

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年6月30日
【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33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内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DC外国株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【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】**

DC外国株式インデックス・オープン

本ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

**(2)【内国投資信託受益証券の形態等】**

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

本ファンドについて、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または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

本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、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者は、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。

**(3)【発行（売出）価額の総額】**

10兆円を上限とします。

**(4)【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

「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（純資産総額）をそのときの受益権総口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより、日々変動します。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当りに換算した価額で行われます。）。また、委託者および指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）で入手できますので、委託者または指定販売会社（以下「販売会社」ということがあります。）にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

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。）

**(5)【申込手数料】**

ありません。

**(6)【申込単位】**

1円以上1円単位

**(7)【申込期間】**

継続募集期間

平成26年7月1日から平成26年12月26日まで

継続募集を行う期間は、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って更新されます。

**(8)【申込取扱場所】**

委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

**(9)【払込期日】**

取得申込者は、取得申込みに係る金額を指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとし、各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」または「委託会社」ということがあります。）の指定する口座を經由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託者」または「受託会社」ということがあります。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

**(10)【払込取扱場所】**

申込みの指定販売会社とします。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

**(11)【振替機関に関する事項】**

本ファンドの受益権に係る振替機関は、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

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(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したがって取り扱われるものとします。

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(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したがって支払われます。

投資信託振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステムの帳簿（振替口座簿）への記載・記録によって行われますので、やむを得ない事情等がある場合を除き、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

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

なお、信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

###### 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。

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

###### ? MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）とは

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

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の全額とします。

原則として、毎年9月30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。

同一銘柄の株式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。

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。

## 〔ファンドの商品分類〕

本ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## 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)	補足分類
単位型投信  追加型投信	国内  海外  内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合	インデックス型  特殊型

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 〔分類における定義〕

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	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います。
投資対象地域	海外	目論見書また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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書また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います。
補足分類	インデックス型	目論見書また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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
	年12回 (毎月)	アジア			
不動産投信		オセアニア			
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCI コクサイ・イン デックス(除く日 本、円ベース))
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ( )	アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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いません。

## 〔区分における定義〕

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(株式一般))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。)、実質的に主として株式一般(大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものを含みます。)に投資する旨の記載があるものをいいます。 本ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて株式に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「株式」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券)」となっています。
決算頻度	年1回	目論見書また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います。
投資対象地域	グローバル (日本を除く)	目論見書また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(日本を除きます。)の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書また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きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書また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または為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他 (MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース))	目論見書または投資信託約款において、日経225またはTOPIXにあてはまらない指数(本ファンドにおいては、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース))に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## (2) 【ファンドの沿革】

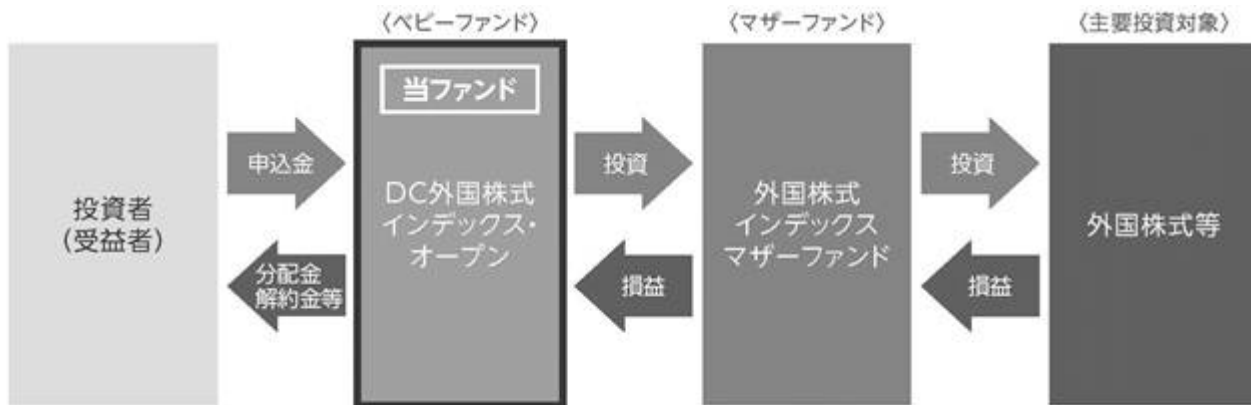
- 平成13年10月1日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
- 平成24年 4月 1日 本ファンドの名称を「すみしん DC外国株式インデックス・オープン」から「DC外国株式インデックス・オープン」に変更
- 本ファンドの主要投資対象である「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

## (イ) ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式（ ）で運用します。

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（DC外国株式インデックス・オープン）とし、その資金をマザーファンド（外国株式インデックス 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。

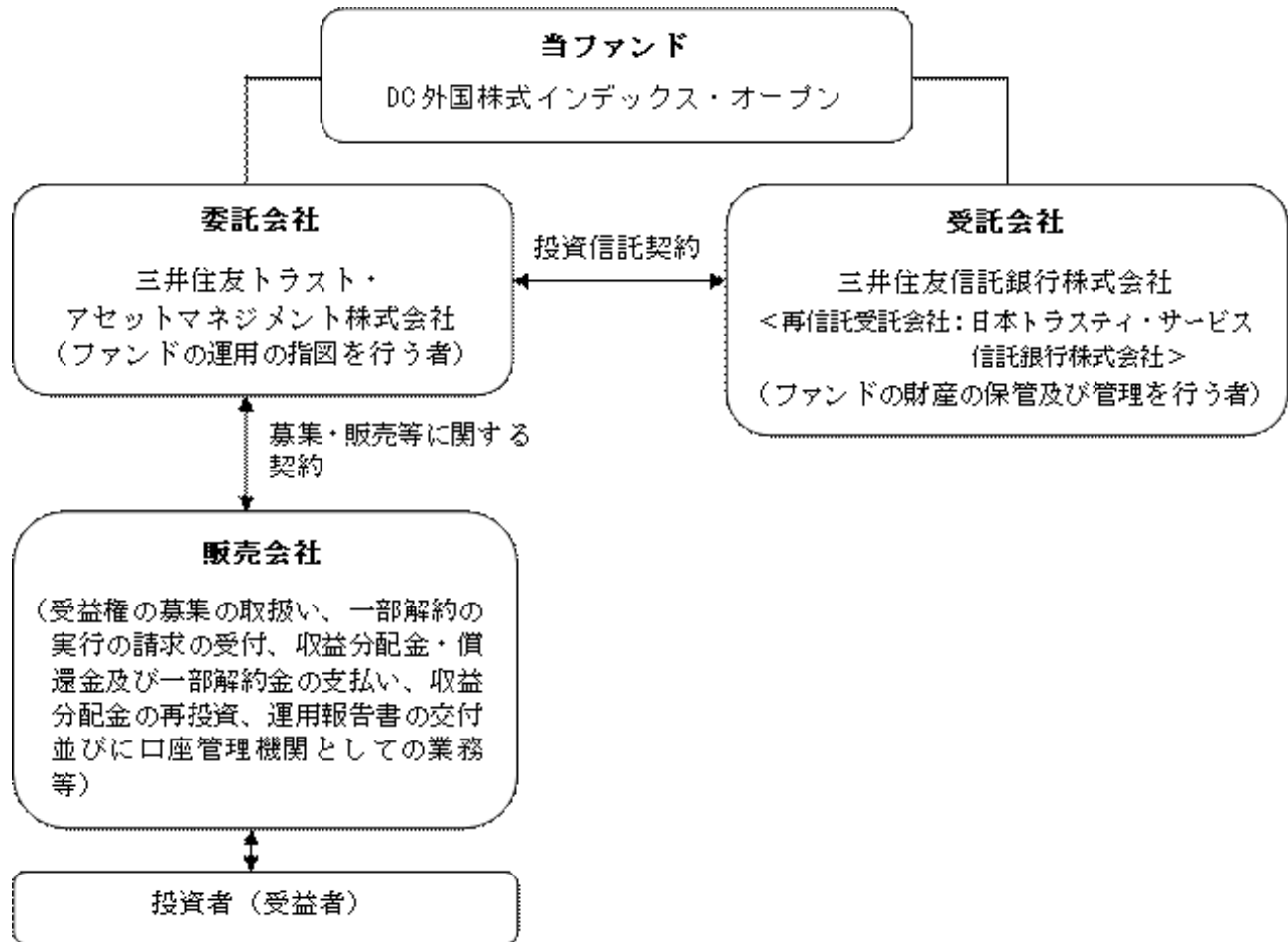


※マザーファンドの運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

## 〈マザーファンドの概要〉

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

## (ロ) 本ファンドの関係法人図





## (八) 委託会社等の概況

## 資本金

平成26年4月30日現在 3億円

## 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

大株主の状況(平成26年4月30日現在)

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】

#### (イ)基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ)運用方法

##### 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。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）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、マザーファンド受益証券に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)実質組入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およ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、および通貨に係る選択権取引なら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、およ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なら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なら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。

#### (参考)「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1.基本方針

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

##### 2.運用方法

###### (1)投資対象

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

###### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

有価証券等の価格変動リスクおよ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、および通貨に係る選択権取引なら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、およ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なら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なら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。

新株引受権証券およ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、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。

同一銘柄の転換社債、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券およ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。

## (2)【投資対象】

(イ)本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、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マザーファンドの受益証券なら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.株券または新株引受権証券

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または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10.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。）および新株予約権証券

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13.証券投資信託また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.投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17.預託証券（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号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

（八）委託者は、信託金を、前記（ロ）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

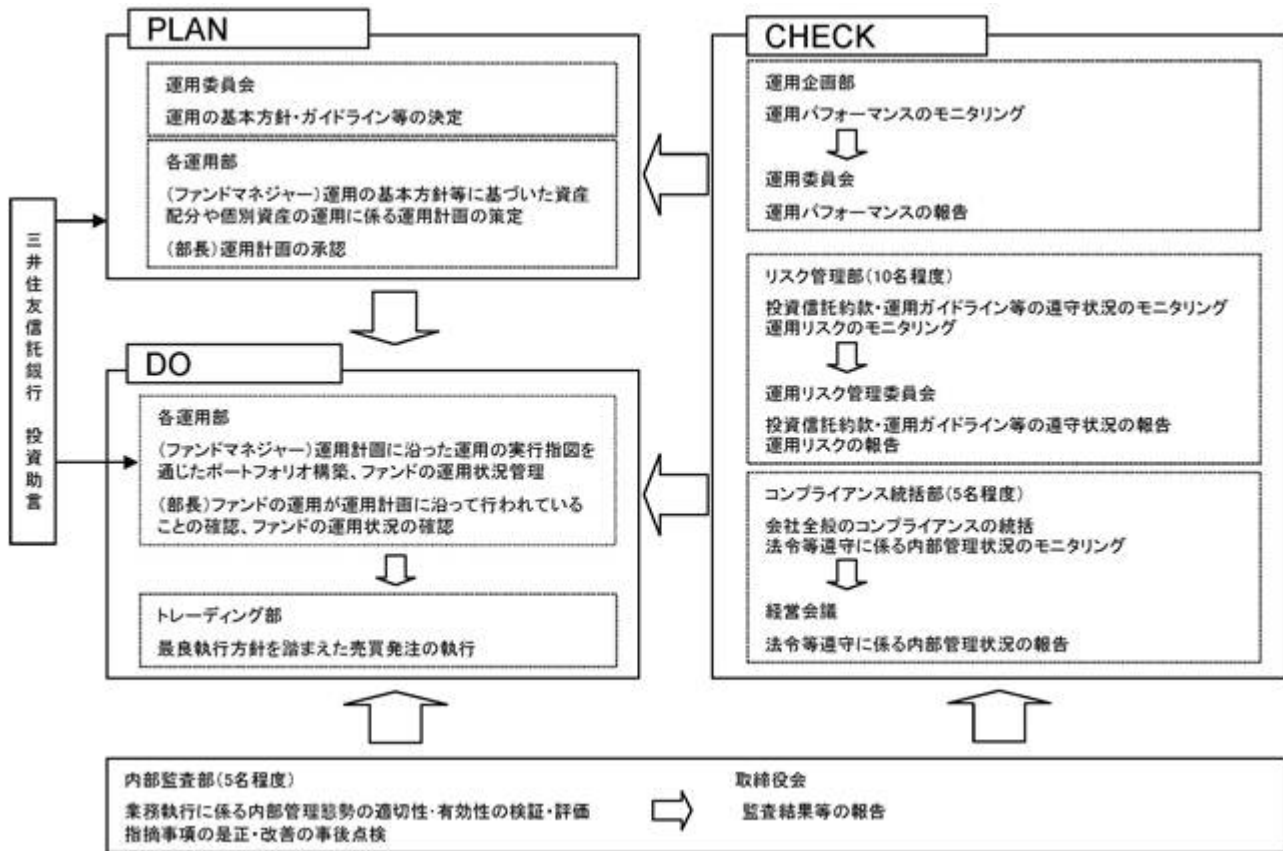
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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

（二）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（八）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。

## (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、平成26年6月30日現在のものであり、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】

##### (イ) 分配方針

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

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、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

##### (ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (5)【投資制限】

##### (イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債なら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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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およ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およ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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託者は、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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。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。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求およ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および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（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

委託者は、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、なら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。）およ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。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等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、委託者は、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、なら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およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およ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。（投資信託約款第23条）

委託者は、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、なら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、当該取引の契約期間が、原則として本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。（投資信託約款第24条）

委託者は、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、なら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本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。（投資信託約款第25条）

委託者は、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およ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。（投資信託約款第26条）

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。

委託者は、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。（投資信託約款第28条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、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%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36条）

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

#### （ロ）法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち、後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

< 同一の法人の発行する株式への投資制限 >（投資信託及び投資法人に関する法律）

運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

<デリバティブ取引に係る投資制限>（金融商品取引業等に関する内閣府令）

投資信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図してはならない。

### 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、全て投資者の皆様様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

##### カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (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。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2808%	（税抜 0.26%）
販売会社	年率 0.5184%	（税抜 0.48%）
受託会社	年率 0.0648%	（税抜 0.06%）

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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】

(イ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ロ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ハ) 投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

手数料等の合計額については、保有期間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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。

なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されません。

上記は、平成26年4月30日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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】

以下の記載は、平成26年4月30日現在の状況について記載してあります。

## (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	9,458,887,935	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		344,616	0.00
合計(純資産総額)		9,459,232,551	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】

## a. 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
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	5,621,256,276	1.4517	8,160,821,008	1.6827	9,458,887,935	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。

## b. 投資有価証券の種類別投資比率

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。

## c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (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3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	239,857,961	239,857,961	10,683	10,683
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	467,609,293	467,609,293	12,697	12,697
第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	1,019,578,148	1,019,578,148	15,145	15,145
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	2,421,339,528	2,421,339,528	17,991	17,991

