

【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8月28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益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、組入有益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 8月29日から平成28年 2月29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（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	あり	日経225	ブル・ベア
一般		(日本を除く)	ファンド	()		型
大型株	年2回				TOPIX	
中小型株			ファンド・	なし		条件付運用
	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	型
債券					(MSCI コク	
一般	年6回	北米			サイ・イン	ロング・
公債	(隔月)				デックス(円	ショート型/
社債		欧州			ベース))	絶対収益追
その他債券	年12回					求型
クレジット属性	(毎月)	アジア				
()						その他
	日々	オセアニア				()
不動産投信						
	その他	中南米				
その他資産	()					
(投資信託証券		アフリカ				
(株式一般))						
		中近東				
資産複合		(中東)				
()						
資産配分		エマージン				
固定型		グ				
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

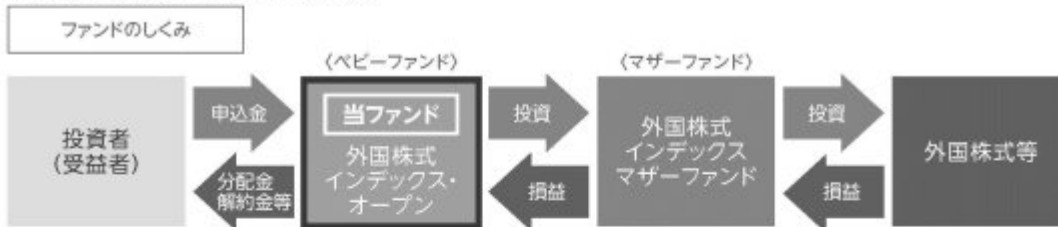
投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

- (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。

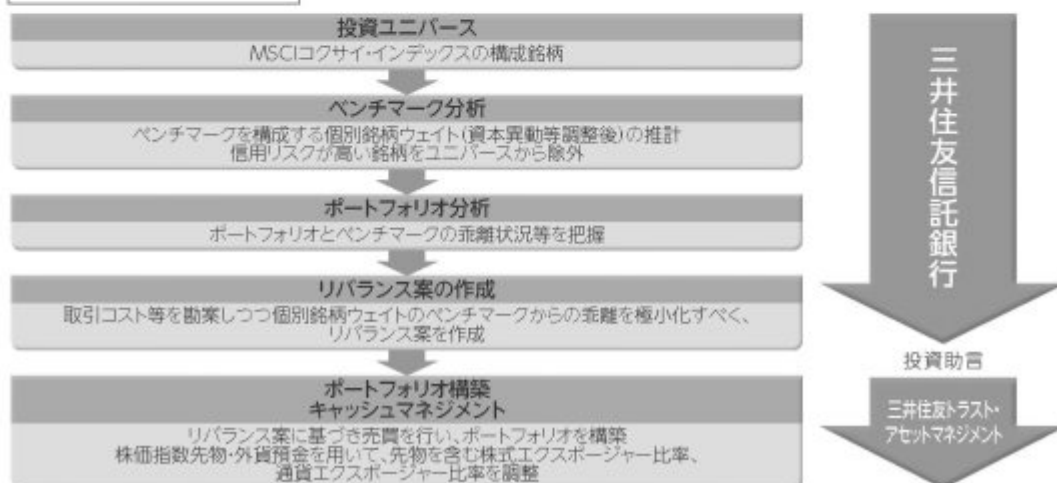
? ファミリーファンド方式とは

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(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(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。

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. MSCI コクサイ・インデックス(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(円ベース)とは

インデックスの概要 (2015年6月末現在)		地域別構成比	
構成国	22カ国	北米(67.2%)	米国/カナダ
構成銘柄数	1,331銘柄	欧州(27.6%)	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3,757兆円	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(0.3%)	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。

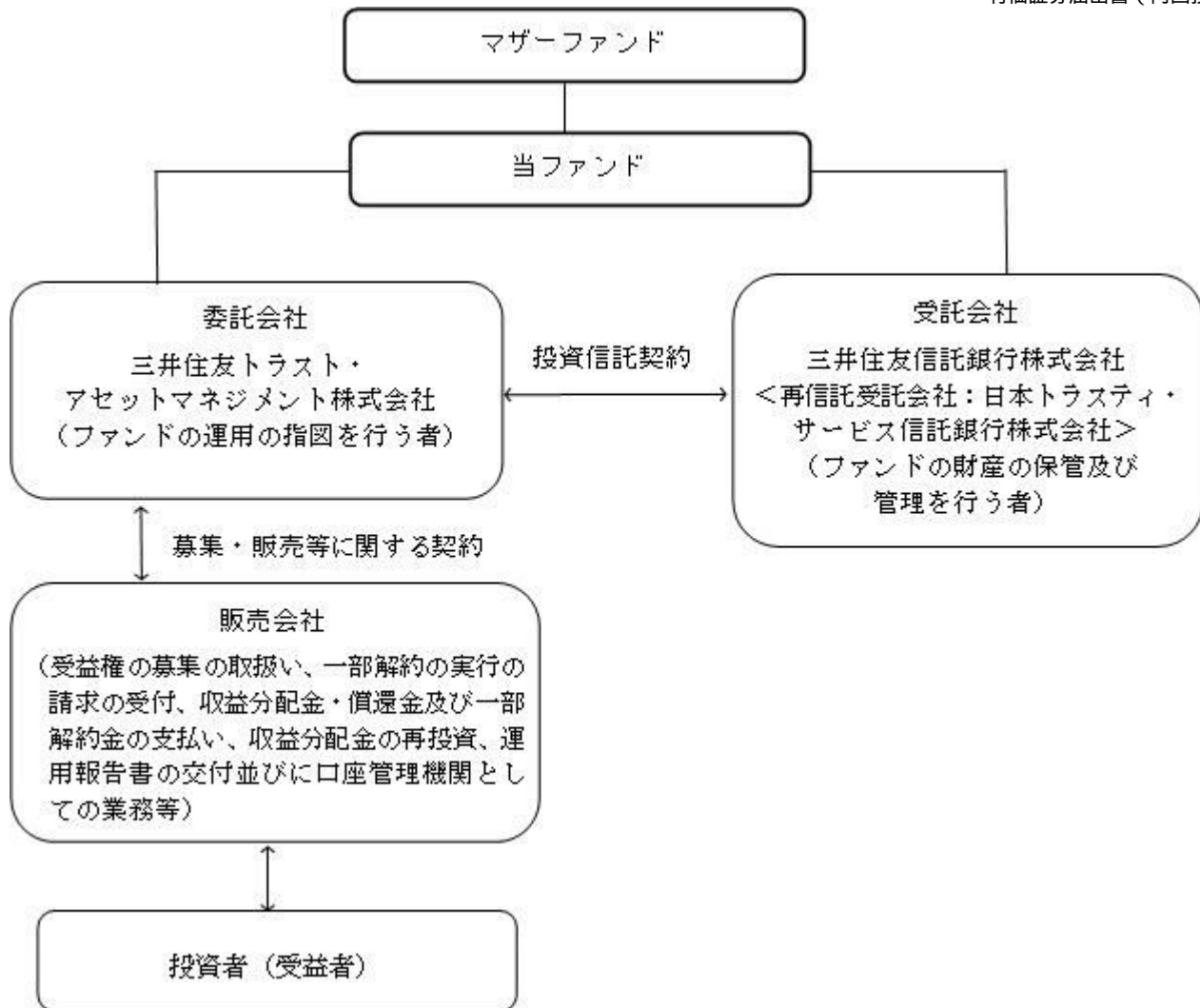
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(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27年 6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（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（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（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（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（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」

といたします。)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。

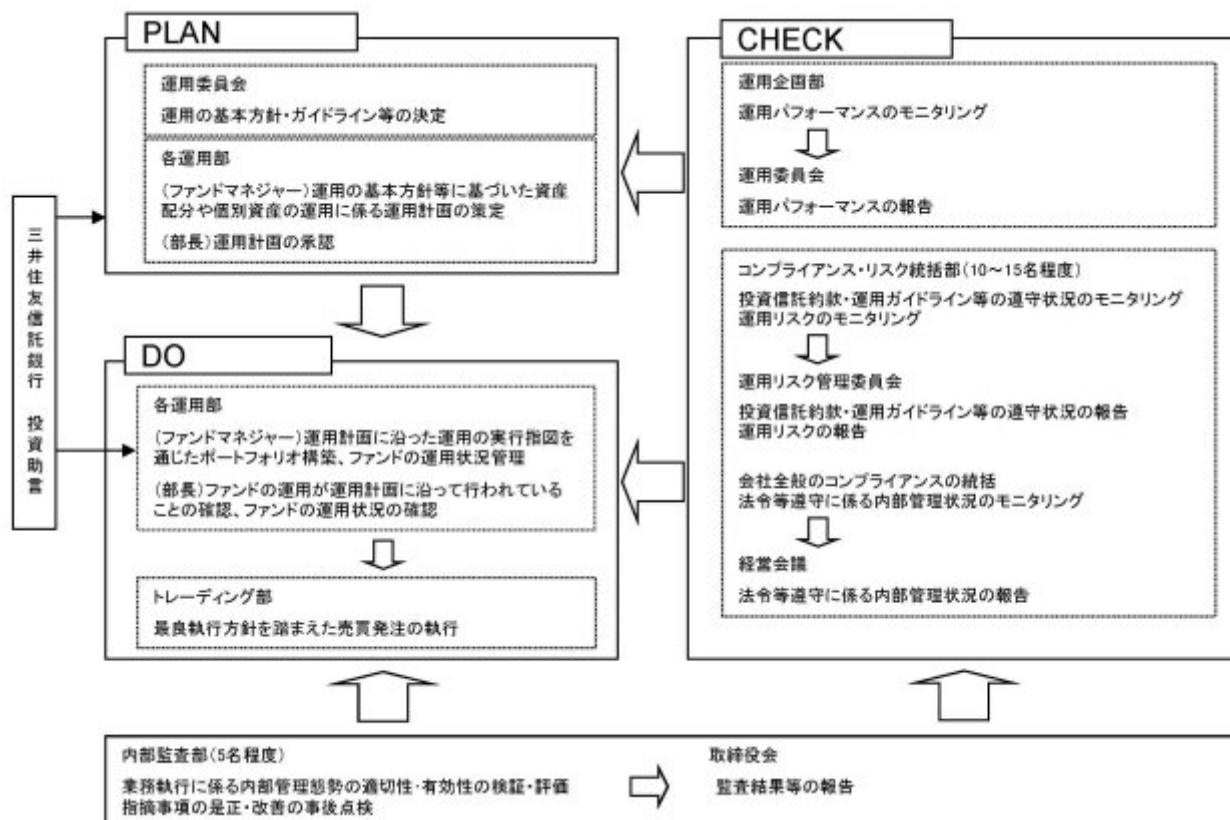
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

(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。）を含みません。）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ます。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 >

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、投資者の皆様の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（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コンプライアンス・リスク統括部が、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】

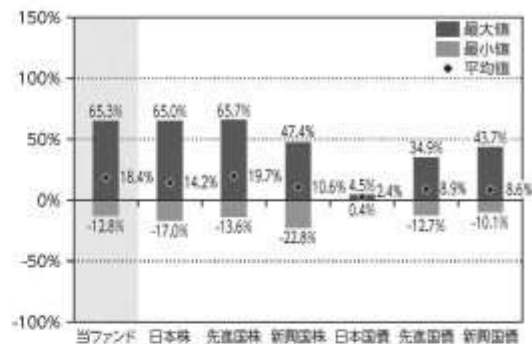
当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



*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。

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



*2010年7月～2015年6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・最小値、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-BP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… JPMorgan Global Bond Index - Emerging Markets^{※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内国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完済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-BP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債・固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、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、指数値の公表、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、ファンドの設定又は完済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、JP, 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。JP, Morganからの書面による事前承認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, JP, 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
す（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。

八．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、上場株式等の譲渡益及び申告
分離課税を選択した上場株式等の配当所得から控除することが可能です。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です。なお、平成28年1月1日以
降は、損益通算の対象に特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等が追加され、これらの所得間並
びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに
限ります。）及び譲渡所得等との損益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

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度で
す。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じ
る配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。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。
- 二．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27年 6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27年 6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	2,142,472,321	100.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		64,891	0.00
合計（純資産総額）		2,142,537,212	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	1,015,149,169	2.1965	2,229,855,195	2.1105	2,142,472,321	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
第15期計算期間末（平成27年 5月29日）	2,169,191,366	2,209,024,362	16,337	16,637
平成26年 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	
平成27年 1月末日	1,967,689,510		14,992	
2月末日	2,090,418,672		15,839	
3月末日	2,091,390,395		15,799	
4月末日	2,134,437,681		15,939	
5月末日	2,169,191,366		16,337	
6月末日	2,142,537,212		15,681	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

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
第15期計算期間	平成26年 5月30日～平成27年 5月29日	300

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	平成26年 5月30日～平成27年 5月29日	28.6

(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期計算期間	平成26年 5月30日～平成27年 5月29日	499,130,409	529,862,277	1,327,766,565

