.82
COMCAST CORP-CL A	112,402	51.85	5,828,043.70
COMCAST CORP-SPECIAL A	24,133	51.42	1,240,918.86
DIRECTV	25,816	82.29	2,124,398.64
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,963	79.03	629,315.89
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,757	76.79	365,290.03
DISH NETWORK CORPORATION-A	11,313	59.19	669,616.47
INTERPUBLIC GROUP OF COS	21,619	18.93	409,247.67
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,072	45.44	503,111.68
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,201	43.26	1,176,715.26
LIBERTY MEDIA CORP	4,935	127.31	628,274.85
NEWS CORP-CLASS A	20,142	17.11	344,629.62
OMNICOM GROUP	13,167	70.65	930,248.55
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,261	76.59	326,349.99
SIRIUS XM HOLDINGS INC	167,674	3.29	552,485.83
THE WALT DISNEY CO	87,454	83.60	7,311,154.40
TIME WARNER CABLE-A	14,575	140.35	2,045,601.25
TIME WARNER INC	46,932	70.67	3,316,684.44
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	76,839	35.16	2,701,659.24
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	22,853	34.16	780,658.48
VIACOM INC-CLASS B	20,386	85.61	1,745,245.46
ADVANCE AUTO PARTS	3,734	121.11	452,224.74
AMAZON.COM	20,511	310.16	6,361,691.76
AUTONATION INC	4,068	56.47	229,719.96
AUTOZONE INC	1,835	533.34	978,678.90
BED BATH & BEYOND INC	10,934	60.51	661,616.34
BEST BUY COMPANY INC	14,689	26.94	395,721.66
CARMAX INC	12,059	44.88	541,207.92
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,316	42.70	226,993.20
DOLLAR GENERAL CORP	16,820	54.60	918,372.00
DOLLAR TREE INC	11,299	52.78	596,361.22
EXPEDIA INC	5,770	73.13	421,960.10
FAMILY DOLLAR STORES	5,520	58.26	321,595.20
GAMESTOP CORP-CLASS A	5,678	38.21	216,956.38
GAP	13,415	40.96	549,478.40
GENUINE PARTS CO	8,040	86.16	692,726.40
HOME DEPOT	73,990	79.68	5,895,523.20
KOHL'S CORP	10,841	53.96	584,980.36
L BRANDS INC	12,820	56.36	722,535.20
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	24,379	29.02	707,478.58
LKQ CORP	15,504	28.29	438,608.16
LOWES COMPANIES	54,113	46.71	2,527,618.23
MACY'S INC	18,914	58.60	1,108,360.40
NETFLIX INC	2,984	401.24	1,197,300.16

NORDSTROM INC	7,529	67.45	507,831.05
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,473	146.69	802,834.37
PETSMART INC	5,053	55.57	280,795.21
PRICELINE GROUP INC/THE	2,739	1,270.02	3,478,584.78
ROSS STORES INC	11,050	67.48	745,654.00
STAPLES INC	34,140	11.34	387,147.60
TARGET (DAYTON HUDSON)	31,504	55.34	1,743,431.36
TIFFANY & CO	6,895	97.78	674,193.10
TJX COMPANIES INC	37,618	54.30	2,042,657.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,518	63.74	479,197.32
TRIPADVISOR INC	6,310	95.19	600,648.90
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,108	85.40	265,423.20
URBAN OUTFITTERS INC	6,170	33.05	203,918.50
COSTCO WHOLESALE CORP	23,081	114.24	2,636,773.44
CVS CAREMARK CORPORATION	61,826	77.25	4,776,058.50
KROGER CO	25,368	46.69	1,184,431.92
SAFEWAY INC	12,078	34.23	413,429.94
SYSCO CORP	29,817	36.67	1,093,389.39
WALGREEN CO	47,066	69.81	3,285,677.46
WAL-MART STORES	84,659	75.53	6,394,294.27
WHOLE FOODS MKT INC	19,517	37.85	738,718.45
ALTRIA GROUP INC	103,825	40.77	4,232,945.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,553	44.29	1,530,352.37
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,200	91.30	566,060.00
BUNGE LIMITED	7,957	76.54	609,028.78
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,449	44.61	466,129.89
COCA-COLA CO	208,164	40.58	8,447,295.12
COCA-COLA ENTERPRISES	13,141	45.85	602,514.85
CONAGRA	22,867	31.58	722,139.86
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,907	83.15	740,617.05
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	10,510	56.84	597,388.40
GENERAL MILLS INC	32,780	54.24	1,777,987.20
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,039	96.75	777,773.25
HORMEL FOODS CORP	8,128	47.71	387,786.88
JM SMUCKER CO	5,676	100.62	571,119.12
KELLOGG CO	14,137	68.02	961,598.74
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	6,597	114.36	754,432.92
KRAFT FOODS GROUP INC	31,257	58.33	1,823,220.81
LORILLARD INC	18,868	58.85	1,110,381.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,992	71.28	427,109.76
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,557	87.13	919,831.41
MOLSON COORS BREWING CO -B	7,769	64.30	499,546.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	89,175	37.40	3,335,145.00
MONSTER BEVERAGE CORP	7,320	68.47	501,200.40
PEPSICO INC	79,765	87.07	6,945,138.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	83,342	87.35	7,279,923.70
REYNOLDS AMERICAN INC	16,567	58.40	967,512.80
TYSON FOODS INC	14,542	40.75	592,586.50

AVON PRODUCTS INC	24,395	14.10	343,969.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,973	68.18	475,419.14
CLOROX COMPANY	7,049	88.47	623,625.03
COLGATE-PALMOLIVE CO	47,974	66.12	3,172,040.88
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,469	114.18	396,090.42
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,444	75.65	941,388.60
HERBALIFE LTD	4,464	65.01	290,204.64
KIMBERLY-CLARK CORP	20,137	110.54	2,225,943.98
PROCTER & GAMBLE CO	142,341	80.10	11,401,514.10
ABBOTT LABORATORIES	80,151	39.67	3,179,590.17
AETNA INC	19,495	76.70	1,495,266.50
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,037	72.68	874,849.16
BARD C R INC	4,050	147.01	595,390.50
BAXTER INTERNATIONAL	28,517	74.30	2,118,813.10
BECTON DICKINSON & CO	10,156	116.94	1,187,642.64
BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,956	13.15	919,921.40
CARDINAL HEALTH	17,759	69.45	1,233,362.55
CAREFUSION CORP	11,482	42.50	487,985.00
CERNER CORP	16,116	54.53	878,805.48
CIGNA CORP	14,189	89.47	1,269,489.83
COVIDIEN PLC	23,332	72.75	1,697,403.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	8,948	69.20	619,201.60
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,997	47.24	377,778.28
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,625	80.36	452,025.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	40,735	71.09	2,895,851.15
HCA HOLDINGS INC	16,922	53.37	903,127.14
HENRY SCHEIN INC	4,467	118.16	527,820.72
HOLOGIC INC	11,506	23.97	275,798.82
HUMANA INC	8,157	124.32	1,014,078.24
INTUITIVE SURGICAL INC	2,067	364.68	753,793.56
LABORATORY CRP OF AMER	4,843	100.62	487,302.66
MCKESSON CORP	11,871	182.72	2,169,069.12
MEDTRONIC	52,535	60.16	3,160,505.60
OMNICARE INC	5,836	63.33	369,593.88
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	38.99	180,601.68
QUEST DIAGNOSTICS	7,276	58.07	422,517.32
RESMED INC	7,971	49.61	395,441.31
ST JUDE MEDICAL INC	14,893	65.76	979,363.68
STRYKER CORP	17,849	82.64	1,475,041.36
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,279	78.58	4,108,083.82
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,000	89.35	446,750.00
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,539	82.36	456,192.04
WELLPOINT INC	14,825	107.88	1,599,321.00
ZIMMER HOLDINGS INC	8,831	102.91	908,798.21
ABBVIE INC	82,997	54.07	4,487,647.79
ACTAVIS PLC	8,981	210.33	1,888,973.73
AGILENT TECHNOLOGIES	16,915	57.11	966,015.65
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,383	167.65	1,740,709.95

ALLERGAN INC	15,667	156.12	2,445,932.04
AMGEN	39,633	115.67	4,584,349.11
BIOGEN IDEC INC	12,409	308.81	3,832,023.29
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,235	57.34	414,854.90
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,627	48.63	4,212,671.01
CELGENE CORP	21,358	154.30	3,295,539.40
ENDO INTERNATIONAL PLC	7,445	73.56	547,654.20
FOREST LABORATORIES INC	12,434	94.53	1,175,386.02
GILEAD SCIENCES INC	80,751	81.86	6,610,276.86
HOSPIRA INC	9,252	48.28	446,686.56
ILLUMINA INC	6,801	157.39	1,070,409.39
JOHNSON & JOHNSON	148,510	100.30	14,895,553.00
LILLY (ELI) & CO	52,570	59.70	3,138,429.00
MERCK & CO	154,372	56.40	8,706,580.80
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,700	245.29	416,993.00
MYLAN INC	19,913	48.87	973,148.31
PERRIGO CO PLC	6,847	136.72	936,121.84
PFIZER	335,083	29.61	9,921,807.63
PHARMACYCLICS INC	3,500	88.40	309,400.00
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,064	50.87	155,865.68
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,049	304.86	1,234,378.14
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,565	116.07	2,386,979.55
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,134	71.72	870,250.48
WATERS CORP	4,274	100.15	428,041.10
ZOETIS INC	26,046	30.48	793,882.08
BANK OF AMERICA CORP	555,179	15.14	8,405,410.06
BB&T CORP	36,863	38.13	1,405,586.19
CIT GROUP INC	9,861	44.62	439,997.82
CITIGROUP	159,402	47.32	7,542,902.64
COMERICA INC	9,514	46.85	445,730.90
FIFTH THIRD BANCORP	46,284	20.60	953,450.40
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,616	51.08	337,945.28
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.85	272,716.95
JPMORGAN CHASE & CO	198,797	55.45	11,023,293.65
KEY CORP	47,236	13.56	640,520.16
M & T BANK CORP	6,337	122.11	773,811.07
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	24,669	15.32	377,929.08
OCWEN FINANCIAL CORP	6,111	34.61	211,501.71
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	14.44	264,107.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,943	84.52	2,361,742.36
REGIONS FINL CORP	72,555	10.10	732,805.50
SUNTRUST BANKS	27,486	38.25	1,051,339.50
US BANCORP	94,810	42.03	3,984,864.30
WELLS FARGO & CO	262,421	50.44	13,236,515.24
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,734	186.53	509,973.02
AMERICAN EXPRESS	50,072	91.06	4,559,556.32
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,348	111.18	1,150,490.64
BANK NEW YORK CO	60,461	34.37	2,078,044.57

