

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年6月30日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC外国株式インデックス・オープン

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

平成28年 7月 1日から平成28年12月28日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデック ス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		ル（日本	ファンド	（ ）		
大型株	年2回	を除く）			TOPIX	条件付運用型
中小型株			ファンド・	なし		
債券	年4回	日本	オブ・ファンズ		その他	ロング・
一般	年6回	北米			（MSCI コク	ショート型/絶
公債	（隔月）				サイ・イン	対収益追求型
社債		欧州			デックス	
その他債券	年12回				（円ベ	その他
クレジット属性	（毎月）	アジア			ス））	（ ）
（ ）	日々	オセアニア				
不動産投信	その他					
	（ ）	中南米				
その他資産						
（投資信託証券		アフリカ				
（株式一般）						
資産複合		中近東				
（ ）		（中東）				
資産配分						
固定型		エマージ				
資産配分		ング				
変更型						

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右さ

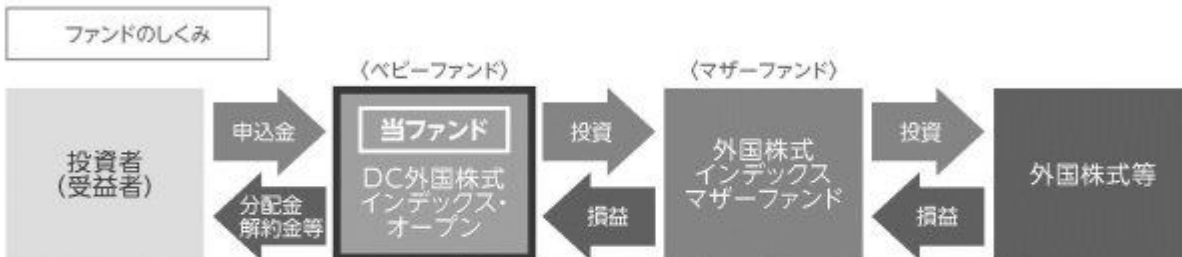
れにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



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

? ファミリーファンド方式とは

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

<マザーファンドの概要>

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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

? MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)とは

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

分配方針

- 原則として、毎年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。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

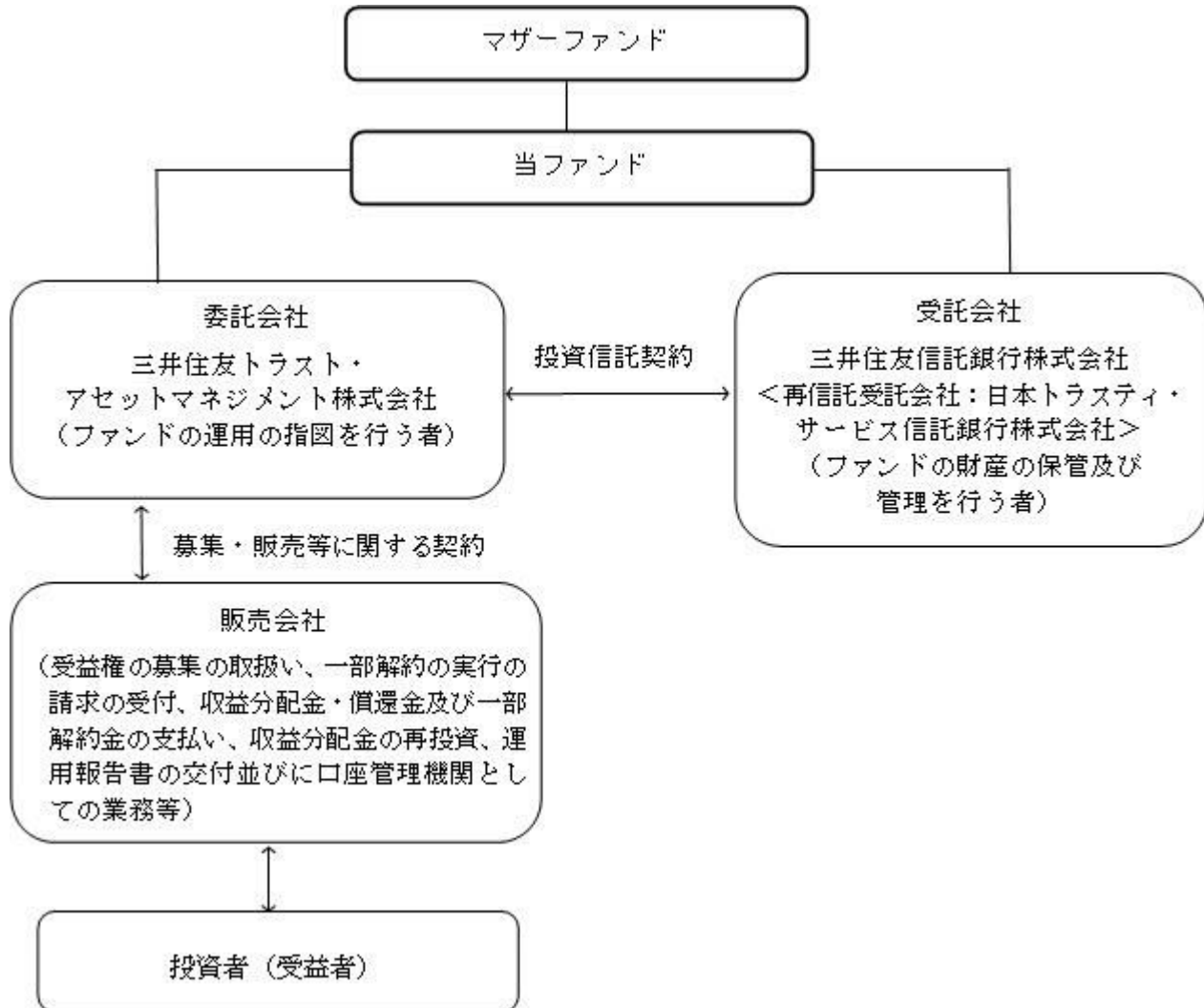
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成28年 4月28日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（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（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。

（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せん。）
 - 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せん。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
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。

(参考) マザーファンドの概要

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

原則として、MSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

有価証券等の価格変動リスク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、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。

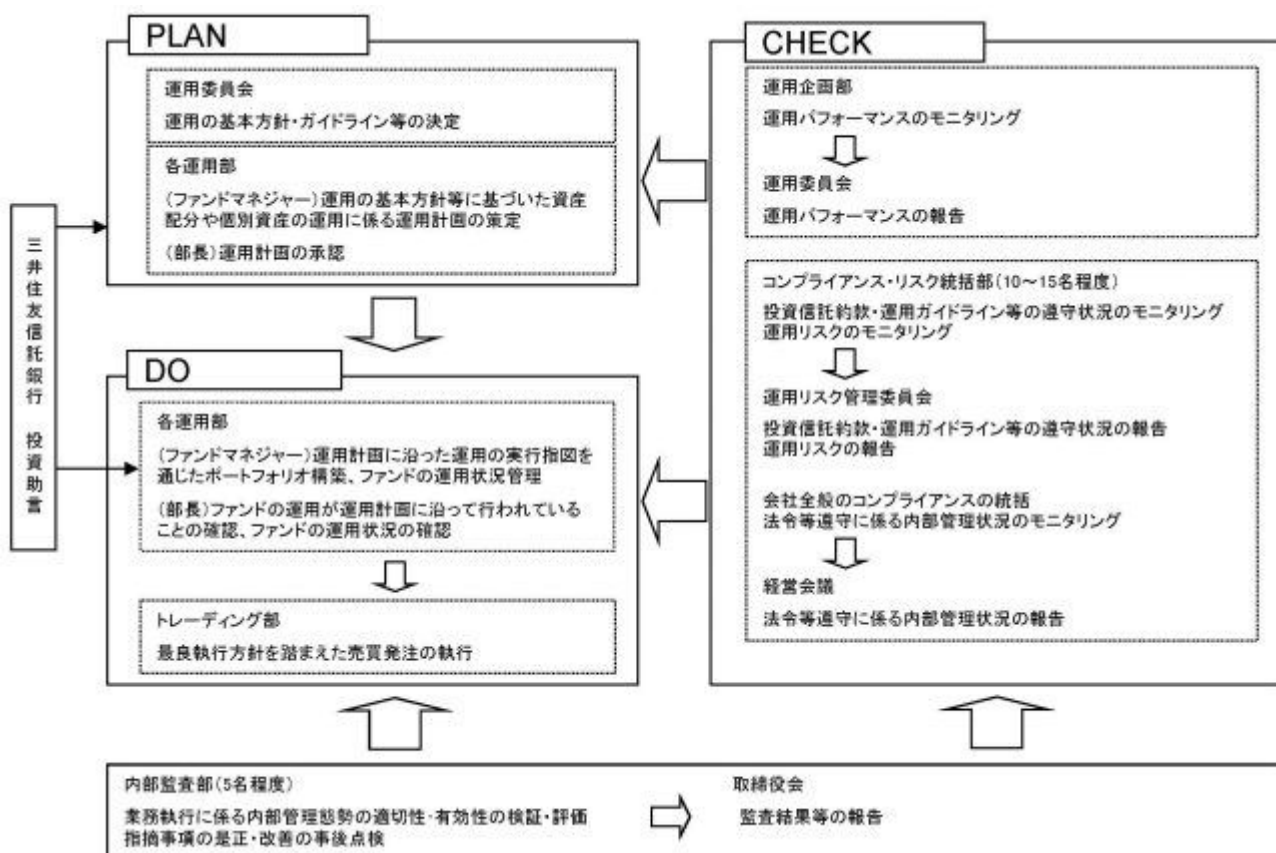
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行う