(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	150,720,809,365	56.04
	イギリス	21,729,921,138	8.08
	スイス	10,990,607,298	4.09
	カナダ	10,255,085,909	3.81
	フランス	10,038,337,934	3.73
	ドイツ	9,993,659,435	3.72
	オーストラリア	6,767,802,749	2.52
	オランダ	4,496,394,104	1.67
	アイルランド	4,369,010,782	1.62
	スペイン	3,898,517,816	1.45
	スウェーデン	3,251,629,098	1.21
	香港	2,577,558,531	0.96
	イタリア	2,441,328,376	0.91
	デンマーク	1,865,115,474	0.69
	シンガポール	1,695,095,652	0.63
	ジャージー	1,482,474,655	0.55
	ベルギー	1,466,495,028	0.55
	バミューダ	1,034,579,454	0.38
	キュラソー	927,883,845	0.34
	フィンランド	902,321,444	0.34
	ケイマン	694,121,573	0.26
	ノルウェー	666,274,948	0.25
	イスラエル	662,427,615	0.25
	ルクセンブルク	431,339,629	0.16
	オーストリア	199,680,697	0.07
	パナマ	169,849,924	0.06
	ポルトガル	161,728,858	0.06
	ニュージーランド	140,895,770	0.05
	リベリア	117,955,809	0.04
	英ヴァージン諸島	73,924,338	0.03
マン島	34,784,550	0.01	
モーリシャス	15,432,063	0.01	
	小計	254,273,043,861	94.54

投資信託受益証券	オーストラリア	147,315,009	0.05
	香港	26,574,570	0.01
	シンガポール	25,380,211	0.01
	小計	199,269,790	0.07
投資証券	アメリカ	4,256,776,220	1.58
	オーストラリア	572,119,198	0.21
	フランス	369,520,182	0.14
	イギリス	362,286,071	0.13
	香港	116,747,312	0.04
	シンガポール	104,169,951	0.04
	カナダ	47,853,174	0.02
	小計	5,829,472,108	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,652,532,205	3.22
合計(純資産総額)		268,954,317,964	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	5,398,300,087	2.01
	買建	カナダ	396,838,195	0.15
	買建	ドイツ	1,518,657,435	0.56
	買建	イギリス	887,331,060	0.33
	買建	オーストラリア	442,093,286	0.16

(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		467,881,100	0.17

(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	403,768	16,119.77	6,508,648,687	15,248.69	6,156,936,496	2.29
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	289,980	10,420.19	3,021,648,503	10,141.30	2,940,776,784	1.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	540,454	5,804.76	3,137,206,714	5,433.10	2,936,344,140	1.09
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	338,220	6,886.39	2,329,117,183	6,864.54	2,321,727,086	0.86
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	192,136	12,377.05	2,378,078,168	11,960.91	2,298,122,557	0.85
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	695,489	3,381.98	2,352,132,922	3,262.06	2,268,732,411	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	257,657	8,113.24	2,090,434,926	8,228.63	2,120,166,696	0.79
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	222,872	9,734.61	2,169,573,397	9,117.94	2,032,135,307	0.76
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	158,984	13,000.61	2,066,889,583	12,205.75	1,940,519,276	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	186,682	9,716.70	1,813,934,175	9,590.28	1,790,333,398	0.67
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	423,665	4,215.42	1,785,928,657	4,113.09	1,742,574,605	0.65
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	48,569	37,287.93	1,811,037,752	34,832.01	1,691,756,185	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	287,301	6,057.87	1,740,434,586	5,726.98	1,645,368,948	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	358,915	4,261.26	1,529,432,409	4,380.03	1,572,060,800	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	111,656	13,537.92	1,511,590,165	13,842.97	1,545,650,937	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	130,008	12,629.12	1,641,887,138	11,839.69	1,539,254,483	0.57
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,352,920	1,200.05	1,623,580,357	1,112.18	1,504,700,198	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	727,425	2,043.78	1,486,700,063	2,068.18	1,504,446,200	0.56
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	139,663	9,819.78	1,371,459,946	10,506.20	1,467,328,807	0.55
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	103,001	13,840.71	1,425,607,251	14,137.46	1,456,173,006	0.54
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	27,300	52,238.10	1,426,100,182	52,636.35	1,436,972,546	0.53
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	209,819	6,686.88	1,403,035,750	6,720.05	1,409,995,430	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	286,891	5,034.36	1,444,314,458	4,824.52	1,384,114,236	0.51
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	196,314	7,303.78	1,433,834,423	7,015.16	1,377,174,218	0.51

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	21,333	66,057.09	1,409,195,917	63,860.12	1,362,328,025	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	79,901	17,706.03	1,414,729,752	16,715.64	1,335,597,111	0.50
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	19,913	67,831.61	1,350,730,938	66,276.06	1,319,755,233	0.49
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	65,166	21,009.36	1,369,096,055	19,955.67	1,300,431,615	0.48
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	91,182	13,731.42	1,252,058,464	13,535.62	1,234,205,176	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	328,690	4,156.40	1,366,169,341	3,721.25	1,223,139,470	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	7.62
		素材	4.85
		資本財	6.89
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.80
		耐久消費財・アパレル	1.75
		消費者サービス	1.67
		メディア	3.20
		小売	3.45
		食品・生活必需品小売り	2.07
		食品・飲料・タバコ	5.79
		家庭用品・パーソナル用品	1.80
		ヘルスケア機器・サービス	3.63
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.03
		銀行	9.35
		各種金融	4.05
		保険	4.14
		不動産	0.70
		ソフトウェア・サービス	7.07
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.29		
電気通信サービス	3.01		
公益事業	2.99		
半導体・半導体製造装置	1.70		
		小計	94.54
投資信託受益証券			0.07

投資証券		2.17
合計		96.78

(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	86	アメリカドル	45,014,512	5,512,026,994	44,085,750	5,398,300,087	2.01
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	4,106,344	404,926,582	4,024,320	396,838,195	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	40	スイスフラン	3,569,090	471,976,462	3,535,200	467,494,848	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	221	ユーロ	7,658,384.5	1,050,960,104	7,659,860	1,051,162,587	0.39
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	4,851,995	455,747,890	4,706,625	442,093,286	0.16
	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	70	イギリスポンド	4,665,167.5	899,071,081	4,604,250	887,331,060	0.33

(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	2,290,000.00	281,387,300	280,387,600	0.10
	カナダドル	買建	150,000.00	14,944,200	14,790,000	0.00
	ユーロ	買建	650,000.00	88,395,050	89,193,000	0.03
	イギリスポンド	買建	210,000.00	40,510,050	40,468,500	0.01
	スイスフラン	買建	100,000.00	13,118,200	13,224,000	0.00
	デンマーククローネ	買建	600,000.00	10,894,800	11,034,000	0.00
	オーストラリアドル	買建	200,000.00	18,774,000	18,784,000	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。

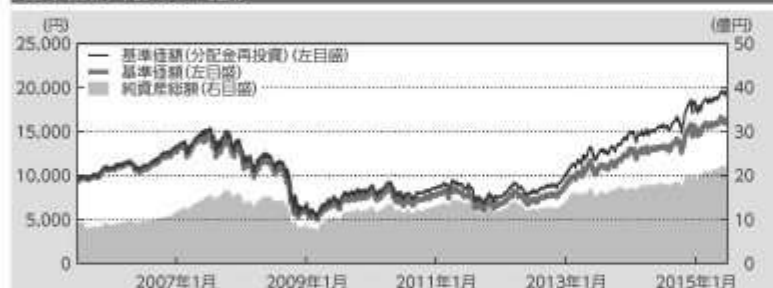
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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：2015年6月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額	15,681円
純資産総額	21.43億円

※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最近10年間の推移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:1,950円

決算期	2011年5月	2012年5月	2013年5月	2014年5月	2015年5月
分配金	150円	100円	200円	250円	300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	2.3%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.1%
WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	銀行	0.9%
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%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	0.8%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	0.8%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.8%
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%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	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。

※2015年は年初から作成基準日までの収益率です。

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。

第2【管理及び運営】

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。

< お問い合わせ先 >

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せん。）

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5億口を下回ることとなった場合
- ・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、本手続きに従います。

(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。受託会社が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っ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てします。）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15期計算期間(平成26年 5月30日から平成27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14期 (平成26年 5月29日現在)	第15期 (平成27年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,565,164	15,094,636
親投資信託受益証券	1,791,935,761	2,208,959,629
未収入金	85,226	20,258,450
未収利息	11	21
流動資産合計	1,800,586,162	2,244,312,736
資産合計	1,800,586,162	2,244,312,736
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	33,962,460	39,832,996
未払解約金	1,217,962	26,399,203
未払受託者報酬	637,164	768,668
未払委託者報酬	6,644,674	8,016,034
その他未払費用	88,524	104,469
流動負債合計	42,550,784	75,121,370
負債合計	42,550,784	75,121,370
純資産の部		
元本等		
元本	1,358,498,433	1,327,766,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	399,536,945	841,424,801
(分配準備積立金)	348,271,630	611,232,915
元本等合計	1,758,035,378	2,169,191,366
純資産合計	1,758,035,378	2,169,191,366
負債純資産合計	1,800,586,162	2,244,312,736

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期		第15期	
	自	平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日	自	平成26年 5月30日 至 平成27年 5月29日
営業収益				
受取利息		3,410		3,317
有価証券売買等損益		273,225,751		511,477,113
営業収益合計		273,229,161		511,480,430
営業費用				
受託者報酬		1,241,005		1,464,303
委託者報酬		12,941,825		15,270,470
その他費用		88,524		104,469
営業費用合計		14,271,354		16,839,242
営業利益又は営業損失（ ）		258,957,807		494,641,188
経常利益又は経常損失（ ）		258,957,807		494,641,188
当期純利益又は当期純損失（ ）		258,957,807		494,641,188
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		55,795,115		77,376,715
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		139,679,713		228,013,422
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		228,013,422
剰余金減少額又は欠損金増加額		104,637,712		163,557,043
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		163,557,043
分配金		33,962,460		39,832,996
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		399,536,945		841,424,801

（ 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14期 (平成26年 5月29日現在)	第15期 (平成27年 5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	1,327,766,565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) 1.6337円 (16,337円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第14期 自 平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日			第15期 自 平成26年 5月30日 至 平成27年 5月29日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	36,428,602円	費用控除後の配当等収益額	A	40,571,346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	166,734,090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	376,693,127円
収益調整金額	C	606,402,426円	収益調整金額	C	700,807,198円
分配準備積立金額	D	179,071,398円	分配準備積立金額	D	233,801,438円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	988,636,516円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,351,873,109円
当ファンドの期末残存口数	F	1,358,498,433口	当ファンドの期末残存口数	F	1,327,766,565口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,277円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,181円
1万口当たり分配金額	H	250円	1万口当たり分配金額	H	300円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	33,962,460円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	39,832,996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

	第15期 自 平成26年 5月30日 至 平成27年 5月29日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第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そのリスク	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、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、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コンプライアンス・リスク統括部が、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

	第15期 (平成27年 5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	(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。
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。

(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。

（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	第15期
	自 平成25年 5月30日 至 平成26年 5月29日	自 平成26年 5月30日 至 平成27年 5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	499,130,409円
期中一部解約元本額	743,537,133円	529,862,277円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第14期 (平成26年 5月29日現在)	第15期 (平成27年 5月29日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	244,507,790	469,277,000
合計	244,507,790	469,277,000

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	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	1,005,306,344	2,208,959,629	
合計		1,005,306,344	2,208,959,629	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「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27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

	平成27年 5月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,269,951,684
コール・ローン	851,698,152
株式	256,692,038,176
投資信託受益証券	211,189,527
投資証券	6,046,641,814
派生商品評価勘定	135,758,977
未収入金	750,191,627
未収配当金	600,201,655
未収利息	1,214
差入委託証拠金	1,115,604,378
流動資産合計	276,673,277,204
資産合計	276,673,277,204
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,459,881
前受金	119,758,076
未払金	4,214,624,765
未払解約金	274,865,415
流動負債合計	4,624,708,137
負債合計	4,624,708,137
純資産の部	
元本等	

	平成27年 5月29日現在
項目	金額（円）
元本	123,812,745,547
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	148,235,823,520
元本等合計	272,048,569,067
純資産合計	272,048,569,067
負債純資産合計	276,673,277,204

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 5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 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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 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>

平成27年 5月29日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 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。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 5月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	123,812,745,547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 2.1973円 (1万口当たり純資産額) (21,973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27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。

平成27年 5月29日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、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。</p> <p>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。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成27年 5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>

（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。

（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27年 5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
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	46,534,835,346円
期中一部解約元本額	21,821,891,407円
期末元本額	123,812,745,547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）	1,739,722,763円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,838,131円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	23,239,944,369円
世界経済インデックスファンド	1,818,399,339円
マイセレクション25	4,171,143円
マイセレクション50	21,182,556円
マイセレクション75	24,536,014円
外国株式インデックス・オープン	1,005,306,344円
D Cマイセレクション25	839,039,376円
D Cマイセレクション50	4,078,811,823円
D Cマイセレクション75	4,568,764,336円
D C外国株式インデックス・オープン	6,174,723,812円
D CマイセレクションS25	296,944,637円
D CマイセレクションS50	1,502,822,657円
D CマイセレクションS75	1,182,082,057円
D Cターゲット・イヤー ファンド2015	1,188,228円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	134,008,767円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	146,805,305円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	75,114,178円