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,805	127.46	7,495,285.30
BLACKROCK INC	7,062	301.47	2,128,981.14
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,827	78.55	2,342,910.85
CME GROUP INC	16,641	71.93	1,196,987.13
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,348	58.72	1,488,434.56
EATON VANCE CORP	6,650	37.34	248,311.00
FRANKLIN RESOURCES INC	21,610	55.26	1,194,168.60
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,339	161.19	3,600,823.41
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,988	195.80	1,172,450.40
INVESCO LTD	22,728	35.94	816,844.32
LEGG MASON INC	6,202	48.62	301,541.24
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,616	25.76	428,028.16
MCGRAW-HILL FINANCIAL	14,222	81.32	1,156,533.04
MOODY'S CORP	9,861	85.96	847,651.56
MORGAN STANLEY	77,269	30.93	2,389,930.17
NASDAQ OMX GROUP	6,376	37.38	238,334.88
NAVIENT CORP	22,604	15.68	354,430.72
NORTHERN TRUST CORP	11,855	60.78	720,546.90
PRICE T ROWE GROUP INC	13,376	81.23	1,086,532.48
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,405	48.59	311,218.95
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,648	25.29	1,533,787.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,978	33.10	230,971.80
STATE STREET CORP	22,616	64.83	1,466,195.28
TD AMERITRADE HOLDING CORP	14,439	29.88	431,437.32
VOYA FINANCIAL INC	7,335	36.45	267,360.75
ACE LTD	17,862	103.07	1,841,036.34
AFLAC	24,405	60.95	1,487,484.75
ALLEGHANY CORP	856	419.86	359,400.16
ALLSTATE CORP	23,465	58.18	1,365,193.70
AMERICAN INT'L GROUP	72,583	53.48	3,881,738.84
AON PLC	15,294	89.12	1,363,001.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,848	56.92	389,788.16
ASSURANT INC	4,030	67.39	271,581.70
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	45.78	271,978.98
CHUBB CORPORATION	12,889	92.55	1,192,876.95
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,700	48.69	423,603.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,493	159.97	398,805.21
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	33.22	430,963.06
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	26,026	17.30	450,249.80
HARTFORD FINANCIAL SVCS	22,516	34.62	779,503.92
LINCOLN NATIONAL CORP	13,750	47.88	658,350.00
LOEWS CORP	17,876	43.26	773,315.76
MARSH & MCLENNAN COS	28,802	49.90	1,437,219.80
METLIFE INC	49,342	51.01	2,516,935.42
PARTNERRE LTD	2,555	106.56	272,260.80
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,321	46.63	714,418.23
PROGRESSIVE CORP	29,765	25.26	751,863.90
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,342	81.84	1,992,149.28

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,183	103.33	225,569.39
TORCHMARK CORP	4,876	80.89	394,419.64
TRAVELERS COS INC/THE	18,770	93.46	1,754,244.20
UNUM GROUP	14,141	33.63	475,561.83
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,583	41.41	355,422.03
WR BERKLEY CORP	5,726	44.25	253,375.50
XL GROUP PLC	14,744	32.34	476,820.96
CBRE GROUP INC-A	14,402	29.66	427,163.32
REALOGY HOLDINGS CORP	7,466	37.73	281,692.18
WEYERHAEUSER CO	29,747	31.11	925,429.17
ACCENTURE PLC-CL A	32,959	79.58	2,622,877.22
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,101	20.33	510,303.33
ADOBE SYSTEMS INC	25,036	64.84	1,623,334.24
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,006	54.35	489,476.10
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,637	253.30	667,952.10
ANSYS INC	5,240	74.05	388,022.00
AUTODESK INC	11,509	51.72	595,245.48
AUTOMATIC DATA PROCESS	25,397	78.87	2,003,061.39
CA INC	16,511	28.90	477,167.90
CITRIX SYSTEMS INC	10,112	60.86	615,416.32
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,636	48.90	1,547,000.40
COMPUTER SCIENCES CORP	7,907	62.06	490,708.42
EBAY	64,630	50.39	3,256,705.70
ELECTRONIC ARTS INC	15,498	34.70	537,780.60
EQUINIX INC	2,777	198.52	551,290.04
FACEBOOK INC-A	98,636	63.51	6,264,372.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,219	53.94	820,912.86
FIREEYE INC	3,393	34.38	116,651.34
FISERV INC	13,143	59.89	787,134.27
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,722	127.66	475,150.52
GOOGLE INC-CL A	14,759	570.45	8,419,271.55
GOOGLE INC-CL C	15,038	561.68	8,446,543.84
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,989	183.08	9,518,146.12
INTUIT INC	13,885	79.08	1,098,025.80
LINKEDIN CORP - A	5,331	160.44	855,305.64
MASTERCARD INC-CLASS A	54,161	76.93	4,166,605.73
MICROSOFT CORP	413,638	40.01	16,549,656.38
NETSUITE INC	1,707	81.32	138,813.24
NUANCE COMMUNICATIONS INC	12,022	16.19	194,636.18
ORACLE CORP	189,918	41.57	7,894,891.26
PAYCHEX INC	17,132	41.07	703,611.24
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	35.47	244,743.00
RED HAT INC	9,757	50.00	487,850.00
SALESFORCE.COM INC	29,577	53.34	1,577,637.18
SERVICENOW INC	6,543	53.81	352,078.83
SYMANTEC CORP	35,448	22.06	781,982.88
SYNOPSYS INC	8,164	39.05	318,804.20

TERADATA CORP	8,368	41.60	348,108.80
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	30.61	285,683.13
TWITTER INC	6,171	33.77	208,394.67
VANTIV INC - CL A	6,378	31.06	198,100.68
VERISIGN INC	6,665	50.01	333,316.65
VISA INC-CLASS A SHARES	26,322	213.80	5,627,643.60
VMWARE INC-CLASS A	4,666	96.03	448,075.98
WESTERN UNION CO	28,486	15.87	452,072.82
WORKDAY INC-CLASS A	4,603	84.04	386,836.12
XEROX CORP	59,126	12.20	721,337.20
YAHOO	50,966	34.78	1,772,597.48
AMPHENOL CORPORATION	8,063	95.31	768,484.53
APPLE INC	46,945	624.01	29,294,149.45
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	57.93	335,994.00
AVNET INC	7,613	43.80	333,449.40
CISCO SYSTEMS	270,708	24.82	6,718,972.56
CORNING	73,143	21.26	1,555,020.18
EMC CORP	106,777	26.56	2,835,997.12
F5 NETWORKS INC	3,880	108.49	420,941.20
FLEXTRONICS INTL LTD	33,519	10.09	338,206.71
FLIR SYSTEMS INC	6,867	34.95	240,001.65
HARRIS CORP	5,322	76.96	409,581.12
HEWLETT-PACKARD CO	99,780	33.35	3,327,663.00
JUNIPER NETWORKS INC	27,303	25.23	688,854.69
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,591	66.93	842,715.63
NETAPP INC	18,444	36.84	679,476.96
QUALCOMM	88,869	80.22	7,129,071.18
SANDISK CORP	12,200	96.03	1,171,566.00
SEAGATE TECHNOLOGY	16,751	53.12	889,813.12
TE CONNECTIVITY LTD	21,655	58.45	1,265,734.75
TRIMBLE NAVIGATION LTD	12,972	35.93	466,083.96
WESTERN DIGITAL CORP	11,791	87.20	1,028,175.20
AT&T INC	277,712	35.34	9,814,342.08
CENTURYLINK INC	30,673	37.80	1,159,439.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	53,046	5.95	315,623.70
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,688	100.45	671,809.60
SPRINT CORP	41,934	9.20	385,792.80
T-MOBILE US INC	12,775	34.40	439,460.00
VERIZON COMMUNICATIONS	220,837	49.74	10,984,432.38
WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	9.69	321,223.50
AES CORP	37,287	13.87	517,170.69
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,173	57.94	357,663.62
AMEREN CORPORATION	13,296	39.18	520,937.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,475	52.94	1,348,646.50
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,509	47.60	452,628.40
CALPINE CORP	17,272	22.82	394,147.04
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	24.01	541,521.54
CMS ENERGY CORP	14,951	29.53	441,503.03