に当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

（４）【分配方針】

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。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（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、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、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、当該取引の契約期限が、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）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、MSCI コクサイ・インデックス（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。

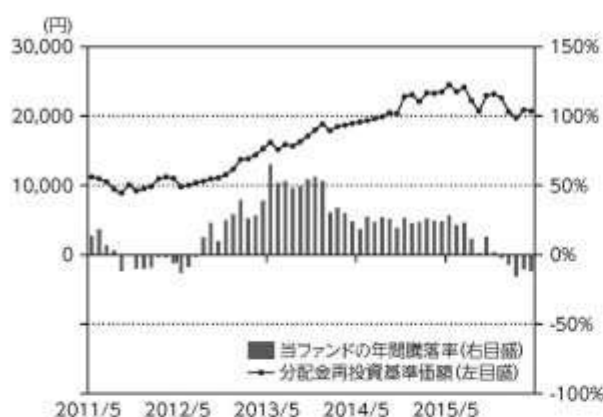
(2) リスクの管理体制

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

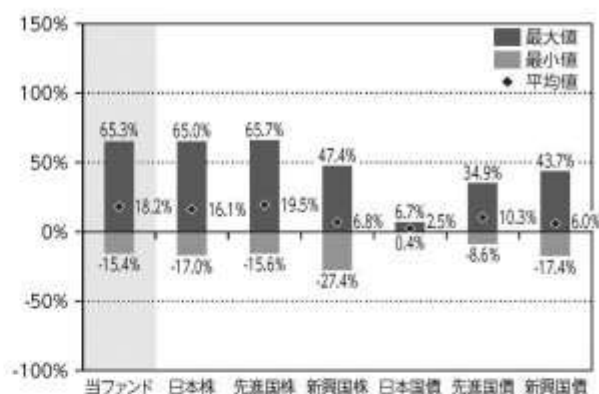
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2011年5月～2016年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX (東証株価指数、配当込み)^{*1}

先進国株… MSCIロクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)^{*2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)^{*3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{*4}

先進国債… シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)^{*5}

新興国債… JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レディ・シフアード (円ベース)^{*6}

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

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

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

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

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

*5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

「信託財産留保額」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徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2808% (税抜 0.26%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.5184% (税抜 0.48%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0648% (税抜 0.06%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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す。

上記は、平成28年 4月28日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、平成28年 4月28日現在の状況について記載してあります。

【DC外国株式インデックス・オープン】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	12,294,204,034	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		387,332	0.00
合計(純資産総額)		12,294,591,366	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	6,553,064,354	1.8636	12,212,511,695	1.8761	12,294,204,034	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。

□ 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期計算期間末（平成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
第13期計算期間末（平成26年 9月30日）	10,784,005,815	10,784,005,815	20,456	20,456
第14期計算期間末（平成27年 9月30日）	11,660,543,974	11,660,543,974	20,674	20,674
平成27年 4月末日	13,049,681,430		23,451	
5月末日	13,568,082,583		24,477	
6月末日	13,111,725,008		23,492	
7月末日	13,362,343,329		24,136	
8月末日	12,265,445,817		22,206	
9月末日	11,660,543,974		20,674	
10月末日	13,051,022,232		22,921	
11月末日	13,170,262,666		23,155	
12月末日	12,887,461,371		22,594	
平成28年 1月末日	11,876,358,224		20,580	
2月末日	11,458,279,854		19,717	

3月末日	12,254,727,670		20,845	
4月末日	12,294,591,366		20,734	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第5期計算期間	平成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
第13期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	0
第14期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
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期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	25.7
第14期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	1.1
第15期中間計算期間	平成27年10月 1日～平成28年 3月31日	0.8

(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期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	1,521,908,168	1,052,984,543	5,271,799,266
第14期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	1,857,940,393	1,489,664,884	5,640,074,775
第15期中間計算期間	平成27年10月 1日～平成28年 3月31日	736,896,683	497,909,188	5,879,062,270

(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)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	148,404,203,548	56.38
	イギリス	19,256,237,031	7.32
	スイス	10,080,038,819	3.83
	カナダ	9,512,648,370	3.61
	フランス	9,381,655,305	3.56
	ドイツ	9,370,446,154	3.56
	オーストラリア	6,275,106,493	2.38
	オランダ	4,262,371,907	1.62
	アイルランド	4,102,640,212	1.56
	スペイン	3,303,032,921	1.25
	スウェーデン	2,941,638,521	1.12
	香港	2,299,625,832	0.87
	デンマーク	1,995,766,199	0.76
	イタリア	1,990,611,892	0.76
	シンガポール	1,730,679,576	0.66
	ベルギー	1,504,043,331	0.57
	ジャージー	1,180,265,466	0.45
	フィンランド	966,969,751	0.37
	キュラソー	946,143,270	0.36
	パミュダ	926,832,304	0.35
イスラエル	677,716,002	0.26	
ノルウェー	621,308,893	0.24	
ケイマン	596,259,821	0.23	
ルクセンブルク	224,858,968	0.09	

	ポルトガル	181,732,572	0.07
	ニュージーランド	180,954,269	0.07
	オーストリア	174,002,398	0.07
	パナマ	166,487,181	0.06
	リベリア	112,045,329	0.04
	英ヴァージン諸島	84,207,926	0.03
	パプアニューギニア	58,654,051	0.02
	マン島	29,434,650	0.01
	モーリシャス	13,826,749	0.01
	小計	243,552,445,711	92.52
投資信託受益証券	オーストラリア	193,204,747	0.07
	香港	51,086,877	0.02
	シンガポール	23,355,348	0.01
	小計	267,646,972	0.10
投資証券	アメリカ	4,806,746,834	1.83
	オーストラリア	656,158,536	0.25
	フランス	404,136,339	0.15
	イギリス	336,398,858	0.13
	香港	120,218,400	0.05
	シンガポール	101,429,074	0.04
	カナダ	59,303,345	0.02
	小計	6,484,391,386	2.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,937,553,573	4.91
合計(純資産総額)		263,242,037,642	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,260,355,700	3.14
	買建	カナダ	705,890,240	0.27
	買建	ドイツ	2,146,442,888	0.82
	買建	イギリス	1,279,514,419	0.49
	買建	オーストラリア	526,558,410	0.20

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		462,198,900	0.18

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	427,536	14,139.71	6,045,236,966	10,735.74	4,589,917,474	1.74
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,738	5,203.94	3,027,334,704	5,590.66	3,252,302,276	1.24
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	318,846	9,166.17	2,922,596,890	9,708.48	3,095,511,608	1.18
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	211,951	11,039.32	2,339,795,013	12,376.50	2,623,213,141	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	722,989	3,006.73	2,173,839,582	3,394.56	2,454,234,962	0.93
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	174,120	9,295.46	1,618,525,586	11,950.67	2,080,851,966	0.79
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	371,816	6,109.94	2,271,775,562	5,589.56	2,078,290,630	0.79
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	30,530	49,330.25	1,506,052,576	66,571.05	2,032,414,385	0.77
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	471,373	3,787.88	1,785,509,020	4,249.52	2,003,108,991	0.76
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	244,547	8,292.14	2,027,819,627	8,190.89	2,003,058,800	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	282,107	7,201.59	2,031,620,743	7,036.07	1,984,925,305	0.75
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	23,850	61,810.09	1,474,170,784	77,465.94	1,847,562,669	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	208,455	8,611.75	1,795,163,597	8,767.92	1,827,718,327	0.69
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	22,345	63,706.19	1,423,515,005	79,180.23	1,769,282,351	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	311,799	5,389.27	1,680,371,325	5,672.97	1,768,828,712	0.67
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	473,152	3,745.91	1,772,389,156	3,621.75	1,713,638,256	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	144,279	10,891.92	1,571,475,782	11,397.53	1,644,425,313	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	316,666	4,506.54	1,427,069,240	4,903.63	1,552,812,898	0.59

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	53,915	31,535.54	1,700,238,722	28,055.65	1,512,620,370	0.57
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	90,921	15,629.52	1,421,052,100	16,199.09	1,472,838,371	0.56
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	174,656	10,937.50	1,910,301,712	8,427.98	1,471,998,148	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	97,262	12,434.15	1,209,370,592	14,898.56	1,449,063,986	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	120,395	11,980.23	1,442,360,886	11,554.48	1,391,101,620	0.53
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	214,289	6,442.86	1,380,634,070	6,180.02	1,324,310,842	0.50
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	798,744	1,808.82	1,444,791,529	1,648.44	1,316,685,553	0.50
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	149,422	7,693.79	1,149,622,281	8,643.90	1,291,590,320	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	190,391	6,442.82	1,226,656,771	6,727.67	1,280,888,771	0.49
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	118,803	9,242.50	1,098,037,643	10,675.38	1,268,267,467	0.48
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	362,362	3,639.18	1,318,700,985	3,484.56	1,262,673,037	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	111,745	10,628.45	1,187,677,048	11,263.64	1,258,655,731	0.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.98
		素材	4.47
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.85
		自動車・自動車部品	1.56
		耐久消費財・アパレル	1.72
		消費者サービス	1.76
		メディア	2.90
		小売	3.73
		食品・生活必需品小売り	2.07
		食品・飲料・タバコ	6.14
		家庭用品・パーソナル用品	2.16
		ヘルスケア機器・サービス	3.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.18
銀行	8.22		

	各種金融	3.77
	保険	4.03
	不動産	0.69
	ソフトウェア・サービス	8.04
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.40
	電気通信サービス	3.16
	公益事業	3.28
	半導体・半導体製造装置	1.94
	小計	92.52
投資信託受益証券		0.10
投資証券		2.46
合計		95.09