第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	2,217,609,846	2,217,609,846	11,647	11,647
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	2,713,326,626	2,713,326,626	10,103	10,103
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	3,476,919,609	3,476,919,609	10,042	10,042
第10期計算期間末 (平成23年 9月30日)	3,710,028,906	3,710,028,906	8,867	8,867
第11期計算期間末 (平成24年10月 1日)	5,083,992,515	5,083,992,515	10,868	10,868
第12期計算期間末 (平成25年 9月30日)	7,817,677,232	7,817,677,232	16,277	16,277
平成25年 4月末日	7,252,928,568		15,269	
5月末日	7,699,319,713		16,181	
6月末日	7,216,468,084		15,169	
7月末日	7,596,385,787		15,864	
8月末日	7,518,985,089		15,659	
9月末日	7,817,677,232		16,277	
10月末日	8,207,016,594		17,076	
11月末日	8,628,417,333		17,992	
12月末日	9,031,088,144		18,833	
平成26年 1月末日	8,751,914,572		17,887	
2月末日	9,116,393,001		18,494	
3月末日	9,274,176,461		18,679	
4月末日	9,459,232,551		18,922	

## 【分配の推移】

期 間	1 万口当たりの分配金(円)
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	0
第4期計算期間(平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	0
第5期計算期間(平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	0
第6期計算期間(平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	0
第7期計算期間(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	0
第8期計算期間(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	0
第9期計算期間(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	0
第10期計算期間(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	0
第11期計算期間(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	0
第12期計算期間(平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	0

## 【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	14.3
第4期計算期間(平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	18.9
第5期計算期間(平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	19.3
第6期計算期間(平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	18.8
第7期計算期間(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	35.3
第8期計算期間(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	13.3
第9期計算期間(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	0.6
第10期計算期間(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	11.7
第11期計算期間(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	22.6
第12期計算期間(平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	49.8
第13期中間計算期間(平成25年10月 1日～平成26年 3月31日)	14.8

(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3期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	80,596,350	19,487,339	224,530,592
第4期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	180,370,659	36,626,429	368,274,822
第5期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	398,392,824	93,445,361	673,222,285
第6期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	894,934,442	222,294,287	1,345,862,440
第7期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	879,668,207	321,508,548	1,904,022,099
第8期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	1,067,367,697	285,659,994	2,685,729,802
第9期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	1,267,126,214	490,484,020	3,462,371,996
第10期計算期間 (平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	1,373,095,152	651,309,411	4,184,157,737
第11期計算期間 (平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	1,321,582,335	827,989,915	4,677,750,157
第12期計算期間 (平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	1,531,761,261	1,406,635,777	4,802,875,641
第13期中間計算期間 (平成25年10月 1日～平成26年 3月31日)	738,004,098	575,734,469	4,965,145,270

(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。

(参考情報)

## 外国株式インデックス マザーファンド

## (1)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	87,917,763,178	52.99
	イギリス	14,807,373,839	8.92
	スイス	7,213,525,466	4.35
	カナダ	7,213,255,411	4.35
	フランス	6,912,084,439	4.17
	ドイツ	6,679,900,799	4.03
	オーストラリア	5,189,205,963	3.13
	オランダ	2,638,701,234	1.59
	スペイン	2,557,700,390	1.54
	スウェーデン	2,279,390,748	1.37
	イタリア	1,791,541,821	1.08
	香港	1,645,971,748	0.99
	アイルランド	1,394,563,163	0.84
	シンガポール	1,024,998,569	0.62
	デンマーク	958,794,087	0.58
	ベルギー	893,005,012	0.54
	ジャージー	875,140,194	0.53
	キュラソー	712,638,107	0.43
	フィンランド	629,815,531	0.38
	バミューダ	622,819,044	0.38
	ノルウェー	506,564,033	0.31
	イスラエル	363,114,858	0.22
	ルクセンブルク	289,149,491	0.17
	オーストリア	207,033,104	0.12
	ケイマン	187,881,906	0.11
	ポルトガル	139,629,802	0.08
	ニュージーランド	96,245,548	0.06
	英ヴァージン諸島	91,720,996	0.06
	パナマ	81,119,644	0.05
	リベリア	42,409,060	0.03
ガーンジー	38,258,847	0.02	
マン島	34,035,870	0.02	
モーリシャス	13,931,904	0.01	
小計	156,049,283,806	94.05	
新株予約権証券	香港	542,893	0.00
投資信託受益証券	オーストラリア	84,319,516	0.05
	シンガポール	15,629,555	0.01
	香港	14,085,981	0.01
	小計	114,035,052	0.07
投資証券	アメリカ	2,395,752,629	1.44
	オーストラリア	380,845,586	0.23
	フランス	225,923,102	0.14
	イギリス	222,322,432	0.13
	香港	62,925,187	0.04
	シンガポール	51,124,527	0.03
	カナダ	35,611,217	0.02
	オランダ	16,529,287	0.01
小計	3,391,033,967	2.04	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,365,133,046	3.84

合計(純資産総額)	165,920,028,764	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。

## (2)投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
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	46,945	45,296.15	2,126,428,156	60,778.98	2,853,269,277	1.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	227,655	9,480.13	2,158,200,793	10,409.78	2,369,839,490	1.43
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	413,638	3,595.45	1,487,216,567	4,156.73	1,719,381,938	1.04
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	146,967	8,993.76	1,321,786,881	10,366.68	1,523,561,079	0.92
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	526,964	2,421.59	1,276,093,914	2,745.84	1,446,960,726	0.87
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	260,622	4,157.75	1,083,602,996	5,076.11	1,322,947,686	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	167,691	7,607.67	1,275,738,846	7,832.96	1,313,518,320	0.79
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	100,148	12,964.77	1,298,396,136	12,925.78	1,294,491,185	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	141,545	8,294.99	1,174,114,699	8,459.16	1,197,352,991	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	195,750	5,604.55	1,097,092,267	5,756.42	1,126,819,410	0.68
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	337,428	2,971.58	1,002,696,185	3,258.89	1,099,641,949	0.66
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	36,616	29,358.82	1,075,002,747	29,636.37	1,085,165,543	0.65
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	53,768	21,320.30	1,146,350,202	20,020.23	1,076,448,108	0.65
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	119,620	8,295.16	992,267,744	8,808.46	1,053,668,045	0.64
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	996,027	1,277.75	1,272,681,467	1,055.18	1,050,994,113	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	217,991	4,976.58	1,084,850,740	4,799.06	1,046,154,002	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	277,712	3,709.35	1,030,131,423	3,634.44	1,009,329,323	0.61
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	152,060	4,894.49	744,257,213	6,025.25	916,200,913	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	555,179	1,369.84	760,508,344	1,563.77	868,175,817	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	206,810	4,361.95	902,095,106	4,162.88	860,926,805	0.52
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	967,994	832.26	805,631,785	867.83	840,063,350	0.51
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	111,418	5,693.69	634,380,198	7,298.19	813,150,023	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,416	45,652.21	658,122,332	55,032.82	793,353,151	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	199,898	3,888.52	777,309,050	3,936.87	786,973,638	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	189,918	3,565.69	677,190,137	4,115.68	781,643,062	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,416	45,511.63	656,095,793	54,147.29	780,587,433	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	157,793	5,310.06	837,891,481	4,941.69	779,765,289	0.47

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	57,815	11,530.28	666,623,467	13,184.35	762,253,709	0.46
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	83,342	9,579.66	798,388,823	8,741.34	728,521,249	0.44
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	252,135	3,076.97	775,814,201	2,875.81	725,094,584	0.44

(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。

#### b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	94.05
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.04
合計	96.16

(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の時価の比率です。

#### c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.32
		素材	5.52
		資本財	7.36
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.76
		耐久消費財・アパレル	1.51
		消費者サービス	1.64
		メディア	2.78
		小売	2.79
		食品・生活必需品小売り	2.12
		食品・飲料・タバコ	5.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	2.83
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.77
		銀行	9.44
		各種金融	3.86
		保険	4.13
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	6.35
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.87		
電気通信サービス	3.21		
公益事業	3.26		
半導体・半導体製造装置	1.45		
合計			94.05

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	83	38,187,323.50	38,839,850	3,985,357,008	2.40
	S&P/TSE 60	モントリオール取引 所	買建	カナダドル	22	3,595,853	3,659,920	342,934,504	0.21
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	36	2,977,642	3,030,120	351,887,835	0.21
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	ユーロ	181	5,560,534.50	5,703,310	808,387,159	0.49
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	26	3,534,057	3,560,050	339,130,363	0.20
	FTSE 100	ロンドン国際金融先 物オプション取引所	買建	イギリスポンド	67	4,402,276.25	4,499,720	776,966,652	0.47

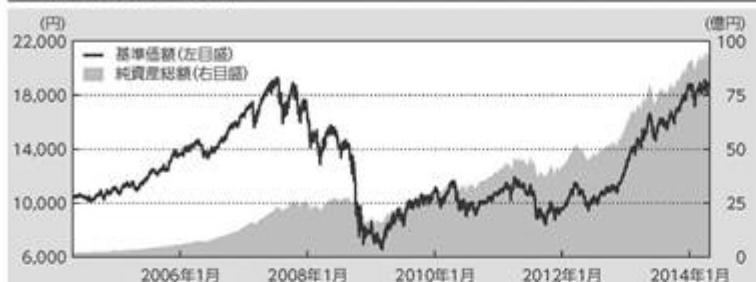
(注)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

（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：2001年10月1日  
作成基準日：2014年4月30日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	18,922円
純資産総額	94.59億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

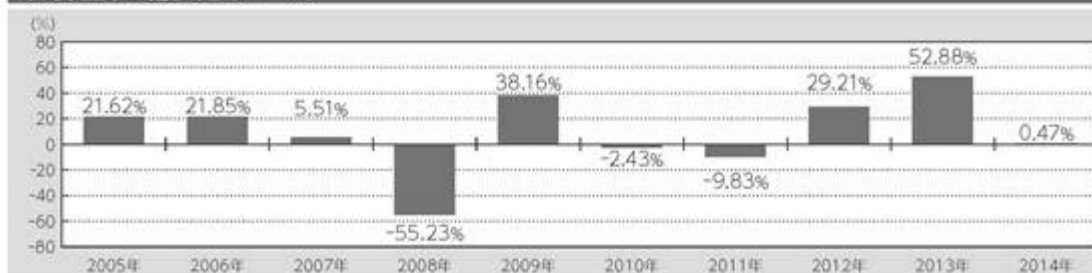
決算期	2009年9月	2010年9月	2011年9月	2012年10月	2013年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※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	1.7%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.4%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.0%
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	0.9%
WELLS FARGO & 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%
CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	0.8%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	0.7%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	0.7%

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2014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】

本ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、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または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により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また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ます。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

#### （イ）申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。ただし、分配金再投資に関する契約（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の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、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所、ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

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。）

取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（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基準価額とします。

申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとします。

本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」（以下、「分配金再投資コース」と読み替えるものとします。）専用ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金再投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金再投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものと

します。なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、）を行うものとします。

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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

- (ロ) 申込単位  
1円以上1円単位
- (ハ) 申込手数料  
ありません。

## 2【換金（解約）手続等】

### (イ) 受益権の買取請求

本ファンドにおいては、指定販売会社による受益権の買取は行っておりません。ご換金は解約請求制のみとなります。

### (ロ) 受益権のご解約の請求

ご解約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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、ご解約の請求を受けないものとします。ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所、ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

受益者が前記のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

委託者は、前記のご解約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。

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額（解約価額）とします。信託財産留保金の控除はありません。

「信託財産留保金」（「信託財産留保額」ということがあります。）とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドは、ご解約による換金時および償還時の差益が非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。



解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

委託者は、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、前記 によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

前記 により、ご解約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ご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、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ご解約の請求を受け付けたものとして、前記 の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

#### （八）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### （イ）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有価証券（受入担保金代用有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を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純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

##### [主要な投資対象の評価方法]

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象である株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額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、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

##### （ロ）基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

##### （ハ）基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当たり換算した価額で行われます。

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

平成13年10月1日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、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、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

## (5) 【その他】

## (イ) 信託の終了

- (a) 委託者は、投資信託約款に定める信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。
- (d) 前記(c)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- (e) 前記(d)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、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f) 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、この投資信託契約に係るすべ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。
- (g) 前記(d)から(f)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、前記(d)の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ) 投資信託約款の変更 (d)」に該当する場合を除き、本ファンドはその委託者と受託者との間において存続します。

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

## (ロ) 投資信託約款の変更

- (a) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。
- (c) 前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- (d) 前記(c)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ときは、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e) 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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すべ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。

委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

(八) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

(二) 運用報告書

委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

(ホ) 信託事務処理の再信託

受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。

(へ) 公告

委託者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。

#### 4 【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

本ファンドの収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。受託者が委託者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、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対して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。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

分配金は、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金請求権

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、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

（ハ）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、ご解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

（二）反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

（ホ）帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

### 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12期計算期間(平成24年10月2日から平成25年9月30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】

【DC外国株式インデックス・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,237,895	50,108,219
親投資信託受益証券	5,083,072,105	7,817,338,555
未収入金	-	922,718
未収利息	51	52
流動資産合計	5,111,310,051	7,868,369,544
資産合計	5,111,310,051	7,868,369,544
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,764,141	18,960,039
未払受託者報酬	1,523,583	2,353,527
未払委託者報酬	18,790,812	29,026,765
その他未払費用	239,000	351,981
流動負債合計	27,317,536	50,692,312
負債合計	27,317,536	50,692,312
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,677,750,157	4,802,875,641
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	406,242,358	3,014,801,591
（分配準備積立金）	155,154,507	2,021,305,386
元本等合計	5,083,992,515	7,817,677,232
純資産合計	5,083,992,515	7,817,677,232
負債純資産合計	5,111,310,051	7,868,369,544

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日)	第12期 (自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	7,826	14,445
有価証券売買等損益	905,707,898	2,631,509,876
営業収益合計	905,715,724	2,631,524,321
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,869,548	4,225,246
委託者報酬	35,390,973	52,111,232
その他費用	239,000	351,981
営業費用合計	38,499,521	56,688,459
営業利益又は営業損失( )	867,216,203	2,574,835,862
経常利益又は経常損失( )	867,216,203	2,574,835,862
当期純利益又は当期純損失( )	867,216,203	2,574,835,862
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( )	104,856,004	435,591,298
期首剰余金又は期首欠損金( )	474,128,831	406,242,358
剰余金増加額又は欠損金減少額	118,010,990	641,073,738
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	79,285,285	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	38,725,705	641,073,738
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	171,759,069
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	171,759,069
期末剰余金又は期末欠損金( )	406,242,358	3,014,801,591

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第12期(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は平成24年10月 2日から平成25年 9月30日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
1. 期首元本額	4,184,157,737円	4,677,750,157円
期中追加設定元本額	1,321,582,335円	1,531,761,261円
期中一部解約元本額	827,989,915円	1,406,635,777円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	4,677,750,157口	4,802,875,641口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0868円 (10,868円)	1.6277円 (16,277円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

## 分配金の計算過程

		第11期 自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日	第12期 自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日
費用控除後の配当等収益額	A	7,826円 (118,531,313円)	13,635円 (164,657,121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	- 円	1,905,913,825円
収益調整金額	C	3,015,033,474円	3,139,610,493円
分配準備積立金額	D	155,146,681円	115,377,926円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,170,187,981円	5,160,915,879円
当ファンドの期末残存口数	F	4,677,750,157口	4,802,875,641口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,777.16円	10,745.47円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	- 円