CONSOLIDATED EDISON INC	15,264	54.52	832,193.28	
DOMINION RESOURCES	30,011	68.35	2,051,251.85	
DTE ENERGY COMPANY	9,457	75.36	712,679.52	
DUKE ENERGY CORP	36,567	70.76	2,587,480.92	
EDISON INTL	16,102	54.36	875,304.72	
ENTERGY CORP	9,623	74.62	718,068.26	
EXELON CORP	44,834	35.99	1,613,575.66	
FIRSTENERGY CORP	21,740	33.64	731,333.60	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	3,984	57.23	228,004.32	
MDU RESOURCES GROUP INC	8,823	33.99	299,893.77	
NEXTERA ENERGY INC	22,506	97.36	2,191,184.16	
NISOURCE INC	16,828	37.24	626,674.72	
NORTHEAST UTILITIES	16,346	45.13	737,694.98	
NRG ENERGY INC	16,296	35.16	572,967.36	
OGE ENERGY CORP	11,103	36.56	405,925.68	
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	27.69	398,016.06	
PG&E CORP	23,235	45.30	1,052,545.50	
PINNACLE WEST CAPITAL	6,136	55.06	337,848.16	
PPL CORPORATION	32,999	34.64	1,143,085.36	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,374	38.19	1,007,223.06	
SCANA CORP	6,775	51.59	349,522.25	
SEMPRA ENERGY	11,918	99.71	1,188,343.78	
SOUTHERN CO	46,606	43.45	2,025,030.70	
WISCONSIN ENERGY CORP	12,243	45.32	554,852.76	
XCEL ENERGY INC	26,973	30.50	822,676.50	
ALTERA CORPORATION	17,227	33.25	572,797.75	
ANALOG DEVICES	15,899	52.45	833,902.55	
APPLIED MATERIALS	61,939	20.54	1,272,227.06	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	12,798	70.10	897,139.80	
BROADCOM CORP-CL A	27,893	31.40	875,840.20	
CREE INC	6,609	48.69	321,792.21	
INTEL CORP	261,288	26.88	7,023,421.44	
KLA-TENCOR CORP	8,938	65.42	584,723.96	
LAM RESEARCH CORP	8,750	61.75	540,312.50	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,056	46.04	555,058.24	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	19,411	15.72	305,140.92	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,649	34.23	501,435.27	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,969	47.26	471,134.94	
MICRON TECHNOLOGY	55,739	28.61	1,594,692.79	
NVIDIA CORP	29,853	18.98	566,609.94	
TEXAS INSTRUMENTS	56,758	46.46	2,636,976.68	
XILINX INC	13,820	46.65	644,703.00	
アメリカドル小計	15,942,213		918,348,474.70 (93,441,957,300)	
カナダドル				
ALTAGAS INCOME LTD	6,922	48.60	336,409.20	
ARC RESOURCES LTD	16,744	31.60	529,110.40	
ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	7.36	147,597.44	
BAYTEX ENERGY CORP	6,001	45.30	271,845.30	

CAMECO CORP	21,148	21.31	450,663.88
CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,118	43.94	2,465,824.92
CANADIAN OIL SANDS LTD	26,085	22.77	593,955.45
CENOVUS ENERGY INC	39,203	31.61	1,239,206.83
CRESCENT POINT ENERGY CORP	21,074	44.11	929,574.14
ENBRIDGE	44,589	51.85	2,311,939.65
ENCANA CORP	39,999	24.94	997,575.06
ENERPLUS CORP	10,454	24.24	253,404.96
HUSKY ENERGY INC	18,542	36.46	676,041.32
IMPERIAL OIL	15,870	54.13	859,043.10
INTER PIPELINE LTD	16,069	31.39	504,405.91
KEYERA CORP	3,777	74.21	280,291.17
MEG ENERGY CORP	8,375	37.12	310,880.00
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	14,995	20.60	308,897.00
PEMBINA PIPELINE CORP	17,218	44.00	757,592.00
PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	6.95	218,751.25
PENN WEST PETROLEUM LTD	23,074	9.97	230,047.78
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,778	38.30	259,597.40
SUNCOR ENERGY	77,084	41.86	3,226,736.24
TALISMAN ENERGY INC	55,994	11.13	623,213.22
TOURMALINE OIL CORP	8,740	53.59	468,376.60
TRANSCANADA CORP	36,433	50.68	1,846,424.44
VERMILION ENERGY INC	5,094	73.18	372,778.92
AGNICO EAGLE MINES	10,066	32.31	325,232.46
AGRIUM INC	7,581	97.60	739,905.60
BARRICK GOLD CORP	59,858	17.04	1,019,980.32
ELDORADO GOLD CORP	34,039	6.15	209,339.85
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,311	22.88	693,515.68
FRANCO-NEVADA CORP	7,259	49.73	360,990.07
GOLDCORP INC	41,679	25.16	1,048,643.64
KINROSS GOLD CORP	55,654	4.04	224,842.16
METHANEX CORP	5,075	63.00	319,725.00
NEW GOLD INC	29,614	5.53	163,765.42
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,238	39.34	1,779,662.92
SILVER WHEATON CORP	18,897	22.00	415,734.00
TECK RESOURCES LTD-CL B	29,114	24.58	715,622.12
YAMANA GOLD INC	37,317	7.74	288,833.58
BOMBARDIER B	71,394	3.79	270,583.26
CAE INC	12,079	14.89	179,856.31
FINNING INTERNATIONAL INC	8,970	29.27	262,551.90
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,077	51.98	419,842.46
CANADIAN NATL RAILWAY CO	43,514	65.34	2,843,204.76
CP RAILWAY LIMITED	9,312	181.49	1,690,034.88
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,784	110.71	1,304,606.64
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,652	59.48	336,180.96
TIM HORTONS INC	7,360	59.02	434,387.20
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	20,777	26.99	560,771.23
THOMSON REUTERS CORP	20,240	38.16	772,358.40

CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,119	103.23	425,204.37		
DOLLARAMA INC	3,609	90.39	326,217.51		
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	21,051	29.26	615,952.26		
EMPIRE CO LTD 'A'	2,863	66.05	189,101.15		
LOBLAW COMPANIES LTD	11,523	46.43	535,012.89		
METRO INC	4,535	66.91	303,436.85		
WESTON (GEORGE) LTD	2,658	80.05	212,772.90		
SAPUTO INC	6,225	58.18	362,170.50		
CATAMARAN CORPORATION	11,095	47.00	521,465.00		
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	16,874	138.11	2,330,468.14		
BANK MONTREAL	33,294	76.62	2,550,986.28		
BANK NOVA SCOTIA	64,193	68.82	4,417,762.26		
CANADIAN IMPERIAL BANK	20,625	99.04	2,042,700.00		
NATIONAL BANK OF CANADA	17,624	45.86	808,236.64		
ROYAL BANK OF CANADA	76,045	75.16	5,715,542.20		
TORONTO-DOMINION BANK	96,906	53.88	5,221,295.28		
CI FINANCIAL CORP	8,227	33.65	276,838.55		
IGM FINANCIAL INC	5,864	52.63	308,622.32		
ONEX CORP	4,342	67.70	293,953.40		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,098	513.34	563,647.32		
GREAT-WEST LIFECO INC	15,149	29.66	449,319.34		
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	5,185	41.83	216,888.55		
INTACT FINANCIAL CORP	7,059	72.30	510,365.70		
MANULIFE FINANCIAL CORP	95,028	20.00	1,900,560.00		
POWER CORP OF CANADA	18,862	29.45	555,485.90		
POWER FINANCIAL CORP	13,355	33.23	443,786.65		
SUN LIFE FINANCIAL INC	31,406	37.02	1,162,650.12		
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	28,687	47.65	1,366,935.55		
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	18.64	103,153.76		
CGI GROUP INC - CL A	12,163	37.01	450,152.63		
OPEN TEXT CORP	6,226	50.58	314,911.08		
BCE INC	13,980	49.75	695,505.00		
BELL ALIANT INC	5,225	28.71	150,009.75		
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,886	44.96	894,074.56		
TELUS CORP	16,454	41.22	678,233.88		
ATCO LTD -CLASS I	4,000	51.66	206,640.00		
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	39.20	225,948.80		
FORTIS INC	11,903	32.51	386,966.53		
TRANSALTA CORP	15,621	13.04	203,697.84		
カナダドル小計	2,023,027		77,787,025.86 (7,278,532,009)		
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	22.45	190,578.05	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	56,076	15.20	852,355.20	
	SANTOS	52,200	14.54	758,988.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	35,062	42.11	1,476,460.82	
	WORLEYPARSONS LTD	10,573	16.36	172,974.28	

ALUMINA LIMITED	119,523	1.48	176,894.04
AMCOR	65,010	10.60	689,106.00
BHP BILLITON LTD	169,105	37.99	6,424,298.95
BORAL LIMITED	35,177	5.28	185,734.56
FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,368	4.68	362,082.24
ILUKA RESOURCES LTD	21,335	9.08	193,721.80
INCITEC PIVOT LTD	83,630	2.76	230,818.80
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,623	14.70	332,558.10
NEWCREST MINING LIMITED	40,479	9.82	397,503.78
ORICA LTD	19,603	20.31	398,136.93
RIO TINTO LTD	23,193	61.40	1,424,050.20
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,336	20.32	108,427.52
ALS LTD	21,808	8.60	187,548.80
BRAMBLES LTD	79,421	9.64	765,618.44
SEEK LTD	15,860	17.00	269,620.00
ASCIANO GROUP	51,076	5.70	291,133.20
AURIZON HOLDINGS LTD	116,448	4.94	575,253.12
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.39	107,237.11
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.27	219,795.89
TRANSURBAN GROUP	93,016	7.31	679,946.96
CROWN RESORTS LTD	21,269	16.33	347,322.77
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	50.65	165,270.95
TABCORP HOLDINGS	45,765	3.48	159,262.20
TATTS GROUP LTD	65,227	3.06	199,594.62
REA GROUP LTD	2,513	44.35	111,451.55
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.19	98,290.28
METCASH LTD	55,380	2.89	160,048.20
WESFARMERS LIMITED	59,265	43.26	2,563,803.90
WOOLWORTHS LTD	64,998	37.45	2,434,175.10
COCA-COLA AMATIL LIMITED	28,004	9.57	267,998.28
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	5.14	198,157.28
COCHLEAR LIMITED	2,709	60.07	162,729.63
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,522	47.77	311,555.94
SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	17.64	381,870.72
CSL LIMITED	25,173	70.62	1,777,717.26
AUST AND NZ BANKING GROUP	144,644	33.69	4,873,056.36
BANK OF QUEENSLAND LTD	18,181	12.16	221,080.96
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,308	11.70	225,903.60
COMMONWEALTH BANK OF AUST	85,072	81.94	6,970,799.68
NATIONAL AUSTRALIA BANK	124,103	33.51	4,158,691.53
WESTPAC BANKING	163,711	34.50	5,648,029.50
ASX LTD	10,432	36.36	379,307.52
MACQUARIE GROUP LIMITED	14,778	60.45	893,330.10
AMP LTD	158,697	5.28	837,920.16
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	121,841	5.95	724,953.95
QBE INSURANCE GROUP	62,788	11.32	710,760.16
SUNCORP GROUP LIMITED	65,908	13.40	883,167.20
COMPUTERSHARE LIMITED	22,437	12.78	286,744.86