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	144	アメリカドル	73,330,823	8,048,057,824	75,265,200	8,260,355,700	3.14
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	50	カナダドル	7,888,233	687,775,035	8,096,000	705,890,240	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	4,525,876	510,971,400	4,657,400	525,820,460	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	426	ユーロ	12,635,477	1,568,315,405	13,056,900	1,620,622,428	0.62
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	49	オーストラリアドル	6,212,843	518,151,106	6,313,650	526,558,410	0.20
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	128	イギリスポンド	7,822,475	1,247,528,313	8,023,040	1,279,514,419	0.49

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,110,000.00	346,373,628	341,284,700	0.13

カナダドル	買建	160,000.00	14,120,960	13,948,800	0.01
ユーロ	買建	300,000.00	37,746,600	37,236,000	0.01
イギリスポンド	買建	200,000.00	32,453,060	31,890,000	0.01
スイスフラン	買建	130,000.00	14,865,175	14,677,000	0.01
オーストラリアドル	買建	120,000.00	10,356,900	10,004,400	0.00
イスラエルシェケル	買建	450,000.00	13,315,905	13,158,000	0.00

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2001年10月1日

作成基準日：2016年4月28日

基準価額・純資産の推移



基準価額	20,734円
純資産総額	122.95億円

※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	2011年9月	2012年10月	2013年9月	2014年9月	2015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%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.2%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.2%
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	1.0%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	0.9%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	0.8%
WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	銀行	0.8%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	0.8%
AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	0.8%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.8%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2016年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当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。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

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。

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けませんとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、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、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

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。

外貨建資産等の円換算

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。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成13年10月1日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

（５）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

ファンドの繰上償還において、上記 から までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 反対者の買取請求権 >

ファンドの償還又は重大な約款変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融

商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(平成26年10月1日から平成27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13期 (平成26年 9月30日現在)	第14期 (平成27年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	71,959,392	86,161,589
親投資信託受益証券	10,783,656,486	11,660,162,655
未収利息	24	15
流動資産合計	10,855,615,902	11,746,324,259
資産合計	10,855,615,902	11,746,324,259
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,160,849	28,886,994
未払受託者報酬	3,221,615	4,216,693
未払委託者報酬	39,733,169	52,005,753
その他未払費用	494,454	670,845
流動負債合計	71,610,087	85,780,285
負債合計	71,610,087	85,780,285
純資産の部		
元本等		
元本	5,271,799,266	5,640,074,775
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,512,206,549	6,020,469,199
(分配準備積立金)	3,496,045,093	2,661,205,384
元本等合計	10,784,005,815	11,660,543,974
純資産合計	10,784,005,815	11,660,543,974
負債純資産合計	10,855,615,902	11,746,324,259

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日	自	平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日
営業収益				
受取利息		16,049		25,491
有価証券売買等損益		2,146,324,553		167,651,016
営業収益合計		2,146,340,602		167,676,507
営業費用				
受託者報酬		5,934,988		8,051,630
委託者報酬		73,198,017		99,303,315
その他費用		494,454		670,845
営業費用合計		79,627,459		108,025,790
営業利益又は営業損失（ ）		2,066,713,143		59,650,717
経常利益又は経常損失（ ）		2,066,713,143		59,650,717
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,066,713,143		59,650,717
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（ ）		205,335,722		283,172,889
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,014,801,591		5,512,206,549
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,322,071,492		2,330,709,042
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,322,071,492		2,330,709,042
剰余金減少額又は欠損金増加額		686,043,955		1,598,924,220
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		686,043,955		1,598,924,220
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,512,206,549		6,020,469,199

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第13期 (平成26年 9月30日現在)	第14期 (平成27年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,271,799,266口	5,640,074,775口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0456円 (20,456円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0674円 (20,674円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第13期 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日			第14期 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	16,049円	費用控除後の配当等収益額	A	- 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	1,861,361,372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
収益調整金額	C	4,030,128,250円	収益調整金額	C	5,390,729,444円
分配準備積立金額	D	1,634,667,672円	分配準備積立金額	D	2,661,205,384円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,526,173,343円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,051,934,828円
当ファンドの期末残存口数	F	5,271,799,266口	当ファンドの期末残存口数	F	5,640,074,775口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,276円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	14,276円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第14期 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第14期 (平成27年 9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期	第14期
	自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日	自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,802,875,641円	5,271,799,266円
期中追加設定元本額	1,521,908,168円	1,857,940,393円
期中一部解約元本額	1,052,984,543円	1,489,664,884円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第13期 (平成26年 9月30日現在)	第14期 (平成27年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,113,815,061	94,947,069
合計	2,113,815,061	94,947,069

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	6,264,189,672	11,660,162,655	
合計		6,264,189,672	11,660,162,655	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「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27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

貸借対照表

項目	平成27年 9月30日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,160,906,411
コール・ローン	1,765,654,366
株式	228,769,237,105
投資信託受益証券	181,884,582
投資証券	5,842,121,235
派生商品評価勘定	5,814,654
未収入金	2,354,869
未収配当金	403,271,469
未収利息	319
前払金	247,594,487
差入委託証拠金	874,853,000
流動資産合計	243,253,692,497
資産合計	243,253,692,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	250,638,246
未払解約金	151,140,718
流動負債合計	401,778,964
負債合計	401,778,964
純資産の部	
元本等	
元本	130,465,120,039
剰余金	
剰余金又は欠損金()	112,386,793,494

	平成27年 9月30日現在
項目	金額（円）
元本等合計	242,851,913,533
純資産合計	242,851,913,533
負債純資産合計	243,253,692,497

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

平成27年 9月30日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,465,120,039口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8614円 (1万口当たり純資産額) (18,614円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成27年 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。

平成27年 9月30日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

平成27年 9月30日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年10月 1日
期首元本額	103,878,614,653円
期中追加設定元本額	76,356,948,219円
期中一部解約元本額	49,770,442,833円
期末元本額	130,465,120,039円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,993,728,722円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,586,430円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	24,803,273,743円
世界経済インデックスファンド	2,191,250,924円
マイセレクション25	4,329,362円
マイセレクション50	20,404,671円
マイセレクション75	23,488,621円
外国株式インデックス・オープン	1,027,589,370円
D Cマイセレクション25	884,773,512円
D Cマイセレクション50	4,382,284,337円
D Cマイセレクション75	4,647,723,061円
D C外国株式インデックス・オープン	6,264,189,672円
D CマイセレクションS25	313,635,861円
D CマイセレクションS50	1,655,684,733円
D CマイセレクションS75	1,219,107,847円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	140,814,391円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	155,252,286円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	81,873,386円
D C世界経済インデックスファンド	2,135,676,097円

区分	平成27年 9月30日現在
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,953,602,205円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,980,235円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	28,010,126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）	142,191,148円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	218,368,853円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	745,208,939円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	555,254,778円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	753,766,051円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,881,085,594円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	709,636,651円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,589,087,831円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,817,837,497円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,032,528,621円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	695,212,573円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	701,325,623円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,436,652円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,640,547,051円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,750,901,039円
外国株式ファンド・シリーズ1	690,805,098円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,953,962,057円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,495,231,648円
分散投資コア戦略ファンドA	705,314,507円
分散投資コア戦略ファンドS	1,260,706,748円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	144,521,058円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	200,357,018円
コア投資戦略ファンド（切替型）	913,478,720円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	521,061,761円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	39,007,373円
SMT インデックスバランス・オープン	184,506,810円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	4,185,967,701円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	26,523,947,636円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,198,603,411円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	32,062,860,999
投資信託受益証券	22,627,063
投資証券	307,367,468
合計	32,392,855,530

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成27年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,742,041,494	-	9,494,447,007	247,594,487
合計		9,742,041,494	-	9,494,447,007	247,594,487

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成27年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,069,179,205	-	3,071,950,100	2,770,895
	アメリカドル	1,965,668,000	-	1,967,180,000	1,512,000
	カナダドル	120,623,400	-	120,595,500	27,900
	ユーロ	404,439,000	-	404,910,000	471,000
	イギリスポンド	263,560,500	-	263,682,500	122,000
	スイスフラン	129,446,650	-	129,738,000	291,350
	スウェーデンクローナ	43,311,315	-	43,543,500	232,185
	デンマーククローネ	13,357,740	-	13,386,600	28,860
	オーストラリアドル	67,064,900	-	67,235,000	170,100
	香港ドル	44,889,100	-	44,863,000	26,100
	シンガポールドル	16,818,600	-	16,816,000	2,600
	合計		3,069,179,205	-	3,071,950,100

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	36,549	59.04	2,157,852.96	
	ANTERO RESOURCES CORP	6,631	20.51	136,001.81	
	APACHE CORP	26,227	37.12	973,546.24	
	BAKER HUGHES	31,466	50.47	1,588,089.02	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,004	21.54	624,746.16	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,037	61.41	862,012.17	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	48.50	761,013.50	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	6.79	283,618.30	
	CHEVRON CORP	134,308	76.25	10,240,985.00	
	CIMAREX ENERGY CO	6,569	99.53	653,812.57	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,979	6.80	135,857.20	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	21,371	17.70	378,266.70	
	CONCHO RESOURCES INC	8,359	96.60	807,479.40	
	CONOCOPHILLIPS	88,345	46.57	4,114,226.65	
	CONSOL ENERGY INC	14,731	9.41	138,618.71	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	28.03	175,607.95	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,702	97.78	264,201.56	
	DEVON ENERGY CORPORATION	27,140	36.43	988,710.20	
	ENERGEN CORP	4,802	50.03	240,244.06	
	ENSCO PLC-CL A	14,882	14.25	212,068.50	
	EOG RESOURCES INC	39,428	70.13	2,765,085.64	
	EQT CORPORATION	10,652	65.06	693,019.12	
	EXXON MOBIL	298,277	72.97	21,765,272.69	
	FMC TECHNOLOGIES INC	15,287	31.55	482,304.85	
	HALLIBURTON CO	61,292	34.68	2,125,606.56	
	HELMERICH & PAYNE	6,883	47.84	329,282.72	
	HESS CORP	17,961	48.28	867,157.08	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,448	46.77	582,192.96	
	KINDER MORGAN INC	132,085	26.16	3,455,343.60	
	MARATHON OIL CORP	47,335	14.97	708,604.95	
MARATHON PETROLEUM CORP	39,252	45.54	1,787,536.08		