区分	平成27年 5月29日現在
DC世界経済インデックスファンド	1,508,091,569円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	30,371,489,693円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	52,716,062円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	30,914,555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）	158,529,816円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	258,117,135円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	897,521,153円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	897,844,582円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	790,554,896円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,542,019,549円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	750,181,377円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,911,926,455円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	4,058,096,984円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,218,825,312円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	731,887,964円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	694,154,441円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	231,473,357円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,693,475,113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）	3,936,689,599円
外国株式ファンド・シリーズ1	616,174,117円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,392,491,226円
コア投資戦略ファンド（成長型）	11,206,190,558円
分散投資コア戦略ファンドA	634,120,524円
分散投資コア戦略ファンドS	990,510,278円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	72,781,120円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	130,337,936円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,225,061,540円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	383,887,005円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	32,179,014円
SMT インデックスバランス・オープン	133,124,126円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	391,972,656円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27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	22,555,107,319
投資信託受益証券	31,225,346
投資証券	431,950,679
合計	23,018,283,344

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成27年 5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	8,983,454,478	-	9,103,212,554	119,758,076
合計		8,983,454,478	-	9,103,212,554	119,758,076

(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27年 5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	633,974,080	-	634,515,100	541,020
	アメリカドル	356,175,600	-	356,313,600	138,000
	カナダドル	26,814,780	-	26,892,000	77,220
	ユーロ	94,465,700	-	94,920,000	454,300
	イギリスポンド	47,467,000	-	47,387,500	79,500
	スイスフラン	26,064,000	-	26,242,000	178,000
	オーストラリアドル	19,155,000	-	18,960,000	195,000
	香港ドル	63,832,000	-	63,800,000	32,000
合計		633,974,080	-	634,515,100	541,020

(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。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 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	33,700	83.92	2,828,104.00	
	ANTERO RESOURCES CORP	3,850	40.34	155,309.00	
	APACHE CORP	25,232	59.79	1,508,621.28	
	BAKER HUGHES	28,888	64.52	1,863,853.76	
	CABOT OIL & GAS CORP	28,477	33.85	963,946.45	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,808	51.30	657,050.40	
	CHENIERE ENERGY INC	15,407	75.85	1,168,620.95	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	14.05	586,868.50	
	CHEVRON CORP	126,154	103.24	13,024,138.96	
	CIMAREX ENERGY CO	6,492	114.36	742,425.12	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,979	10.05	200,788.95	
	CONCHO RESOURCES INC	8,018	117.31	940,591.58	
	CONOCOPHILLIPS	82,894	63.86	5,293,610.84	
	CONSOL ENERGY INC	14,731	28.50	419,833.50	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	45.36	284,180.40	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,702	119.91	323,996.82	
	DEVON ENERGY CORPORATION	26,444	65.38	1,728,908.72	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,834	30.64	148,113.76	
	ENERGEN CORP	4,802	67.77	325,431.54	
	ENSCO PLC-CL A	14,882	24.02	357,465.64	
	EOG RESOURCES INC	36,414	89.15	3,246,308.10	
	EQT CORPORATION	10,283	85.64	880,636.12	
	EXXON MOBIL	280,380	85.11	23,863,141.80	
	FMC TECHNOLOGIES INC	15,287	41.92	640,831.04	
	HALLIBURTON CO	56,494	45.35	2,562,002.90	
	HELMERICH & PAYNE	6,883	73.09	503,078.47	
	HESS CORP	17,367	67.29	1,168,625.43	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,448	42.06	523,562.88	
	KINDER MORGAN INC	121,871	41.62	5,072,271.02	
	MARATHON OIL CORP	45,368	27.22	1,234,916.96	
	MARATHON PETROLEUM CORP	18,190	102.77	1,869,386.30	
MURPHY OIL CORP	11,085	43.40	481,089.00		
NABORS INDUSTRIES LTD	18,529	14.53	269,226.37		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,055	49.89	1,399,663.95		
NOBLE ENERGY INC	25,925	43.65	1,131,626.25		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,761	77.73	4,023,382.53
OCEANEERING INTL INC	7,126	51.18	364,708.68
ONEOK INC	13,214	42.21	557,762.94
PHILLIPS 66	36,278	79.56	2,886,277.68
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,159	148.69	1,510,541.71
RANGE RESOURCES CORP	10,750	55.48	596,410.00
SCHLUMBERGER	85,258	90.65	7,728,637.70
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,359	25.68	625,539.12
SPECTRA ENERGY CORP	43,704	35.01	1,530,077.04
TESORO CORP	8,241	89.02	733,613.82
VALERO ENERGY CORP	34,741	58.92	2,046,939.72
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	13.60	719,263.20
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	32.36	453,622.48
WILLIAMS COS	47,326	51.28	2,426,877.28
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	13,675	148.20	2,026,635.00
AIRGAS INC	4,296	104.30	448,072.80
ALBEMARLE CORP	7,098	60.59	430,067.82
ALCOA	84,358	12.68	1,069,659.44
ASHLAND INC	4,125	127.67	526,638.75
AVERY DENNISON CORP	6,084	62.81	382,136.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	8,367	33.66	281,633.22
BALL CORP	8,446	71.86	606,929.56
CELANESE CORP-SERIES A	10,170	68.64	698,068.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,194	321.65	1,027,350.10
CROWN HOLDINGS INC	8,966	55.99	502,006.34
DOW CHEMICAL CO	78,596	51.57	4,053,195.72
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	60,340	71.44	4,310,689.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,677	76.51	740,387.27
ECOLAB INC	18,382	114.80	2,110,253.60
FMC CORP	8,555	57.92	495,505.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	69,879	20.16	1,408,760.64
INT'L PAPER CO	27,052	52.71	1,425,910.92
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,305	119.27	632,727.35
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,285	101.46	2,768,336.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,737	151.07	564,548.59
MEADWESTVACO CORP	11,040	51.38	567,235.20
MONSANTO CO	32,258	118.60	3,825,798.80
MOSAIC CO/THE	21,681	46.53	1,008,816.93
NEWMONT MINING CORP	32,176	27.47	883,874.72
NUCOR CORP	21,574	47.58	1,026,490.92
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	70.50	485,533.50
PPG INDUSTRIES INC	9,198	229.82	2,113,884.36

PRAXAIR INC	19,489	122.75	2,392,274.75
ROCK-TENN COMPANY -CL A	9,366	66.19	619,935.54
SEALED AIR CORP	14,731	49.47	728,742.57
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,486	289.91	1,590,446.26
SIGMA-ALDRICH	8,040	138.88	1,116,595.20
VULCAN MATERIALS CO	9,207	90.50	833,233.50
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	70.70	230,482.00
3 M COMPANY	42,629	160.87	6,857,727.23
ACUITY BRANDS INC	3,010	178.60	537,586.00
AGCO CORP	5,969	51.57	307,821.33
AMETEK INC	15,516	54.17	840,501.72
B/E AEROSPACE INC	6,965	58.93	410,447.45
BOEING CO	44,889	142.33	6,389,051.37
CATERPILLAR	38,247	86.01	3,289,624.47
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	54.09	353,640.42
CUMMINS INC	11,610	139.25	1,616,692.50
DANAHER CORP	42,000	87.32	3,667,440.00
DEERE&CO	21,552	93.50	2,015,112.00
DOVER CORP	10,404	76.57	796,634.28
EATON CORP	31,689	72.78	2,306,325.42
EMERSON ELECTRIC CO	46,213	61.02	2,819,917.26
FASTENAL CO	19,144	42.55	814,577.20
FLOWSERVE CORP	8,985	55.50	498,667.50
FLUOR CORP	10,027	56.47	566,224.69
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	46.56	515,605.44
GENERAL DYNAMICS CORP	18,777	140.41	2,636,478.57
GENERAL ELECTRIC CO	674,756	27.63	18,643,508.28
GRAINGER (WW) INC	4,144	244.66	1,013,871.04
HONEYWELL INTL INC	49,345	105.69	5,215,273.05
ILLINOIS TOOL WORKS	22,864	95.54	2,184,426.56
INGERSOLL-RAND PLC	17,860	69.44	1,240,198.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	43.34	343,122.78
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,450	118.21	644,244.50
LOCKHEED MARTIN CORP	17,842	190.12	3,392,121.04
MASCO CORP	23,242	27.59	641,246.78
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,809	160.48	2,055,588.32
PACCAR INC	23,707	65.17	1,544,985.19
PALL CORP	6,924	124.64	863,007.36
PARKER HANNIFIN CORP	9,733	122.27	1,190,053.91
PENTAIR PLC	12,104	64.48	780,465.92
PRECISION CASTPARTS CORP	9,527	215.84	2,056,307.68
QUANTA SERVICES INC	14,015	29.41	412,181.15

RAYTHEON COMPANY	20,584	104.44	2,149,792.96
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,169	123.82	1,135,305.58
ROCKWELL COLLIN	9,165	96.40	883,506.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,733	177.18	1,192,952.94
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	11,862	55.66	660,238.92
SNAP-ON INC	3,801	156.81	596,034.81
STANLEY BLACK&DECKER	10,815	103.34	1,117,622.10
TEXTRON	17,592	45.95	808,352.40
TRANSDIGM GROUP INC	3,646	227.49	829,428.54
UNITED RENTALS INC	6,249	94.95	593,342.55
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,690	117.69	6,436,466.10
WABCO HOLDINGS INC	3,875	128.45	497,743.75
WABTEC CORP	6,250	100.82	630,125.00
XYLEM INC	11,717	36.70	430,013.90
ADT CORPORATION	11,437	36.98	422,940.26
CINTAS CORP	6,449	86.28	556,419.72
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	128.85	314,394.00
EQUIFAX INC	7,882	100.29	790,485.78
IHS INC-CLASS A	4,455	125.17	557,632.35
MANPOWER GROUP	5,272	85.42	450,334.24
NIELSEN NV	23,138	45.10	1,043,523.80
REPUBLIC SERVICES INC	16,349	40.17	656,739.33
ROBERT HALF INTL INC	9,340	56.93	531,726.20
STERICYCLE INC	5,473	138.17	756,204.41
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,476	138.24	618,762.24
TYCO INTERNATIONAL PLC	28,159	40.75	1,147,479.25
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	11,066	73.16	809,588.56
WASTE MANAGEMENT INC	31,279	49.79	1,557,381.41
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,255	41.97	514,342.35
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,364	62.50	585,250.00
CSX CORP	66,429	34.72	2,306,414.88
DELTA AIR LINES INC	13,337	42.25	563,488.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,420	45.98	571,071.60
FEDEX CORP	17,900	175.10	3,134,290.00
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,586	20.20	516,837.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,122	84.59	517,859.98
KANSAS CITY SOUTHERN	7,504	92.40	693,369.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,651	93.71	1,935,205.21
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	36.81	409,952.97
UNION PACIFIC CORP	58,930	101.36	5,973,144.80
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,125	53.49	327,626.25
UNITED PARCEL SERVICE B	46,606	99.87	4,654,541.22

AUTOLIV INC	6,037	128.20	773,943.40
BORGWARNER INC	15,633	60.38	943,920.54
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,834	87.60	1,737,458.40
FORD MOTOR COMPANY	248,725	15.29	3,803,005.25
GENERAL MOTORS CO	97,602	36.39	3,551,736.78
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	32.03	597,103.26
HARLEY-DAVIDSON	13,690	54.02	739,533.80
JOHNSON CONTROLS INC	44,450	53.00	2,355,850.00
LEAR CORP	5,323	116.29	619,011.67
TESLA MOTORS INC	6,421	251.45	1,614,560.45
COACH INC	17,774	35.19	625,467.06
DR HORTON INC	21,692	26.35	571,584.20
GARMIN LTD	7,608	46.21	351,603.72
HANESBRANDS INC	25,408	31.93	811,277.44
HARMAN INTL INDS INC	4,743	122.32	580,163.76
HASBRO INC	6,979	72.45	505,628.55
JARDEN CORP	11,913	54.43	648,424.59
LEGGETT & PLATT INC	9,020	47.57	429,081.40
LENNAR CORP-CL A	11,040	47.52	524,620.80
LULULEMON ATHLETICA INC	7,116	61.23	435,712.68
MATTEL INC	21,936	25.86	567,264.96
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	45.78	637,257.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,014	188.83	757,963.62
NEWELL RUBBERMAID	17,771	39.84	707,996.64
NIKE B	46,229	102.30	4,729,226.70
POLARIS INDUSTRIES INC	4,072	144.86	589,869.92
PULTE GROUP INC	20,589	19.43	400,044.27
PVH CORP	5,223	104.97	548,258.31
RALPH LAUREN CORPORATION	3,958	131.85	521,862.30
TOLL BROTHERS INC	11,131	36.46	405,836.26
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	11,318	78.38	887,104.84
VF CORP	23,539	71.08	1,673,152.12
WHIRLPOOL CORP	5,250	187.52	984,480.00
ARAMARK	11,777	31.44	370,268.88
BLOCK H & R INC	17,436	32.05	558,823.80
CARNIVAL CORPORATION	28,337	47.15	1,336,089.55
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,078	629.42	1,307,934.76
DARDEN RESTAURANTS INC	7,354	64.94	477,568.76
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	33,822	29.41	994,705.02
LAS VEGAS SANDS CORP	26,857	51.05	1,371,049.85
MARRIOTT INTL A	14,589	79.03	1,152,968.67
MCDONALD'S CORP	64,507	96.48	6,223,635.36

MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,010	20.19	504,951.90
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9,731	54.75	532,772.25
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,330	76.32	864,705.60
STARBUCKS CORP	100,962	51.81	5,230,841.22
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,366	84.09	955,766.94
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	85.30	689,224.00
WYNN RESORTS LTD	5,532	102.99	569,740.68
YUM BRANDS INC	29,189	91.80	2,679,550.20
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,178	25.29	333,271.62
CBS CORP-CL B	30,673	62.03	1,902,646.19
CHARTER COMMUNICATION-A	5,758	176.36	1,015,480.88
COMCAST CORP-CL A	142,461	59.03	8,409,472.83
COMCAST CORP-SPECIAL A	26,643	58.56	1,560,214.08
DIRECTV	31,758	91.42	2,903,316.36
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	33.05	323,989.15
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,203	31.02	564,657.06
DISH NETWORK CORPORATION-A	14,985	70.30	1,053,445.50
GANNETT CO	15,014	36.03	540,954.42
INTERPUBLIC GROUP OF COS	26,809	20.64	553,337.76
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,338	57.69	1,000,229.22
LIBERTY GLOBAL PLC-C	42,445	53.54	2,272,505.30
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	38.12	243,358.08
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,068	37.93	495,669.24
NEWS CORP-CLASS A	23,149	15.35	355,337.15
OMNICOM GROUP	16,681	75.37	1,257,246.97
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	67.50	332,167.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.80	630,864.60
THE WALT DISNEY CO	108,329	110.53	11,973,604.37
TIME WARNER CABLE-A	18,663	182.38	3,403,757.94
TIME WARNER INC	55,626	84.78	4,715,972.28
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,674	33.96	3,011,369.04
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	29,647	33.77	1,001,179.19
VIACOM INC-CLASS B	23,239	67.34	1,564,914.26
ADVANCE AUTO PARTS	4,609	156.35	720,617.15
AMAZON.COM	26,486	426.57	11,298,133.02
AUTONATION INC	5,015	63.38	317,850.70
AUTOZONE INC	2,150	679.51	1,460,946.50
BED BATH & BEYOND INC	12,541	71.76	899,942.16
BEST BUY COMPANY INC	21,899	34.18	748,507.82
CARMAX INC	14,096	72.38	1,020,268.48
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	54.06	342,956.64
DOLLAR GENERAL CORP	20,303	73.11	1,484,352.33

DOLLAR TREE INC	14,139	76.19	1,077,250.41
EXPEDIA INC	6,684	109.24	730,160.16
FAMILY DOLLAR STORES	6,720	77.92	523,622.40
FOOT LOCKER INC	9,388	63.13	592,664.44
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	40.92	306,531.72
GAP	17,645	38.50	679,332.50
GENUINE PARTS CO	10,336	92.41	955,149.76
HOME DEPOT	88,470	112.19	9,925,449.30
KOHL'S CORP	13,086	65.38	855,562.68
L BRANDS INC	16,664	87.43	1,456,933.52
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	29,115	28.32	824,536.80
LKQ CORP	19,772	28.81	569,631.32
LOWES COMPANIES	65,465	70.45	4,612,009.25
MACY'S INC	23,212	68.04	1,579,344.48
NETFLIX INC	3,891	626.55	2,437,906.05
NORDSTROM INC	9,132	73.63	672,389.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,811	222.67	1,516,605.37
PRICELINE GROUP INC/THE	3,475	1,190.55	4,137,161.25
ROSS STORES INC	14,062	96.94	1,363,170.28
SIGNET JEWELERS LTD	4,912	132.38	650,250.56
STAPLES INC	41,695	16.49	687,550.55
TARGET (DAYTON HUDSON)	40,207	80.05	3,218,570.35
TIFFANY & CO	8,996	94.63	851,291.48
TJX COMPANIES INC	46,064	65.97	3,038,842.08
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,923	88.37	788,525.51
TRIPADVISOR INC	7,647	76.80	587,289.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,993	156.27	623,986.11
URBAN OUTFITTERS INC	7,303	34.66	253,121.98
COSTCO WHOLESALE CORP	29,689	144.26	4,282,935.14
CVS HEALTH CORP	75,312	103.19	7,771,445.28
KROGER CO	31,090	73.94	2,298,794.60
RITE AID CORP	68,357	8.70	594,705.90
SYSCO CORP	40,413	37.25	1,505,384.25
WAL-MART STORES	108,260	74.84	8,102,178.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	57,838	86.05	4,976,959.90
WHOLE FOODS MKT INC	24,168	42.23	1,020,614.64
ALTRIA GROUP INC	130,957	51.62	6,760,000.34
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,016	52.66	2,265,222.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,709	94.85	731,198.65
BUNGE LIMITED	9,373	91.52	857,816.96
CAMPBELL SOUP CO (US)	12,938	48.39	626,069.82
COCA-COLA CO	278,182	41.14	11,444,407.48

COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	44.65	673,768.50
CONAGRA	28,680	38.70	1,109,916.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,075	119.03	1,318,257.25
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,122	76.99	1,010,262.78
GENERAL MILLS INC	40,073	56.25	2,254,106.25
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,272	93.39	959,302.08
HORMEL FOODS CORP	9,273	58.20	539,688.60
JM SMUCKER CO	6,608	119.50	789,656.00
KELLOGG CO	17,922	62.56	1,121,200.32
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	88.22	725,344.84
KRAFT FOODS GROUP INC	39,164	85.14	3,334,422.96
LORILLARD INC	24,509	72.52	1,777,392.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,477	78.87	589,710.99
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	13,836	96.89	1,340,570.04
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,651	74.54	793,925.54
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,277	40.47	4,462,910.19
MONSTER BEVERAGE CORP	9,554	129.20	1,234,376.80
PEPSICO INC	99,100	97.06	9,618,646.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	103,915	84.26	8,755,877.90
REYNOLDS AMERICAN INC	21,344	76.78	1,638,792.32
TYSON FOODS INC	20,777	42.35	879,905.95
WHITEWAVE FOODS CO	12,111	48.63	588,957.93
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,621	84.53	728,733.13
CLOROX COMPANY	8,745	108.93	952,592.85
COLGATE-PALMOLIVE CO	57,705	67.33	3,885,277.65
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,934	144.25	567,479.50
ESTEE LAUDER CO-CL A	15,544	88.46	1,375,022.24
KIMBERLY-CLARK CORP	24,399	109.73	2,677,302.27
PROCTER & GAMBLE CO	181,126	79.33	14,368,725.58
ABBOTT LABORATORIES	101,618	49.26	5,005,702.68
AETNA INC	23,452	116.39	2,729,578.28
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,915	113.10	1,573,786.50
ANTHEM INC	17,966	164.22	2,950,376.52
BARD C R INC	4,806	170.70	820,384.20
BAXTER INTERNATIONAL	36,109	67.15	2,424,719.35
BECTON DICKINSON & CO	13,985	141.43	1,977,898.55
BOSTON SCIENTIFIC CORP	88,970	18.27	1,625,481.90
CARDINAL HEALTH	22,093	88.11	1,946,614.23
CENTENE CORP	7,820	72.41	566,246.20
CERNER CORP	20,571	68.33	1,405,616.43
CIGNA CORP	17,372	135.87	2,360,333.64
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,616	84.23	978,415.68

DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,058	52.15	472,374.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,213	130.65	942,378.45
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	37.27	478,733.15
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	48,724	89.23	4,347,642.52
HCA HOLDINGS INC	22,815	81.80	1,866,267.00
HENRY SCHEIN INC	5,464	142.66	779,494.24
HOLOGIC INC	16,743	35.29	590,860.47
HUMANA INC	9,959	178.41	1,776,785.19
INTUITIVE SURGICAL INC	2,373	485.80	1,152,803.40
LABORATORY CRP OF AMER	6,539	118.91	777,552.49
MCKESSON CORP	15,403	237.84	3,663,449.52
MEDTRONIC PLC	95,184	77.21	7,349,156.64
OMNICARE INC	6,427	95.63	614,614.01
PATTERSON COMPANIES INC	5,552	47.58	264,164.16
QUEST DIAGNOSTICS	9,138	76.04	694,853.52
RESMED INC	8,940	58.65	524,331.00
ST JUDE MEDICAL INC	18,678	74.15	1,384,973.70
STRYKER CORP	22,732	96.24	2,187,727.68
THE COOPER COS INC	3,161	180.78	571,445.58
UNITEDHEALTH GROUP INC	63,600	119.62	7,607,832.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,365	129.94	827,068.10
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	87.40	588,202.00
ZIMMER HOLDINGS INC	11,252	113.39	1,275,864.28
ABBVIE INC	107,144	67.47	7,229,005.68
ACTAVIS PLC	25,303	313.08	7,921,863.24
AGILENT TECHNOLOGIES	22,519	41.75	940,168.25
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,704	166.19	2,277,467.76
ALKERMES PLC	9,419	59.92	564,386.48
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,206	128.50	668,971.00
AMGEN	50,981	157.35	8,021,860.35
BIOGEN INC	15,652	400.10	6,262,365.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,865	127.39	1,384,092.35
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	111,676	69.15	7,722,395.40
CELGENE CORP	53,841	114.93	6,187,946.13
ENDO INTERNATIONAL PLC	11,237	82.94	931,996.78
GILEAD SCIENCES INC	99,903	112.85	11,274,053.55
HOSPIRA INC	11,423	88.44	1,010,250.12
ILLUMINA INC	9,760	208.62	2,036,131.20
INCYTE CORP	10,602	108.14	1,146,500.28
ISIS PHARMACEUTICALS INC	7,665	66.71	511,332.15
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,851	179.93	692,910.43
JOHNSON & JOHNSON	186,444	101.15	18,858,810.60

LILLY (ELI) & CO	66,464	76.41	5,078,514.24
MALLINCKRODT PLC	7,852	130.18	1,022,173.36
MEDIVATION INC	5,003	131.63	658,544.89
MERCK & CO	190,497	59.70	11,372,670.90
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,879	328.18	616,650.22
MYLAN NV	28,126	72.68	2,044,197.68
PERRIGO CO PLC	9,570	193.96	1,856,197.20
PFIZER	410,442	34.44	14,135,622.48
PHARMACYCLICS INC	4,327	261.25	1,130,428.75
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,028	200.05	405,701.40
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	5,470	70.59	386,127.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,051	512.12	2,586,718.12
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26,569	130.13	3,457,423.97
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	181.85	586,648.10
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,057	127.40	2,045,661.80
WATERS CORP	5,319	134.57	715,777.83
ZOETIS INC	31,728	49.11	1,558,162.08
BANK OF AMERICA CORP	705,869	16.67	11,766,836.23
BB&T CORP	48,976	39.89	1,953,652.64
CIT GROUP INC	12,099	46.51	562,724.49
CITIGROUP	203,595	54.55	11,106,107.25
CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,671	26.83	608,262.93
COMERICA INC	11,868	49.50	587,466.00
FIFTH THIRD BANCORP	56,562	20.59	1,164,611.58
FIRST REPUBLIC BANK/CA	8,878	61.38	544,931.64
HUDSON CITY BANCORP INC	33,541	9.60	321,993.60
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,227	11.28	600,400.56
JPMORGAN CHASE & CO	250,016	66.20	16,551,059.20
KEY CORP	56,451	14.86	838,861.86
M & T BANK CORP	8,028	121.79	977,730.12
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,326	17.72	501,936.72
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	15.56	339,783.72
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,980	96.00	3,358,080.00
REGIONS FINL CORP	93,279	10.22	953,311.38
SUNTRUST BANKS	34,995	43.01	1,505,134.95
US BANCORP	118,681	43.70	5,186,359.70
WELLS FARGO & CO	328,230	56.21	18,449,808.30
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,774	225.04	849,300.96
ALLY FINANCIAL INC	27,249	22.75	619,914.75
AMERICAN EXPRESS	61,794	80.09	4,949,081.46
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,352	127.01	1,568,827.52
BANK NEW YORK CO	74,906	43.95	3,292,118.70

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	77,520	144.74	11,220,244.80
BLACKROCK INC	8,306	369.51	3,069,150.06
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,016	84.30	3,120,448.80
CME GROUP INC	21,248	94.03	1,997,949.44
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	30,329	59.04	1,790,624.16
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	29.84	597,575.84
EATON VANCE CORP	7,881	40.70	320,756.70
FRANKLIN RESOURCES INC	27,118	51.58	1,398,746.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,392	208.48	5,502,204.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,530	236.44	1,780,393.20
INVESCO LTD	28,995	40.34	1,169,658.30
LEGG MASON INC	6,202	53.65	332,737.30
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,648	24.97	540,550.56
MCGRAW-HILL FINANCIAL	18,568	105.34	1,955,953.12
MOODY'S CORP	12,085	108.83	1,315,210.55
MORGAN STANLEY	97,549	38.73	3,778,072.77
NASDAQ OMX GROUP	7,604	52.34	397,993.36
NAVIENT CORP	25,310	19.29	488,229.90
NORTHERN TRUST CORP	15,081	75.65	1,140,877.65
PRICE T ROWE GROUP INC	17,401	81.28	1,414,353.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,630	58.74	506,926.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	78,345	31.90	2,499,205.50
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,417	47.76	449,755.92
STATE STREET CORP	27,867	79.12	2,204,837.04
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	32.53	375,884.15
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,841	37.61	671,000.01
VOYA FINANCIAL INC	15,523	45.62	708,159.26
ACE LTD	22,128	107.58	2,380,530.24
AFLAC	29,290	62.56	1,832,382.40
ALLEGHANY CORP	1,109	480.41	532,774.69
ALLSTATE CORP	28,008	67.80	1,898,942.40
AMERICAN INT'L GROUP	91,816	59.45	5,458,461.20
AON PLC	19,035	102.90	1,958,701.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,815	64.22	566,099.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,411	48.80	556,856.80
ASSURANT INC	4,769	65.86	314,086.34
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	55.00	326,755.00
CHUBB CORPORATION	15,797	98.29	1,552,687.13
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,898	51.11	505,886.78
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	184.15	541,585.15
FNF GROUP	16,273	38.27	622,767.71
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,099	41.34	1,161,612.66