	TELSTRA CORP	224,105	5.34	1,196,720.70	
	TPG TELECOM LTD	20,000	6.08	121,600.00	
	AGL ENERGY LTD	29,447	15.74	463,495.78	
	SP AUSNET	87,439	1.37	120,228.62	
	オーストラリアドル小計	3,185,258		55,525,882.15 (5,217,767,145)	
イギリスポ ド	AMEC PLC	15,243	11.74	178,952.82	
	BG GROUP	176,864	12.11	2,141,823.04	
	BP PLC	967,994	5.06	4,899,017.63	
	PETROFAC LTD	12,770	12.54	160,135.80	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	204,745	23.42	4,796,151.62	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	128,858	24.42	3,147,356.65	
	TULLOW OIL PLC	47,460	8.41	399,375.90	
	ANGLO AMERICAN PLC	73,284	15.27	1,119,413.10	
	ANTOFAGASTA PLC	19,350	7.97	154,316.25	
	BHP BILLITTON PLC	109,611	19.22	2,106,723.42	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,661	26.07	173,652.27	
	FRESNILLO PLC	9,483	8.21	77,902.84	
	GLENCORE PLC	559,165	3.28	1,834,061.20	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,991	33.44	367,539.04	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,501	44.37	199,709.37	
	REXAM	40,774	5.31	216,713.81	
	RIO TINTO PLC REG	65,746	31.77	2,089,079.15	
	BAE SYSTEMS PLC	169,479	4.19	711,133.88	
	BUNZL PLC	17,199	16.80	288,943.20	
	COBHAM PLC	56,036	3.14	175,953.04	
	IMI PLC	14,701	15.61	229,482.61	
	MEGGITT PLC	40,649	4.82	195,968.82	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	56,502	2.82	159,505.14	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	97,063	10.16	986,160.08	
	SMITHS GROUP PLC	21,067	13.13	276,609.71	
	TRAVIS PERKINS PLC	12,089	17.18	207,689.02	
	WEIR GROUP PLC/THE	11,331	25.84	292,793.04	
	WOLSELEY LTD	13,535	33.36	451,527.60	
	AGGREKO PLC	12,371	17.49	216,368.79	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	26,521	12.21	323,821.41	
	CAPITA GROUP PLC	35,312	11.03	389,491.36	
	EXPERIAN PLC	51,666	10.35	534,743.10	
	G4S PLC	76,673	2.53	193,982.69	
	INTERTEK GROUP PLC	8,601	29.00	249,429.00	
EASYJET PLC	7,667	15.65	119,988.55		
ROYAL MAIL PLC	36,948	5.16	190,651.68		
NEW GKN	87,889	3.94	346,282.66		
BURBERRY GROUP PLC	23,806	15.21	362,089.26		
PERSIMMON PLC	15,599	13.56	211,522.44		
CARNIVAL PLC	9,460	23.93	226,377.80		
COMPASS GROUP PLC	95,010	10.02	952,000.20		
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,993	23.01	321,978.93		

TUI TRAVEL PLC	20,444	4.11	84,208.83
WHITBREAD PLC	9,667	41.67	402,823.89
WILLIAM HILL	44,403	3.46	153,767.58
BRITISH SKY BROADCASTING	53,402	8.85	472,607.70
ITV PLC	200,934	1.84	370,924.16
PEARSON	41,654	11.47	477,771.38
REED ELSEVIER PLC	61,631	9.43	581,488.48
WPP PLC	70,175	12.85	901,748.75
ASOS PLC	3,098	44.80	138,790.40
KINGFISHER PLC	123,985	4.17	517,389.40
MARKS & SPENCER GROUP PLC	87,223	4.43	386,921.22
NEXT PLC	7,921	66.75	528,726.75
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	14,452	7.98	115,326.96
MORRISON SUPERMARKETS	118,741	1.98	236,175.84
SAINSBURY (J) PLC	63,963	3.35	214,595.86
TESCO	425,642	3.01	1,282,459.34
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,442	30.19	556,763.98
BRITISH AMERICAN TOBACCO	98,425	35.37	3,481,292.25
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	13.68	154,064.16
DIAGEO	131,205	18.80	2,467,310.02
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	51,011	26.60	1,356,892.60
SABMILLER PLC	50,682	32.81	1,662,876.42
TATE & LYLE	23,966	6.74	161,650.67
UNILEVER PLC	67,627	26.72	1,806,993.44
RECKITT BENCKISER PLC	34,078	50.50	1,720,939.00
SMITH & NEPHEW PLC	48,397	9.93	480,824.19
ASTRAZENECA	66,256	42.55	2,819,192.80
GLAXOSMITHKLINE	255,229	16.08	4,105,358.46
SHIRE PLC	30,292	34.56	1,046,891.52
BARCLAYS	877,838	2.45	2,153,775.53
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,010,293	6.29	6,356,763.55
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,065,086	0.77	2,388,008.50
ROYAL BANK OF SCOTLAND	131,020	3.43	449,529.62
STANDARD CHARTERED PLC	128,571	13.48	1,733,137.08
3I GROUP PLC	49,028	4.30	211,163.59
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	50,274	4.43	223,166.28
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,576	12.16	128,604.16
ICAP PLC	32,393	4.00	129,669.17
INVESTEC PLC	30,876	5.20	160,555.20
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	9,458	19.55	184,903.90
SCHRODERS PLC	5,924	26.06	154,379.44
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	14.08	162,328.32
AVIVA PIC	156,581	5.27	825,181.87
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	73,421	2.46	181,129.60
FRIENDS LIFE GROUP LTD	74,378	3.14	233,546.92
LEGAL & GENERAL GROUP	314,312	2.29	720,717.41
OLD MUTUAL PLC	259,537	2.03	528,676.86
PRUDENTIAL	135,653	14.06	1,907,281.18

	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	54,813	4.79	262,937.96	
	STANDARD LIFE PLC	125,741	4.02	506,233.26	
	SAGE GROUP PLC	58,315	4.14	241,482.41	
	BT GROUP PLC	410,398	3.98	1,635,025.63	
	INMARSAT PLC	23,362	7.10	165,987.01	
	VODAFONE GROUP PLC	1,389,158	2.09	2,913,758.90	
	CENTRICA PLC	258,458	3.30	854,979.06	
	NATIONAL GRID PLC	192,481	8.92	1,717,892.92	
	SEVERN TRENT PLC	12,322	19.33	238,184.26	
	SSE PLC	50,573	15.43	780,341.39	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	36,246	8.60	311,715.60	
	ARM HOLDINGS PLC	73,437	9.25	679,659.43	
	イギリスポンド小計	14,810,926		90,503,909.98 (15,395,620,126)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	18,824	37.27	701,570.48	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	332.00	158,364.00	
	GIVAUDAN-REG	496	1,465.00	726,640.00	
	HOLCIM LTD	11,538	79.55	917,847.90	
	SIKA AG-BR	110	3,603.00	396,330.00	
	SYNGENTA AG	4,893	347.70	1,701,296.10	
	ABB LTD	115,050	21.39	2,460,919.50	
	GEBERIT AG-REG	2,055	298.40	613,212.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,042	134.90	140,565.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,485	137.10	340,693.50	
	SULZER AG-REG	1,193	135.60	161,770.80	
	ADECCO	8,693	74.65	648,932.45	
	SGS SA	296	2,251.00	666,296.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,767	122.40	338,680.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,157	94.20	2,558,189.40	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,613	527.00	850,051.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,319	98.55	228,537.45	
	ARYZTA AG	4,457	82.15	366,142.55	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,194.00	157,608.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	4,434.00	217,266.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	52,500.00	262,500.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	168,891	69.95	11,813,925.45	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,677	135.90	363,804.30	
	ACTELION LTD-REG	5,535	88.25	488,463.75	
	LONZA GROUP AG-REG	2,757	96.45	265,912.65	
	NOVARTIS	120,620	80.80	9,746,096.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	36,816	265.30	9,767,284.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	79,942	27.04	2,161,631.68	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,321	40.55	499,616.55	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,299	80.20	104,179.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	936	238.20	222,955.20	
	UBS AG-REG	194,556	18.25	3,550,647.00	
	BALOISE HOLDING AG	2,556	107.50	274,770.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,662	215.00	357,330.00	