MURPHY OIL CORP	11,085	23.98	265,818.30
NABORS INDUSTRIES LTD	18,529	9.66	178,990.14
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,272	37.08	1,048,325.76
NOBLE ENERGY INC	29,710	29.70	882,387.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,076	64.47	3,550,749.72
OCEANEERING INTL INC	7,126	39.25	279,695.50
ONEOK INC	15,568	30.86	480,428.48
PHILLIPS 66	38,948	74.51	2,902,015.48
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,365	118.45	1,227,734.25
RANGE RESOURCES CORP	12,769	31.07	396,732.83
SCHLUMBERGER	90,789	69.10	6,273,519.90
SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,105	12.17	354,207.85
SPECTRA ENERGY CORP	46,574	25.34	1,180,185.16
TESORO CORP	9,230	98.33	907,585.90
VALERO ENERGY CORP	36,660	58.74	2,153,408.40
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	8.35	441,606.45
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	14.59	204,522.62
WILLIAMS COS	51,233	34.93	1,789,568.69
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,784	125.82	1,860,122.88
AIRGAS INC	5,138	89.09	457,744.42
ALBEMARLE CORP	7,098	42.53	301,877.94
ALCOA	92,840	9.45	877,338.00
ASHLAND INC	4,845	99.55	482,319.75
AVERY DENNISON CORP	6,084	55.59	338,209.56
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,076	25.00	276,900.00
BALL CORP	9,343	60.50	565,251.50
CELANESE CORP-SERIES A	11,407	56.51	644,609.57
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	44.19	764,796.33
CROWN HOLDINGS INC	10,494	45.01	472,334.94
DOW CHEMICAL CO	83,043	40.56	3,368,224.08
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	65,265	47.50	3,100,087.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,546	63.43	668,932.78
ECOLAB INC	19,413	108.36	2,103,592.68
FMC CORP	8,555	32.93	281,716.15
FREEPORT-MCMORAN INC	76,807	9.11	699,711.77
INT'L PAPER CO	27,907	37.39	1,043,442.73
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	101.09	609,370.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	80.96	2,355,207.36
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,255	148.37	631,314.35
MONSANTO CO	34,323	83.60	2,869,402.80
MOSAIC CO/THE	23,240	31.04	721,369.60
NEWMONT MINING CORP	39,440	15.82	623,940.80

NUCOR CORP	22,283	37.16	828,036.28
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	59.49	409,707.63
PPG INDUSTRIES INC	19,788	85.95	1,700,778.60
PRAXAIR INC	20,875	100.55	2,098,981.25
SEALED AIR CORP	14,781	45.97	679,482.57
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,525	218.94	1,209,643.50
SIGMA-ALDRICH	8,333	138.58	1,154,787.14
VULCAN MATERIALS CO	9,287	85.15	790,788.05
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	49.97	162,902.20
WESTROCK CO	18,286	50.57	924,723.02
3 M COMPANY	45,347	141.55	6,418,867.85
ACUITY BRANDS INC	3,065	169.87	520,651.55
AGCO CORP	5,969	46.36	276,722.84
AMETEK INC	16,903	51.13	864,250.39
B/E AEROSPACE INC	6,965	43.59	303,604.35
BOEING CO	46,968	128.75	6,047,130.00
CATERPILLAR	41,174	64.31	2,647,899.94
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	37.34	244,128.92
CUMMINS INC	11,934	108.10	1,290,065.40
DANAHER CORP	43,959	83.21	3,657,828.39
DEERE&CO	22,921	73.62	1,687,444.02
DOVER CORP	11,832	56.50	668,508.00
EATON CORP	33,730	50.66	1,708,761.80
EMERSON ELECTRIC CO	48,150	43.46	2,092,599.00
FASTENAL CO	19,679	36.49	718,086.71
FLOWSERVE CORP	8,985	40.19	361,107.15
FLUOR CORP	10,027	41.35	414,616.45
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	46.75	517,709.50
GENERAL DYNAMICS CORP	20,072	135.59	2,721,562.48
GENERAL ELECTRIC CO	718,680	24.57	17,657,967.60
GRAINGER (WW) INC	4,203	211.93	890,741.79
HONEYWELL INTL INC	53,131	92.52	4,915,680.12
ILLINOIS TOOL WORKS	23,885	81.34	1,942,805.90
INGERSOLL-RAND PLC	18,349	50.61	928,642.89
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	37.31	295,383.27
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	102.08	624,423.36
LOCKHEED MARTIN CORP	19,263	202.47	3,900,179.61
MASCO CORP	23,242	24.58	571,288.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,265	163.55	2,169,490.75
PACCAR INC	24,562	52.21	1,282,382.02
PARKER HANNIFIN CORP	10,107	96.50	975,325.50
PENTAIR PLC	12,104	50.79	614,762.16

PRECISION CASTPARTS CORP	9,957	229.24	2,282,542.68
QUANTA SERVICES INC	14,015	23.85	334,257.75
RAYTHEON COMPANY	21,971	106.68	2,343,866.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,353	100.36	938,667.08
ROCKWELL COLLIN	9,269	80.03	741,798.07
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,964	153.12	1,066,327.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,018	43.35	520,980.30
SNAP-ON INC	4,317	148.90	642,801.30
STANLEY BLACK&DECKER	10,775	94.90	1,022,547.50
TEXTRON	19,521	37.43	730,671.03
TRANSDIGM GROUP INC	3,709	212.22	787,123.98
UNITED RENTALS INC	7,302	59.94	437,681.88
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,490	87.98	5,321,910.20
WABCO HOLDINGS INC	3,875	104.09	403,348.75
WABTEC CORP	7,158	85.77	613,941.66
XYLEM INC	11,717	31.99	374,826.83
ADT CORPORATION	11,437	30.07	343,910.59
CINTAS CORP	6,449	84.80	546,875.20
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	102.54	250,197.60
EQUIFAX INC	8,759	95.80	839,112.20
IHS INC-CLASS A	5,122	110.56	566,288.32
MANPOWER GROUP	5,272	77.43	408,210.96
NIELSEN HOLDINGS PLC	24,369	45.24	1,102,453.56
REPUBLIC SERVICES INC	18,168	40.32	732,533.76
ROBERT HALF INTL INC	9,340	49.77	464,851.80
STERICYCLE INC	5,973	138.21	825,528.33
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,146	118.44	609,492.24
TYCO INTERNATIONAL PLC	29,209	33.39	975,288.51
VERISK ANALYTICS INC	11,168	72.25	806,888.00
WASTE MANAGEMENT INC	33,137	49.22	1,631,003.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	39.18	483,324.48
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,328	68.15	703,853.20
CSX CORP	71,296	25.94	1,849,418.24
DELTA AIR LINES INC	15,095	44.04	664,783.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	46.53	658,585.62
FEDEX CORP	19,359	141.93	2,747,622.87
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,586	16.23	415,260.78
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,122	71.77	439,375.94
KANSAS CITY SOUTHERN	7,756	88.15	683,691.40
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,053	74.91	1,651,990.23
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	37.68	419,642.16
UNION PACIFIC CORP	62,862	86.55	5,440,706.10

UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,125	52.46	321,317.50
UNITED PARCEL SERVICE B	50,208	98.14	4,927,413.12
AUTOLIV INC	6,037	104.35	629,960.95
BORGWARNER INC	15,914	40.42	643,243.88
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,004	72.94	1,459,091.76
FORD MOTOR COMPANY	265,953	13.15	3,497,281.95
GENERAL MOTORS CO	103,843	29.15	3,027,023.45
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	28.32	527,941.44
HARLEY-DAVIDSON	14,677	53.22	781,109.94
JOHNSON CONTROLS INC	47,274	39.80	1,881,505.20
LEAR CORP	5,323	105.58	562,002.34
TESLA MOTORS INC	6,859	246.65	1,691,772.35
COACH INC	19,687	27.74	546,117.38
DR HORTON INC	24,329	28.82	701,161.78
GARMIN LTD	7,608	35.19	267,725.52
HANESBRANDS INC	28,237	28.03	791,483.11
HARMAN INTL INDS INC	4,743	91.99	436,308.57
HASBRO INC	7,972	72.69	579,484.68
JARDEN CORP	13,882	47.63	661,199.66
LEGGETT & PLATT INC	9,020	40.68	366,933.60
LENNAR CORP-CL A	12,360	47.00	580,920.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	49.81	421,990.32
MATTEL INC	25,250	21.03	531,007.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	40.70	566,544.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,358	176.19	767,836.02
NEWELL RUBBERMAID	19,732	38.56	760,865.92
NIKE B	48,802	119.67	5,840,135.34
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	118.68	556,727.88
PULTE GROUP INC	24,602	18.72	460,549.44
PVH CORP	5,867	96.76	567,690.92
RALPH LAUREN CORPORATION	3,958	104.05	411,829.90
TOLL BROTHERS INC	11,131	34.02	378,676.62
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12,439	93.96	1,168,768.44
VF CORP	24,586	67.23	1,652,916.78
WHIRLPOOL CORP	5,470	145.46	795,666.20
ARAMARK	17,044	28.81	491,037.64
BLOCK H & R INC	19,500	35.25	687,375.00
CARNIVAL CORPORATION	28,759	48.23	1,387,046.57
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,247	708.54	1,592,089.38
DARDEN RESTAURANTS INC	8,439	67.89	572,923.71
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,483	21.90	755,177.70
LAS VEGAS SANDS CORP	27,583	37.81	1,042,913.23