LINCOLN NATIONAL CORP	17,556	57.70	1,012,981.20
LOEWS CORP	19,829	40.33	799,703.57
MARSH & MCLENNAN COS	36,152	58.72	2,122,845.44
METLIFE INC	64,248	52.89	3,398,076.72
PARTNERRE LTD	2,971	132.34	393,182.14
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,809	52.33	1,036,604.97
PROGRESSIVE CORP	40,491	27.42	1,110,263.22
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,399	85.07	2,586,042.93
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	102.87	334,224.63
TORCHMARK CORP	8,367	57.44	480,600.48
TRAVELERS COS INC/THE	21,447	102.15	2,190,811.05
UNUM GROUP	16,333	35.24	575,574.92
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,983	47.94	526,525.02
WR BERKLEY CORP	7,065	49.26	348,021.90
XL GROUP PLC	21,040	37.62	791,524.80
CBRE GROUP INC-A	19,000	38.32	728,080.00
JONES LANG LASALLE INC	3,112	172.46	536,695.52
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	47.43	446,885.46
WEYERHAEUSER CO	33,993	32.96	1,120,409.28
ACCENTURE PLC-CL A	41,724	96.91	4,043,472.84
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,097	25.72	902,870.32
ADOBE SYSTEMS INC	33,946	80.01	2,716,189.19
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,512	77.03	886,769.36
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,296	300.07	1,289,100.72
ANSYS INC	5,989	89.71	537,273.19
AUTODESK INC	14,607	54.55	796,811.85
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,121	85.97	2,761,442.37
CA INC	21,128	30.70	648,629.60
CDK GLOBAL INC	9,538	54.46	519,439.48
CITRIX SYSTEMS INC	10,361	65.48	678,438.28
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,608	64.84	2,633,022.72
COMPUTER SCIENCES CORP	9,202	69.34	638,066.68
EBAY	73,081	60.56	4,425,785.36
ELECTRONIC ARTS INC	20,956	63.27	1,325,886.12
FACEBOOK INC-A	135,496	80.14	10,859,326.92
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	19,083	63.40	1,209,862.20
FIREEYE INC	7,918	46.82	370,720.76
FISERV INC	16,414	80.79	1,326,087.06
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,053	152.92	772,704.76
GARTNER INC	6,094	88.22	537,612.68
GOOGLE INC-CL A	19,316	554.18	10,704,540.88
GOOGLE INC-CL C	20,686	539.78	11,165,889.08

INTL BUSINESS MACHINES CORP	63,225	171.71	10,856,364.75
INTUIT INC	17,650	105.09	1,854,838.50
LINKEDIN CORP - A	7,241	196.23	1,420,901.43
MASTERCARD INC-CLASS A	67,489	92.82	6,264,328.98
MICROSOFT CORP	524,054	47.45	24,866,362.30
NETSUITE INC	2,264	96.33	218,091.12
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	17.05	298,784.20
ORACLE CORP	235,003	43.86	10,307,231.58
PAYCHEX INC	22,018	49.57	1,091,542.35
RACKSPACE HOSTING INC	8,040	41.86	336,554.40
RED HAT INC	11,958	77.78	930,093.24
SALESFORCE.COM INC	40,010	72.68	2,907,926.80
SERVICENOW INC	9,115	78.40	714,616.00
SPLUNK INC	8,664	71.07	615,750.48
SYMANTEC CORP	46,562	24.81	1,155,203.22
SYNOPSYS INC	10,776	49.83	536,968.08
TERADATA CORP	9,511	38.73	368,361.03
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,950	41.23	451,468.50
TWITTER INC	33,221	36.83	1,223,529.43
VANTIV INC - CL A	9,716	39.96	388,251.36
VERISIGN INC	7,532	63.66	479,487.12
VISA INC-CLASS A SHARES	132,323	69.56	9,204,387.88
VMWARE INC-CLASS A	5,459	87.12	475,588.08
WESTERN UNION CO	34,620	21.94	759,562.80
WORKDAY INC-CLASS A	6,801	80.14	545,032.14
XEROX CORP	69,076	11.50	794,374.00
YAHOO	59,985	43.07	2,583,553.95
ZILLOW GROUP INC - CL A	3,100	93.05	288,455.00
AMPHENOL CORPORATION	20,848	57.63	1,201,470.24
APPLE INC	391,468	131.78	51,587,653.04
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	61.24	402,897.96
AVNET INC	9,057	44.88	406,478.16
CISCO SYSTEMS	343,802	29.35	10,090,588.70
CORNING	85,831	21.05	1,806,742.55
EMC CORP	133,284	26.52	3,534,691.68
F5 NETWORKS INC	4,710	126.83	597,369.30
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	12.21	471,806.61
FLIR SYSTEMS INC	9,284	30.97	287,525.48
HARRIS CORP	6,847	79.25	542,624.75
HEWLETT-PACKARD CO	122,554	33.65	4,123,942.10
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	27.65	672,558.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,616	59.63	811,922.08

NETAPP INC	20,591	33.26	684,856.66
PALO ALTO NETWORKS INC	4,460	166.37	742,010.20
QUALCOMM	110,284	70.60	7,786,050.40
SANDISK CORP	14,057	69.58	978,156.34
SEAGATE TECHNOLOGY	22,571	56.36	1,272,214.41
TE CONNECTIVITY LTD	27,167	69.57	1,890,008.19
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	23.82	405,787.40
WESTERN DIGITAL CORP	15,810	99.23	1,568,826.30
AT&T INC	348,231	34.80	12,118,438.80
CENTURYLINK INC	38,277	34.06	1,303,714.62
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	69,180	5.17	357,660.60
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	19,271	55.55	1,070,504.05
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,698	112.54	978,872.92
SPRINT CORP	53,367	4.63	247,089.21
T-MOBILE US INC	19,668	38.32	753,677.76
VERIZON COMMUNICATIONS	278,719	49.54	13,807,739.26
AES CORP	44,856	13.33	597,930.48
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,080	61.46	435,136.80
AMEREN CORPORATION	15,288	40.44	618,246.72
AMERICAN ELECTRIC POWER	32,718	56.10	1,835,479.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,597	52.71	611,277.87
CALPINE CORP	25,284	20.32	513,770.88
CENTERPOINT ENERGY INC	25,781	20.38	525,416.78
CMS ENERGY CORP	18,893	34.12	644,629.16
CONSOLIDATED EDISON INC	20,080	61.81	1,241,144.80
DOMINION RESOURCES	38,855	70.97	2,757,539.35
DTE ENERGY COMPANY	11,965	79.53	951,576.45
DUKE ENERGY CORP	46,982	75.95	3,568,282.90
EDISON INTL	22,230	61.05	1,357,141.50
ENERGY CORP	12,200	76.55	933,910.00
EVERSOURCE ENERGY	20,795	49.25	1,024,153.75
EXELON CORP	57,455	33.95	1,950,597.25
FIRSTENERGY CORP	28,387	36.07	1,023,919.09
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,591	71.94	402,216.54
MDU RESOURCES GROUP INC	12,385	20.95	259,465.75
NEXTERA ENERGY INC	29,963	102.27	3,064,316.01
NISOURCE INC	21,371	47.36	1,012,130.56
NRG ENERGY INC	21,373	25.42	543,301.66
OGE ENERGY CORP	12,751	31.53	402,039.03
PEPCO HOLDINGS INC	16,437	27.13	445,935.81
PG&E CORP	31,779	53.36	1,695,727.44
PINNACLE WEST CAPITAL	7,037	61.18	430,523.66

	PPL CORPORATION	45,499	34.80	1,583,365.20
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	33,995	43.05	1,463,484.75
	SCANA CORP	8,592	53.25	457,524.00
	SEMPRA ENERGY	15,994	107.98	1,727,032.12
	SOUTHERN CO	59,886	43.51	2,605,639.86
	WISCONSIN ENERGY CORP	14,493	48.33	700,446.69
	XCEL ENERGY INC	33,100	34.13	1,129,703.00
	ALTERA CORPORATION	20,000	46.97	939,400.00
	ANALOG DEVICES	20,600	68.31	1,407,186.00
	APPLIED MATERIALS	81,589	20.36	1,661,152.04
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,892	142.38	2,405,082.96
	BROADCOM CORP-CL A	36,380	56.25	2,046,375.00
	FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,708	44.60	343,776.80
	INTEL CORP	318,104	34.01	10,818,717.04
	KLA-TENCOR CORP	10,702	60.27	645,009.54
	LAM RESEARCH CORP	10,244	82.38	843,900.72
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,680	48.03	801,223.80
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,929	14.20	353,991.80
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,443	34.72	640,340.96
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,001	48.88	635,488.88
	MICRON TECHNOLOGY	71,810	28.28	2,030,786.80
	NVIDIA CORP	35,288	22.14	781,276.32
	QORVO INC	10,323	82.30	849,582.90
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	12,842	107.65	1,382,441.30
	TEXAS INSTRUMENTS	70,259	55.91	3,928,180.69
	XILINX INC	16,914	47.80	808,489.20
	アメリカドル 小計	20,962,807		1,299,916,453.47 (160,838,662,787)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	39.62	348,259.80
	ARC RESOURCES LTD	21,371	22.47	480,206.37
	BAYTEX ENERGY CORP	17,204	20.69	355,950.76
	CAMECO CORP	28,709	18.51	531,403.59
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	73,364	38.24	2,805,439.36
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	10.68	309,506.40
	CENOVUS ENERGY INC	56,678	20.52	1,163,032.56
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,507	28.08	828,556.56
	ENBRIDGE	56,920	60.49	3,443,090.80
	ENCANA CORP	57,917	15.62	904,663.54
	ENERPLUS CORP	14,969	11.80	176,634.20
	HUSKY ENERGY INC	22,657	24.48	554,643.36
	IMPERIAL OIL	19,205	48.77	936,627.85
	INTER PIPELINE LTD	21,128	31.17	658,559.76

KEYERA CORP	11,240	40.30	452,972.00
MEG ENERGY CORP	11,150	19.55	217,982.50
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A	4,574	31.32	143,257.68
PEMBINA PIPELINE CORP	24,385	40.26	981,740.10
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	33.10	303,593.20
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	32.30	298,290.50
SUNCOR ENERGY	97,307	36.50	3,551,705.50
TOURMALINE OIL CORP	11,584	39.02	452,007.68
TRANSCANADA CORP	47,764	54.60	2,607,914.40
VERESEN INC	23,096	18.51	427,506.96
VERMILION ENERGY INC	7,138	52.69	376,101.22
AGNICO EAGLE MINES	13,800	39.91	550,758.00
AGRIUM INC	9,289	130.96	1,216,487.44
BARRICK GOLD CORP	75,173	14.92	1,121,581.16
ELDORADO GOLD CORP	45,613	6.00	273,678.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,609	16.23	642,854.07
FRANCO-NEVADA CORP	10,197	64.43	656,992.71
GOLDCORP INC	58,034	22.14	1,284,872.76
KINROSS GOLD CORP	81,986	2.88	236,119.68
METHANEX CORP	6,468	69.27	448,038.36
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	56,188	40.22	2,259,881.36
SILVER WHEATON CORP	28,647	23.58	675,496.26
TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	15.09	562,343.94
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	69.31	299,904.37
YAMANA GOLD INC	59,651	4.48	267,236.48
BOMBARDIER B	157,835	2.56	404,057.60
CAE INC	18,429	14.97	275,882.13
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	24.95	293,511.80
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,840	44.91	531,734.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,455	73.95	4,026,947.25
CP RAILWAY LIMITED	10,799	208.80	2,254,831.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,940	71.98	1,939,141.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,244	39.60	682,862.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,714	47.75	607,093.50
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	25,738	27.67	712,170.46
THOMSON REUTERS CORP	23,276	50.10	1,166,127.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,298	131.50	696,687.00
DOLLARAMA INC	8,315	70.29	584,461.35
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,506	48.50	1,431,041.00
EMPIRE CO LTD 'A'	3,833	90.25	345,928.25
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	23.32	128,586.48
LOBLAW COMPANIES LTD	14,753	64.13	946,109.89