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項



1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
	計算期間(自 平成23年10月1日 至 平成24年10月 1日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	866,176,010	2,492,029,360
合計	866,176,010	2,492,029,360

## (デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	5,427,199,775	7,817,338,555	
親投資信託受益証券 小計		5,427,199,775	7,817,338,555	
合計		5,427,199,775	7,817,338,555	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

## &lt; 参考 &gt;

「DC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25年9月30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」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,854,697,158
コール・ローン	645,936,018
株式	152,183,409,467
投資信託受益証券	96,904,568
投資証券	3,132,928,749
派生商品評価勘定	5,643,753
未収入金	1,309,147
未収配当金	275,468,742
未収利息	678
差入委託証拠金	938,058,501
流動資産合計	160,134,356,781
資産合計	160,134,356,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,703,207
未払金	81,628,510
未払解約金	326,737,957
流動負債合計	430,069,674
負債合計	430,069,674
純資産の部	
元本等	
元本	110,876,572,872
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	48,827,714,235
元本等合計	159,704,287,107
純資産合計	159,704,287,107
負債純資産合計	160,134,356,781

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 9月30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)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成25年 9月30日現在
1. 計算期間の期首元本額	139,817,550,104円
計算期間中の追加設定元本額	15,448,288,867円
計算期間中の一部解約元本額	44,389,266,099円
計算日の元本額	110,876,572,872円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,098,444,531円
SBI資産設計オープン(分配型)	18,572,334円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,718,110,381円
世界経済インデックスファンド	811,176,860円
マイセレクション25	12,187,532円
マイセレクション50	43,053,405円
マイセレクション75	53,377,856円
外国株式インデックス・オープン	1,143,657,942円
DCマイセレクション25	804,053,100円
DCマイセレクション50	4,607,175,351円
DCマイセレクション75	5,049,073,751円
DC外国株式インデックス・オープン	5,427,199,775円
DCマイセレクションS25	285,618,714円
DCマイセレクションS50	1,497,890,439円
DCマイセレクションS75	1,124,912,966円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	5,046,063円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	134,783,144円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	137,701,943円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	63,175,114円
DC世界経済インデックスファンド	573,309,433円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	12,087,753,001円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	138,012,224円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	78,423,674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)	350,483,544円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	828,250,269円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,039,791,054円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,904,411,650円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,434,452,458円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,393,181,050円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,138,639,619円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,009,969,768円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	13,731,814,130円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	6,384,492,545円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,137,336,064円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,176,644,558円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	360,292,405円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,130,631,948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)	5,542,189,254円
外国株式ファンド・シリーズ1	764,535,204円
コア投資戦略ファンド(安定型)	681,912,341円
コア投資戦略ファンド(成長型)	904,037,786円
分散投資コア戦略ファンドA	21,336,546円

分散投資コア戦略ファンドS	29,068,007円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
2. 計算日における受益権総数	110,876,572,872口
3. 1口当たり純資産額	1.4404円
(1万口当たり純資産額)	(14,404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25年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 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

	平成25年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成25年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,892,747,590
投資信託受益証券	3,311,075
投資証券	290,882,084
合計	2,598,554,431

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。



## (デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

## 株式関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	3,956,030,625	-	3,942,703,799	13,326,826
	合計	3,956,030,625	-	3,942,703,799	13,326,826

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

## 通貨関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	142,308,783	-	140,745,600	1,563,183
	カナダドル	11,518,560	-	11,378,400	140,160
	オーストラリアドル	8,343,783	-	8,176,500	167,283
	イギリスポンド	36,418,042	-	36,358,400	59,642
	スイスフラン	8,697,040	-	8,640,000	57,040
	ユーロ	79,849,280	-	79,116,000	733,280
	計	287,135,488	-	284,414,900	2,720,588
	売 建				
	アメリカドル	214,050,600	-	214,050,600	-
	カナダドル	22,754,160	-	22,756,800	2,640
	オーストラリアドル	16,351,200	-	16,353,000	1,800
	イギリスポンド	34,773,200	-	34,777,600	4,400
	スイスフラン	17,278,400	-	17,280,000	1,600
	ユーロ	42,193,600	-	42,195,200	1,600
	計	347,401,160	-	347,413,200	12,040
	合計	634,536,648	-	631,828,100	2,732,628

## (注)時価の算定方法

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

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表さ  
れている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表さ  
れていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもと  
に計算したレートを用いております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在

該当事項はありません。

## (3) 附属明細表(平成25年9月30日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	29,195	94.53	2,759,803.35	
	APACHE CORP	23,335	86.25	2,012,643.75	
	BAKER HUGHES	26,316	49.53	1,303,431.48	
	CABOT OIL & GAS CORP	25,068	37.11	930,273.48	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,763	59.01	871,164.63	
	CHENIERE ENERGY INC	12,228	33.58	410,616.24	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	31,811	26.21	833,766.31	
	CHEVRON CORP	112,856	122.64	13,840,659.84	
	CIMAREX ENERGY CO	5,441	96.30	523,968.30	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,143	25.20	432,003.60	
	CONCHO RESOURCES INC	6,186	107.93	667,654.98	
	CONOCOPHILLIPS	67,622	70.31	4,754,502.82	
	CONSOL ENERGY INC	14,265	33.50	477,877.50	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	106.67	332,917.07	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,673	169.29	452,512.17	
	DENBURY RESOURCES INC	22,245	18.55	412,644.75	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,974	58.71	1,348,803.54	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,348	62.77	272,923.96	
	ENERGEN CORP	4,302	76.60	329,533.20	
	ENSCO PLC-CL A	13,861	54.50	755,424.50	
	EOG RESOURCES INC	15,840	170.73	2,704,363.20	
	EQT CORPORATION	8,967	90.37	810,347.79	
	EXXON MOBIL	259,757	86.90	22,572,883.30	
	FMC TECHNOLOGIES INC	14,145	55.33	782,642.85	
	HALLIBURTON CO	49,226	48.39	2,382,046.14	
	HELMERICH & PAYNE	6,624	69.07	457,519.68	
	HESS CORP	18,309	78.33	1,434,143.97	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,189	42.68	520,226.52	
	KINDER MORGAN INC	40,098	35.84	1,437,112.32	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,362	75.26	478,804.12	
	MARATHON OIL CORP	42,154	34.90	1,471,174.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	18,909	64.94	1,227,950.46	
	MURPHY OIL CORP	10,789	61.27	661,042.03	
	NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	16.42	327,168.50	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	25,413	78.01	1,982,468.13	
	NOBLE CORP	15,867	37.60	596,599.20	
NOBLE ENERGY INC	20,809	67.01	1,394,411.09		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,903	94.46	4,430,457.38		
OCEANEERING INTL INC	6,800	80.36	546,448.00		
PEABODY ENERGY CORP	16,869	17.49	295,038.81		
PHILLIPS 66	34,248	58.53	2,004,535.44		

PIONEER NATURAL RESOURCES	7,884	188.78	1,488,341.52
QEP RESOURCES INC	11,161	27.98	312,284.78
RANGE RESOURCES CORP	9,700	77.31	749,907.00
ROWAN COMPANIES PLC	7,231	36.81	266,173.11
SCHLUMBERGER	77,398	88.82	6,874,490.36
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,913	36.44	762,069.72
SPECTRA ENERGY CORP	39,797	34.17	1,359,863.49
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	9,499	25.39	241,179.61
TESORO CORP	8,166	44.74	365,346.84
VALERO ENERGY CORP	32,935	34.30	1,129,670.50
WEATHERFORD INTL LTD	44,155	15.26	673,805.30
WHITING PETROLEUM CORP	7,534	59.98	451,889.32
WILLIAMS COS	40,595	36.24	1,471,162.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,367	107.00	1,323,269.00
AIRGAS INC	3,849	105.93	407,724.57
ALBEMARLE CORP	5,130	62.77	322,010.10
ALCOA	63,694	8.20	522,290.80
ASHLAND INC	4,469	91.35	408,243.15
AVERY DENNISON CORP	5,957	43.57	259,546.49
BALL CORP	8,456	45.00	380,520.00
CELANESE CORP-SERIES A	9,323	52.50	489,457.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,462	210.48	728,681.76
CROWN HOLDINGS INC	8,530	42.55	362,951.50
DOW CHEMICAL CO	70,637	39.02	2,756,255.74
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	53,753	59.01	3,171,964.53
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,170	77.70	712,509.00
ECOLAB INC	15,812	98.11	1,551,315.32
FMC CORP	8,200	71.52	586,464.00
FREEPORT-MCMOR-B	60,777	33.42	2,031,167.34
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,854	81.60	396,086.40
INT'L PAPER CO	24,966	45.44	1,134,455.04
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,206	73.39	1,849,868.34
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,855	96.94	276,763.70
MEADWESTVACO CORP	10,334	38.69	399,822.46
MONSANTO CO	31,175	105.61	3,292,391.75
MOSAIC CO/THE	17,752	43.43	770,969.36
NEWMONT MINING CORP	29,588	27.98	827,872.24
NUCOR CORP	18,922	48.80	923,393.60
OWENS-ILLINOIS INC	9,681	30.32	293,527.92
PPG INDUSTRIES INC	8,344	165.27	1,379,012.88
PRAXAIR INC	17,271	119.86	2,070,102.06
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,201	104.24	437,912.24
SEALED AIR CORP	11,574	27.49	318,169.26
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,235	180.43	944,551.05
SIGMA-ALDRICH	7,174	85.53	613,592.22
VULCAN MATERIALS CO	7,736	51.30	396,856.80
3 M COMPANY	38,173	120.22	4,589,158.06

AGCO CORP	5,665	61.22	346,811.30
AMETEK INC	14,491	45.64	661,369.24
BOEING CO	41,961	118.74	4,982,449.14
CATERPILLAR	38,290	83.80	3,208,702.00
CUMMINS INC	10,494	133.54	1,401,368.76
DANAHER CORP	34,279	69.87	2,395,073.73
DEERE&CO	21,462	82.37	1,767,824.94
DOVER CORP	10,004	89.36	893,957.44
EATON CORP	27,543	69.69	1,919,471.67
EMERSON ELECTRIC CO	41,851	64.90	2,716,129.90
FASTENAL CO	16,785	50.00	839,250.00
FLOWSERVE CORP	8,598	62.16	534,451.68
FLUOR CORP	9,680	71.05	687,764.00
GENERAL DYNAMICS CORP	17,478	88.29	1,543,132.62
GENERAL ELECTRIC CO	601,984	24.05	14,477,715.20
GRAINGER (WW) INC	3,520	263.92	928,998.40
HONEYWELL INTL INC	43,515	83.58	3,636,983.70
ILLINOIS TOOL WORKS	24,912	76.73	1,911,497.76
INGERSOLL-RAND PLC	17,650	65.42	1,154,663.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,615	57.79	440,070.85
JOY GLOBAL INC	6,186	51.21	316,785.06
KBR INC	9,414	32.88	309,532.32
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,355	95.43	511,027.65
LOCKHEED MARTIN CORP	15,928	129.24	2,058,534.72
MASCO CORP	21,437	21.12	452,749.44
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,007	96.25	1,251,923.75
PACCAR INC	20,593	55.80	1,149,089.40
PALL CORP	6,617	77.50	512,817.50
PARKER HANNIFIN CORP	8,885	108.95	968,020.75
PENTAIR LTD	12,202	65.52	799,475.04
PRECISION CASTPARTS CORP	8,519	228.09	1,943,098.71
QUANTA SERVICES INC	12,193	27.64	337,014.52
RAYTHEON COMPANY	18,898	78.74	1,488,028.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,327	107.18	892,487.86
ROCKWELL COLLIN	7,819	68.59	536,305.21
ROPER INDUSTRIES INC	5,890	133.43	785,902.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	38.70	270,900.00
SPX CORP	2,519	84.28	212,301.32
STANLEY BLACK&DECKER	9,068	90.59	821,470.12
TEXTRON	16,174	27.90	451,254.60
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	138.67	392,713.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	50,844	109.36	5,560,299.84
XYLEM INC	10,787	27.99	301,928.13
ADT CORPORATION	12,100	41.26	499,246.00
CINTAS CORP	6,063	51.22	310,546.86
DUN & BRADSTREET CORP	2,435	104.17	253,653.95
EQUIFAX INC	7,175	59.81	429,136.75

IHS INC-CLASS A	3,625	114.98	416,802.50
IRON MOUNTAIN INC	8,702	27.72	241,219.44
MANPOWER GROUP	4,455	73.10	325,660.50
NIELSEN HOLDINGS NV	13,430	36.32	487,777.60
REPUBLIC SERVICES INC	17,278	33.75	583,132.50
ROBERT HALF INTL INC	8,611	38.97	335,570.67
STERICYCLE INC	5,128	115.72	593,412.16
TYCO INTERNATIONAL LTD	27,758	34.95	970,142.10
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,032	65.34	590,150.88
WASTE MANAGEMENT INC	26,324	41.39	1,089,550.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,593	60.45	579,896.85
CSX CORP	59,497	25.85	1,537,997.45
DELTA AIR LINES INC	12,452	23.57	293,493.64
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,300	44.14	542,922.00
FEDEX CORP	17,525	113.77	1,993,819.25
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,843	22.32	532,175.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,476	72.34	396,133.84
KANSAS CITY SOUTHERN	6,561	110.11	722,431.71
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,344	77.79	1,426,979.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	10,842	14.64	158,726.88
UNION PACIFIC CORP	27,175	156.59	4,255,333.25
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	30.91	166,635.81
UNITED PARCEL SERVICE B	42,190	91.25	3,849,837.50
AUTOLIV INC	5,587	87.74	490,203.38
BORGWARNER INC	6,751	101.51	685,294.01
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	17,352	58.44	1,014,050.88
FORD MOTOR COMPANY	214,249	17.05	3,652,945.45
GENERAL MOTORS CO	44,169	36.37	1,606,426.53
HARLEY-DAVIDSON	13,516	64.65	873,809.40
JOHNSON CONTROLS INC	40,018	42.53	1,701,965.54
TESLA MOTORS INC	4,848	190.86	925,289.28
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	72.19	509,228.26
COACH INC	16,774	54.24	909,821.76
DR HORTON INC	16,578	19.63	325,426.14
FOSSIL GROUP INC	3,299	116.46	384,201.54
GARMIN LTD	6,856	45.19	309,822.64
HASBRO INC	6,870	47.38	325,500.60
LEGGETT & PLATT INC	8,864	30.36	269,111.04
LENNAR CORP-CL A	9,411	35.86	337,478.46
LULULEMON ATHLETICA INC	5,911	72.02	425,710.22
MATTEL INC	20,582	42.09	866,296.38
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,233	74.45	836,296.85
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,720	130.09	483,934.80
NEWELL RUBBERMAID	16,854	27.59	465,001.86
NIKE B	41,809	73.64	3,078,814.76
POLARIS INDUSTRIES INC	3,815	128.20	489,083.00
PULTE GROUP INC	20,375	16.57	337,613.75