MARRIOTT INTL A	15,364	65.44	1,005,420.16
MCDONALD'S CORP	68,516	97.48	6,678,939.68
MGM RESORTS INTERNATIONAL	31,282	17.76	555,568.32
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,086	56.08	621,702.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,264	85.85	1,052,864.40
STARBUCKS CORP	107,240	55.72	5,975,412.80
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,530	64.53	808,560.90
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	70.18	567,054.40
WYNN RESORTS LTD	5,532	53.22	294,413.04
YUM BRANDS INC	31,103	76.15	2,368,493.45
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,178	32.10	423,013.80
CBS CORP-CL B	31,516	38.97	1,228,178.52
CHARTER COMMUNICATION-A	5,860	167.36	980,729.60
COMCAST CORP-CL A	151,626	55.14	8,360,657.64
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,986	55.58	1,611,041.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	26.40	258,799.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,203	24.70	449,614.10
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,581	56.36	878,145.16
INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	18.74	576,648.54
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,571	42.49	746,591.79
LIBERTY GLOBAL PLC-C	44,688	40.70	1,818,801.60
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	35.09	224,014.56
LIBERTY MEDIA CORP-C	15,233	33.70	513,352.10
NEWS CORP-CLASS A	27,721	12.26	339,859.46
OMNICOM GROUP	16,939	64.85	1,098,494.15
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	48.14	236,896.94
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.65	605,962.05
TEGNA INC	15,014	21.85	328,055.90
THE WALT DISNEY CO	115,045	99.42	11,437,773.90
TIME WARNER CABLE-A	20,265	174.00	3,526,110.00
TIME WARNER INC	59,065	66.60	3,933,729.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	90,566	25.80	2,336,602.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	30,649	25.88	793,196.12
VIACOM INC-CLASS B	25,254	42.83	1,081,628.82
ADVANCE AUTO PARTS	5,123	170.53	873,625.19
AMAZON.COM	28,241	496.07	14,009,512.87
AUTONATION INC	5,015	56.65	284,099.75
AUTOZONE INC	2,296	724.72	1,663,957.12
BED BATH & BEYOND INC	12,615	56.52	712,999.80
BEST BUY COMPANY INC	22,277	35.97	801,303.69
CARMAX INC	14,601	57.96	846,273.96
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	49.00	310,856.00

DOLLAR GENERAL CORP	22,000	70.33	1,547,260.00
DOLLAR TREE INC	15,514	66.24	1,027,647.36
EXPEDIA INC	7,575	114.01	863,625.75
FOOT LOCKER INC	9,388	71.91	675,091.08
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	40.43	302,861.13
GAP	17,852	30.22	539,487.44
GENUINE PARTS CO	10,617	82.54	876,327.18
HOME DEPOT	92,729	112.91	10,470,031.39
KOHL'S CORP	14,309	46.27	662,077.43
L BRANDS INC	17,992	89.39	1,608,304.88
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	31,128	26.09	812,129.52
LKQ CORP	22,518	27.94	629,152.92
LOWES COMPANIES	67,794	66.77	4,526,605.38
MACY'S INC	23,441	50.39	1,181,191.99
NETFLIX INC	28,992	98.35	2,851,363.20
NORDSTROM INC	10,094	70.44	711,021.36
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,304	242.98	1,774,725.92
PRICELINE GROUP INC/THE	3,710	1,200.32	4,453,187.20
ROSS STORES INC	30,013	47.56	1,427,418.28
SIGNET JEWELERS LTD	5,419	133.80	725,062.20
STAPLES INC	47,470	11.83	561,570.10
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,511	77.98	3,392,987.78
TIFFANY & CO	9,101	75.20	684,395.20
TJX COMPANIES INC	48,793	69.48	3,390,137.64
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	82.31	824,005.41
TRIPADVISOR INC	8,771	63.42	556,256.82
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,504	161.71	728,341.84
URBAN OUTFITTERS INC	7,303	29.01	211,860.03
COSTCO WHOLESALE CORP	31,505	143.72	4,527,898.60
CVS HEALTH CORP	80,600	95.12	7,666,672.00
KROGER CO	67,058	35.61	2,387,935.38
RITE AID CORP	69,829	6.10	425,956.90
SYSCO CORP	42,954	38.93	1,672,199.22
WAL-MART STORES	115,229	63.78	7,349,305.62
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,415	82.06	5,121,774.90
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	31.27	785,752.56
ALTRIA GROUP INC	140,516	54.23	7,620,182.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,789	41.02	1,837,244.78
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,415	95.52	803,800.80
BUNGE LIMITED	10,583	72.39	766,103.37
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,202	50.59	667,889.18
COCA-COLA CO	295,556	39.66	11,721,750.96

COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	47.71	719,943.90
CONAGRA	29,521	40.06	1,182,611.26
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,414	123.50	1,533,129.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,320	78.24	1,042,156.80
GENERAL MILLS INC	42,898	55.56	2,383,412.88
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,504	92.39	970,464.56
HORMEL FOODS CORP	10,754	61.78	664,382.12
JM SMUCKER CO	7,181	112.54	808,149.74
KELLOGG CO	18,340	66.45	1,218,693.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	53.71	441,603.62
KRAFT HEINZ CO/THE	42,751	69.20	2,958,369.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,566	81.19	695,473.54
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,100	69.64	981,924.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,738	82.00	880,516.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,411	40.81	4,750,732.91
MONSTER BEVERAGE CORP	9,868	134.55	1,327,739.40
PEPSICO INC	105,394	93.04	9,805,857.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,640	78.64	8,700,729.60
REYNOLDS AMERICAN INC	61,705	43.47	2,682,316.35
TYSON FOODS INC	21,224	41.82	887,587.68
WHITELAVE FOODS CO	12,395	40.23	498,650.85
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,620	84.53	813,178.60
CLOROX COMPANY	9,110	114.56	1,043,641.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,584	63.07	3,884,102.88
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	81.11	365,319.44
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,024	78.73	1,261,569.52
KIMBERLY-CLARK CORP	26,166	107.74	2,819,124.84
PROCTER & GAMBLE CO	193,587	72.28	13,992,468.36
ABBOTT LABORATORIES	106,578	39.50	4,209,831.00
AETNA INC	25,079	106.31	2,666,148.49
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,456	95.05	1,374,042.80
ANTHEM INC	19,010	137.72	2,618,057.20
BARD C R INC	5,186	185.40	961,484.40
BAXTER INTERNATIONAL	37,616	32.69	1,229,667.04
BECTON DICKINSON & CO	15,099	130.89	1,976,308.11
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,069	16.00	1,553,104.00
CARDINAL HEALTH	23,879	76.72	1,831,996.88
CENTENE CORP	7,820	52.87	413,443.40
CERNER CORP	21,475	59.48	1,277,333.00
CIGNA CORP	18,507	132.50	2,452,177.50
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,984	71.18	853,021.12
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,467	50.52	528,792.84

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,475	137.79	1,029,980.25
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	35.99	462,291.55
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	52,190	80.80	4,216,952.00
HCA HOLDINGS INC	23,905	74.08	1,770,882.40
HENRY SCHEIN INC	5,885	129.95	764,755.75
HOLOGIC INC	16,762	37.86	634,609.32
HUMANA INC	10,808	175.76	1,899,614.08
INTUITIVE SURGICAL INC	2,554	455.47	1,163,270.38
LABORATORY CRP OF AMER	7,053	106.86	753,683.58
MCKESSON CORP	16,616	184.77	3,070,138.32
MEDTRONIC PLC	101,217	66.37	6,717,772.29
PATTERSON COMPANIES INC	5,552	42.97	238,569.44
QUEST DIAGNOSTICS	10,170	60.70	617,319.00
RESMED INC	10,525	50.62	532,775.50
ST JUDE MEDICAL INC	19,447	62.94	1,223,994.18
STRYKER CORP	24,512	93.23	2,285,253.76
THE COOPER COS INC	3,161	145.29	459,261.69
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,006	114.22	7,767,645.32
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,432	121.16	779,301.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	73.25	492,972.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,989	93.79	1,124,448.31
ABBVIE INC	122,912	52.79	6,488,524.48
AGILENT TECHNOLOGIES	23,439	33.74	790,831.86
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,101	147.75	2,378,922.75
ALKERMES PLC	10,522	55.08	579,551.76
ALLERGAN PLC	28,032	252.10	7,066,867.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	77.40	415,560.60
AMGEN	54,309	133.82	7,267,630.38
BAXALTA INC	37,546	31.07	1,166,554.22
BIOGEN INC	16,831	278.23	4,682,889.13
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,088	96.82	1,073,540.16
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	119,135	58.95	7,023,008.25
CELGENE CORP	56,686	105.34	5,971,303.24
ENDO INTERNATIONAL PLC	14,108	60.57	854,521.56
GILEAD SCIENCES INC	104,905	96.00	10,070,880.00
ILLUMINA INC	10,393	169.82	1,764,939.26
INCYTE CORP	11,132	99.59	1,108,635.88
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,019	38.04	343,082.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,302	124.81	536,932.62
JOHNSON & JOHNSON	197,782	93.04	18,401,637.28
LILLY (ELI) & CO	71,505	80.28	5,740,421.40
MALLINCKRODT PLC	8,200	57.96	475,272.00