	SWISS RE LTD	18,733	79.80	1,494,893.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,933	266.70	2,115,731.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,934	73.30	215,062.20	
	SWISSCOM	1,169	533.50	623,661.50	
	スイスフラン小計	866,988		58,679,379.11 (6,648,960,446)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	112,000	102.70	11,502,400.00	
	NWS HOLDINGS LTD	78,000	14.36	1,120,080.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	14.72	839,040.00	
	MTR CORP	71,000	29.20	2,073,200.00	
	LI & FUNG	314,800	11.52	3,626,496.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	72,000	23.65	1,702,800.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	24.35	1,132,275.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	122,000	61.00	7,442,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	43,600	26.90	1,172,840.00	
	SANDS CHINA LTD	124,000	57.05	7,074,200.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.38	1,213,240.00	
	SJM HOLDINGS LTD	95,000	21.75	2,066,250.00	
	WYNN MACAU LTD	82,800	32.30	2,674,440.00	
	BANK EAST ASIA	65,960	32.00	2,110,720.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	200,500	23.20	4,651,600.00	
	HANG SENG BANK	41,400	127.30	5,270,220.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.89	1,137,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	56,600	144.10	8,156,060.00	
	AIA GROUP LTD	624,800	38.35	23,961,080.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	72,000	134.10	9,655,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	120,000	23.90	2,868,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,000	49.90	2,794,400.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	35.85	1,434,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	25.10	966,350.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	270,500	8.74	2,364,170.00	
	SINO LAND CO	139,400	12.04	1,678,376.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	85,000	104.00	8,840,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	36,500	92.40	3,372,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	51,800	24.10	1,248,380.00	
	WHARF HOLDINGS	77,000	53.55	4,123,350.00	
WHEELLOCK & CO LTD	53,000	32.00	1,696,000.00		
PCCW LTD	232,000	4.29	995,280.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	51.85	1,607,350.00		
CLP HOLDINGS	94,500	63.85	6,033,825.00		
HONG KONG & CHINA GAS	291,967	18.88	5,512,336.96		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	75,000	66.50	4,987,500.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	86.50	1,193,700.00		
	香港ドル小計	4,211,927		150,297,678.96 (1,971,905,547)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	74,300	10.66	792,038.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.36	310,350.49	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	45,000	5.39	242,550.00	

	SEMBCORP MARINE LTD	41,000	4.06	166,460.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	76,000	3.79	288,040.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.14	151,620.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	99,000	2.36	233,640.00	
	SINGAPORE AIRLINES	24,533	10.34	253,671.22	
	GENTING SINGAPORE PLC	313,000	1.32	414,725.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.20	390,600.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	44.90	269,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	2.16	187,920.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	284,000	0.57	161,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.24	359,640.00	
	DBS GROUP	91,000	16.86	1,534,260.00	
	OCBC BANK	135,000	9.63	1,300,050.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	67,000	22.05	1,477,350.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	6.90	289,800.00	
	CAPITALAND LTD	130,500	3.18	414,990.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	2.35	185,650.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.48	251,520.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	158,000	2.82	445,560.00	
	KEPPEL LAND LTD	40,000	3.50	140,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	22,300	6.76	150,748.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	425,243	3.83	1,628,680.69	
	STARHUB LTD	38,000	4.17	158,460.00	
	シンガポールドル小計	2,866,239		12,199,603.40 (988,655,859)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	35,168	9.18	322,842.24	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,782	3.92	187,305.44	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	15,000	8.41	126,150.00	
	XERO LTD	3,006	32.55	97,845.30	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.72	294,387.20	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.41	137,971.23	
	ニュージーランドドル小計	234,491		1,166,501.41 (100,832,381)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,307	131.70	1,489,131.90	
	BOLIDEN AB	13,292	95.10	1,264,069.20	
	ALFA LAVAL AB	16,494	174.00	2,869,956.00	
	ASSA ABLOY B	16,934	341.90	5,789,734.60	
	ATLAS COPCO A	34,888	195.20	6,810,137.60	
	ATLAS COPCO B	20,730	182.70	3,787,371.00	
	SANDVIK AB	55,142	96.15	5,301,903.30	
	SKANSKA B	19,200	154.10	2,958,720.00	
	SKF AB-B	21,056	168.60	3,550,041.60	
	VOLVO B	79,072	97.50	7,709,520.00	
	SECURITAS B	15,190	77.35	1,174,946.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	166.80	2,272,983.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,855	51.70	1,026,503.50	
	HENNES & MAURITZ B	49,008	282.50	13,844,760.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,523	227.20	2,390,825.60	

	SCA SV CELLULOSA B	29,937	185.70	5,559,300.90	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	84.20	1,776,872.60	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	174.90	1,892,068.20	
	NORDEA BANK AB	160,134	98.15	15,717,152.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	79,981	89.00	7,118,309.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	26,015	337.00	8,767,055.00	
	SWEDBANK AB-A	47,847	175.40	8,392,363.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	136.50	1,017,334.50	
	INVESTOR AB-B SHS	25,163	259.80	6,537,347.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	12,549	267.50	3,356,857.50	
	ERICSSON (LM) B	159,514	81.95	13,072,172.30	
	HEXAGON AB-B SHS	13,502	208.00	2,808,416.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,309	617.00	2,041,653.00	
	TELE2 AB-B SHS	15,978	78.95	1,261,463.10	
	TELIASONERA AB	123,887	49.30	6,107,629.10	
	スウェーデンクローナ小計	1,133,508		147,666,598.90 (2,262,252,295)	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	8,029	105.50	847,059.50	
	SEADRILL LTD	20,267	223.40	4,527,647.80	
	STATOIL ASA	58,513	184.60	10,801,499.80	
	SUBSEA 7 SA	13,385	119.50	1,599,507.50	
	NORSK HYDRO	69,507	32.70	2,272,878.90	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,529	273.70	2,608,087.30	
	ORKLA	38,985	52.05	2,029,169.25	
	DNB ASA	53,015	112.60	5,969,489.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,106	110.30	1,114,691.80	
	TELENOR ASA	41,786	142.00	5,933,612.00	
	ノルウェークローネ小計	323,122		37,703,642.85 (643,224,147)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S	12,663	267.60	3,388,618.80	
	VESTAS WIND SYSEMS	11,858	292.80	3,472,022.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	155	13,530.00	2,097,150.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	340	14,260.00	4,848,400.00	
	DSV A/S	9,332	182.40	1,702,156.80	
	PANDORA A/S	6,120	404.20	2,473,704.00	
	CARLSBERG AS-B	5,492	569.00	3,124,948.00	
	COLOPLAST-B	5,601	472.00	2,643,672.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	491.50	729,386.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	103,817	231.80	24,064,780.60	
	DANSKE BANK A/S	35,811	153.90	5,511,312.90	
	TRYG A/S	1,289	522.50	673,502.50	
TDC A/S	41,126	53.15	2,185,846.90		
	デンマーククローネ小計	235,088		56,915,500.90 (1,055,213,386)	
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	201	1,447.00	290,847.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,596	30.82	634,768.72	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,067.00	332,787.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	44,466	178.60	7,941,627.60	

	BANK HAPOALIM BM	58,582	20.23	1,185,113.86
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.74	973,066.80
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	46.41	380,562.00
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	137.30	461,053.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.35	708,869.55
	イスラエルシェケル小計	318,017		12,908,695.93 (377,192,095)
ユーロ	ENI	134,405	18.88	2,537,566.40
	FUGRO NV-CVA	3,638	41.88	152,359.44
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.83	269,932.88
	NESTE OIL OYJ	6,385	14.92	95,264.20
	OMV AG	8,150	30.20	246,170.75
	REPSOL SA	46,543	20.47	952,735.21
	SAIPEM	15,941	19.34	308,298.94
	TECHNIP S.A.	5,427	78.53	426,182.31
	TENARIS SA	25,624	16.26	416,646.24
	TOTAL SA	112,577	51.80	5,831,488.60
	VOPAK	3,622	37.65	136,368.30
	AIR LIQUIDE	16,197	106.55	1,725,790.35
	AKZO NOBEL	12,441	55.16	686,245.56
	ARCELORMITTAL	51,938	11.35	589,755.99
	ARKEMA	3,184	74.39	236,857.76
	BASF SE	48,227	84.81	4,090,131.87
	CRH	41,755	20.59	859,735.45
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,114	69.97	147,916.58
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,624	63.90	487,173.60
	IMERYS SA	1,975	63.40	125,215.00
	K+S AG	8,300	25.91	215,053.00
	KONINKLIJKE DSM NV	8,993	52.53	472,402.29
	LAFARGE (FRANCE)	9,630	64.17	617,957.10
	LANXESS	4,818	52.07	250,873.26
	LINDE AG	9,734	153.70	1,496,115.80
	SOLVAY SA	3,155	119.40	376,707.00
	STORA ENSO OYJ R	31,297	7.67	240,204.47
	THYSSEN KRUPP	24,299	22.35	543,082.65
	UMICORE	5,353	35.31	189,041.19
	UPM KYMMENE CORP	27,512	13.12	360,957.44
	VOESTALPINE AG	5,461	34.58	188,868.68
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,407	32.00	301,071.03
	AIRBUS GROUP NV	31,000	53.12	1,646,720.00
	ALSTOM RGPT	11,643	28.99	337,588.78
	ANDRITZ AG	3,496	43.27	151,289.40
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	41.36	183,122.85
	BOUYGUES ORD	9,712	33.66	326,954.48
	BRENTAG AG	2,783	138.20	384,610.60
	CNH INDUSTRIAL NV	50,975	7.99	407,290.25
	FERROVIAL SA	22,078	15.83	349,494.74
	FINMECCANICA SPA	21,154	6.00	126,924.00