PVH CORP	4,650	118.51	551,071.50
RALPH LAUREN CORPORATION	3,565	165.63	590,470.95
TOLL BROTHERS INC	9,562	32.36	309,426.32
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,800	79.99	383,952.00
VF CORP	5,119	198.48	1,016,019.12
WHIRLPOOL CORP	4,625	147.41	681,771.25
BLOCK H & R INC	15,909	26.36	419,361.24
CARNIVAL CORPORATION	23,000	32.88	756,240.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,854	419.00	776,826.00
DARDEN RESTAURANTS INC	7,584	46.70	354,172.80
INT'L GAME TECHNOLOGY	16,160	19.23	310,756.80
LAS VEGAS SANDS CORP	24,094	65.88	1,587,312.72
MARRIOTT INTL A	14,928	42.35	632,200.80
MCDONALD'S CORP	58,570	97.12	5,688,318.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	23,000	20.22	465,060.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,973	38.40	344,563.20
STARBUCKS CORP	43,740	77.32	3,381,976.80
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,573	66.99	775,275.27
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,163	61.65	503,248.95
WYNN RESORTS LTD	4,721	158.00	745,918.00
YUM BRANDS INC	26,280	72.13	1,895,576.40
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	16.83	178,414.83
CBS CORP-CL B	33,422	55.50	1,854,921.00
CHARTER COMMUNICATION-A	3,616	133.57	482,989.12
COMCAST CORP-CL A	124,406	44.74	5,565,924.44
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,888	43.03	1,243,050.64
DIRECTV	30,999	59.96	1,858,700.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	8,670	84.84	735,562.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,403	77.76	420,137.28
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,632	44.46	561,618.72
INTERPUBLIC GROUP OF COS	25,027	17.15	429,213.05
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,715	79.84	935,325.60
LIBERTY GLOBAL PLC-C	9,451	76.11	719,315.61
LIBERTY MEDIA CORP	5,649	149.02	841,813.98
NEWS CORP-CLASS A	22,802	16.17	368,708.34
OMNICOM GROUP	15,107	64.32	971,682.24
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,954	78.11	386,956.94
SIRIUS XM RADIO INC	186,426	3.91	729,857.79
THE WALT DISNEY CO	99,952	65.19	6,515,870.88
TIME WARNER CABLE-A	16,998	112.17	1,906,665.66
TIME WARNER INC	54,458	66.20	3,605,119.60
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,567	33.26	2,945,738.42
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	26,238	33.27	872,938.26
VIACOM INC-CLASS B	25,341	84.42	2,139,287.22
ADVANCE AUTO PARTS	4,262	82.06	349,739.72
AMAZON.COM	21,277	316.01	6,723,744.77
AUTOZONE INC	2,124	422.57	897,538.68

BED BATH & BEYOND INC	12,855	77.23	992,791.65
BEST BUY COMPANY INC	16,090	37.98	611,098.20
CARMAX INC	13,119	49.22	645,717.18
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,200	53.49	331,638.00
DOLLAR GENERAL CORP	18,572	56.59	1,050,989.48
DOLLAR TREE INC	13,077	57.52	752,189.04
EXPEDIA INC	6,277	52.21	327,722.17
FAMILY DOLLAR STORES	6,337	72.58	459,939.46
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,944	49.65	344,769.60
GAP	17,669	40.67	718,598.23
GENUINE PARTS CO	9,252	80.39	743,768.28
HOME DEPOT	85,341	75.96	6,482,502.36
J.C. PENNEY CO INC	11,122	9.05	100,654.10
KOHL'S CORP	12,322	52.03	641,113.66
L BRANDS INC	14,644	61.11	894,894.84
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	29,256	23.75	694,830.00
LKQ CORP	17,445	31.56	550,564.20
LOWES COMPANIES	63,592	47.77	3,037,789.84
MACY'S INC	22,416	43.52	975,544.32
NETFLIX INC	3,011	312.40	940,636.40
NORDSTROM INC	9,415	56.45	531,476.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,454	126.75	818,044.50
PETSMART INC	5,734	76.62	439,339.08
PRICELINE.COM INC	3,013	1,014.97	3,058,104.61
ROSS STORES INC	12,841	72.55	931,614.55
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,537	59.05	149,809.85
STAPLES INC	40,259	14.59	587,378.81
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,614	63.94	2,277,159.16
TIFFANY & CO	7,453	76.89	573,061.17
TJX COMPANIES INC	42,050	56.47	2,374,563.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,154	66.45	541,833.30
TRIPADVISOR INC	6,995	75.85	530,570.75
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,534	119.11	420,934.74
URBAN OUTFITTERS INC	7,459	37.07	276,505.13
COSTCO WHOLESALE CORP	25,405	115.72	2,939,866.60
CVS CAREMARK CORPORATION	71,282	57.80	4,120,099.60
KROGER CO	28,763	40.69	1,170,366.47
SAFEWAY INC	15,052	32.25	485,427.00
SYSCO CORP	34,904	32.03	1,117,975.12
WALGREEN CO	53,480	54.51	2,915,194.80
WAL-MART STORES	95,764	74.36	7,121,011.04
WHOLE FOODS MKT INC	20,500	58.34	1,195,970.00
ALTRIA GROUP INC	116,941	34.71	4,059,022.11
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,229	37.12	1,456,180.48
BEAM INC	9,155	64.37	589,307.35
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,852	68.77	539,982.04
BUNGE LIMITED	8,562	76.21	652,510.02



CAMPBELL SOUP CO (US)	11,922	40.96	488,325.12
COCA-COLA CO	233,361	38.40	8,961,062.40
COCA-COLA ENTERPRISES	15,650	40.57	634,920.50
CONAGRA	24,266	30.27	734,531.82
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,671	56.98	551,053.58
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,655	44.98	524,241.90
GENERAL MILLS INC	38,514	48.08	1,851,753.12
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	7,383	74.88	552,839.04
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,250	93.00	860,250.00
HORMEL FOODS CORP	9,753	42.29	412,454.37
JM SMUCKER CO	6,389	104.79	669,503.31
KELLOGG CO	14,988	59.02	884,591.76
KRAFT FOODS GROUP INC	35,072	52.88	1,854,607.36
LORILLARD INC	22,596	45.23	1,022,017.08
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,531	65.40	492,527.40
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,063	75.24	907,620.12
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,767	50.40	441,856.80
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	98,693	31.81	3,139,424.33
MONSTER BEVERAGE CORP	8,382	53.07	444,832.74
PEPSICO INC	90,030	80.20	7,220,406.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	95,216	87.33	8,315,213.28
REYNOLDS AMERICAN INC	19,762	49.34	975,057.08
TYSON FOODS INC	16,582	28.60	474,245.20
AVON PRODUCTS INC	27,701	20.73	574,241.73
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,912	60.67	540,691.04
CLOROX COMPANY	7,719	82.21	634,578.99
COLGATE-PALMOLIVE CO	54,457	59.93	3,263,608.01
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,136	92.19	381,297.84
ESTEE LAUDER CO-CL A	14,127	70.42	994,823.34
HERBALIFE LTD	5,219	68.21	355,987.99
KIMBERLY-CLARK CORP	22,391	94.79	2,122,442.89
PROCTER & GAMBLE CO	159,563	77.21	12,319,859.23
ABBOTT LABORATORIES	90,754	33.14	3,007,587.56
AETNA INC	22,530	64.48	1,452,734.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,710	61.28	840,148.80
BARD C R INC	4,451	115.74	515,158.74
BAXTER INTERNATIONAL	31,635	66.38	2,099,931.30
BECTON DICKINSON & CO	11,553	99.89	1,154,029.17
BOSTON SCIENTIFIC CORP	80,854	11.52	931,438.08
CARDINAL HEALTH	20,303	52.28	1,061,440.84
CAREFUSION CORP	13,118	36.94	484,578.92
CERNER CORP	18,254	52.61	960,342.94
CIGNA CORP	17,033	77.65	1,322,612.45
COVIDIEN PLC	28,117	60.96	1,714,012.32
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,682	56.98	608,660.36
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,916	43.39	386,865.24
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,227	68.79	497,145.33

EXPRESS SCRIPTS HOLDING	47,737	61.93	2,956,352.41
HCA HOLDINGS INC	15,475	42.07	651,033.25
HENRY SCHEIN INC	5,073	103.48	524,954.04
HOLOGIC INC	16,992	20.91	355,302.72
HUMANA INC	9,454	93.88	887,541.52
INTUITIVE SURGICAL INC	2,390	367.46	878,229.40
LABORATORY CRP OF AMER	5,326	98.63	525,303.38
MCKESSON CORP	13,193	129.29	1,705,722.97
MEDTRONIC	59,151	53.00	3,135,003.00
OMNICARE INC	7,014	55.25	387,523.50
PATTERSON COMPANIES INC	6,126	39.97	244,856.22
QUEST DIAGNOSTICS	9,200	61.72	567,824.00
RESMED INC	8,978	52.70	473,140.60
ST JUDE MEDICAL INC	16,849	52.39	882,719.11
STRYKER CORP	18,132	67.65	1,226,629.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,383	71.99	4,274,982.17
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,312	74.18	468,224.16
WELLPOINT INC	17,487	83.95	1,468,033.65
ZIMMER HOLDINGS INC	10,087	82.30	830,160.10
ABBVIE INC	92,202	44.33	4,087,314.66
ACTAVIS INC	7,614	144.30	1,098,700.20
AGILENT TECHNOLOGIES	20,667	51.63	1,067,037.21
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,628	116.42	1,353,731.76
ALLERGAN INC	17,732	91.04	1,614,321.28
AMGEN	43,662	113.19	4,942,101.78
BIOGEN IDEC INC	14,029	244.82	3,434,579.78
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,093	74.09	599,610.37
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	95,627	46.20	4,417,967.40
CELGENE CORP	24,284	154.61	3,754,549.24
FOREST LABORATORIES INC	14,275	43.17	616,251.75
GILEAD SCIENCES INC	88,804	63.54	5,642,606.16
HOSPIRA INC	10,412	38.90	405,026.80
ILLUMINA INC	7,915	81.01	641,194.15
JOHNSON & JOHNSON	163,898	86.73	14,214,873.54
LIFE TECHNOLOGIES CORP	10,149	74.91	760,261.59
LILLY (ELI) & CO	59,191	50.50	2,989,145.50
MERCK & CO	175,797	47.79	8,401,338.63
MYLAN INC	23,561	38.34	903,328.74
ONYX PHARMACEUTICALS INC	4,289	124.70	534,838.30
PERRIGO CO	5,318	123.70	657,836.60
PFIZER	382,194	28.88	11,037,762.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,545	305.65	1,389,179.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,302	93.01	1,981,299.02
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,996	76.09	988,865.64
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	9,903	23.11	228,858.33
WATERS CORP	5,509	107.28	591,005.52
ZOETIS INC	29,863	31.15	930,232.45

BB&T CORP	41,689	33.97	1,416,175.33
CIT GROUP INC	11,131	48.47	539,519.57
COMERICA INC	10,866	39.19	425,838.54
FIFTH THIRD BANCORP	52,136	18.08	942,618.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,400	46.72	299,008.00
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.12	252,505.44
KEY CORP	55,029	11.36	625,129.44
M & T BANK CORP	6,760	112.08	757,660.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,108	15.11	424,711.88
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,088	14.28	315,416.64
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,822	72.63	2,238,601.86
REGIONS FINL CORP	84,188	9.30	782,948.40
SUNTRUST BANKS	32,102	32.60	1,046,525.20
US BANCORP	107,683	36.50	3,930,429.50
WELLS FARGO & CO	292,929	41.59	12,182,917.11
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,300	183.94	607,002.00
AMERICAN EXPRESS	57,565	75.89	4,368,607.85
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,120	91.43	1,108,131.60
BANK NEW YORK CO	67,571	30.24	2,043,347.04
BANK OF AMERICA CORP	627,615	13.90	8,723,848.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,410	114.85	7,167,788.50
BLACKROCK INC	7,857	270.95	2,128,854.15
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,681	68.92	2,390,214.52
CITIGROUP	177,151	48.89	8,660,912.39
CME GROUP INC	18,876	74.83	1,412,491.08
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,508	51.29	1,513,465.32
EATON VANCE CORP	7,818	39.11	305,761.98
FRANKLIN RESOURCES INC	24,684	50.82	1,254,440.88
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,359	159.85	4,053,636.15
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,327	181.28	784,398.56
INVESCO LTD	26,264	32.09	842,811.76
JPMORGAN CHASE & CO	220,046	52.24	11,495,203.04
LEGG MASON INC	7,601	33.89	257,597.89
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,488	27.30	504,722.40
MCGRAW-HILL FINANCIAL	15,160	65.92	999,347.20
MOODY'S CORP	11,940	70.35	839,979.00
MORGAN STANLEY	85,586	27.08	2,317,668.88
NASDAQ OMX GROUP	7,871	32.20	253,446.20
NORTHERN TRUST CORP	13,902	54.78	761,551.56
NYSE EURONEXT	14,159	41.95	593,970.05
PRICE T ROWE GROUP INC	15,359	72.45	1,112,759.55
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,476	41.96	313,692.96
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,066	21.19	1,421,128.54
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,731	30.82	269,089.42
SLM CORP	27,003	25.14	678,855.42
STATE STREET CORP	27,214	66.21	1,801,838.94
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,812	26.28	336,699.36

ACE LTD	20,211	94.32	1,906,301.52
AFLAC	27,861	62.21	1,733,232.81
ALLEGHANY CORP	1,001	406.13	406,536.13
ALLSTATE CORP	27,284	51.07	1,393,393.88
AMERICAN INT'L GROUP	81,653	49.15	4,013,244.95
AON PLC	17,631	75.07	1,323,559.17
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,748	54.17	419,709.16
ASSURANT INC	4,482	54.30	243,372.60
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,195	43.25	311,183.75
CHUBB CORPORATION	15,545	89.65	1,393,609.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,869	47.46	468,382.74
EVEREST RE GROUP LTD	3,222	145.45	468,639.90
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	26.51	343,914.23
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,705	31.27	772,525.35
LINCOLN NATIONAL CORP	16,170	42.15	681,565.50
LOEWS CORP	19,248	46.95	903,693.60
MARSH & MCLENNAN COS	32,664	43.76	1,429,376.64
METLIFE INC	54,187	47.21	2,558,168.27
PARTNERRE LTD	3,128	91.39	285,867.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,476	43.19	754,788.44
PROGRESSIVE CORP	34,174	27.32	933,633.68
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,578	78.41	2,162,390.98
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,591	90.25	233,837.75
TORCHMARK CORP	5,579	72.84	406,374.36
TRAVELERS COS INC/THE	21,914	85.41	1,871,674.74
UNUM GROUP	15,540	30.62	475,834.80
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,629	43.65	420,305.85
WR BERKLEY CORP	6,732	43.22	290,957.04
XL GROUP PLC	17,569	31.00	544,639.00
CBRE GROUP INC-A	16,741	23.34	390,734.94
REALOGY HOLDINGS CORP	8,488	42.84	363,625.92
WEYERHAEUSER CO	33,573	28.93	971,266.89
ACCENTURE PLC-CL A	38,379	74.09	2,843,500.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,926	16.82	469,715.32
ADOBE SYSTEMS INC	28,381	52.03	1,476,663.43
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,333	51.75	586,482.75
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,864	209.28	599,377.92
ANSYS INC	5,900	86.49	510,291.00
AUTODESK INC	14,251	41.79	595,549.29
AUTOMATIC DATA PROCESS	28,890	72.56	2,096,258.40
CA INC	18,491	30.06	555,839.46
CITRIX SYSTEMS INC	11,103	70.80	786,092.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,975	82.70	1,486,532.50
COMPUTER SCIENCES CORP	9,142	52.02	475,566.84
EBAY	68,000	55.78	3,793,040.00
ELECTRONIC ARTS INC	17,619	25.95	457,213.05
EQUINIX INC	3,100	184.13	570,803.00