	METRO INC	15,750	34.88	549,360.00
	WESTON (GEORGE) LTD	3,518	103.12	362,776.16
	SAPUTO INC	16,769	34.34	575,847.46
	CATAMARAN CORPORATION	13,435	74.83	1,005,341.05
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	21,283	300.48	6,395,115.84
	BANK MONTREAL	43,357	77.11	3,343,258.27
	BANK NOVA SCOTIA	81,223	64.57	5,244,569.11
	CANADIAN IMPERIAL BANK	26,763	95.63	2,559,345.69
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,214	49.32	1,144,914.48
	ROYAL BANK OF CANADA	97,236	80.05	7,783,741.80
	TORONTO-DOMINION BANK	125,110	55.37	6,927,340.70
	CI FINANCIAL CORP	15,063	35.00	527,205.00
	IGM FINANCIAL INC	7,685	42.25	324,691.25
	ONEX CORP	5,970	71.39	426,198.30
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,347	620.88	836,325.36
	GREAT-WEST LIFECO INC	19,628	36.82	722,702.96
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	42.91	296,980.11
	INTACT FINANCIAL CORP	8,577	88.53	759,321.81
	MANULIFE FINANCIAL CORP	132,488	23.02	3,049,873.76
	POWER CORP OF CANADA	24,148	32.45	783,602.60
	POWER FINANCIAL CORP	16,605	36.39	604,255.95
	SUN LIFE FINANCIAL INC	41,708	40.00	1,668,320.00
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	57,210	44.69	2,556,714.90
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,116	19.04	211,648.64
	CGI GROUP INC - CL A	14,453	52.65	760,950.45
	CONSTELLATION SOFTWARE -RTS	1,236	0.25	309.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,236	515.95	637,714.20
	OPEN TEXT CORP	8,064	52.85	426,182.40
	BCE INC	10,313	54.67	563,811.71
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	23,300	43.14	1,005,162.00
	TELUS CORP	16,454	42.54	699,953.16
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	43.29	226,882.89
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	36.76	267,134.92
	FORTIS INC	17,872	38.11	681,101.92
	TRANSALTA CORP	15,621	10.80	168,706.80
	カナダドル 小計	2,615,726		104,930,425.40 (10,452,119,674)
ユーロ	ENI	171,351	16.57	2,839,286.07
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	10.81	279,146.63
	NESTE OIL OYJ	9,335	23.38	218,252.30
	OMV AG	9,889	25.76	254,790.08
	REPSOL SA	71,868	17.54	1,260,564.72

SAIPEM	15,941	11.63	185,393.83
TECHNIP S.A.	7,230	60.58	437,993.40
TENARIS SA	34,866	13.19	459,882.54
TOTAL SA	143,721	46.92	6,744,107.92
VOPAK	4,507	44.62	201,102.34
AIR LIQUIDE	23,008	120.05	2,762,110.40
AKZO NOBEL	16,338	70.85	1,157,547.30
ARCELORMITTAL	63,516	10.00	635,477.58
ARKEMA	4,293	69.78	299,565.54
BASF SE	60,994	86.24	5,260,122.56
CRH	56,420	25.81	1,456,482.30
EVONIK INDUSTRIES AG	7,472	34.01	254,122.72
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	40.59	171,635.66
HEIDELBERGCEMENT AG	8,992	75.74	681,054.08
IMERYS SA	1,975	69.08	136,433.00
K+S AG	14,212	31.08	441,708.96
KONINKLIJKE DSM NV	12,871	54.82	705,588.22
LAFARGE (FRANCE)	12,815	66.41	851,044.15
LANXESS	5,814	51.71	300,641.94
LINDE AG	12,401	178.50	2,213,578.50
OCI NV	5,400	27.11	146,421.00
SOLVAY SA	4,144	128.20	531,260.80
STORA ENSO OYJ R	36,014	9.67	348,435.45
SYMRISE AG	8,131	58.07	472,167.17
THYSSEN KRUPP	25,892	24.65	638,367.26
UMICORE	6,892	45.41	312,965.72
UPM KYMMENE CORP	36,421	16.66	606,773.86
VOESTALPINE AG	7,829	38.10	298,324.04
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	30.01	427,972.61
AIRBUS GROUP NV	39,385	64.64	2,545,846.40
ALSTOM RGPT	13,896	28.95	402,289.20
ANDRITZ AG	5,242	56.54	296,382.68
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	45.99	269,179.47
BOUYGUES ORD	13,925	36.84	512,997.00
BRENTAG AG	9,887	55.64	550,112.68
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	8.17	537,310.05
FERROVIAL SA	32,322	20.02	647,248.05
FINMECCANICA SPA	28,941	12.20	353,080.20
GEA GROUP AG	11,636	44.96	523,212.74
KONE OYJ-B	22,070	39.08	862,495.60
KONINKLIJKE PHILIPS	61,089	25.20	1,539,442.80
LEGRAND SA	18,099	52.38	948,025.62

MAN SE	2,329	94.09	219,135.61
METSO OYJ	6,575	26.32	173,054.00
OSRAM LICHT AG	5,675	49.60	281,508.37
PRYSMIAN SPA	14,715	20.83	306,513.45
REXEL SA	18,266	16.83	307,416.78
SAFRAN SA	19,667	66.73	1,312,378.91
SAINT-GOBAIN	32,316	43.56	1,407,846.54
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37,378	71.06	2,656,080.68
SIEMENS	52,667	97.37	5,128,185.79
THALES SA	6,178	57.60	355,852.80
VALLOUREC	7,471	22.55	168,471.05
VINCI S.A.	31,162	55.39	1,726,063.18
WARTSILA OYJ	9,741	41.18	401,134.38
ZARDOYA OTIS SA	13,496	11.68	157,633.28
ZODIAC AEROSPACE	13,148	34.03	447,426.44
BUREAU VERITAS SA	18,808	21.24	399,575.96
EDENRED	13,303	23.36	310,824.59
RANDSTAD HOLDING NV	7,953	54.12	430,416.36
SOCIETE BIC SA	1,899	150.75	286,274.25
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	29,721	16.26	483,412.06
ADP	1,728	113.50	196,128.00
AENA SA	5,053	96.75	488,877.75
ATLANTIA SPA	27,137	23.60	640,433.20
BOLLORE	61,805	5.25	324,908.88
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	13.17	194,080.92
DEUTSCHE POST AG-REG	64,788	28.15	1,823,782.20
FRAPORT AG	2,319	61.13	141,760.47
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,159	13.77	415,289.43
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	7.97	480,514.12
TNT EXPRESS	29,257	7.68	224,957.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,084	103.05	2,275,756.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	77.34	276,954.54
CONTINENTAL AG	7,210	215.40	1,553,034.00
DAIMLER AG	64,947	87.58	5,688,058.26
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	60,311	14.67	884,762.37
MICHELIN	12,616	99.89	1,260,212.24
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	29.85	229,755.45
PEUGEOT SA	29,979	19.25	577,095.75
PIRELLI & CO	16,123	15.53	250,390.19
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,392	82.18	854,014.56
RENAULT SA	13,059	96.55	1,260,846.45
VALEO SA	5,433	149.90	814,406.70

VOLKSWAGEN AG-PFD	10,841	226.85	2,459,280.85
VOLKSWAGEN STAMM	2,554	223.95	571,968.30
ADIDAS AG	14,173	72.96	1,034,062.08
CHRISTIAN DIOR	3,494	185.30	647,438.20
HERMES INTERNATIONAL	1,648	350.50	577,624.00
HUGO BOSS AG	4,618	105.35	486,506.30
KERING	4,833	162.40	784,879.20
LUXOTTICA GROUP SPA	11,110	61.15	679,376.50
LVMH	18,623	166.55	3,101,660.65
ACCOR	14,341	50.99	731,247.59
SODEXO	6,061	95.10	576,401.10
ALTICE SA	5,811	122.10	709,523.10
AXEL SPRINGER SE	2,489	51.51	128,208.39
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	31.47	376,884.72
JC DECAUX SA	4,674	37.53	175,415.22
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	122.50	162,067.50
LAGADERE S.C.A	9,057	27.90	252,690.30
NUMERICABLE-SFR	5,900	53.17	313,703.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	13,995	44.51	622,987.42
PUBLICIS GROUPE	12,832	75.07	963,298.24
REED ELSEVIER NV	45,317	22.71	1,029,375.65
RTL GROUP	2,486	83.34	207,188.21
SES	22,020	32.78	721,815.60
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	49.64	159,840.80
VIVENDI	76,471	23.55	1,801,274.40
WOLTERS KLUWER	19,392	28.80	558,489.60
INDITEX	73,892	30.73	2,271,070.62
CARREFOUR	36,495	31.68	1,156,161.60
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	73.10	269,519.70
COLRUYT SA	4,415	41.78	184,458.70
DELHAIZE GROUP	7,165	82.49	591,040.85
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	7.40	341,983.60
JERONIMO MARTINS	15,262	12.71	193,980.02
KONINKLIJKE AHOLD NV	61,242	18.92	1,159,004.85
METRO STAMM	10,502	32.14	337,534.28
ANHEUSER-BUSCH INBEV	53,621	112.25	6,018,957.25
DANONE (GROUPE)	38,736	64.17	2,485,689.12
HEINEKEN HOLDING NV	6,365	64.11	408,060.15
HEINEKEN NV	15,768	72.58	1,144,441.44
KERRY GROUP PLC-A	11,078	68.79	762,055.62
PERNOD-RICARD	14,278	113.25	1,616,983.50
REMY COINTREAU	1,575	67.10	105,682.50

UNILEVER NV-CVA	108,771	39.54	4,301,349.19
BEIERSDORF AG	6,416	83.68	536,890.88
HENKEL AG & CO KGAA	7,179	93.08	668,221.32
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,990	110.40	1,323,696.00
LOREAL	16,775	176.50	2,960,787.50
ESSILOR INTERNATIONAL	13,759	113.70	1,564,398.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,677	79.19	1,162,271.63
FRESENIUS SE&CO KGAA	25,466	57.94	1,475,500.04
BAYER	55,680	133.40	7,427,712.00
GRIFOLS SA	9,815	37.15	364,676.32
MERCK KGAA	9,075	100.20	909,315.00
ORION OYJ-CLASS B	5,839	30.19	176,279.41
QIAGEN N.V.	14,956	22.78	340,772.46
SANOFI	79,277	92.27	7,314,888.79
UCB (GROUPE)	8,266	64.64	534,314.24
BANCO BILBAO VIZCAYA	434,949	9.09	3,954,556.30
BANCO DE SABADELL SA	346,738	2.31	801,658.25
BANCO SANTANDER SA	977,143	6.59	6,440,349.51
BANKINTER SA	46,530	6.78	315,845.64
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.08	212,038.69
BNP PARIBAS	71,799	56.15	4,031,513.85
CAIXABANK	156,396	4.40	689,237.17
COMMERZBANK AG	75,767	12.25	928,524.58
CREDIT AGRICOLE SA	67,420	13.93	939,497.70
ERSTE GROUP BANK AG	17,314	26.42	457,435.88
ING GROEP NV-CVA	262,803	15.14	3,980,151.43
INTESA SANPAOLO	869,694	3.35	2,915,214.28
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.91	189,410.00
KBC GROEP NV	17,786	61.70	1,097,396.20
NATIXIS	66,904	6.92	463,176.39
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	13.95	128,298.15
SOCIETE GENERALE	49,708	43.54	2,164,534.86
UNICREDIT SPA	331,855	6.41	2,127,190.55
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,870	7.54	496,989.15
DEUTSCHE BANK NAMEN	93,568	28.01	2,620,839.68
DEUTSCHE BOERSE	13,320	74.68	994,737.60
EURAZEO	2,763	62.55	172,825.65
EXOR SPA	7,381	45.32	334,506.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,049	76.25	384,986.25
MEDIOBANCA	41,923	9.44	395,962.73
WENDEL	1,898	116.75	221,591.50
AEGON	127,254	7.04	896,249.92

AGEAS	13,863	34.55	478,966.65
ALLIANZ SE-REG	30,925	146.80	4,539,790.00
ASSICURAZIONI GENERALI	81,295	17.97	1,460,871.15
AXA	133,409	23.74	3,167,796.70
CNP ASSURANCES	11,830	15.46	182,950.95
DELTA LLOYD NV	13,360	16.14	215,697.20
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	89.57	354,428.49
MAPFRE SA	65,064	3.30	214,776.26
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,758	171.35	2,014,733.30
NN GROUP NV	12,045	26.18	315,398.32
SAMPO OYJ-A SHS	31,087	43.64	1,356,636.68
SCOR SE	10,368	31.79	329,650.56
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	71,163	2.50	177,907.50
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIE	23,417	29.50	690,801.50
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	18,648	22.72	423,682.56
DEUTSCHE WOHNEN AG-RTS	18,648	0.11	2,051.28
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	31,138	42.35	1,318,849.99
ATOS	5,213	71.73	373,928.49
CAP GEMINI SA	10,594	81.59	864,364.46
DASSAULT SYSTEMES SA	8,235	71.92	592,261.20
GEMALTO	5,820	81.87	476,483.40
SAP SE	66,411	68.12	4,523,917.32
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	43.19	343,230.93
ALCATEL-LUCENT	181,124	3.65	662,732.71
NOKIA CORP	250,293	6.75	1,690,729.21
BELGACOM	10,096	31.81	321,204.24
DEUTSCHE TELEKOM	211,183	16.08	3,396,878.55
ELISA A	10,064	27.47	276,458.08
ILIAD SA	1,701	210.00	357,210.00
KPN (KON.)	206,162	3.36	693,116.64
ORANGE	125,419	14.68	1,841,778.01
TELECOM ITALIA ORD	678,554	1.13	772,194.45
TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.90	373,970.52
TELEFONICA	299,500	13.01	3,897,992.50
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	5.06	190,375.21
E.ON SE	133,954	13.68	1,832,490.72
ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	22.58	356,075.11
ENAGAS	15,285	26.36	402,912.60
ENDESA	20,295	17.18	348,668.10
ENEL	481,534	4.45	2,145,715.50
ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.70	210,346.78
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.57	570,037.32