MEDIVATION INC	11,768	39.15	460,717.20
MERCK & CO	201,689	48.65	9,812,169.85
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,879	282.43	530,685.97
MYLAN NV	28,817	39.80	1,146,916.60
PERRIGO CO PLC	10,560	154.90	1,635,744.00
PFIZER	439,346	31.02	13,628,512.92
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,028	71.47	144,941.16
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	68.86	453,993.98
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,456	451.82	2,465,129.92
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,546	119.84	3,420,952.64
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	136.97	441,865.22
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,550	99.83	1,752,016.50
WATERS CORP	5,852	117.20	685,854.40
ZOETIS INC	32,871	39.65	1,303,335.15
BANK OF AMERICA CORP	749,534	15.35	11,505,346.90
BB&T CORP	56,217	35.17	1,977,151.89
CIT GROUP INC	12,099	39.61	479,241.39
CITIGROUP	216,580	49.00	10,612,420.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,664	23.22	688,798.08
COMERICA INC	11,868	40.71	483,146.28
FIFTH THIRD BANCORP	56,599	18.65	1,055,571.35
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,126	61.77	625,483.02
HUDSON CITY BANCORP INC	33,541	9.50	318,639.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,051	10.44	626,932.44
JPMORGAN CHASE & CO	264,723	59.84	15,841,024.32
KEY CORP	62,338	12.77	796,056.26
M & T BANK CORP	8,310	120.10	998,031.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,048	17.90	591,559.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	15.53	339,128.61
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,154	87.85	3,263,978.90
REGIONS FINL CORP	93,833	8.83	828,545.39
SUNTRUST BANKS	35,813	37.58	1,345,852.54
US BANCORP	126,859	40.65	5,156,818.35
WELLS FARGO & CO	348,898	50.89	17,755,419.22
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,839	166.61	639,615.79
ALLY FINANCIAL INC	30,804	19.93	613,923.72
AMERICAN EXPRESS	65,430	73.10	4,782,933.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,569	106.45	1,337,970.05
BANK NEW YORK CO	80,497	38.44	3,094,304.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	83,237	128.81	10,721,757.97
BLACKROCK INC	8,875	293.52	2,604,990.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,238	71.55	2,807,478.90

CME GROUP INC	23,109	90.39	2,088,822.51
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	51.10	1,636,579.70
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	25.54	511,464.04
EATON VANCE CORP	7,881	33.27	262,200.87
FRANKLIN RESOURCES INC	27,900	36.36	1,014,444.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,821	171.86	4,781,317.06
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,040	227.79	1,831,431.60
INVESCO LTD	29,872	30.82	920,655.04
LEGG MASON INC	7,716	41.18	317,744.88
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,648	20.08	434,691.84
MCGRAW-HILL FINANCIAL	19,765	85.40	1,687,931.00
MOODY'S CORP	12,621	97.53	1,230,926.13
MORGAN STANLEY	105,938	31.01	3,285,137.38
NASDAQ INC	7,604	51.81	393,963.24
NAVIENT CORP	29,884	11.63	347,550.92
NORTHERN TRUST CORP	15,365	67.25	1,033,296.25
PRICE T ROWE GROUP INC	18,086	68.27	1,234,731.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,630	48.95	422,438.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	84,997	27.58	2,344,217.26
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,417	46.64	439,208.88
STATE STREET CORP	29,676	66.62	1,977,015.12
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	31.04	358,667.20
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	30.99	624,107.61
VOYA FINANCIAL INC	16,094	38.38	617,687.72
ACE LTD	23,508	101.59	2,388,177.72
AFLAC	31,363	57.72	1,810,272.36
ALLEGHANY CORP	1,109	463.63	514,165.67
ALLSTATE CORP	29,595	58.36	1,727,164.20
AMERICAN INT'L GROUP	95,373	55.72	5,314,183.56
AON PLC	20,347	88.40	1,798,674.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,789	73.25	643,794.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,411	40.78	465,340.58
ASSURANT INC	4,769	77.45	369,359.05
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	53.99	394,234.98
CHUBB CORPORATION	16,578	121.83	2,019,697.74
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,121	53.27	592,415.67
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	172.04	505,969.64
FNF GROUP	18,683	34.75	649,234.25
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,014	45.05	1,307,080.70
LINCOLN NATIONAL CORP	17,658	46.92	828,513.36
LOEWS CORP	21,888	35.65	780,307.20
MARSH & MCLENNAN COS	38,821	51.79	2,010,539.59

METLIFE INC	68,046	46.34	3,153,251.64
PARTNERRE LTD	3,587	138.23	495,831.01
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,417	46.79	955,311.43
PROGRESSIVE CORP	40,801	30.44	1,241,982.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,576	74.99	2,442,874.24
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	106.15	344,881.35
TORCHMARK CORP	8,367	56.67	474,157.89
TRAVELERS COS INC/THE	22,954	99.47	2,283,234.38
UNUM GROUP	18,574	31.53	585,638.22
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,983	40.60	445,909.80
WR BERKLEY CORP	7,065	53.84	380,379.60
XL GROUP PLC	21,398	36.24	775,463.52
CBRE GROUP INC-A	21,139	31.31	661,862.09
JONES LANG LASALLE INC	3,112	143.50	446,572.00
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	37.15	350,027.30
WEYERHAEUSER CO	36,213	27.06	979,923.78
ACCENTURE PLC-CL A	44,937	96.60	4,340,914.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,536	30.66	1,089,533.76
ADOBE SYSTEMS INC	36,009	79.83	2,874,598.47
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,545	67.50	846,787.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,344	251.20	1,091,212.80
ANSYS INC	5,989	86.92	520,563.88
AUTODESK INC	16,007	45.24	724,156.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,826	79.09	2,675,298.34
CA INC	24,426	26.83	655,349.58
CDK GLOBAL INC	9,538	46.92	447,522.96
CITRIX SYSTEMS INC	11,275	67.62	762,415.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,959	60.58	2,663,036.22
COMPUTER SCIENCES CORP	10,337	59.81	618,255.97
EBAY	78,992	24.08	1,902,127.36
ELECTRONIC ARTS INC	22,844	66.00	1,507,704.00
FACEBOOK INC-A	152,743	86.67	13,238,235.81
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	19,633	66.50	1,305,594.50
FIREEYE INC	7,918	31.23	247,279.14
FISERV INC	16,464	84.76	1,395,488.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,487	140.62	771,581.94
GARTNER INC	6,094	83.67	509,884.98
GOOGLE INC-CL A	20,610	622.61	12,831,992.10
GOOGLE INC-CL C	22,046	594.97	13,116,708.62
INTL BUSINESS MACHINES CORP	66,925	142.47	9,534,804.75
INTUIT INC	18,993	86.83	1,649,162.19
LINKEDIN CORP - A	7,652	186.61	1,427,939.72

MASTERCARD INC-CLASS A	71,942	88.76	6,385,571.92
MICROSOFT CORP	549,044	43.44	23,850,471.36
NETSUITE INC	2,264	83.65	189,383.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	16.04	281,084.96
ORACLE CORP	249,963	35.51	8,876,186.13
PAYCHEX INC	22,738	46.01	1,046,175.38
PAYPAL HOLDINGS INC	78,428	30.63	2,402,249.64
RACKSPACE HOSTING INC	8,040	25.19	202,527.60
RED HAT INC	12,854	70.49	906,078.46
SALESFORCE.COM INC	44,787	68.38	3,062,535.06
SERVICENOW INC	10,271	68.94	708,082.74
SPLUNK INC	8,873	54.44	483,046.12
SYMANTEC CORP	47,460	19.35	918,351.00
SYNOPSYS INC	11,010	45.96	506,019.60
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,378	77.58	262,065.24
TERADATA CORP	9,511	29.20	277,721.20
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,950	44.90	491,655.00
TWITTER INC	34,394	25.59	880,142.46
VANTIV INC - CL A	9,716	44.63	433,625.08
VERISIGN INC	7,494	68.19	511,015.86
VISA INC-CLASS A SHARES	140,034	68.53	9,596,530.02
VMWARE INC-CLASS A	5,459	77.41	422,581.19
WESTERN UNION CO	34,620	18.10	626,622.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,992	70.70	565,034.40
XEROX CORP	73,995	9.49	702,212.55
YAHOO	64,457	28.26	1,821,554.82
ZILLOW GROUP INC-A	3,100	28.75	89,125.00
ZILLOW GROUP INC-C	6,200	27.50	170,500.00
AMPHENOL CORPORATION	21,467	49.72	1,067,339.24
APPLE INC	411,408	109.06	44,868,156.48
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	52.17	343,226.43
AVNET INC	9,057	40.94	370,793.58
CISCO SYSTEMS	363,870	25.64	9,329,626.80
CORNING	87,462	16.70	1,460,615.40
EMC CORP	139,592	23.13	3,228,762.96
F5 NETWORKS INC	5,350	115.00	615,250.00
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	10.34	399,547.94
FLIR SYSTEMS INC	9,284	27.45	254,845.80
HARRIS CORP	8,769	71.07	623,212.83
HEWLETT-PACKARD CO	130,581	24.65	3,218,821.65
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	25.04	609,072.96
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,616	67.45	918,399.20