FACEBOOK INC-A	96,102	51.24	4,924,266.48
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,541	46.54	816,358.14
FISERV INC	7,952	101.09	803,867.68
GOOGLE INC-CL A	15,784	876.39	13,832,939.76
INTL BUSINESS MACHINES CORP	61,324	186.92	11,462,682.08
INTUIT INC	16,772	66.51	1,115,505.72
LINKEDIN CORP - A	5,331	246.72	1,315,264.32
MASTERCARD INC-CLASS A	6,123	681.85	4,174,967.55
MICROSOFT CORP	462,980	33.29	15,412,604.20
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,487	18.87	292,239.69
ORACLE CORP	219,397	33.78	7,411,230.66
PAYCHEX INC	19,498	40.35	786,744.30
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	53.35	368,115.00
RED HAT INC	11,038	45.95	507,196.10
SAIC INC	19,851	16.03	318,211.53
SALESFORCE.COM INC	32,628	52.43	1,710,686.04
SYMANTEC CORP	41,051	24.73	1,015,191.23
SYNOPSYS INC	9,382	37.61	352,857.02
TERADATA CORP	9,513	56.51	537,579.63
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	29.31	334,925.37
VERISIGN INC	8,776	51.18	449,155.68
VISA INC-CLASS A SHARES	30,154	193.05	5,821,229.70
VMWARE INC-CLASS A	5,218	82.63	431,163.34
WESTERN UNION CO	33,878	18.64	631,485.92
YAHOO	56,726	33.55	1,903,157.30
AMPHENOL CORPORATION	9,512	77.54	737,560.48
APPLE INC	54,895	482.75	26,500,561.25
ARROW ELECTRONICS INC	6,842	48.15	329,442.30
AVNET INC	8,881	41.73	370,604.13
CISCO SYSTEMS	311,138	23.35	7,265,072.30
CORNING	87,703	14.73	1,291,865.19
DELL INC	88,025	13.78	1,212,984.50
EMC CORP	122,307	26.07	3,188,543.49
F5 NETWORKS INC	5,014	86.80	435,215.20
FLEXTRONICS INTL LTD	36,425	9.14	332,924.50
FLIR SYSTEMS INC	8,635	31.32	270,448.20
HARRIS CORP	7,124	59.23	421,954.52
HEWLETT-PACKARD CO	113,177	21.17	2,395,957.09
JUNIPER NETWORKS INC	30,344	19.95	605,362.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,795	59.75	884,001.25
NETAPP INC	21,467	42.58	914,064.86
QUALCOMM	100,592	67.38	6,777,888.96
SANDISK CORP	14,405	59.94	863,435.70
SEAGATE TECHNOLOGY	19,238	43.51	837,045.38
TE CONNECTIVITY LTD	25,033	51.96	1,300,714.68
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,000	29.93	478,880.00

WESTERN DIGITAL CORP	12,902	63.32	816,954.64
XEROX CORP	69,252	10.37	718,143.24
AT&T INC	315,878	33.98	10,733,534.44
CENTURYLINK INC	35,759	31.78	1,136,421.02
CROWN CASTLE INTL CORP	17,584	72.71	1,278,532.64
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	63,307	4.29	271,587.03
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,748	79.83	618,522.84
SPRINT CORP	55,972	6.16	344,787.52
T-MOBILE US INC	8,460	26.07	220,552.20
VERIZON COMMUNICATIONS	167,979	47.00	7,895,013.00
WINDSTREAM HOLDINGS INC	38,003	8.13	308,964.39
AES CORP	36,943	13.47	497,622.21
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,120	49.71	353,935.20
AMEREN CORPORATION	13,296	35.01	465,492.96
AMERICAN ELECTRIC POWER	28,929	43.44	1,256,675.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,567	40.88	431,978.96
CALPINE CORP	20,101	19.77	397,396.77
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	23.93	539,717.22
CMS ENERGY CORP	16,700	26.21	437,707.00
CONSOLIDATED EDISON INC	17,445	55.15	962,091.75
DOMINION RESOURCES	34,328	62.43	2,143,097.04
DTE ENERGY COMPANY	10,127	66.06	668,989.62
DUKE ENERGY CORP	41,087	66.90	2,748,720.30
EDISON INTL	18,436	45.81	844,553.16
ENTERGY CORP	10,608	63.32	671,698.56
EXELON CORP	49,826	29.74	1,481,825.24
FIRSTENERGY CORP	24,911	36.59	911,493.49
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,934	55.82	275,415.88
MDU RESOURCES GROUP INC	10,444	27.79	290,238.76
NEXTERA ENERGY INC	24,838	80.07	1,988,778.66
NISOURCE INC	18,279	30.67	560,616.93
NORTHEAST UTILITIES	18,723	41.44	775,881.12
NRG ENERGY INC	17,935	27.72	497,158.20
OGE ENERGY CORP	12,400	35.98	446,152.00
ONEOK INC	12,458	53.04	660,772.32
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	18.45	265,200.30
PG&E CORP	26,134	40.78	1,065,744.52
PINNACLE WEST CAPITAL	7,000	54.93	384,510.00
PPL CORPORATION	34,717	30.34	1,053,313.78
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	30,137	33.02	995,123.74
SCANA CORP	7,835	46.03	360,645.05
SEMPRA ENERGY	13,767	86.62	1,192,497.54
SOUTHERN CO	51,760	41.23	2,134,064.80
WISCONSIN ENERGY CORP	13,316	40.31	536,767.96
XCEL ENERGY INC	29,084	27.69	805,335.96
ALTERA CORPORATION	18,638	36.96	688,860.48
ANALOG DEVICES	17,941	46.89	841,253.49

	APPLIED MATERIALS	71,480	17.60	1,258,048.00
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,410	42.70	658,007.00
	BROADCOM CORP-CL A	30,854	25.84	797,267.36
	CREE INC	7,602	59.26	450,494.52
	INTEL CORP	289,403	22.98	6,650,480.94
	KLA-TENCOR CORP	9,658	60.91	588,268.78
	LAM RESEARCH CORP	9,670	51.14	494,523.80
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	14,528	39.60	575,308.80
	LSI CORP	31,994	7.89	252,432.66
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	23,144	11.69	270,553.36
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,304	29.49	539,784.96
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,179	40.30	490,813.70
	MICRON TECHNOLOGY	59,971	17.62	1,056,689.02
	NVIDIA CORP	33,645	15.58	524,189.10
	TEXAS INSTRUMENTS	64,573	40.16	2,593,251.68
	XILINX INC	15,362	46.54	714,947.48
	アメリカドル小計	17,843,646		913,635,036.42 (89,307,824,810)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	36.46	252,376.12
	ARC RESOURCES LTD	18,664	26.16	488,250.24
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	7.97	159,830.38
	BAYTEX ENERGY CORP	7,544	42.87	323,411.28
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,435	12.88	134,402.80
	CAMECO CORP	23,549	18.89	444,840.61
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	63,479	32.44	2,059,258.76
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,862	20.11	580,414.82
	CENOVUS ENERGY INC	44,478	31.04	1,380,597.12
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,215	38.96	865,496.40
	ENBRIDGE	45,292	42.91	1,943,479.72
	ENCANA CORP	43,667	17.87	780,329.29
	ENERPLUS CORP	10,454	17.45	182,422.30
	HUSKY ENERGY INC	20,481	29.80	610,333.80
	IMPERIAL OIL	17,670	45.49	803,808.30
	KEYERA CORP	4,636	59.51	275,888.36
	MEG ENERGY CORP	8,375	35.15	294,381.25
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,856	21.54	384,618.24
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,567	34.09	598,859.03
	PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	6.05	190,423.75
	PENN WEST PETROLEUM LTD	29,712	11.51	341,985.12
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,413	30.26	254,577.38
	SUNCOR ENERGY	87,855	37.32	3,278,748.60
	TALISMAN ENERGY INC	61,047	11.85	723,406.95
	TOURMALINE OIL CORP	8,740	41.60	363,584.00
	TRANSCANADA CORP	41,160	45.55	1,874,838.00
	VERMILION ENERGY INC	6,014	56.79	341,535.06
	AGNICO EAGLE MINES	10,066	27.11	272,889.26
	AGRIUM INC	8,901	87.46	778,481.46

BARRICK GOLD CORP	59,366	19.11	1,134,484.26
ELDORADO GOLD CORP	43,374	6.86	297,545.64
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,423	19.30	645,063.90
FRANCO-NEVADA CORP	8,570	46.37	397,390.90
GOLDCORP INC	47,438	26.55	1,259,478.90
KINROSS GOLD CORP	67,919	5.15	349,782.85
NEW GOLD INC	29,614	6.26	185,383.64
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	50,564	32.57	1,646,869.48
SILVER WHEATON CORP	20,718	25.72	532,866.96
TECK RESOURCES LTD-CL B	33,778	28.10	949,161.80
YAMANA GOLD INC	43,938	10.68	469,257.84
BOMBARDIER B	85,798	4.86	416,978.28
CAE INC	16,121	11.25	181,361.25
FINNING INTERNATIONAL INC	10,988	23.87	262,283.56
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,386	41.35	388,111.10
CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,690	104.70	2,585,043.00
CP RAILWAY LIMITED	10,245	129.09	1,322,527.05
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,795	85.98	1,186,094.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,836	48.43	331,067.48
TIM HORTONS INC	9,165	59.45	544,859.25
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,741	24.00	545,784.00
THOMSON REUTERS CORP	22,240	36.23	805,755.20
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,643	92.13	427,759.59
DOLLARAMA INC	4,200	84.30	354,060.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,961	65.01	517,544.61
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	74.62	156,105.04
LOBLAW COMPANIES LTD	7,078	45.80	324,172.40
METRO INC	5,624	64.74	364,097.76
SHOPPERS DRUG MART CORP	12,155	59.50	723,222.50
WESTON (GEORGE) LTD	3,224	81.83	263,819.92
SAPUTO INC	7,636	49.05	374,545.80
CATAMARAN CORPORATION	12,239	48.97	599,343.83
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,104	107.98	1,954,869.92
BANK MONTREAL	37,731	68.60	2,588,346.60
BANK NOVA SCOTIA	69,765	59.13	4,125,204.45
CANADIAN IMPERIAL BANK	23,276	82.50	1,920,270.00
NATIONAL BANK OF CANADA	9,662	85.51	826,197.62
ROYAL BANK OF CANADA	84,089	66.54	5,595,282.06
TORONTO-DOMINION BANK	53,786	92.73	4,987,575.78
CI FINANCIAL CORP	9,764	31.89	311,373.96
IGM FINANCIAL INC	5,864	48.49	284,345.36
ONEX CORP	5,804	54.38	315,621.52
GREAT-WEST LIFECO INC	16,992	30.49	518,086.08
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	43.30	266,165.10
INTACT FINANCIAL CORP	7,762	61.92	480,623.04
MANULIFE FINANCIAL CORP	106,714	17.38	1,854,689.32
POWER CORP OF CANADA	20,816	29.41	612,198.56



	POWER FINANCIAL CORP	14,791	32.28	477,453.48
	SUN LIFE FINANCIAL INC	35,735	33.30	1,189,975.50
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	32,268	37.85	1,221,343.80
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	17,731	17.29	306,568.99
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	16.95	93,801.30
	CGI GROUP INC - CL A	12,038	36.07	434,210.66
	OPEN TEXT CORP	3,673	77.86	285,979.78
	BLACKBERRY LIMITED	28,099	8.28	232,659.72
	BCE INC	15,348	44.20	678,381.60
	BELL ALIANT INC	5,225	25.82	134,909.50
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,190	44.64	945,921.60
	TELUS CORP	16,454	34.52	567,992.08
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	45.20	180,800.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	35.45	204,333.80
	FORTIS INC	11,903	31.32	372,801.96
	TRANSALTA CORP	15,621	13.34	208,384.14
	カナダドル小計	2,184,792		75,701,657.57 (7,178,788,187)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	18.95	160,866.55
	ORIGIN ENERGY LIMITED	65,165	14.47	942,937.55
	SANTOS	57,269	15.66	896,832.54
	WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	2.02	66,882.20
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,373	38.83	1,490,023.59
	WORLEYPARSONS LTD	13,182	24.41	321,772.62
	ALUMINA LIMITED	163,150	1.04	169,676.00
	AMCOR	71,875	10.68	767,625.00
	BHP BILLITON LTD	186,979	36.36	6,798,556.44
	BORAL LIMITED	48,581	4.86	236,103.66
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,738	4.94	443,305.72
	ILUKA RESOURCES LTD	26,815	11.73	314,539.95
	INCITEC PIVOT LTD	102,417	2.73	279,598.41
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,080	10.91	306,352.80
	NEWCREST MINING LIMITED	45,621	11.47	523,272.87
	ORICA LTD	21,846	20.28	443,036.88
	RIO TINTO LTD	25,369	63.29	1,605,604.01
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,493	19.74	187,391.82
	ALS LTD	21,808	10.32	225,058.56
	BRAMBLES LTD	92,722	9.21	853,969.62
	SEEK LTD	19,117	12.15	232,271.55
	ASCIANO GROUP	61,334	5.98	366,777.32
	AURIZON HOLDINGS LTD	116,346	4.70	546,826.20
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.51	116,494.99
	TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.87	244,820.09
	TRANSURBAN GROUP	84,248	6.87	578,783.76
CROWN LTD	25,191	15.85	399,277.35	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	47,591	2.74	130,399.34	