	FORTUM OYJ	28,668	17.46	500,543.28
	GAS NATURAL SDG SA	23,632	22.54	532,665.28
	GDF SUEZ	98,800	18.83	1,860,404.00
	IBERDROLA SA	371,329	6.34	2,356,825.16
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,272	76.97	559,725.84
	RWE STAMM	30,993	21.85	677,197.05
	SNAM SPA	137,387	4.50	618,241.50
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	17.88	371,367.60
	TERNA SPA	94,904	4.34	412,452.78
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,385	19.17	563,310.45
	ASML HOLDING NV	23,858	103.80	2,476,460.40
	INFINEON TECHNOLOGIES	79,114	12.17	962,817.38
	STMICROELECTRONICS	42,509	7.85	333,738.15
	ユーロ 小計	14,998,385		247,074,599.01 (33,505,786,371)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	9.51	249,066.90
	BG GROUP	226,142	11.51	2,604,025.13
	BP PLC	1,227,175	4.53	5,562,784.27
	PETROFAC LTD	16,711	8.89	148,560.79
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	262,104	19.54	5,121,512.16
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	164,712	19.85	3,269,533.20
	TULLOW OIL PLC	67,219	3.91	263,027.94
	ANGLO AMERICAN PLC	92,618	10.35	958,596.30
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	7.56	192,160.08
	BHP BILLITON PLC	139,880	13.76	1,925,448.20
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	29.77	257,957.05
	FRESNILLO PLC	17,743	7.40	131,386.91
	GLENCORE PLC	734,567	2.85	2,099,025.20
	JOHNSON MATTHEY PLC	13,109	35.71	468,122.39
	LONMIN PLC	7,926	1.36	10,811.06
	MONDI PLC	26,172	14.93	390,747.96
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,987	46.82	280,311.34
	REXAM PLC	44,988	5.66	254,857.02
	RIO TINTO PLC REG	84,235	28.84	2,429,337.40
	ASHTREAD GROUP PLC	32,745	11.61	380,169.45
	BAE SYSTEMS PLC	210,041	5.21	1,095,363.81
	BUNZL PLC	21,394	19.06	407,769.64
	COBHAM PLC	72,398	2.98	216,180.42
	IMI PLC	17,506	12.53	219,350.18
	MEGGITT PLC	50,990	5.13	261,833.65
	MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.67	172,030.77
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	125,506	10.15	1,273,885.90

SMITHS GROUP PLC	24,869	12.01	298,676.69
TRAVIS PERKINS PLC	17,877	22.38	400,087.26
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	19.76	264,586.40
WOLSELEY LTD	17,041	40.80	695,272.80
AGGREKO PLC	18,794	16.28	305,966.32
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,206	11.31	217,219.86
CAPITA GROUP PLC	42,129	12.62	531,667.98
EXPERIAN PLC	66,036	12.55	828,751.80
G4S PLC	100,693	3.01	303,589.39
INTERTEK GROUP PLC	10,210	25.37	259,027.70
EASYJET PLC	11,633	16.24	188,919.92
ROYAL MAIL PLC	44,937	5.26	236,368.62
NEW GKN	102,805	3.68	379,042.03
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	70,432	6.00	422,944.16
BURBERRY GROUP PLC	28,283	17.16	485,336.28
PERSIMMON PLC	19,808	19.66	389,425.28
TAYLOR WIMPAY PLC	230,785	1.84	426,490.68
CARNIVAL PLC	11,844	32.10	380,192.40
COMPASS GROUP PLC	110,958	11.56	1,282,674.48
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,805	27.98	414,243.90
MERLIN ENTERTAINME	48,554	4.60	223,639.72
TUI AG-DI	32,064	11.88	380,920.32
WHITBREAD PLC	12,139	51.85	629,407.15
WILLIAM HILL	55,917	4.25	237,815.00
ITV PLC	256,099	2.74	702,991.75
PEARSON	54,591	13.35	728,789.85
REED ELSEVIER PLC	75,619	11.06	836,346.14
SKY PLC	68,919	10.68	736,054.92
WPP PLC	87,456	15.77	1,379,181.12
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.73	316,004.43
KINGFISHER PLC	164,264	3.75	615,990.00
MARKS & SPENCER GROUP PLC	114,726	5.87	673,441.62
NEXT PLC	9,848	75.45	743,031.60
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	6.86	124,124.84
MORRISON SUPERMARKETS	135,997	1.77	240,714.69
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.57	223,411.63
TESCO	540,022	2.16	1,168,607.60
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	23,781	29.50	701,539.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	125,536	36.91	4,634,161.44
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	14.62	204,665.38
DIAGEO	169,916	18.41	3,129,003.14
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	63,414	33.72	2,138,320.08

	SABMILLER PLC	64,087	35.74	2,290,469.38
	TATE & LYLE	29,189	5.85	170,755.65
	UNILEVER PLC	85,046	29.11	2,475,689.06
	RECKITT BENCKISER PLC	42,819	59.11	2,531,031.09
	SMITH & NEPHEW PLC	59,650	11.70	697,905.00
	ASTRAZENECA	85,181	44.92	3,826,330.52
	GLAXOSMITHKLINE	327,532	14.60	4,781,967.20
	SHIRE PLC	39,053	56.50	2,206,494.50
	BARCLAYS	1,111,075	2.71	3,012,124.32
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,311,820	6.23	8,180,509.52
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,847,097	0.87	3,383,137.10
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	174,975	3.48	609,787.87
	STANDARD CHARTERED PLC	166,880	10.57	1,763,921.60
	3I GROUP PLC	62,380	5.64	352,135.10
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	4.51	263,571.08
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,796	12.93	255,962.28
	ICAP PLC	42,238	5.56	234,843.28
	INVESTEC PLC	36,474	6.12	223,220.88
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	20,896	24.89	520,101.44
	SCHRODERS PLC	7,932	34.06	270,163.92
	ADMIRAL GROUP PLC	15,994	14.93	238,790.42
	AVIVA PIC	267,774	5.28	1,413,846.72
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	103,443	3.37	348,602.91
	LEGAL & GENERAL GROUP	402,548	2.68	1,081,243.92
	OLD MUTUAL PLC	333,096	2.26	754,462.44
	PRUDENTIAL	172,943	16.32	2,822,429.76
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	4.31	303,219.71
	STANDARD LIFE PLC	133,270	4.93	657,021.10
	SAGE GROUP PLC	69,473	5.77	401,206.57
	BT GROUP PLC	565,919	4.49	2,545,220.70
	INMARSAT PLC	27,503	10.04	276,130.12
	VODAFONE GROUP PLC	1,785,970	2.53	4,531,005.89
	CENTRICA PLC	331,184	2.78	923,009.80
	NATIONAL GRID PLC	249,311	9.35	2,332,055.09
	SEVERN TRENT PLC	15,457	22.15	342,372.55
	SSE PLC	65,691	16.73	1,099,010.43
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	43,604	10.04	437,784.16
	ARM HOLDINGS PLC	93,244	11.68	1,089,089.92
	イギリスポンド 小計	19,326,751		119,769,123.99 (22,704,632,834)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	17.80	405,768.80
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	405.00	193,185.00

	GIVAUDAN-REG	628	1,765.00	1,108,420.00
	HOLCIM LTD	15,561	75.90	1,181,079.90
	SIKA AG-BR	138	3,240.00	447,120.00
	SYNGENTA AG	6,316	423.60	2,675,457.60
	ABB LTD	146,912	20.84	3,061,646.08
	GEBERIT AG-REG	2,584	342.50	885,020.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	164.60	222,539.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,860	166.10	475,046.00
	SULZER AG-REG	1,607	104.20	167,449.40
	ADECCO	11,912	76.25	908,290.00
	SGS SA	351	1,824.00	640,224.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,294	133.80	440,737.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	34,904	84.15	2,937,171.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,114	378.90	800,994.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,872	75.50	216,836.00
	ARYZTA AG	5,619	61.20	343,882.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,073.00	141,636.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	5,020.00	311,240.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	59,360.00	415,520.00
	NESTLE SA - REGISTERED	216,451	73.75	15,963,261.25
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,452	141.70	489,148.40
	ACTELION LTD-REG	6,571	133.20	875,257.20
	LONZA GROUP AG-REG	3,394	135.40	459,547.60
	NOVARTIS	154,415	98.45	15,202,156.75
	ROCHE HOLDING GENUSS	47,181	282.50	13,328,632.50
	CREDIT SUISSE GROUP AG	104,088	25.17	2,619,894.96
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,356	52.00	746,512.00
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	66.80	126,652.80
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,159	291.50	337,848.50
	UBS GROUP AG	247,721	20.70	5,127,824.70
	BALOISE HOLDING AG	3,124	119.90	374,567.60
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,095	229.60	481,012.00
	SWISS RE LTD	24,427	85.15	2,079,959.05
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,162	302.80	3,077,053.60
	SWISS PRIME SITE-REG	3,845	76.10	292,604.50
	SWISSCOM	1,802	552.50	995,605.00
	スイスフラン 小計	1,108,637		80,556,802.59 (10,569,858,067)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	136.10	1,931,395.10
	BOLIDEN AB	18,196	184.80	3,362,620.80
	ALFA LAVAL AB	19,284	164.80	3,178,003.20
	ASSA ABLOY B	22,455	510.50	11,463,277.50

	ATLAS COPCO A	45,041	262.80	11,836,774.80	
	ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION	24,898	5.95	148,143.10	
	ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	45,041	5.95	267,993.95	
	ATLAS COPCO B	24,898	233.60	5,816,172.80	
	SANDVIK AB	67,396	105.40	7,103,538.40	
	SKANSKA B	26,115	177.30	4,630,189.50	
	SKF AB-B	27,040	209.40	5,662,176.00	
	VOLVO B	103,261	114.50	11,823,384.50	
	SECURITAS B	22,844	116.00	2,649,904.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,271	261.60	3,994,893.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	65.30	1,812,597.40	
	HENNES & MAURITZ B	63,278	342.10	21,647,403.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	302.30	1,732,179.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	257.30	3,193,093.00	
	SCA SV CELLULOSA B	40,560	227.60	9,231,456.00	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	61.25	1,292,558.75	
	GETINGE AB-B SHS	12,725	206.90	2,632,802.50	
	NORDEA BANK AB	207,963	111.90	23,271,059.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	104,072	106.70	11,104,482.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	102,174	129.90	13,272,402.60	
	SWEDBANK AB-A	61,784	199.30	12,313,551.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	170.50	2,181,036.00	
	INVESTOR AB-B SHS	31,222	340.70	10,637,335.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,668	287.00	4,209,716.00	
	ERICSSON (LM) B	202,794	97.10	19,691,297.40	
	HEXAGON AB-B SHS	17,545	313.30	5,496,848.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	685.00	2,965,365.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	99.55	2,121,410.50	
	TELIASONERA AB	173,919	50.50	8,782,909.50	
	スウェーデンクローナ 小計	1,614,067		231,457,971.90 (3,383,915,549)	
ノルウェークローネ	SEADRILL LTD	23,438	95.15	2,230,125.70	
	STATOIL ASA	76,364	145.80	11,133,871.20	
	SUBSEA 7 SA	18,360	81.80	1,501,848.00	
	NORSK HYDRO	83,896	35.48	2,976,630.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,268	391.20	4,408,041.60	
	ORKLA	58,072	61.60	3,577,235.20	
	DNB ASA	63,701	137.00	8,727,037.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	122.00	1,644,682.00	
	TELENOR ASA	47,978	176.00	8,444,128.00	
	ノルウェークローネ 小計	396,558		44,643,598.78 (708,493,912)	

デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	16,749	328.50	5,502,046.50	
	VESTAS WIND SYSEMS	14,394	347.90	5,007,672.60	
	ISS A/S	11,483	235.20	2,700,801.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	245	12,780.00	3,131,100.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	497	13,200.00	6,560,400.00	
	DSV A/S	11,156	234.40	2,614,966.40	
	PANDORA A/S	7,298	692.50	5,053,865.00	
	CARLSBERG AS-B	6,869	640.00	4,396,160.00	
	COLOPLAST-B	6,961	514.50	3,581,434.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	567.00	841,428.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	127,246	386.50	49,180,579.00	
	DANSKE BANK A/S	49,086	200.70	9,851,560.20	
	TRYG A/S	6,445	140.90	908,100.50	
	TDC A/S	52,498	50.50	2,651,149.00	
デンマーククローネ 小計		312,411		101,981,263.30 (1,854,019,366)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,386	33.82	689,454.52	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	80,275	12.82	1,029,125.50	
	SANTOS	74,790	8.17	611,034.30	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	51,156	36.42	1,863,101.52	
	WORLEYPARSONS LTD	15,026	10.94	164,384.44	
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.70	290,630.89	
	AMCOR	77,157	14.47	1,116,461.79	
	BHP BILLITON LTD	214,975	29.20	6,277,270.00	
	BORAL LIMITED	46,867	6.26	293,387.42	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	2.43	219,861.54	
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	8.73	249,285.15	
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.96	436,344.48	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	17.45	513,867.60	
	NEWCREST MINING LIMITED	56,897	13.90	790,868.30	
	ORICA LTD	22,850	21.58	493,103.00	
	RIO TINTO LTD	30,548	57.65	1,761,092.20	
	SOUTH32 LTD	354,855	2.18	773,583.90	
	CIMIC GROUP LIMITED	5,336	23.89	127,477.04	
	BRAMBLES LTD	99,661	11.37	1,133,145.57	
	SEEK LTD	21,328	16.89	360,229.92	
	ASCIANO GROUP	64,054	6.76	433,005.04	
	AURIZON HOLDINGS LTD	136,201	5.25	715,055.25	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	36,374	3.45	125,490.30	
	TRANSURBAN GROUP	127,628	10.14	1,294,147.92	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,905	7.90	362,649.50		
CROWN RESORTS LTD	21,269	12.92	274,795.48		