NETAPP INC	23,085	28.95	668,310.75
PALO ALTO NETWORKS INC	4,973	167.81	834,519.13
QUALCOMM	116,767	52.43	6,122,093.81
SANDISK CORP	15,286	49.09	750,389.74
SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	41.78	967,081.66
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	57.60	1,696,608.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	16.34	278,302.88
WESTERN DIGITAL CORP	16,063	69.37	1,114,290.31
AT&T INC	438,612	32.07	14,066,286.84
CENTURYLINK INC	39,157	24.69	966,786.33
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	4.68	386,787.96
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,961	41.64	872,816.04
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,972	103.61	929,588.92
SPRINT CORP	53,367	3.74	199,592.58
T-MOBILE US INC	19,816	39.56	783,920.96
VERIZON COMMUNICATIONS	291,030	43.53	12,668,535.90
AES CORP	44,856	9.46	424,337.76
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,521	57.74	492,002.54
AMEREN CORPORATION	17,147	41.69	714,858.43
AMERICAN ELECTRIC POWER	35,378	56.13	1,985,767.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,314	54.19	721,485.66
CALPINE CORP	25,284	14.30	361,561.20
CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	17.53	534,963.01
CMS ENERGY CORP	18,893	34.50	651,808.50
CONSOLIDATED EDISON INC	20,321	65.90	1,339,153.90
DOMINION RESOURCES	42,626	69.29	2,953,555.54
DTE ENERGY COMPANY	12,439	78.23	973,102.97
DUKE ENERGY CORP	49,603	70.73	3,508,420.19
EDISON INTL	22,596	61.79	1,396,206.84
ENTERGY CORP	12,548	64.33	807,212.84
EVERSOURCE ENERGY	22,121	49.30	1,090,565.30
EXELON CORP	62,204	29.15	1,813,246.60
FIRSTENERGY CORP	29,330	30.83	904,243.90
MDU RESOURCES GROUP INC	12,385	16.66	206,334.10
NEXTERA ENERGY INC	31,883	96.79	3,085,955.57
NRG ENERGY INC	25,186	14.47	364,441.42
OGE ENERGY CORP	12,751	26.54	338,411.54
PEPCO HOLDINGS INC	16,437	24.16	397,117.92
PG&E CORP	34,729	52.01	1,806,255.29
PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	63.22	526,622.60
PPL CORPORATION	46,162	32.21	1,486,878.02
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,913	40.91	1,428,290.83

	SCANA CORP	10,178	54.78	557,550.84
	SEMPRA ENERGY	17,041	94.46	1,609,692.86
	SOUTHERN CO	65,269	44.29	2,890,764.01
	WEC ENERGY GROUP INC	22,005	51.12	1,124,895.60
	XCEL ENERGY INC	35,219	34.70	1,222,099.30
	ALTERA CORPORATION	21,988	49.65	1,091,704.20
	ANALOG DEVICES	21,812	54.05	1,178,938.60
	APPLIED MATERIALS	85,527	14.55	1,244,417.85
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,714	119.67	2,239,504.38
	BROADCOM CORP-CL A	39,952	50.52	2,018,375.04
	FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,708	34.92	269,163.36
	INTEL CORP	339,374	29.24	9,923,295.76
	KLA-TENCOR CORP	10,702	48.18	515,622.36
	LAM RESEARCH CORP	11,195	62.86	703,717.70
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,891	38.73	654,188.43
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,286	9.05	274,088.30
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,025	32.13	675,533.25
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,894	41.67	620,632.98
	MICRON TECHNOLOGY	75,291	14.38	1,082,684.58
	NVIDIA CORP	37,929	23.71	899,296.59
	QORVO INC	10,609	43.57	462,234.13
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,268	82.85	1,099,253.80
	TEXAS INSTRUMENTS	74,739	47.53	3,552,344.67
	XILINX INC	18,324	40.96	750,551.04
	アメリカドル 小計	22,527,588		1,215,703,707.05 (145,835,816,697)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	32.47	285,411.30
	ARC RESOURCES LTD	21,371	17.48	373,565.08
	BAYTEX ENERGY CORP	17,204	3.96	68,127.84
	CAMECO CORP	28,709	15.91	456,760.19
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,135	26.23	2,023,251.05
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	6.22	180,255.60
	CENOVUS ENERGY INC	59,243	20.42	1,209,742.06
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	15.03	577,963.62
	ENBRIDGE	60,169	48.53	2,920,001.57
	ENCANA CORP	57,917	8.47	490,556.99
	ENERPLUS CORP	14,969	6.36	95,202.84
	HUSKY ENERGY INC	22,657	20.89	473,304.73
	IMPERIAL OIL	21,387	41.88	895,687.56
	INTER PIPELINE LTD	25,744	24.71	636,134.24
	KEYERA CORP	11,240	36.02	404,864.80
	MEG ENERGY CORP	11,150	8.26	92,099.00

PEMBINA PIPELINE CORP	25,731	31.96	822,362.76
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	26.86	246,359.92
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	25.03	231,152.05
SUNCOR ENERGY	104,463	35.50	3,708,436.50
TOURMALINE OIL CORP	11,584	30.01	347,635.84
TRANSCANADA CORP	49,707	41.38	2,056,875.66
VERESEN INC	23,263	10.03	233,327.89
VERMILION ENERGY INC	7,138	42.25	301,580.50
AGNICO EAGLE MINES	13,800	33.09	456,642.00
AGRIUM INC	9,859	118.45	1,167,798.55
BARRICK GOLD CORP	89,275	8.34	744,553.50
ELDORADO GOLD CORP	45,613	4.04	184,276.52
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,991	4.65	260,358.15
FRANCO-NEVADA CORP	10,197	57.44	585,715.68
GOLDCORP INC	59,518	16.37	974,309.66
KINROSS GOLD CORP	81,986	2.26	185,288.36
METHANEX CORP	6,468	43.17	279,223.56
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58,698	27.25	1,599,520.50
SILVER WHEATON CORP	28,647	15.87	454,627.89
TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	6.31	235,148.46
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	43.71	189,133.17
YAMANA GOLD INC	59,651	2.20	131,232.20
BOMBARDIER B	157,835	1.69	266,741.15
CAE INC	18,429	13.70	252,477.30
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	19.55	229,986.20
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	37.54	455,435.28
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,934	74.42	4,311,448.28
CP RAILWAY LIMITED	10,996	185.50	2,039,758.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,782	61.70	1,775,849.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.82	703,181.38
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,433	46.60	719,177.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,558	25.58	781,673.64
THOMSON REUTERS CORP	25,460	52.69	1,341,487.40
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	119.23	644,915.07
DOLLARAMA INC	8,315	88.09	732,468.35
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,496	60.04	1,770,939.84
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	26.84	308,633.16
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	19.85	109,452.90
LOBLAW COMPANIES LTD	16,203	68.27	1,106,178.81
METRO INC	19,179	36.05	691,402.95
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	106.63	375,124.34
SAPUTO INC	16,769	28.96	485,630.24

	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	23,471	212.06	4,977,260.26
	BANK MONTREAL	46,810	70.73	3,310,871.30
	BANK NOVA SCOTIA	87,726	58.01	5,088,985.26
	CANADIAN IMPERIAL BANK	28,004	93.65	2,622,574.60
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,678	41.87	991,397.86
	ROYAL BANK OF CANADA	103,729	72.00	7,468,488.00
	TORONTO-DOMINION BANK	133,315	51.43	6,856,390.45
	CI FINANCIAL CORP	18,671	29.37	548,367.27
	IGM FINANCIAL INC	7,685	33.40	256,679.00
	ONEX CORP	5,970	76.49	456,645.30
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,554	595.19	924,925.26
	GREAT-WEST LIFE CO INC	22,628	31.66	716,402.48
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	39.12	270,749.52
	INTACT FINANCIAL CORP	9,906	93.68	927,994.08
	MANULIFE FINANCIAL CORP	142,781	20.31	2,899,882.11
	POWER CORP OF CANADA	28,343	27.40	776,598.20
	POWER FINANCIAL CORP	16,605	30.30	503,131.50
	SUN LIFE FINANCIAL INC	42,970	42.56	1,828,803.20
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	60,418	40.12	2,423,970.16
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,916	18.42	127,392.72
	CGI GROUP INC - CL A	17,086	47.28	807,826.08
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	551.30	798,282.40
	OPEN TEXT CORP	8,064	59.25	477,792.00
	BCE INC	10,313	54.40	561,027.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	25,886	46.31	1,198,780.66
	TELUS CORP	16,454	42.47	698,801.38
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.38	201,149.58
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	34.95	253,981.65
	FORTIS INC	21,187	36.30	769,088.10
	TRANSALTA CORP	15,621	5.99	93,569.79
	カナダドル 小計	2,756,260		95,518,256.65 (8,533,601,049)
ユーロ	ENI	182,966	13.69	2,504,804.54
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	8.49	219,469.67
	NESTE OIL OYJ	9,335	21.08	196,781.80
	OMV AG	9,889	21.25	210,190.69
	REPSOL SA	74,777	10.23	764,968.71
	SAIPEM	22,904	7.11	162,961.96
	TECHNIP S.A.	7,230	41.54	300,370.35
	TENARIS SA	34,866	10.87	378,993.42
	TOTAL SA	154,199	39.18	6,042,287.81
	VOPAK	4,507	34.61	155,987.27