FLIGHT CENTRE LTD	3,263	49.83	162,595.29		
TABCORP HOLDINGS	45,765	3.28	150,109.20		
TATTS GROUP LTD	87,285	3.10	270,583.50		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.24	99,830.88		
METCASH LTD	55,380	3.23	178,877.40		
WESFARMERS LIMITED	58,607	41.70	2,443,911.90		
WOOLWORTHS LTD	72,519	35.53	2,576,600.07		
COCA-COLA AMATIL LIMITED	34,047	12.48	424,906.56		
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.46	171,941.92		
COCHLEAR LIMITED	3,583	61.50	220,354.50		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,412	36.35	305,776.20		
SONIC HEALTHCARE LTD	23,448	16.20	379,857.60		
CSL LIMITED	28,631	65.54	1,876,475.74		
AUST AND NZ BANKING GROUP	159,747	31.52	5,035,225.44		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,405	10.20	259,131.00		
COMMONWEALTH BANK OF AUST	93,650	73.16	6,851,434.00		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	136,408	35.11	4,789,284.88		
WESTPAC BANKING	180,694	33.30	6,017,110.20		
ASX LTD	10,432	34.76	362,616.32		
MACQUARIE GROUP LIMITED	18,200	48.90	889,980.00		
AMP LTD	174,549	4.70	820,380.30		
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	123,836	5.94	735,585.84		
QBE INSURANCE GROUP	71,284	14.72	1,049,300.48		
SUNCORP GROUP LIMITED	76,636	13.33	1,021,557.88		
COMPUTERSHARE LIMITED	28,469	10.03	285,544.07		
TELSTRA CORP	253,545	5.02	1,272,795.90		
AGL ENERGY LTD	32,770	15.68	513,833.60		
SP AUSNET	87,439	1.20	105,363.99		
オーストラリアドル小計	3,586,133		58,920,022.05 (5,354,062,403)		
イギリス ポンド	AMEC PLC	17,698	10.91	193,085.18	
	BG GROUP	198,158	11.92	2,362,043.36	
	BP PLC	1,105,443	4.41	4,876,109.07	
	PETROFAC LTD	15,103	14.10	212,952.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	221,111	20.37	4,505,136.62	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	148,990	21.46	3,197,325.40	
	TULLOW OIL PLC	54,074	10.46	565,614.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	81,139	15.40	1,249,540.60	
	ANTOFAGASTA PLC	22,958	8.30	190,551.40	
	BHP BILLITON PLC	122,961	18.41	2,263,712.01	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,905	26.74	211,379.70	
	FRESNILLO PLC	11,483	10.00	114,830.00	
	GLENCORE XSTRATA PLC	617,738	3.44	2,125,018.72	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,206	28.13	343,354.78	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,212	45.11	235,113.32	
	REXAM	46,082	4.84	223,313.37	
RIO TINTO PLC REG	74,004	30.67	2,269,702.68		

VEDANTA RESOURCES PLC	6,684	10.73	71,719.32
BAE SYSTEMS PLC	188,528	4.66	879,860.17
BUNZL PLC	19,364	13.49	261,220.36
COBHAM PLC	67,822	2.93	199,125.39
IMI PLC	19,153	14.69	281,357.57
INVENSYS PLC	37,986	5.01	190,309.86
MEGGITT PLC	45,930	5.55	255,141.15
MELROSE INDUSTRIES PLC	77,063	2.99	230,572.49
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	109,464	11.25	1,231,470.00
SMITHS GROUP PLC	23,431	14.01	328,268.31
TRAVIS PERKINS PLC	14,589	16.48	240,426.72
WEIR GROUP PLC/THE	12,658	23.68	299,741.44
WOLSELEY LTD	16,321	32.41	528,963.61
AGGREKO PLC	15,998	16.08	257,247.84
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,079	12.01	253,158.79
CAPITA GROUP PLC	39,034	9.94	388,193.13
EXPERIAN PLC	60,166	11.84	712,365.44
G4S PLC	88,705	2.53	225,221.99
INTERTEK GROUP PLC	9,579	33.46	320,513.34
SERCO GROUP PLC	29,062	5.50	159,986.31
EASYJET PLC	9,444	12.74	120,316.56
NEW GKN	97,251	3.52	342,420.77
BURBERRY GROUP PLC	26,334	16.23	427,400.82
PERSIMMON PLC	18,044	10.61	191,446.84
CARNIVAL PLC	10,686	21.13	225,795.18
COMPASS GROUP PLC	105,961	8.49	900,138.69
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,984	18.05	288,511.20
TUI TRAVEL PLC	30,444	3.68	112,094.80
WHITBREAD PLC	10,679	30.30	323,573.70
WILLIAM HILL	51,392	4.02	206,595.84
BRITISH SKY BROADCASTING	60,347	8.73	527,131.04
ITV PLC	221,382	1.75	389,189.55
PEARSON	48,692	12.58	612,545.36
REED ELSEVIER PLC	71,114	8.39	597,002.03
WPP PLC	76,682	12.82	983,063.24
KINGFISHER PLC	141,309	3.87	547,572.37
MARKS & SPENCER GROUP PLC	96,106	4.96	476,974.07
NEXT PLC	9,604	51.70	496,526.80
MORRISON SUPERMARKETS	131,478	2.80	368,138.40
SAINSBURY (J) PLC	71,870	3.94	283,670.89
TESCO	470,374	3.62	1,705,576.12
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,220	18.82	399,360.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	111,675	32.95	3,679,691.25
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	18.54	208,797.48
DIAGEO	146,143	19.77	2,889,247.11
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	56,709	22.90	1,298,636.10
SABMILLER PLC	55,977	31.65	1,771,672.05

TATE & LYLE	27,775	7.38	204,979.50	
UNILEVER PLC	74,721	24.57	1,835,894.97	
RECKITT BENCKISER PLC	37,659	45.18	1,701,433.62	
SMITH & NEPHEW PLC	53,914	7.75	418,103.07	
ASTRAZENECA	72,894	32.01	2,333,336.94	
GLAXOSMITHKLINE	286,775	15.68	4,498,065.87	
SHIRE PLC	32,255	24.67	795,730.85	
BARCLAYS	907,590	2.65	2,412,374.22	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,098,167	6.77	7,442,277.75	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,725,473	0.74	2,023,118.60	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	126,708	3.66	464,384.82	
STANDARD CHARTERED PLC	142,721	14.95	2,133,678.95	
3I GROUP PLC	57,274	3.65	209,565.56	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,623	3.86	215,205.38	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,852	9.94	127,813.14	
ICAP PLC	32,393	3.76	122,056.82	
INVESTEC PLC	34,476	3.99	137,800.57	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	11,371	15.66	178,069.86	
SCHRODERS PLC	6,124	25.91	158,672.84	
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	12.47	143,766.63	
AVIVA PIC	177,394	4.03	715,607.39	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,676	2.12	105,611.17	
LEGAL & GENERAL GROUP	356,036	1.98	707,799.56	
OLD MUTUAL PLC	294,642	1.88	553,926.96	
PRUDENTIAL	150,889	11.58	1,747,294.62	
RESOLUTION LTD	83,609	3.23	270,307.89	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	215,507	1.22	264,642.59	
STANDARD LIFE PLC	141,984	3.51	499,073.76	
SAGE GROUP PLC	67,266	3.29	221,910.53	
BT GROUP PLC	461,171	3.46	1,597,496.34	
INMARSAT PLC	28,187	7.12	200,691.44	
VODAFONE GROUP PLC	2,848,571	2.17	6,187,096.21	
CENTRICA PLC	299,561	3.67	1,099,388.87	
NATIONAL GRID PLC	210,288	7.39	1,554,028.32	
SEVERN TRENT PLC	14,198	17.71	251,446.58	
SSE PLC	57,087	14.68	838,037.16	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,616	6.89	280,047.32	
ARM HOLDINGS PLC	83,182	10.10	840,138.20	
イギリスポンド小計	17,231,202		98,317,609.31 (15,543,030,855)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	21,416	40.63	870,132.08
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	317.75	151,566.75
	GIVAUDAN-REG	495	1,328.00	657,360.00
	HOLCIM LTD	13,638	67.95	926,702.10
	SIKA AG-BR	125	2,679.00	334,875.00
	SYNGENTA AG	5,422	374.80	2,032,165.60
	ABB LTD	128,022	21.53	2,756,313.66

GEBERIT AG-REG	2,260	242.50	548,050.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,379	130.90	180,511.10	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,895	135.00	390,825.00	
SULZER AG-REG	1,508	139.50	210,366.00	
ADECCO	7,891	64.20	506,602.20	
SGS SA	326	2,179.00	710,354.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,144	120.80	379,795.20	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	30,390	91.65	2,785,243.50	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,795	586.00	1,051,870.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,730	102.70	280,371.00	
ARYZTA AG	5,078	58.10	295,031.80	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	896.50	118,338.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	3,695.00	181,055.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	42,900.00	257,400.00	
NESTLE SA - REGISTERED	187,742	63.25	11,874,681.50	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,090	111.90	345,771.00	
ACTELION LTD-REG	6,418	64.15	411,714.70	
LONZA GROUP AG-REG	3,389	74.60	252,819.40	
NOVARTIS	133,917	69.65	9,327,319.05	
ROCHE HOLDING GENUSS	40,902	243.90	9,975,997.80	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	496.00	105,648.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG	88,338	27.72	2,448,729.36	
JULIUS BAER GROUP LTD	13,195	42.37	559,072.15	
PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	68.75	129,250.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,099	223.90	246,066.10	
UBS AG-REG	214,908	18.75	4,029,525.00	
BALOISE HOLDING AG	3,007	101.40	304,909.80	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,929	174.10	335,838.90	
SWISS RE LTD	20,763	75.95	1,576,949.85	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,744	233.70	2,043,472.80	
SWISS PRIME SITE-REG	3,464	69.50	240,748.00	
SWISSCOM	1,396	437.40	610,610.40	
スイスフラン小計	963,572		60,444,051.80 (6,527,957,594)	
香港ドル				
HOPEWELL HOLDINGS	35,500	25.95	921,225.00	
HUTCHISON WHAMPOA	124,000	94.15	11,674,600.00	
NWS HOLDINGS LTD	101,000	12.04	1,216,040.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	15.26	869,820.00	
MTR CORP	84,500	30.95	2,615,275.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	45.35	657,575.00	
LI & FUNG	346,800	11.40	3,953,520.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	21.40	995,100.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	125,000	54.95	6,868,750.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	59,600	25.20	1,501,920.00	
SANDS CHINA LTD	144,000	48.75	7,020,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.76	1,250,480.00	
SJM HOLDINGS LTD	113,000	21.30	2,406,900.00	

WYNN MACAU LTD	98,000	26.45	2,592,100.00		
BANK EAST ASIA	76,960	33.25	2,558,920.00		
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	220,000	25.15	5,533,000.00		
HANG SENG BANK	45,500	126.80	5,769,400.00		
FIRST PACIFIC CO	128,000	8.68	1,111,040.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	65,000	125.60	8,164,000.00		
AIA GROUP LTD	699,200	37.20	26,010,240.00		
CHEUNG KONG HOLDINGS	81,000	121.00	9,801,000.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	133,000	26.50	3,524,500.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,000	48.75	2,730,000.00		
HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	35.05	1,402,000.00		
KERRY PROPERTIES LTD	38,500	33.55	1,291,675.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	236,500	11.84	2,800,160.00		
SINO LAND CO	183,400	11.44	2,098,096.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	93,000	107.40	9,988,200.00		
SWIRE PACIFIC A	40,500	93.40	3,782,700.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	75,000	22.40	1,680,000.00		
WHARF HOLDINGS	90,000	69.20	6,228,000.00		
WHEELOK & CO LTD	53,000	40.95	2,170,350.00		
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	43,500	36.65	1,594,275.00		
PCCW LTD	232,000	3.36	779,520.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	53.60	1,661,600.00		
CLP HOLDINGS	105,000	63.80	6,699,000.00		
HONG KONG & CHINA GAS	324,967	18.64	6,057,384.88		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	81,000	67.65	5,479,650.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	79.00	1,090,200.00		
香港ドル小計	4,633,227		164,548,215.88 (2,074,953,002)		
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	85,300	10.53	898,209.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	0.93	211,447.59	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	63,000	5.32	335,160.00	
	SEMBICORP MARINE LTD	54,000	4.56	246,240.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	98,000	4.21	412,580.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.16	154,945.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.95	256,105.00	
	SINGAPORE AIRLINES	33,533	10.43	349,749.19	
	GENTING SINGAPORE PLC	363,000	1.46	531,795.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.09	380,370.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	37.49	224,940.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	1.50	130,935.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	444,000	0.52	230,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.25	360,750.00	
	DBS GROUP	97,000	16.53	1,603,410.00	
	OCBC BANK	153,000	10.45	1,598,850.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	75,000	21.28	1,596,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	54,000	7.33	395,820.00	
	CAPITALAND LTD	152,500	3.17	483,425.00	

	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	1.98	156,815.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.33	247,920.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	182,000	2.92	531,440.00
	KEPPEL LAND LTD	40,000	3.65	146,000.00
	UOL GROUP LIMITED	31,300	6.36	199,068.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	459,243	3.78	1,735,938.54
	STARHUB LTD	38,000	4.31	163,780.00
	シンガポールドル小計	3,314,239		13,582,572.32 (1,056,452,475)
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,789	9.64	393,205.96
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	3.37	227,977.13
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	33,590	4.04	135,703.60
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.37	256,035.84
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.47	139,501.41
	ニュージーラントドル小計	275,563		1,152,423.94 (93,277,193)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,993	141.10	1,974,412.30
	BOLIDEN AB	17,199	96.60	1,661,423.40
	ALFA LAVAL AB	18,739	156.60	2,934,527.40
	ASSA ABLOY B	19,900	294.30	5,856,570.00
	ATLAS COPCO A	39,998	188.80	7,551,622.40
	ATLAS COPCO B	23,243	170.50	3,962,931.50
	SANDVIK AB	63,102	88.45	5,581,371.90
	SCANIA AB-B SHS	19,061	138.90	2,647,572.90
	SKANSKA B	21,892	125.30	2,743,067.60
	SKF AB-B	23,353	180.10	4,205,875.30
	VOLVO B	87,725	97.00	8,509,325.00
	SECURITAS B	19,690	74.50	1,466,905.00
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	171.00	2,330,217.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	41.88	1,082,807.40
	HENNES & MAURITZ B	55,505	280.70	15,580,253.50
	SWEDISH MATCH AB	12,270	230.80	2,831,916.00
	SCA SV CELLULOZA B	34,723	163.20	5,666,793.60
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	103.90	2,192,601.70
	GETINGE AB-B SHS	10,818	231.60	2,505,448.80
	NORDEA BANK AB	163,626	78.15	12,787,371.90
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	91,014	68.85	6,266,313.90
	SVENSKA HANDELSBK A	29,383	278.70	8,189,042.10
	SWEDBANK AB-A	53,715	148.90	7,998,163.50
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	118.90	886,161.70
	INVESTOR AB-B SHS	27,426	196.90	5,400,179.40
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,279	223.50	2,967,856.50
	RATOS AB-B SHS	12,127	61.15	741,566.05
ERICSSON (LM) B	176,367	87.30	15,396,839.10	
HEXAGON AB-B SHS	14,104	194.40	2,741,817.60	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,975	579.00	2,301,525.00	
TELE2 AB-B SHS	20,353	83.30	1,695,404.90	