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.92	149,836.96	
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.95	310,518.45	
	TATTS GROUP LTD	93,361	4.09	381,846.49	
	REA GROUP LTD	3,593	39.62	142,354.66	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	4.60	141,735.20	
	WESFARMERS LTD	77,044	43.60	3,359,118.40	
	WOOLWORTHS LTD	86,130	28.01	2,412,501.30	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	10.05	381,940.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	5.30	204,325.60	
	COCHLEAR LIMITED	3,856	87.50	337,400.00	
	HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.79	247,191.21	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,644	66.02	702,716.88	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	19.95	493,363.50	
	CSL LIMITED	32,222	92.60	2,983,757.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	184,483	32.72	6,036,283.76	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	13.05	318,119.85	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	12.18	380,076.90	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	108,104	83.50	9,026,684.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	175,529	33.44	5,869,689.76	
	WESTPAC BANKING	207,683	33.12	6,878,460.96	
	ASX LTD	12,620	41.43	522,846.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	19,165	81.00	1,552,365.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	7.74	156,556.98	
	AMP LTD	188,491	6.58	1,240,270.78	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	149,680	5.64	844,195.20	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	213,373	2.15	458,751.95	
	QBE INSURANCE GROUP	96,940	14.58	1,413,385.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	81,936	13.42	1,099,581.12	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	12.67	390,451.39	
	TELSTRA CORP	277,305	6.15	1,705,425.75	
	TPG TELECOM LTD	20,000	8.93	178,600.00	
	AGL ENERGY LTD	43,547	16.13	702,413.11	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.51	181,547.30	
	オーストラリアドル 小計	4,631,918		73,603,164.23 (6,979,788,063)	
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	8.66	403,123.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	4.86	297,237.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.80	171,724.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	108,032	2.73	295,467.52	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	6.20	158,118.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.29	253,145.76	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.75	169,787.75	

	ニュージーランドドル 小計	435,546		1,748,605.03 (155,188,696)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	144,000	115.00	16,560,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	12.66	1,253,340.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	20.30	1,745,800.00	
	MTR CORP	94,000	37.05	3,482,700.00	
	LI & FUNG	378,800	6.61	2,503,868.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	26.90	2,515,150.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	27.15	1,262,475.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	148,000	37.15	5,498,200.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	14.54	977,088.00	
	SANDS CHINA LTD	154,000	30.50	4,697,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.24	1,199,520.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	9.97	1,316,040.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	14.90	1,531,720.00	
	WH GROUP LTD	465,000	5.84	2,715,600.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	34.65	2,936,934.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	236,000	32.10	7,575,600.00	
	HANG SENG BANK	48,800	156.50	7,637,200.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	7.11	910,080.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	75,500	300.20	22,665,100.00	
	AIA GROUP LTD	804,800	50.60	40,722,880.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	93,000	121.00	11,253,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	139,000	25.25	3,509,750.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	67,600	62.50	4,225,000.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	35.90	1,436,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	33.35	1,283,975.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	323,500	10.38	3,357,930.00	
	SINO LAND CO	227,400	13.48	3,065,352.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	132.60	15,514,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	104.40	4,228,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	26.85	1,858,020.00	
	WHARF HOLDINGS	96,000	53.65	5,150,400.00	
WHELOCK & CO LTD	65,000	43.25	2,811,250.00		
PCCW LTD	232,000	4.99	1,157,680.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	64.60	2,648,600.00		
CLP HOLDINGS	126,500	67.60	8,551,400.00		
HONG KONG & CHINA GAS	445,163	18.62	8,288,935.06		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	88,000	73.50	6,468,000.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	81.60	1,126,080.00		
	香港ドル 小計	5,749,823		215,640,067.06 (3,441,615,470)	

シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	94,300	8.81	830,783.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.81	241,026.03	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	4.15	236,550.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	2.99	182,091.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.45	376,050.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.47	196,175.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	3.07	445,150.00	
	SINGAPORE AIRLINES	31,533	11.43	360,422.19	
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.92	393,125.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	124,800	4.13	515,424.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	39.85	239,100.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.41	173,885.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	150,200	3.36	504,672.00	
	DBS GROUP	118,400	20.34	2,408,256.00	
	OCBC BANK	197,100	10.25	2,020,275.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	85,200	23.63	2,013,276.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	8.69	477,950.00	
	CAPITALAND LTD	165,500	3.52	582,560.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.41	249,840.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	199,000	2.79	555,210.00	
UOL GROUP LIMITED	32,500	7.45	242,125.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	544,343	4.12	2,242,693.16		
STARHUB LTD	38,000	4.00	152,000.00		
シンガポールドル 小計		3,512,339		15,638,638.38	(1,437,503,639)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	1,118.00	486,330.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	27.68	906,686.08	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,380.00	222,180.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	57,693	234.80	13,546,316.40	
	BANK HAPOLIM BM	75,703	20.30	1,536,770.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	15.13	1,437,183.57	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	44.02	360,964.00	
	AZRIELI GROUP	3,726	165.40	616,280.40	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	243.00	815,994.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.48	723,381.84	
イスラエルシェケル 小計		388,654		20,652,087.19	(660,453,748)
合 計		76,053,622		256,692,038,176	(256,692,038,176)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	218,785.00	
		アメリカドル 小計		329,000	218,785.00 (27,070,268)
	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	685,354.00	
		LEND LEASE GROUP	33,337	548,393.65	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	399,080.76	
	オーストラリアドル 小計		178,591	1,632,828.41 (154,841,118)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,834,470.00	
香港ドル 小計		187,000	1,834,470.00 (29,278,141)		
投資信託受益証券合計			694,591	211,189,527 (211,189,527)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,115	477,787.05	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	58,790	534,401.10	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	27,880	2,637,448.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	61,309	633,321.97	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,843	1,483,678.54	
		BOSTON PROPERTIES	10,280	1,352,334.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	318,436.35	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	454,583.37	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,973	207,138.54	
		CROWN CASTLE INTL CORP	22,699	1,867,446.73	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,590	571,235.00	
		DUKE REALTY CORP	21,780	430,372.80	
		EQUINIX INC	3,901	1,050,110.19	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	24,683	1,848,509.87	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,313	970,338.74	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,671	541,879.44	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,287	581,574.42	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	39,489	1,128,200.73	
		HCP INC	30,818	1,205,600.16	
		HEALTH CARE REIT INC	23,030	1,631,214.90	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	51,077	1,026,136.93	
		IRON MOUNTAIN INC	14,074	517,219.50	
		KIMCO REALTY CORP	26,472	643,799.04	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	9,708	344,439.84	
MACERICH CO/THE	9,059	742,022.69			
PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,594	481,730.70			
PROLOGIS INC	33,566	1,351,367.16			

	PUBLIC STORAGE	9,811	1,918,246.72	
	REALTY INCOME CORP	15,686	722,183.44	
	REGENCY CENTERS CORP	6,051	387,506.04	
	SIMON PROPERTY GROUP	21,198	3,896,616.36	
	SL GREEN REALTY CORP	6,544	784,887.36	
	UDR INC	16,019	530,549.28	
	VENTAS INC	21,684	1,455,646.92	
	VORNADO REALTY TRUST	11,047	1,120,055.33	
アメリカドル 小計		671,855	35,848,019.21 (4,435,475,416)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	213,304.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	296,039.92	
カナダドル 小計		19,938	509,344.72 (50,735,827)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	188,796.30	
	GECINA SA	2,522	303,018.30	
	ICADE	2,811	200,789.73	
	KLEPIERRE	10,883	451,862.16	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,704	1,610,971.20	
ユーロ 小計		25,230	2,755,437.69 (373,664,905)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	66,079	577,530.46	
	HAMMERSON PLC	51,215	346,469.47	
	INTU PROPERTIES PLC	56,999	192,029.63	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	53,777	715,771.87	
	SEGRO PLC	48,938	210,922.78	
イギリスポンド 小計		277,008	2,042,724.21 (387,239,228)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	59,205	462,983.10	
	FEDERATION CENTRES	97,628	295,812.84	
	GOODMAN GROUP	119,536	771,007.20	
	GPT GROUP	109,865	502,083.05	
	MIRVAC GROUP	241,410	485,234.10	
	NOVION PROPERTY GROUP	126,802	315,736.98	
	SCENTRE GROUP	376,553	1,479,853.29	
	STOCKLAND	150,322	649,391.04	
	WESTFIELD CORP	126,950	1,202,216.50	
オーストラリアドル 小計		1,408,271	6,164,318.10 (584,562,285)	
香港ドル	LINK REIT	146,500	6,563,200.00	
香港ドル 小計		146,500	6,563,200.00 (104,748,672)	

シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	344,367.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	231,660.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	141,000	311,610.00	
	SUNTEC REIT	173,000	311,400.00	
シンガポールドル 小計		595,300	1,199,037.00	(110,215,481)
投資証券合計		3,144,102	6,046,641,814	(6,046,641,814)
合計			6,257,831,341	(6,257,831,341)

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	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 607銘柄	97.3%			61.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.7%	1.7%
カナダドル	株式 91銘柄	99.5%			4.0%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 228銘柄	98.9%			12.7%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.3%			8.6%
	投資証券 5銘柄			1.7%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			4.0%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.4%			2.7%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券 9銘柄			7.6%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	96.3%			1.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.9%	0.0%

シンガポールドル	株式	23銘柄	92.9%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%			0.3%

(注)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。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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。

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27年 6月30日現在）

資産総額	2,144,820,083円
負債総額	2,282,871円
純資産総額（ - ）	2,142,537,212円
発行済口数	1,366,345,852口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5681円
（1万口当たり純資産額）	（15,681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27年 6月30日現在）

資産総額	269,660,867,498円
負債総額	706,549,534円
純資産総額（ - ）	268,954,317,964円
発行済口数	127,434,977,934口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1105円
（1万口当たり純資産額）	（21,105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27年 6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、会長1名及び副社長、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コンプライアンス・リスク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（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）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 8月28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27年6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	424	6,984,968
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	21	96,399
単位型公社債投資信託	0	0
合計	445	7,081,367

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。

なお、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、当事業年度（自平成26年4月1日至平成27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。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		10,457,599		12,314,170
前払費用		114,325		125,306
未収委託者報酬		2,735,763		4,518,944
未収運用受託報酬		15,268		-
繰延税金資産		144,183		116,728
その他		3,448		8,789
流動資産合計		13,470,589		17,083,939
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67,359	1	57,461
器具備品	1	87,378	1	116,879
有形固定資産合計		154,737		174,341
無形固定資産				
ソフトウェア		203,360		197,641
その他		4,686		7,648
無形固定資産合計		208,046		205,290
投資その他の資産				
投資有価証券		69,583		60,277
長期前払費用		34,773		5,425
長期貸付金		28,838		25,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		117,743		114,415
その他		553		463
貸倒引当金		28,838		25,838
投資その他の資産合計		247,653		205,581
固定資産合計		610,437		585,213
資産合計		14,081,027		17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
預り金		13,353		13,868

未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
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	62,500	65,500
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	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384

営業費用		
支払手数料	10,451,296	12,922,655
広告宣伝費	76,961	130,384
公告費	-	880
調査費	5,091,105	5,994,577
調査費	259,236	279,702
委託調査費	4,830,390	5,712,946
図書費	1,479	1,928
営業雑経費	1,264,334	1,299,065
通信費	17,246	17,456
印刷費	327,214	330,921
協会費	22,524	23,182
諸会費	773	105
情報機器関連費	837,859	857,009
その他営業雑経費	58,716	70,390
営業費用合計	16,883,698	20,347,563
一般管理費		
給料	2,201,964	2,185,555
役員報酬	102,330	89,055
給料・手当	1,846,450	1,839,000
賞与	253,183	257,499
退職給付費用	72,029	71,270
役員退職慰労金	1,070	-
福利費	207,122	212,286
交際費	2,758	4,491
旅費交通費	45,973	55,788
租税公課	42,862	42,868
不動産賃借料	130,938	130,938
寄付金	3,385	-
減価償却費	119,445	129,285
諸経費	1 219,615	1 212,345
一般管理費合計	3,047,165	3,044,830
営業利益	2,898,479	4,775,990

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	1,775	1,936
営業外収益合計	16,027	18,203
営業外費用		

長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				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	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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

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26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
建 物	35,517	千円	45,415	千円
器具備品	188,630	"	218,270	"
計	224,147	"	263,685	"

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月

23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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

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27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27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27年3月31日	平成27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。

当事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

（*）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） 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3） 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	-

当事業年度（平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

（有価証券関係）

1. 其他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成27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	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

（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。

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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
34,635	1,846	117

（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26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）

(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

(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26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付費用	72,029	71,270

(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13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

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主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	102,368 千円	64,846 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	10,277 "	8,356 "
賞与引当金損金算入限度超過額	33,736 "	31,368 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	111,906 "	110,871 "
外国税関連費用損金不算入額	- "	18,609 "
その他	13,094 "	5,855 "
繰延税金資産 合計	271,384 "	239,908 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,503 "	1,546 "
投資有価証券売却益益金不算入額	7,953 "	7,217 "
繰延税金負債 合計	9,457 "	8,763 "
繰延税金資産(負債)の純額	261,926 "	231,144 "

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27年法律第9号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第2号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。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する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27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等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

この税率変更により、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20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
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）	3,178,319千円

（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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

- (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）

当事業年度（平成27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）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56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25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

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

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 8月28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27年3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27年3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	19,107	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SBI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27年3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。

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27年 6月 5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27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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27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

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27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27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

- 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。
- XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。