GEA GROUP AG	9,866	32.31	318,770.46
HOCHTIEF AG	1,223	67.31	82,320.13
KONE OYJ-B	16,796	30.60	513,957.60
KONINKLIJKE PHILIPS	50,819	23.23	1,180,525.37
LEGRAND SA	14,256	47.20	672,954.48
MAN SE	1,667	91.43	152,413.81
METSO OYJ	6,575	28.43	186,927.25
OCI NV	5,400	28.35	153,117.00
OSRAM LICHT AG	4,722	37.41	176,673.63
PRYSMIAN SPA	10,872	17.13	186,237.36
REXEL SA	14,819	17.52	259,702.97
SAFRAN SA	13,991	49.67	694,932.97
SAINT-GOBAIN	23,607	41.95	990,431.68
SCHNEIDER ELECTRIC	27,546	69.57	1,916,375.22
SIEMENS	41,633	98.02	4,080,866.66
THALES SA	4,601	44.34	204,008.34
VALLOUREC	5,583	38.91	217,262.44
VINCI S.A.	24,959	54.52	1,360,764.68
WARTSILA OYJ	6,994	39.07	273,255.58
ZARDOYA OTIS SA	10,201	13.25	135,163.25
ZODIAC AEROSPACE	8,950	25.64	229,522.75
BUREAU VERITAS SA	11,149	21.85	243,605.65
EDENRED	11,350	23.13	262,525.50
RANDSTAD HOLDING NV	6,762	43.36	293,200.32
SOCIETE BIC SA	1,437	94.56	135,882.72
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	22,413	16.02	359,056.26
ADP	1,728	93.19	161,032.32
ATLANTIA SPA	23,265	19.84	461,577.60
BOLLORE	311	473.00	147,103.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	19.37	235,580.62
DEUTSCHE POST AG-REG	50,802	27.12	1,377,750.24
FRAPORT AG	2,319	55.78	129,353.82
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	25,823	9.83	254,020.85
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	4.84	275,530.30
TNT EXPRESS	22,191	6.42	142,599.36
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,094	91.36	1,561,707.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,666	70.95	189,152.70
CONTINENTAL AG	5,738	175.00	1,004,150.00
DAIMLER AG	50,556	69.29	3,503,025.24
FIAT ORD	47,091	7.75	365,190.70
MICHELIN	9,752	89.51	872,901.52
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	31.00	191,518.00
PEUGEOT SA	20,500	10.30	211,252.50
PIRELLI & CO	11,059	12.20	134,919.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,935	78.29	621,231.15
RENAULT SA	9,986	69.41	693,128.26
VALEO SA	3,978	97.78	388,968.84
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,459	194.70	1,452,267.30

VOLKSWAGEN STAMM	1,589	193.40	307,312.60
ADIDAS AG	10,925	78.63	859,032.75
CHRISTIAN DIOR	2,802	150.30	421,140.60
HUGO BOSS AG	1,699	103.15	175,251.85
KERING	4,084	159.90	653,031.60
LUXOTTICA GROUP SPA	9,028	41.47	374,391.16
LVMH	14,744	144.20	2,126,084.80
ACCOR	9,315	38.11	354,994.65
SODEXO	5,007	79.83	399,708.81
ALTICE SA	3,137	51.10	160,300.70
AXEL SPRINGER SE	2,489	47.11	117,256.79
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,169	25.29	181,339.85
JC DECAUX SA	3,121	29.00	90,524.60
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	104.00	137,592.00
LAGADERE S.C.A	5,564	26.43	147,056.52
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	11,754	33.45	393,171.30
PUBLICIS GROUPE	9,336	63.43	592,182.48
REED ELSEVIER NV	37,555	16.18	607,639.90
RTL GROUP	2,054	84.10	172,741.40
SES	15,539	26.35	409,530.34
SKY DEUTSCHLAND AG	23,240	6.89	160,239.80
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	43.35	139,587.00
WOLTERS KLUWER	15,329	21.76	333,559.04
INDITEX	11,740	106.65	1,252,071.00
CARREFOUR	32,139	26.92	865,342.57
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,860	93.54	267,524.40
COLRUYT SA	4,415	41.91	185,032.65
DELHAIZE GROUP	5,268	52.33	275,674.44
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	33,359	6.70	223,672.09
JERONIMO MARTINS	15,262	12.52	191,080.24
KONINKLIJKE AHOLD NV	48,280	13.18	636,330.40
METRO STAMM	8,530	29.68	253,213.05
ANHEUSER-BUSCH INBEV	42,066	80.92	3,403,980.72
DANONE (GROUPE)	29,809	54.10	1,612,666.90
HEINEKEN HOLDING NV	5,452	47.96	261,505.18
HEINEKEN NV	11,920	50.88	606,489.60
KERRY GROUP PLC-A	9,060	55.38	501,742.80
PERNOD-RICARD	11,083	88.57	981,621.31
REMY COINTREAU	1,575	64.95	102,296.25
UNILEVER NV-CVA	85,429	31.69	2,707,245.01
BEIERSDORF AG	5,460	73.79	402,893.40
HENKEL AG & CO KGAA	6,146	74.03	454,988.38
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,274	84.51	783,745.74
LOREAL	12,552	127.50	1,600,380.00
CELESIO AG	2,526	26.09	65,915.97
ESSILOR INTERNATIONAL	10,580	77.43	819,209.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,168	48.51	541,815.52

FRESENIUS SE&CO KGAA	6,499	109.80	713,590.20
BAYER	43,420	104.75	4,548,245.00
GRIFOLS SA	8,679	39.91	346,422.28
MERCK KGAA	3,505	126.75	444,258.75
ORION OYJ-CLASS B	5,839	23.37	136,457.43
QIAGEN N.V.	11,173	16.94	189,326.48
SANOFI	62,227	78.00	4,853,706.00
UCB (GROUPE)	5,804	58.65	340,404.60
BANCO BILBAO VIZCAYA	317,042	9.39	2,978,609.59
BANCO DE SABADELL SA	187,781	2.38	448,233.24
BANCO SANTANDER SA	639,053	7.52	4,810,790.98
BNP PARIBAS	56,992	53.06	3,023,995.52
CAIXABANK	92,785	4.45	413,635.53
COMMERZBANK AG	50,443	11.99	605,063.78
CREDIT AGRICOLE SA	54,249	11.95	648,275.55
ERSTE GROUP BANK AG	14,327	25.20	361,112.03
INTESA SANPAOLO	630,416	2.43	1,535,693.37
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.10	136,500.00
KBC GROEP NV	13,397	43.71	585,649.85
NATIXIS	46,847	4.96	232,501.66
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,746	24.44	140,460.97
SOCIETE GENERALE	38,171	43.03	1,642,688.98
UNICREDIT SPA	235,426	6.36	1,497,309.36
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	45,851	6.62	303,533.62
DEUTSCHE BANK NAMEN	53,868	30.27	1,630,853.70
DEUTSCHE BOERSE	10,126	55.43	561,284.18
EURAZEO	2,073	62.59	129,749.07
EXOR SPA	5,807	31.43	182,514.01
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,236	76.14	322,529.04
ING GROEP	205,666	10.20	2,098,821.53
MEDIOBANCA	30,462	7.22	220,087.95
WENDEL	1,898	111.60	211,816.80
AEGON	98,534	6.39	630,321.99
AGEAS	11,969	30.92	370,141.32
ALLIANZ SE-REG	24,486	124.70	3,053,404.20
ASSICURAZIONI GENERALI	63,268	16.66	1,054,044.88
AXA	97,941	18.05	1,767,835.05
CNP ASSURANCES	8,550	15.89	135,902.25
DELTA LLOYD NV	11,075	17.76	196,692.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,252	64.91	211,087.32
MAPFRE SA	65,064	3.00	195,192.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	9,463	162.75	1,540,103.25
SAMPO OYJ-A SHS	23,132	36.55	845,474.60
SCOR SE	7,779	25.64	199,492.45
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	47,000	2.46	115,714.00
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	39.12	88,579.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,145	16.21	261,710.45

IMMOFINANZ AG	55,175	2.55	141,082.47	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,889	31.94	667,299.10	
ATOS	4,325	64.89	280,649.25	
CAP GEMINI SA	7,599	53.68	407,914.32	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,198	93.46	298,885.08	
GEMALTO	4,231	80.70	341,441.70	
SAP AG	48,384	56.06	2,712,407.04	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,632	33.88	190,812.16	
ALCATEL-LUCENT	148,862	2.97	442,864.45	
NOKIA CORP	197,059	5.80	1,142,942.20	
BELGACOM	7,760	24.30	188,606.80	
DEUTSCHE TELEKOM	163,631	12.23	2,001,207.13	
ELISA A	7,061	22.06	155,765.66	
ILIAD SA	1,349	221.70	299,073.30	
KPN (KON.)	171,949	2.73	469,592.71	
ORANGE	96,826	12.17	1,178,372.42	
TELECOM ITALIA ORD	544,541	0.90	493,081.87	
TELECOM ITALIA RNC	319,440	0.69	222,170.52	
TELEFONICA	216,971	12.26	2,660,064.46	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	5.65	94,512.50	
TELEKOM AUSTRIA AG	13,843	7.14	98,880.54	
VIVENDI	63,096	19.14	1,207,972.92	
ZIGGO NV	7,516	34.36	258,287.34	
E.ON SE	105,098	14.16	1,488,713.17	
ELECTRICITE DE FRANCE	12,365	27.59	341,150.35	
ENAGAS	10,414	21.47	223,588.58	
ENEL	350,505	4.23	1,482,636.15	
ENEL GREEN POWER SPA	92,686	2.04	189,820.92	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	114,604	3.43	393,206.32	
FORTUM OYJ	23,610	17.50	413,175.00	
GAS NATURAL SDG SA	19,183	21.20	406,679.60	
GDF SUEZ	76,605	20.39	1,561,975.95	
IBERDROLA SA	273,911	5.23	1,433,376.26	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,917	62.13	367,623.21	
RWE STAMM	25,441	29.28	744,912.48	
SNAM SPA	110,056	4.27	470,159.23	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,532	14.75	214,419.66	
TERNA SPA	83,672	3.86	323,308.60	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	13.87	274,128.37	
ASML HOLDING NV	18,708	62.61	1,171,307.88	
INFINEON TECHNOLOGIES	58,579	9.08	532,131.63	
STMICROELECTRONICS	32,158	7.26	233,627.87	
グループ小計	9,262,238		162,632,331.02 (22,500,182,996)	
合計	55,413,042		157,882,295,732 (157,882,295,732)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	257,000.00	190,180.00	
	アメリカドル小計		257,000.00	190,180.00 (19,350,815)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	40,986.00	284,032.98	
		LEND LEASE GROUP	28,820.00	384,170.60	
		SYDNEY AIRPORT	58,361.00	256,204.79	
	オーストラリアドル小計		128,167.00	924,408.37 (86,866,654)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	1,094,600.00	
香港ドル小計		130,000.00	1,094,600.00 (14,361,152)		
投資信託受益証券合計				120,578,621 (120,578,621)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	18,579.00	439,393.35	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	46,690.00	579,422.90	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	20,727.00	1,848,641.13	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	50,991.00	599,144.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,791.00	952,573.57	
		BOSTON PROPERTIES	7,935.00	946,645.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,483.00	312,823.74	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,176.00	1,315,853.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,811.00	392,586.04	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	332,001.33	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,864.00	1,093,098.16	
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,300.00	590,469.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,356.00	399,364.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,817.00	656,759.37	
		HCP INC	23,765.00	985,059.25	
		HEALTH CARE REIT INC	14,921.00	930,324.35	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,654.00	881,378.72	
		KIMCO REALTY CORP	20,531.00	467,080.25	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	321,324.34	
		MACERICH CO/THE	7,524.00	493,348.68	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	9,142.00	412,121.36	
		PROLOGIS INC	25,562.00	1,049,064.48	
		PUBLIC STORAGE	7,650.00	1,303,866.00	
		RAYONIER INC	7,016.00	329,120.56	
		REALTY INCOME CORP	11,520.00	497,203.20	
		REGENCY CENTERS CORP	4,458.00	237,745.14	
SIMON PROPERTY GROUP	16,495.00	2,902,130.30			
SL GREEN REALTY CORP	4,630.00	502,308.70			
UDR INC	13,985.00	384,167.95			
VENTAS INC	15,287.00	1,012,458.01			
VORNADO REALTY TRUST	8,760.00	930,049.20			