	TELIASONERA AB	138,656	49.53	6,867,631.68
	スウェーデンクローナ小計	1,293,274		155,525,516.03 (2,362,432,588)
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	88.35	930,237.15
	SEADRILL LTD	21,855	272.80	5,962,044.00
	STATOIL ASA	64,973	137.30	8,920,792.90
	SUBSEA 7 SA	15,716	127.20	1,999,075.20
	NORSK HYDRO	58,546	25.39	1,486,482.94
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,004	250.00	2,751,000.00
	ORKLA	45,519	43.85	1,996,008.15
	DNB ASA	58,845	93.15	5,481,411.75
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,659	90.95	1,151,336.05
	TELENOR ASA	42,029	139.10	5,846,233.90
	ノルウェークローネ小計	341,675		36,524,622.04 (594,986,093)
デンマーク クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	35	48,920.00	1,712,200.00
	A P MOLLER-MAERSK AIS	79	51,650.00	4,080,350.00
	DSV A/S	10,479	159.70	1,673,496.30
	CARLSBERG AS-B	6,151	567.50	3,490,692.50
	COLOPLAST-B	6,468	310.10	2,005,726.80
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	508.50	754,614.00
	NOVO NORDISK A/S-B	23,186	937.50	21,736,875.00
	NOVOZYMES A/S	13,135	211.20	2,774,112.00
	DANSKE BANK A/S	39,476	121.00	4,776,596.00
	TRYG A/S	1,646	507.50	835,345.00
	TDC A/S	41,126	46.86	1,927,164.36
	デンマーククローネ小計	143,265		45,767,171.96 (809,163,600)
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	299	1,138.00	340,262.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,519	30.63	873,536.97
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,880.00	302,680.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	49,326	134.60	6,639,279.60
	BANK HAPOLIM BM	58,582	17.77	1,041,002.14
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	80,820	13.10	1,058,742.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	39.57	324,474.00
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	144.70	485,902.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.45	720,032.85
	イスラエルシェケル小計	340,898		11,785,912.16 (323,876,866)
ユーロ	CGG	10,161	17.39	176,699.79
	ENI	148,103	17.11	2,534,042.33
	FUGRO NV-CVA	4,431	45.44	201,344.64
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.37	260,153.47
	NESTE OIL OYJ	8,623	16.66	143,659.18
	OMV AG	8,574	37.30	319,810.20
	REPSOL SA	50,929	18.51	942,950.43
	SAIPEM	15,771	16.16	254,859.36
	TECHNIP S.A.	6,058	87.79	531,831.82



TENARIS SA	28,127	17.23	484,628.21
TOTAL SA	124,532	43.67	5,438,935.10
VOPAK	4,421	42.70	188,776.70
AIR LIQUIDE	18,146	103.30	1,874,481.80
AKZO NOBEL	14,190	48.28	685,093.20
ARCELORMITTAL	59,519	10.16	605,010.63
ARKEMA	3,655	83.39	304,790.45
BASF SE	53,472	71.53	3,824,852.16
CRH	46,255	17.75	821,257.52
FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,114	62.44	131,998.16
HEIDELBERGCEMENT AG	8,376	58.15	487,064.40
IMERYS SA	1,975	52.00	102,700.00
K+S AG	10,261	19.30	198,088.60
KONINKLIJKE DSM NV	9,186	56.01	514,507.86
LAFARGE (FRANCE)	11,122	52.13	579,789.86
LANXESS	4,844	48.69	235,854.36
LINDE AG	10,783	147.35	1,588,875.05
SOLVAY SA	3,532	111.35	393,288.20
STORA ENSO OYJ R	31,297	6.62	207,342.62
THYSSEN KRUPP	22,984	17.59	404,288.56
UMICORE	6,637	35.94	238,566.96
UPM KYMMENE CORP	30,064	10.43	313,567.52
VOESTALPINE AG	6,910	35.35	244,268.50
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,693	23.51	227,930.89
ALSTOM RGPT	13,216	26.77	353,858.40
ANDRITZ AG	4,662	43.12	201,048.75
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	32.77	145,072.79
BOUYGUES ORD	11,148	26.93	300,271.38
BRENNTAG AG	3,068	124.50	381,966.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	33,878	47.45	1,607,511.10
FERROVIAL SA	24,281	13.30	322,937.30
FIAT INDUSTRIAL	50,975	9.75	497,006.25
FINMECCANICA SPA	25,448	4.54	115,635.71
GEA GROUP AG	10,980	30.66	336,646.80
HOCHTIEF AG	1,793	64.79	116,168.47
KONE OYJ-B	9,274	66.45	616,257.30
KONINKLIJKE PHILIPS	55,723	24.07	1,341,252.61
LEGRAND SA	15,181	41.70	633,047.70
MAN SE	2,099	88.00	184,712.00
METSO OYJ	7,612	29.20	222,270.40
OCI NV	5,400	25.60	138,240.00
OSRAM LICHT AG	4,722	35.10	165,742.20
PRYSMIAN SPA	12,810	18.40	235,704.00
REXEL SA	12,359	18.90	233,585.10
SAFRAN SA	14,689	45.77	672,388.97
SAINT-GOBAIN	23,191	37.36	866,531.71
SCHNEIDER ELECTRIC	30,719	64.64	1,985,676.16

SIEMENS	46,161	89.83	4,146,642.63
THALES SA	5,301	41.29	218,904.79
VALLOUREC	6,501	45.28	294,365.28
VINCI S.A.	26,999	43.23	1,167,166.77
WARTSILA OYJ	10,737	34.21	367,312.77
ZARDOYA OTIS SA	10,201	11.99	122,309.99
ZODIAC AEROSPACE	2,146	117.70	252,584.20
BUREAU VERITAS SA	12,862	23.30	299,748.91
EDENRED	11,350	24.28	275,634.75
RANDSTAD HOLDING NV	7,714	40.99	316,196.86
SOCIETE BIC SA	1,800	86.34	155,412.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	21,346	14.34	306,208.37
ABERTIS INFRASTRUCTURAS-R	21,346	0.71	15,155.66
ADP	1,728	77.05	133,142.40
ATLANTIA SPA	19,265	15.34	295,525.10
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,664	14.63	214,534.32
DEUTSCHE POST AG-REG	52,790	24.66	1,301,801.40
FRAPORT AG	2,319	51.73	119,961.87
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	32,020	6.31	202,174.28
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	4.02	229,068.33
TNT EXPRESS	22,191	6.84	151,897.39
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,276	80.10	1,544,007.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,343	60.77	203,154.11
CONTINENTAL AG	6,552	127.85	837,673.20
DAIMLER AG	56,005	58.00	3,248,290.00
FIAT ORD	52,136	5.97	311,251.92
MICHELIN	10,794	83.41	900,327.54
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	38.41	237,296.98
PIRELLI & CO	14,958	9.86	147,485.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,121	65.10	593,777.10
RENAULT SA	11,410	60.01	684,714.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,420	174.55	1,469,711.00
VOLKSWAGEN STAMM	1,758	169.80	298,508.40
ADIDAS AG	12,180	80.12	975,861.60
CHRISTIAN DIOR	3,142	144.75	454,804.50
HUGO BOSS AG	1,699	95.09	161,557.91
KERING	4,403	166.35	732,439.05
LUXOTTICA GROUP SPA	9,878	39.40	389,193.20
LVMH	14,782	146.05	2,158,911.10
ACCOR	9,288	30.93	287,277.84
OPAP SA	14,930	8.30	123,919.00
SODEXO	5,616	69.12	388,177.92
AXEL SPRINGER AG	2,489	41.01	102,086.33
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	23.38	197,790.33
JC DECAUX SA	4,621	26.80	123,842.80
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	94.05	124,428.15
LAGADERE S.C.A	6,639	23.94	158,970.85

PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	6,369	31.83	202,725.27
PUBLICIS GROUPE	10,591	59.37	628,787.67
REED ELSEVIER NV	41,081	15.02	617,036.62
SES	17,459	21.16	369,519.73
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	36.30	116,886.00
WOLTERS KLUWER	17,576	19.17	337,019.80
INDITEX	12,982	113.70	1,476,053.40
AHOLD (KON.)	60,037	12.86	772,075.82
CARREFOUR	35,096	25.40	891,438.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,282	76.63	251,499.66
COLRUYT SA	4,415	41.22	181,986.30
DELHAIZE GROUP	6,071	47.80	290,224.15
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	39,901	6.42	256,443.72
JERONIMO MARTINS	15,262	15.38	234,805.87
KESKO OYJ-B SHS	4,473	22.43	100,329.39
METRO STAMM	7,548	29.49	222,628.26
ANHEUSER-BUSCH INBEV	46,781	73.80	3,452,437.80
DANONE (GROUPE)	33,286	55.44	1,845,375.84
HEINEKEN HOLDING NV	6,278	46.30	290,671.40
HEINEKEN NV	13,724	51.74	710,079.76
KERRY GROUP PLC-A	9,560	44.50	425,420.00
PERNOD-RICARD	12,357	91.90	1,135,608.30
REMY COINTREAU	1,575	78.99	124,409.25
SUEDZUCKER AG	4,926	21.40	105,441.03
UNILEVER NV-CVA	94,837	28.79	2,730,831.41
BEIERSDORF AG	6,056	66.02	399,817.12
HENKEL AG & CO KGAA	7,819	65.86	514,959.34
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,372	76.22	790,553.84
LOREAL	14,078	127.65	1,797,056.70
CELESIO AG	5,912	16.86	99,676.32
ESSILOR INTERNATIONAL	11,876	80.80	959,580.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,839	48.15	618,262.04
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,471	92.04	687,630.84
BAYER	48,143	87.49	4,212,031.07
ELAN CORPORATION PLC	34,320	11.50	394,680.00
GRIFOLS SA	9,679	30.15	291,870.24
MERCK KGAA	3,762	115.05	432,818.10
ORION OYJ-CLASS B	5,839	18.80	109,773.20
QIAGEN N.V.	13,772	16.00	220,352.00
SANOFI	69,376	75.11	5,210,831.36
UCB (GROUPE)	6,553	43.70	286,398.86
BANCO BILBAO VIZCAYA	331,500	8.36	2,771,340.00
BANCO DE SABADELL SA	146,060	1.85	270,357.06
BANCO SANTANDER SA	665,182	6.08	4,045,636.92
BNP PARIBAS	58,593	50.89	2,981,797.77
CAIXABANK	55,446	3.28	182,029.21

COMMERZBANK AG	58,251	8.67	505,327.42
CREDIT AGRICOLE SA	60,165	8.27	498,045.87
ERSTE GROUP BANK AG	15,199	23.65	359,456.35
INTESA SANPAOLO	685,455	1.58	1,083,704.35
KBC GROEP NV	13,809	36.53	504,511.81
NATIXIS	55,749	3.58	199,804.41
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	24.50	83,317.00
SOCIETE GENERALE	41,403	37.16	1,538,742.49
UNICREDIT SPA	255,991	4.77	1,221,589.05
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	3.89	211,509.37
DEUTSCHE BANK NAMEN	60,108	34.14	2,052,387.66
DEUTSCHE BOERSE	11,621	55.22	641,711.62
EURAZEO	1,975	47.98	94,760.50
EXOR SPA	5,807	27.84	161,666.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,858	63.64	309,163.12
ING GROEP	225,867	8.42	1,903,607.07
MEDIOBANCA	30,462	5.28	160,839.36
OKO BANK-A	9,611	12.50	120,137.50
WENDEL	1,898	99.96	189,724.08
AEGON	106,867	5.54	592,043.18
AGEAS	13,907	30.50	424,163.50
ALLIANZ SE-REG	26,882	117.75	3,165,355.50
ASSICURAZIONI GENERALI	68,843	14.96	1,029,891.28
AXA	105,748	17.39	1,839,486.46
CNP ASSURANCES	11,367	13.63	154,989.04
DELTA LLOYD NV	11,075	15.75	174,486.62
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,891	54.81	213,265.71
MAPFRE SA	55,064	2.64	145,754.40
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,574	145.60	1,539,574.40
SAMPO OYJ-A SHS	25,235	32.14	811,052.90
SCOR SE	9,248	24.48	226,437.28
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	38.92	88,114.88
IMMOFINANZ AG	58,893	3.22	190,165.49
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,953	25.92	594,941.76
ATOS	3,458	58.00	200,564.00
CAP GEMINI SA	8,568	44.05	377,463.24
DASSAULT SYSTEMES SA	3,709	98.86	366,671.74
SAP AG	53,641	55.19	2,960,446.79
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,790	27.66	187,811.40
GEMALTO	4,718	80.23	378,525.14
NOKIA CORP	223,066	4.91	1,095,254.06
BELGACOM	9,742	19.85	193,378.70
DEUTSCHE TELEKOM	164,374	10.78	1,771,951.72
ELISA A	9,087	17.89	162,566.43
ILIAD SA	1,349	171.80	231,758.20
KPN (KON.)	192,845	2.36	456,078.42

ORANGE	108,509	9.40	1,020,635.65	
PORTUGAL TELECOM	41,591	3.37	140,286.44	
TELECOM ITALIA ORD	601,478	0.58	348,857.24	
TELECOM ITALIA RNC	378,931	0.47	178,665.96	
TELEFONICA	241,971	11.54	2,793,555.19	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	5.91	98,959.76	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	6.09	97,031.97	
VIVENDI	69,784	17.14	1,196,446.68	
ZIGGO NV	8,778	30.32	266,148.96	
ACCIONA SA	1,857	42.23	78,430.39	
E.ON SE	104,845	13.41	1,406,495.67	
ELECTRICITE DE FRANCE	13,993	23.63	330,724.55	
ENAGAS	12,304	18.23	224,301.92	
ENEL	383,213	2.87	1,101,354.16	
ENEL GREEN POWER SPA	110,043	1.61	177,389.31	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	124,604	2.71	338,175.25	
FORTUM OYJ	26,458	16.78	443,965.24	
GAS NATURAL SDG SA	21,106	15.40	325,032.40	
GDF SUEZ	77,259	18.84	1,455,559.56	
IBERDROLA SA	282,941	4.33	1,226,832.17	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,979	42.17	294,304.43	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	24.43	64,093.00	
RWE STAMM	29,150	25.44	741,576.00	
SNAM SPA	120,285	3.73	448,663.05	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	17,972	12.10	217,461.20	
TERNA SPA	83,672	3.35	280,301.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	12.79	252,692.03	
VERBUND AG	4,553	17.14	78,038.42	
ASML HOLDING NV	20,806	72.56	1,509,683.36	
INFINEON TECHNOLOGIES	64,362	7.57	487,477.78	
STMICROELECTRONICS	37,108	7.00	260,089.97	
ユーロ小計	9,752,107		158,918,660.81 (20,956,603,801)	
合計	61,903,593		152,183,409,467 (152,183,409,467)	

## B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	335,000.00	264,650.00	
	アメリカドル小計		335,000.00	264,650.00 (25,869,537)	
オーストラリア ドル	オーストラリア ドル	APA GROUP	40,986.00	243,456.84	
		LEND LEASE GROUP	34,217.00	355,172.46	
		SYDNEY AIRPORT	13,063.00	52,121.37	
オーストラリアドル小計		88,266.00	650,750.67 (59,133,713)		
香港ドル	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	943,800.00	

		香港ドル小計	130,000.00	943,800.00 (11,901,318)
		投資信託受益証券合計		96,904,568 (96,904,568)
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,168.00	530,083.84
		AMERICAN TOWER CORPORATION	23,534.00	1,753,753.68
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,422.00	656,187.86
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,321.00	946,605.30
		BOSTON PROPERTIES	9,032.00	967,236.88
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,256.00	330,970.32
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,831.00	427,964.15
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	296,557.69
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	20,232.00	1,103,655.60
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,867.00	395,555.43
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	524,519.70
		HCP INC	27,005.00	1,122,057.75
		HEALTH CARE REIT INC	16,770.00	1,059,528.60
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,285.00	771,338.70
		KIMCO REALTY CORP	25,608.00	521,634.96
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	299,863.90
		MACERICH CO/THE	8,322.00	476,517.72
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,175.00	478,937.25
		PROLOGIS INC	29,539.00	1,131,343.70
		PUBLIC STORAGE	8,695.00	1,413,720.05
		RAYONIER INC	7,845.00	437,751.00
		REALTY INCOME CORP	11,551.00	465,043.26
		REGENCY CENTERS CORP	5,612.00	272,013.64
		SIMON PROPERTY GROUP	18,050.00	2,709,305.00
		SL GREEN REALTY CORP	5,669.00	502,216.71
		UDR INC	16,000.00	383,840.00
		VENTAS INC	17,389.00	1,089,594.74
		VORNADO REALTY TRUST	10,010.00	844,944.10
				アメリカドル小計
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	159,666.65
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	231,764.52
		カナダドル小計	17,018.00	391,431.17 (37,119,417)
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	254,872.02
		DEXUS PROPERTY GROUP	289,071.00	291,961.71
		FEDERATION CENTRES	89,917.00	204,111.59
		GOODMAN GROUP	102,048.00	503,096.64
		GPT GROUP	105,353.00	370,842.56
		MIRVAC GROUP	215,406.00	381,268.62
		STOCKLAND	131,200.00	511,680.00
		WESTFIELD GROUP	121,352.00	1,326,377.36
		WESTFIELD RETAIL TRUST	185,818.00	559,312.18

オーストラリアドル小計		1,366,967.00	4,403,522.68 (400,148,105)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	54,509.00	319,422.74
	HAMMERSON PLC	45,117.00	229,419.94
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	130,586.58
	LAND SECURITIES GROUP PLC	47,061.00	436,020.16
	SEGRO PLC	46,969.00	146,120.55
イギリスポンド小計		233,886.00	1,261,569.97 (199,441,596)
香港ドル	LINK REIT	136,000.00	5,154,400.00
香港ドル小計		136,000.00	5,154,400.00 (64,996,984)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	259,740.00
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	162,800.00
	CAPITAMALL TRUST	149,000.00	295,765.00
シンガポールドル小計		370,000.00	718,305.00 (55,869,762)
ユーロ	CORIO NV	4,573.00	147,182.00
	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	101,166.15
	GECINA SA	1,389.00	130,163.19
	ICADE	2,102.00	142,746.82
	KLEPIERRE	6,313.00	200,469.31
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,696.00	1,048,064.00
ユーロ小計		21,722.00	1,769,791.47 (233,382,401)
投資証券合計			3,132,928,749 (3,132,928,749)
合計			3,229,833,317 (3,229,833,317)

## (注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

## (4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 573銘柄	97.6%	57.5%
	投資信託受益証券 1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券 28銘柄	2.3%	1.4%
カナダドル	株式 92銘柄	99.5%	4.6%
	投資証券 2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	92.1%	3.4%
	投資信託受益証券 3銘柄	1.0%	0.0%
	投資証券 9銘柄	6.9%	0.3%
イギリスポンド	株式 102銘柄	98.7%	10.0%
	投資証券 5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	4.2%

香港ドル	株式	39銘柄	96.4%	1.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.6%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	26銘柄	95.0%	0.7%
	投資証券	3銘柄	5.0%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	226銘柄	98.9%	13.5%
	投資証券	6銘柄	1.1%	0.2%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。



## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(平成25年10月1日から平成26年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DC外国株式インデックス・オープン】 中間財務諸表

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

第13期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	44,057,270
親投資信託受益証券	9,273,832,435
未収利息	35
流動資産合計	9,317,889,740
<b>資産合計</b>	
9,317,889,740	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	7,309,006
未払受託者報酬	2,713,373
未払委託者報酬	33,464,848
その他未払費用	226,052
流動負債合計	43,713,279
<b>負債合計</b>	
43,713,279	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	4,965,145,270
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,309,031,191
（分配準備積立金）	1,794,303,036
元本等合計	9,274,176,461
<b>純資産合計</b>	
9,274,176,461	
<b>負債純資産合計</b>	
9,317,889,740	

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期中間計算期間 (自 平成25年10月 1日 至 平成26年 3月31日)
<b>営業収益</b>	
受取利息	7,516
有価証券売買等損益	1,187,058,560
営業収益合計	1,187,066,076
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	2,713,373
委託者報酬	33,464,848
その他費用	226,052
営業費用合計	36,404,273
営業利益又は営業損失( )	1,150,661,803
経常利益又は経常損失( )	1,150,661,803
中間純利益又は中間純損失( )	1,150,661,803
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	74,615,260
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,014,801,591
剰余金増加額又は欠損金減少額	584,167,663
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	584,167,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	365,984,606
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	365,984,606
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,309,031,191

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (中間貸借対照表に関する注記)

	第13期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)
1. 期首元本額	4,802,875,641円
期中追加設定元本額	738,004,098円
期中一部解約元本額	575,734,469円
2. 当該中間計算期間の末日における 受益権総数	4,965,145,270口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8679円 (18,679円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

&lt; 参考 &gt;

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

同マザーファンドの平成26年3月31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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,130,433,921
コール・ローン	571,576,854
株式	157,870,911,615
投資信託受益証券	110,090,462
投資証券	3,282,576,065
派生商品評価勘定	21,619,798
未収入金	9,272,097
未収配当金	329,040,020
未収利息	463
差入委託証拠金	887,999,830
流動資産合計	165,213,521,125
資産合計	165,213,521,125
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,974,571
未払解約金	268,975,817
流動負債合計	274,950,388
負債合計	274,950,388
純資産の部	
元本等	
元本	99,368,029,056
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	65,570,541,681
元本等合計	164,938,570,737
純資産合計	164,938,570,737
負債純資産合計	165,213,521,125

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成26年 3月31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)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	110,876,572,872円
中間計算期間中の追加設定元本額	9,285,648,380円
中間計算期間中の一部解約元本額	20,794,192,196円
計算日の元本額	99,368,029,056円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,112,719,223円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,608,821円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	18,394,437,537円
世界経済インデックスファンド	935,023,188円
マイセレクション25	10,891,846円
マイセレクション50	27,602,927円
マイセレクション75	34,218,668円
外国株式インデックス・オープン	1,071,959,221円
DCマイセレクション25	856,088,384円
DCマイセレクション50	4,483,386,507円
DCマイセレクション75	4,671,766,548円
DC外国株式インデックス・オープン	5,586,982,611円
DCマイセレクションS25	310,256,041円
DCマイセレクションS50	1,530,567,445円
DCマイセレクションS75	1,053,858,507円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	3,763,114円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	133,438,469円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	137,274,828円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	65,931,716円
DC世界経済インデックスファンド	863,652,647円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	12,862,205,531円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	84,239,176円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	52,618,553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)	268,943,763円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	562,333,638円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,966,745,014円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,775,026,585円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,573,916,694円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,951,018,911円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	965,240,603円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,046,460,133円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	8,767,332,892円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,618,196,732円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	960,484,972円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,032,646,572円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	331,009,512円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,690,953,929円
FOfs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,875,462,729円
外国株式ファンド・シリーズ1	653,357,249円
コア投資戦略ファンド(安定型)	877,013,494円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,607,006,509円
分散投資コア戦略ファンドA	65,828,314円
分散投資コア戦略ファンドS	196,643,884円



DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	176,605,903円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	98,723,009円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,193,368円
2. 計算日における受益権総数	99,368,029,056口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6599円 (16,599円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在		
		契約額等(円)	時価	評価損益
		うち1年超	(円)	(円)

市場取引	株価指数先物取引 買 建	3,709,629,909	-	3,722,678,051	13,048,142
合計		3,709,629,909	-	3,722,678,051	13,048,142

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

## 通貨関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	205,345,455	-	206,849,100	1,503,645
	カナダドル	9,184,700	-	9,316,000	131,300
	オーストラリアドル	9,478,320	-	9,517,000	38,680
	イギリスポンド	32,178,620	-	32,547,000	368,380
	スイスフラン	8,129,730	-	8,129,100	630
	香港ドル	13,148,900	-	13,270,000	121,100
	ユーロ	56,221,390	-	56,656,000	434,610
	計	333,687,115	-	336,284,200	2,597,085
合計		333,687,115	-	336,284,200	2,597,085

## (注)時価の算定方法

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

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

## . ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成26年4月30日現在)

資産総額	9,481,436,635 円
負債総額	22,204,084 円
純資産総額( - )	9,459,232,551 円
発行済口数	4,999,173,426 口
1口当たり純資産額( / )	1.8922 円
1万口当たり純資産額	18,922 円

(参考情報)

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	166,096,829,522 円
負債総額	176,800,758 円
純資産総額( - )	165,920,028,764 円
発行済口数	98,603,046,403 口
1口当たり純資産額( / )	1.6827 円
1万口当たり純資産額	16,827 円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （イ）名義書換

該当事項はありません。

##### （ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### （ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

##### （ニ）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

###### 受益証券の不発行

委託者は、本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または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

###### 受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、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また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指定販売会社の名義で記載また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。

###### 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（平成26年4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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。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）からファンドマネージャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

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

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

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役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26年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成26年4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	371	4,892,631
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	0	0
単体型公社債投資信託	0	0
合計	371	4,892,631

### 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。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	4,826,115	8,192,444
前払費用	30,184	81,751
未収委託者報酬	944,716	2,210,605
未収運用受託報酬	26,998	31,051
未収入金	75,514	676
一年以内返還予定保証金	187,128	-
繰延税金資産	69,857	61,743
その他	31,325	19,263
流動資産合計	6,191,840	10,597,535
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 3,525	1 79,281
器具備品	1 14,970	1 103,209
建設仮勘定	62,454	-
有形固定資産合計	80,949	182,491
無形固定資産		
ソフトウェア	60,130	168,561
ソフトウェア仮勘定	12,151	-
その他無形固定資産	928	1,770
無形固定資産合計	73,209	170,332
投資その他の資産		
投資有価証券	43,194	47,112
長期前払費用	357	-
長期貸付金	-	31,838
会員権	-	25,000
その他の投資	165	633
貸倒引当金	-	31,838
投資その他の資産合計	43,717	72,746
固定資産合計	197,876	425,570
資産合計	6,389,717	11,023,105



（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	-	350,000
資本剰余金合計	-	350,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	56,500	59,500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	7,821,113	19,128,296
運用受託報酬	98,179	94,659
営業収益合計	7,919,292	19,222,955
営業費用		
支払手数料	3,715,816	9,030,246
広告宣伝費	61,165	73,287
公告費	2,451	2,244
調査費	1,023,870	4,132,154
調査費	86,225	207,030
委託調査費	936,024	3,922,394
図書費	1,620	2,729
営業雑経費	610,455	1,294,879
通信費	10,764	21,905
印刷費	121,287	330,735
協会費	10,136	21,939
諸会費	803	757
情報機器関連費	436,328	874,151
その他営業雑経費	31,135	45,391
営業費用合計	5,413,759	14,532,812
一般管理費		
給料	1,276,685	2,259,238
役員報酬	35,160	78,205
給料・手当	1,048,061	1,967,177
賞与	193,464	213,855
退職給付費用	66,790	64,787
福利費	152,149	190,716
交際費	1,012	879
旅費交通費	25,687	45,160
租税公課	16,148	25,420
不動産賃借料	238,033	129,096
寄付金	2,832	-
減価償却費	55,540	129,966
敷金償却	2,804	-
諸経費	81,858	1 257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213
営業利益	585,991	1,586,929

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
<b>株主資本</b>		
<b>資本金</b>		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
<b>資本剰余金</b>		
<b>その他資本剰余金</b>		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000
<b>利益剰余金</b>		
<b>利益準備金</b>		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
<b>その他利益剰余金</b>		
<b>別途積立金</b>		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
<b>繰越利益剰余金</b>		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
<b>利益剰余金合計</b>		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

#### 時価のあるもの

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

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

#### (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、当期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、当期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24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
建 物	84,592	千円	23,594	千円
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

## （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23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
諸経費		千円	97,199	千円

## （株主資本等変動計算書関係）

## 前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24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）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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	-

(注) (1)普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2)普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

## 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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

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

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

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成25年6月28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通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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

（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24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	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(\*)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25年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(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

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24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	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

（有価証券関係）

## 1．その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位:千円）

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

## 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23年4月1日 至 平成24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
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位:千円）

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

## （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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

（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。

（注）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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

（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。

（注）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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

## 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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

当事業年度は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。

## （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

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

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

（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23年4月1日 至 平成24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㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-

(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

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

## (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23年4月1日至平成24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	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	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	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(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。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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24年3月31日）

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

当事業年度（平成25年3月31日）

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

## （企業結合等関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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

## 1．企業結合の概要

## (1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

## 結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## (2)企業結合日

平成24年4月1日

## (3)企業結合の法的形式

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

## (4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5)その他取引の概要に関する事項

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

## 2．実施した会計処理の概要

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

## （1株当たり情報）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末

(平成25年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	73,320
器具備品	1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070



(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

## 中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,222,467
運用受託報酬	36,913
営業収益合計	11,259,380
営業費用	8,307,878
一般管理費	1 1,553,438
営業利益	1,398,063
営業外収益	2 8,577
営業外費用	9,483
経常利益	1,397,157
税引前中間純利益	1,397,157
法人税、住民税及び事業税	577,514
法人税等調整額	55,190
法人税等合計	522,324
中間純利益	874,833

## 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

（単位：千円）

		第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高		4,998
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）		3,247
当中間期変動額合計		3,247
当中間期末残高		1,751
評価・換算差額等合計		
当期首残高		4,998
当中間期変動額		
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）		3,247
当中間期変動額合計		3,247
当中間期末残高		1,751
純資産合計		
当期首残高		8,546,410
当中間期変動額		
剰余金の配当		30,000
中間純利益		874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）		3,247
当中間期変動額合計		841,585
当中間期末残高		9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間  
(自 平成25年4月1日  
至 平成25年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## 有価証券

## その他有価証券

## 時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間末 （平成25年9月30日）	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建    物                    29,556千円
	器具備品                  251,697千円
	計                    281,253千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

## （中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1	減価償却実施額
	有形固定資産                    23,080千円
	無形固定資産                    33,012千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息                        4,063千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成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

## （リ - ス取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

## （金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	-
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	58,285	58,285	-
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## （注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

## (3)投資有価証券

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

## (4)未払金

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

## （有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	14,024	13,494	529
小計	14,024	13,494	529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,535,927千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

委託者は、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。

- (イ) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (ロ) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (ハ) 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、委託者の親法人等（委託者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（ニ）および（ホ）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (ニ) 委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (ホ) 前記（ハ）および（ニ）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (イ) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (ロ) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年6月30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25年9月末日現在）

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

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	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。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 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25年9月末日現在）

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

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25年11月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC外国株式インデックス・オープンの平成24年10月2日から平成25年9月30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、DC外国株式インデックス・オープンの平成25年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- 1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
  - 2．財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成26年5月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山田 信之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC外国株式インデックス・オープンの平成25年10月1日から平成26年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC外国株式インデックス・オープンの平成26年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年10月1日から平成26年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成25年6月7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	高波博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤浩之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27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25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

---

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。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9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 公認会計士 白川 芳樹 印  
業務執行社員  
指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 浩之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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