アメリカドル小計		491,591.00	24,097,526.19 (2,451,923,289)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	175,490.15
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,604.00	208,957.92
カナダドル小計		15,139.00	384,448.07 (35,972,805)
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	263,748.16
	DEXUS PROPERTY GROUP	290,814.00	327,165.75
	FEDERATION CENTRES	67,999.00	168,637.52
	GOODMAN GROUP	91,399.00	465,220.91
	GPT GROUP	90,744.00	353,901.60
	MIRVAC GROUP	182,219.00	325,260.91
	STOCKLAND	116,175.00	450,759.00
	WESTFIELD GROUP	104,929.00	1,138,479.65
	WESTFIELD RETAIL TRUST	165,924.00	537,593.76
オーストラリアドル小計		1,237,005.00	4,030,767.26 (378,771,199)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,918.00	357,662.47
	HAMMERSON PLC	38,982.00	233,112.36
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	126,603.81
	LAND SECURITIES GROUP PLC	42,914.00	457,463.24
	SEGRO PLC	38,146.00	139,309.19
イギリスポンド小計		210,190.00	1,314,151.07 (223,550,238)
香港ドル	LINK REIT	125,000.00	5,131,250.00
香港ドル小計		125,000.00	5,131,250.00 (67,322,000)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	270,840.00
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	183,700.00
	CAPITAMALL TRUST	109,000.00	222,360.00
シンガポールドル小計		330,000.00	676,900.00 (54,855,976)
ユーロ	CORIO NV	3,438.00	125,263.53
	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	119,222.70
	GECINA SA	1,389.00	142,580.85
	ICADE	2,102.00	149,136.90
	KLEPIERRE	5,171.00	182,949.98
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,148.00	1,045,044.00
ユーロ小計		18,897.00	1,764,197.96 (244,076,787)
投資証券合計			3,456,472,294 (3,456,472,294)
合計			3,577,050,915 (3,577,050,915)

(注) 有価証券明細表注記

(1) 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

(3) 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式	584銘柄	97.4%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%
	投資証券	31銘柄	2.6%
カナダドル	株式	91銘柄	99.5%
	投資証券	2銘柄	0.5%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	91.8%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.5%
	投資証券	9銘柄	6.7%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.6%
	投資証券	5銘柄	1.4%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%
香港ドル	株式	37銘柄	96.0%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.7%
	投資証券	1銘柄	3.3%
シンガポールドル	株式	26銘柄	94.7%
	投資証券	3銘柄	5.3%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%
スウェーデンクローナ	株式	30銘柄	100.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%
デンマーククローネ	株式	13銘柄	100.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%
ユーロ	株式	225銘柄	98.9%
	投資証券	6銘柄	1.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(平成26年 5月30日から平成26年11月29日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【外国株式インデックス・オープン】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成26年 5月29日現在)	第15期中間計算期間 (平成26年11月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,565,164	9,236,662
親投資信託受益証券	1,791,935,761	1,990,468,652
未収入金	85,226	14,347,269
未収利息	11	22
流動資産合計	1,800,586,162	2,014,052,605
資産合計	1,800,586,162	2,014,052,605
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	33,962,460	-
未払解約金	1,217,962	15,520,542
未払受託者報酬	637,164	695,635
未払委託者報酬	6,644,674	7,254,436
その他未払費用	88,524	49,626
流動負債合計	42,550,784	23,520,239
負債合計	42,550,784	23,520,239
純資産の部		
元本等		
元本	1,358,498,433	1,286,221,756
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	399,536,945	704,310,610
(分配準備積立金)	348,271,630	273,450,686
元本等合計	1,758,035,378	1,990,532,366
純資産合計	1,758,035,378	1,990,532,366
負債純資産合計	1,800,586,162	2,014,052,605

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 平成25年 5月30日 至 平成25年11月29日	第15期中間計算期間 自 平成26年 5月30日 至 平成26年11月29日
営業収益		
受取利息	1,313	1,464
有価証券売買等損益	165,406,188	345,875,373
営業収益合計	165,407,501	345,876,837
営業費用		
受託者報酬	603,841	695,635
委託者報酬	6,297,151	7,254,436
その他費用	43,068	49,626
営業費用合計	6,944,060	7,999,697
営業利益又は営業損失（ ）	158,463,441	337,877,140
経常利益又は経常損失（ ）	158,463,441	337,877,140
中間純利益又は中間純損失（ ）	158,463,441	337,877,140
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	9,642,963	27,940,366
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	195,294,712	399,536,945
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,715,434	91,357,368
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,715,434	91,357,368
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,485,600	96,520,477
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,485,600	96,520,477
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	331,345,024	704,310,610

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第14期 (平成26年 5月29日現在)	第15期中間計算期間 (平成26年11月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,358,498,433口	1,286,221,756口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2941円 (12,941円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5476円 (15,476円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第15期中間計算期間 (平成26年11月29日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価と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 「(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第15期中間計算期間 (平成26年11月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期 自 平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日	第15期中間計算期間末 自 平成26年 5月30日 至 平成26年11月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,472,272,230円	1,358,498,433円
期中追加設定元本額	629,763,336円	252,458,852円
期中一部解約元本額	743,537,133円	324,735,529円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

「外国株式インデックス・オープン」は、「外国株式インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成26年11月29日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見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

	平成26年11月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,362,648,487
コール・ローン	1,932,341,107
株式	215,241,542,159
投資信託受益証券	163,024,254
投資証券	4,930,571,631
派生商品評価勘定	212,744,460
未収入金	9,827,991
未収配当金	445,304,090
未収利息	2,393
差入委託証拠金	1,857,656,380
流動資産合計	230,155,662,952
資産合計	230,155,662,952
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,332,366
前受金	209,154,061
未払金	249,010,102
未払解約金	1,460,989,874
流動負債合計	1,920,486,403
負債合計	1,920,486,403
純資産の部	
元本等	
元本	112,112,237,513
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	116,122,939,036
元本等合計	228,235,176,549
純資産合計	228,235,176,549
負債純資産合計	230,155,662,952

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成26年11月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

	平成26年11月29日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		平成26年11月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		112,112,237,513口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0358円 (20,358円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		平成26年11月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年11月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	平成26年11月29日現在
期首	平成26年 5月30日
期首元本額	99,099,801,608円
期中追加設定元本額	26,017,766,952円
期中一部解約元本額	13,005,331,047円
期末元本額	112,112,237,513円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,416,791,705円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,805,545円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	20,718,231,501円
世界経済インデックスファンド	1,365,986,996円
マイセレクション25	8,153,608円
マイセレクション50	24,312,685円
マイセレクション75	25,024,222円
外国株式インデックス・オープン	977,732,907円
D C マイセレクション25	851,113,400円
D C マイセレクション50	3,963,853,908円
D C マイセレクション75	4,594,368,122円
D C 外国株式インデックス・オープン	5,958,587,390円
D C マイセレクションS25	277,956,077円
D C マイセレクションS50	1,422,206,365円
D C マイセレクションS75	1,148,069,908円
D C ターゲット・イヤー ファンド2015	2,618,273円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	140,067,838円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	147,392,006円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	72,255,171円
D C 世界経済インデックスファンド	1,370,352,729円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	24,115,386,086円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	60,561,050円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	35,468,361円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	210,905,641円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	362,779,200円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,220,239,219円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,955,050,386円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,031,328,036円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,031,634,392円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	825,024,394円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,333,887,675円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,318,929,744円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,969,467,289円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	809,995,308円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	865,437,304円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	244,751,232円

区分	平成26年11月29日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,575,032,618円
F O F s用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	4,357,096,926円
外国株式ファンド・シリーズ1	617,247,601円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,058,436,085円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,087,017,403円
分散投資コア戦略ファンドA	628,985,824円
分散投資コア戦略ファンドS	825,542,215円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	49,640,450円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,300,540円
コア投資戦略ファンド（切替型）	696,282,184円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	213,976,827円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,953,167円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成26年11月29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	7,596,896,197	-	7,806,050,258	209,154,061
合計		7,596,896,197	-	7,806,050,258	209,154,061

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

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。

通貨関連

（平成26年11月29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	432,774,937	-	435,029,770	2,254,833
	アメリカドル	354,909,796	-	357,024,400	2,114,604
	ユーロ	25,852,992	-	25,905,440	52,448
	イギリスポンド	16,882,775	-	16,899,610	16,835
	スウェーデンクローナ	16,122,904	-	16,123,920	1,016

	シンガポールドル	19,006,470	-	19,076,400	69,930
	売建	47,291,200	-	47,288,000	3,200
	アメリカドル	47,291,200	-	47,288,000	3,200
	合計	480,066,137	-	482,317,770	2,258,033

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、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。

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。

2【ファンドの現況】

【外国株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

(平成26年12月30日現在)

資産総額	1,994,938,084円
負債総額	1,500,723円
純資産総額(-)	1,993,437,361円
発行済口数	1,272,293,958口
1口当たり純資産額(/)	1.5668円
(1万口当たり純資産額)	(15,668円)

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成26年12月30日現在)

資産総額	236,119,579,879円
負債総額	731,708,415円
純資産総額(-)	235,387,871,464円
発行済口数	114,131,032,692口
1口当たり純資産額(/)	2.0624円
(1万口当たり純資産額)	(20,624円)

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。

(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

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又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、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

受益権の譲渡

- イ．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又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。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．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及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．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。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．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又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又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。

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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載又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又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成26年12月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。

ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成27年 2月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成26年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	396	5,990,397
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	8	52,515
単位型公社債投資信託	0	0
合計	404	6,042,912

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」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。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「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）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
- また、第29期事業年度の中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		8,192,444		10,457,599
前払費用		81,751		114,325
未収委託者報酬		2,210,605		2,735,763
未収運用受託報酬		31,051		15,268
未収入金		676		-
繰延税金資産		61,743		144,183
その他		19,263		3,448
流動資産合計		10,597,535		13,470,589
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	79,281	1	67,359
器具備品	1	103,209	1	87,378
有形固定資産合計		182,491		154,737
無形固定資産				
ソフトウェア		168,561		203,360
その他		1,770		4,686
無形固定資産合計		170,332		208,046
投資その他の資産				
投資有価証券		47,112		69,583
長期前払費用		-		34,773
長期貸付金		31,838		28,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		-		117,743
その他		633		553
貸倒引当金		31,838		28,838
投資その他の資産合計		72,746		247,653
固定資産合計		425,570		610,437
資産合計		11,023,105		14,081,027

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				

預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	19,128,296	22,773,831
運用受託報酬	94,659	55,511
営業収益合計	19,222,955	22,829,342
営業費用		

支払手数料	9,030,246		10,451,296
広告宣伝費	73,287		76,961
公告費	2,244		-
調査費	4,132,154		5,091,105
調査費	207,030		259,236
委託調査費	3,922,394		4,830,390
図書費	2,729		1,479
営業雑経費	1,294,879		1,264,334
通信費	21,905		17,246
印刷費	330,735		327,214
協会費	21,939		22,524
諸会費	757		773
情報機器関連費	874,151		837,859
その他営業雑経費	45,391		58,716
営業費用合計	14,532,812		16,883,698
一般管理費			
給料	2,259,238		2,201,964
役員報酬	78,205		102,330
給料・手当	1,967,177		1,846,450
賞与	213,855		253,183
退職給付費用	64,787		72,029
役員退職慰労金	-		1,070
福利費	190,716		207,122
交際費	879		2,758
旅費交通費	45,160		45,973
租税公課	25,420		42,862
不動産賃借料	129,096		130,938
寄付金	-		3,385
減価償却費	129,966		119,445
諸経費	1	257,947	1
一般管理費合計	3,103,213		3,047,165
営業利益	1,586,929		2,898,479

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1
支払補償費	-	23,222
		14,648

投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	-	-
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
合併による増加		350,000	350,000
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	350,000	350,000
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638

当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
-------	--------	-----------	-----------	-----------	-----------

	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	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
合併による増加			2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496
当期末残高	4,998	4,998	8,546,410

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	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	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	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	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			

剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（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しております。）

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
		千円		千円
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	"	188,630	"
計	258,807	"	224,147	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
諸経費	97,199	千円	73,276	千円
長期前払費用償却	-	"	23,222	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

4. 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

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

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

平成26年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(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

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

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、次表には含めておりません（（注2）を参照ください）。

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2) 未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-

(3) 投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4) 未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
(2) 未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(3) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（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	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

当事業年度（平成26年3月31日）

（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	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			

その他	45,159	37,315	7,843
小計	45,159	37,315	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	1,952	2,030	77
小計	1,952	2,030	77
合計	47,112	39,345	7,766

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	7,950	8,138	188
小計	7,950	8,138	188
合計	69,583	65,365	4,218

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付債務	268,531	313,992

(2) 退職給付引当金	268,531	313,992
-------------	---------	---------

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(1) 退職給付費用	64,787	72,029

(注) 1. 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

(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

	前事業年度 (平成25年3月31日)		当事業年度 (平成26年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	"	10,277	"
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	"	33,736	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	"	111,906	"
減価償却超過額	1,067	"	-	"
その他	11,680	"	13,094	"
繰延税金資産 小計	171,228	"	271,384	"
評価性引当額	11,347	"	-	"
繰延税金資産 合計	159,881	"	271,384	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	"	1,503	"
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	"	7,953	"
繰延税金負債 合計	401,693	"	9,457	"
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	"	261,926	"

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

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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

当社は資産運用に関する事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）

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

内国籍投資信託又は本邦顧客から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) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	3,172,592千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 （百万円）	事業の内容 又は職業	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 （千円）	科目	期末残高 （千円）
----	----------------	-----	-------------------	---------------	---------------------------	-------------------	-------	--------------	----	--------------

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	-------	----------	--------	---	---

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	73,276	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上 の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料 等の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用 の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成25年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成26年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	10,736,816
未収委託者報酬	3,496,458
繰延税金資産	85,943
その他流動資産	131,122
流動資産合計	14,450,340

固定資産

有形固定資産		
建物	1	62,410
器具備品	1	116,552
有形固定資産合計		178,963
無形固定資産		193,575
投資その他の資産		
投資有価証券		58,781
長期貸付金		27,338
会員権		25,000
その他の投資		20,550
繰延税金資産		122,025
貸倒引当金		27,338
投資その他の資産合計		226,357
固定資産合計		598,896
資産合計		15,049,237
負債の部		
流動負債		
未払金		2,137,961
未払費用		69,372
未払法人税等		681,263
賞与引当金		93,828
その他流動負債	2	185,306
流動負債合計		3,167,732
固定負債		
退職給付引当金		328,845
資産除去債務		12,599
固定負債合計		341,445
負債合計		3,509,177

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		65,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		8,721,600

利益剰余金合計	10,887,100
株主資本合計	11,537,100
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,959
評価・換算差額等合計	2,959
純資産合計	11,540,060
負債・純資産合計	15,049,237

中間損益計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		13,096,655
運用受託報酬		8,732
営業収益合計		13,105,387
営業費用		9,550,999
一般管理費	1	1,514,728
営業利益		2,039,658
営業外収益	2	9,123
営業外費用		24,340
経常利益		2,024,441
税引前中間純利益		2,024,441
法人税、住民税及び事業税		668,312
法人税等調整額		53,822
法人税等合計		722,134
中間純利益		1,302,307

中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,302,307	1,302,307	1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,269,307	1,272,307	1,272,307
当中間期末残高	65,500	2,100,000	8,721,600	10,887,100	11,537,100

	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	2,715	2,715	10,267,508
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,302,307
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	244	244	244
当中間期変動額合計	244	244	1,272,551
当中間期末残高	2,959	2,959	11,540,060

重要な会計方針

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。</p> <p> （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しております。）</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産</p> <p> 定率法によっております。</p>

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 40,466千円
	器具備品 187,949千円
	計 228,416千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 22,111千円
	無形固定資産 36,655千円
2	営業外収益の主要項目

受取利息	3,339千円
------	---------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

(リ-ス取引関係)

第29期中間会計期間(自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

平成26年9月30日における貸借対照表計上額、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)を参照ください。)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	10,736,816	10,736,816	-
(2)未収委託者報酬	3,496,458	3,496,458	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,778	58,778	-
(4)未払金	(2,137,961)	(2,137,961)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(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

(1)現金及び預金、並びに(2)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。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（3）投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成26年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	56,226	51,514	4,711
小計	56,226	51,514	4,711
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,552	2,665	113
小計	2,552	2,665	113
合計	58,778	54,180	4,598

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載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29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

当社は資産運用に関する事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29期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	1,703,639千円
J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型)	1,456,865千円

(注) 当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

(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)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第29期中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,846,686円70銭
1株当たり中間純利益	434,102円38銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
中間純利益	1,302,307千円
普通株式に係る中間純利益	1,302,307千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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。以下同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又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。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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】**(1)定款の変更**

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 2月27日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	19,078	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社八千代銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	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。
楽天証券株式会社	7,495	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。
株式会社S B I証券	47,937	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

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する

る法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成26年 6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 浩之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1. 上記は、当社が、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、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年7月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式インデックス・オープンの平成25年5月30日から平成26年5月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、外国株式インデックス・オープンの平成26年5月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント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

1. 上記は、当社が、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、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 白川 芳樹 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年1月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

中島紀子

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式インデックス・オープンの平成26年5月30日から平成26年11月29日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、外国株式インデックス・オープンの平成26年11月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年5月30日から平成26年11月29日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント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

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。