AIR LIQUIDE	24,736	103.00	2,547,808.00
AKZO NOBEL	17,228	56.21	968,385.88
ARCELORMITTAL	75,111	4.69	352,871.47
ARKEMA	4,293	56.54	242,726.22
BASF SE	65,779	66.66	4,384,828.14
CRH	58,420	22.97	1,341,907.40
EVONIK INDUSTRIES AG	10,337	29.52	305,148.24
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	38.57	163,073.96
HEIDELBERGCEMENT AG	10,108	60.25	609,007.00
IMERYS SA	3,000	57.00	171,000.00
K+S AG	14,355	29.40	422,108.77
KONINKLIJKE DSM NV	13,482	40.56	546,829.92
LANXESS	5,814	41.38	240,612.39
LINDE AG	13,402	142.50	1,909,785.00
OCI NV	5,400	22.71	122,634.00
SOLVAY SA	4,469	90.48	404,355.12
STORA ENSO OYJ R	36,014	6.69	240,933.66
SYMRISE AG	8,131	52.45	426,470.95
THYSSEN KRUPP	26,520	15.61	414,109.80
UMICORE	6,892	33.75	232,639.46
UPM KYMMENE CORP	38,348	13.29	509,644.92
VOESTALPINE AG	7,829	29.94	234,439.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	25.49	363,512.89
AIRBUS GROUP SE	42,522	52.26	2,222,199.72
ALSTOM RGPT	16,356	27.34	447,173.04
ANDRITZ AG	5,242	39.81	208,684.02
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	38.79	227,037.87
BOUYGUES ORD	13,925	31.47	438,219.75
BRENTAG AG	11,535	46.78	539,664.97
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	5.70	374,638.20
FERROVIAL SA	31,764	20.98	666,408.72
FINMECCANICA SPA	28,941	10.91	315,746.31
GEA GROUP AG	13,801	32.14	443,633.14
KONE OYJ-B	23,752	32.63	775,027.76
KONINKLIJKE PHILIPS	65,209	20.78	1,355,369.06
LEGRAND SA	18,733	46.60	872,957.80
MAN SE	2,329	90.20	210,075.80
METSO OYJ	6,575	18.61	122,360.75
OSRAM LICHT AG	5,675	44.69	253,644.12
PRYSMIAN SPA	14,715	18.17	267,371.55
REXEL SA	18,266	10.92	199,556.05
SAFRAN SA	20,383	66.79	1,361,380.57

SAINT-GOBAIN	33,361	38.00	1,267,884.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,019	48.96	1,959,530.33
SIEMENS	56,767	79.00	4,484,593.00
THALES SA	7,875	60.46	476,122.50
VINCI S.A.	34,479	56.18	1,937,030.22
WARTSILA OYJ	9,741	34.70	338,012.70
ZARDOYA OTIS SA	13,496	9.06	122,273.76
ZODIAC AEROSPACE	13,148	19.40	255,071.20
BUREAU VERITAS SA	19,558	18.59	363,583.22
ELENRED	13,303	14.43	191,962.29
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	51.96	498,192.48
SOCIETE BIC SA	1,899	136.10	258,453.90
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	34,142	13.81	471,671.73
ADP	2,382	98.96	235,722.72
AENA SA	4,899	97.30	476,672.70
ATLANTIA SPA	29,543	24.22	715,531.46
BOLLORE	61,805	4.31	266,750.38
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	11.69	172,279.04
DEUTSCHE POST AG-REG	67,417	24.40	1,645,311.88
FRAPORT AG	2,319	53.27	123,533.13
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,159	11.95	360,400.05
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	7.68	463,043.07
TNT EXPRESS	38,784	6.83	264,972.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,900	76.37	1,825,243.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	59.50	213,069.50
CONTINENTAL AG	7,670	183.00	1,403,610.00
DAIMLER AG	68,927	63.26	4,360,322.02
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	11.08	740,853.12
MICHELIN	13,073	79.38	1,037,734.74
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	28.20	217,055.40
PEUGEOT SA	31,342	12.64	396,319.59
PIRELLI & CO	19,856	14.96	297,045.76
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,908	37.54	409,486.32
RENAULT SA	13,521	62.72	848,037.12
VALEO SA	5,679	114.25	648,825.75
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,739	95.20	1,117,552.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	103.30	267,960.20
ADIDAS AG	14,723	70.58	1,039,149.34
CHRISTIAN DIOR	4,038	159.20	642,849.60
HERMES INTERNATIONAL	1,961	311.10	610,067.10
HUGO BOSS AG	4,852	97.47	472,924.44
KERING	5,366	140.25	752,581.50

LUXOTTICA GROUP SPA	12,039	59.65	718,126.35
LVMH	20,068	145.55	2,920,897.40
ACCOR	14,931	40.10	598,733.10
SODEXO	7,055	71.34	503,303.70
ALTICE NV -A	17,433	18.92	329,919.52
ALTICE NV -B	5,811	19.97	116,074.72
AXEL SPRINGER SE	2,489	50.19	124,922.91
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	27.03	323,711.28
JC DECAUX SA	4,674	32.17	150,385.95
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	116.05	153,534.15
LAGADERE S.C.A	9,057	23.93	216,779.29
NUMERICABLE-SFR	7,526	41.07	309,092.82
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,172	43.26	699,681.58
PUBLICIS GROUPE	13,383	59.13	791,336.79
RELX NV	71,956	14.15	1,018,177.40
RTL GROUP	2,486	76.00	188,936.00
SES	22,954	27.09	621,938.63
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	50.93	163,994.60
VIVENDI	83,735	20.45	1,712,380.75
WOLTERS KLUWER	22,399	27.09	606,788.91
INDITEX	78,610	28.93	2,274,580.35
CARREFOUR	38,705	25.27	978,075.35
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	45.56	167,998.15
COLRUYT SA	4,415	41.63	183,818.52
DELHAIZE GROUP	7,450	77.61	578,194.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.18	239,665.80
JERONIMO MARTINS	20,234	11.24	227,430.16
KONINKLIJKE AHOLD NV	62,997	17.10	1,077,563.68
METRO STAMM	13,712	23.63	324,083.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV	57,541	93.55	5,382,960.55
DANONE (GROUPE)	41,751	54.18	2,262,069.18
HEINEKEN HOLDING NV	7,613	61.85	470,864.05
HEINEKEN NV	16,177	69.52	1,124,625.04
KERRY GROUP PLC-A	11,778	64.61	760,976.58
PERNOD-RICARD	14,803	88.29	1,306,956.87
REMY COINTREAU	1,575	55.27	87,050.25
BEIERSDORF AG	7,534	76.43	575,823.62
HENKEL AG & CO KGAA	7,463	77.01	574,725.63
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,471	89.21	1,112,537.91
LOREAL	18,113	148.80	2,695,214.40
UNILEVER NV-CVA	116,743	34.81	4,064,407.54
ESSILOR INTERNATIONAL	14,283	105.50	1,506,856.50

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,305	68.80	1,052,984.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	26,443	59.50	1,573,358.50
BAYER	59,112	112.55	6,653,055.60
GRIFOLS SA	11,364	36.46	414,388.26
MERCK KGAA	9,216	77.34	712,765.44
ORION OYJ-CLASS B	7,975	33.46	266,843.50
QIAGEN N.V.	14,956	22.60	338,080.38
SANOFI	84,117	83.09	6,989,281.53
UCB (GROUPE)	9,374	69.36	650,180.64
BANCO BILBAO VIZCAYA	458,597	7.50	3,440,853.29
BANCO DE SABADELL SA	352,757	1.64	578,874.23
BANCO SANTANDER SA	1,044,045	4.66	4,867,337.79
BANKINTER SA	46,530	6.48	301,793.58
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.04	101,505.28
BNP PARIBAS	77,319	50.90	3,935,537.10
CAIXABANK	184,750	3.40	629,443.25
COMMERZBANK AG	77,118	9.27	715,038.09
CREDIT AGRICOLE SA	74,240	10.10	750,195.20
ERSTE GROUP BANK AG	20,524	25.68	527,056.32
ING GROEP NV-CVA	282,592	12.42	3,509,792.64
INTESA SANPAOLO	928,149	3.06	2,845,704.83
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.82	183,560.00
KBC GROEP NV	17,988	55.38	996,175.44
NATIXIS	69,996	4.81	337,310.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	10.90	100,247.30
SOCIETE GENERALE	53,264	38.73	2,063,181.04
UNICREDIT SPA	351,961	5.39	1,897,069.79
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	6.29	412,208.86
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,094	23.51	2,376,719.94
DEUTSCHE BOERSE	13,777	74.97	1,032,861.69
EURAZEO	2,763	57.54	158,983.02
EXOR SPA	7,381	37.05	273,466.05
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	66.23	413,738.81
MEDIOBANCA	41,923	8.66	363,053.18
WENDEL	1,898	101.90	193,406.20
AEGON	131,858	4.97	656,125.40
AGEAS	13,863	36.44	505,237.03
ALLIANZ SE-REG	33,348	137.30	4,578,680.40
ASSICURAZIONI GENERALI	86,452	15.83	1,368,535.16
AXA	143,565	21.08	3,026,350.20
CNP ASSURANCES	11,830	12.26	145,094.95
DELTA LLOYD NV	13,360	7.36	98,409.76

HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	89.50	354,151.50
MAPFRE SA	90,939	2.30	209,432.51
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,261	164.85	2,021,225.85
NN GROUP NV	15,034	25.28	380,059.52
SAMPO OYJ-A SHS	31,815	42.39	1,348,637.85
SCOR SE	10,368	31.08	322,237.44
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.92	182,553.60
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,500	23.78	606,390.00
VONOVIA SE	33,154	28.33	939,252.82
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,922	37.31	1,228,319.82
ATOS SE	6,536	66.83	436,800.88
CAP GEMINI SA	11,005	77.54	853,327.70
DASSAULT SYSTEMES SA	9,516	64.20	610,927.20
GEMALTO	6,158	56.96	350,759.68
SAP SE	70,432	56.78	3,999,128.96
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	44.48	353,522.29
ALCATEL-LUCENT	209,497	3.16	663,895.99
INGENICO GROUP	3,848	104.60	402,500.80
NOKIA OYJ	256,784	5.89	1,512,457.76
DEUTSCHE TELEKOM	227,738	15.52	3,534,493.76
ELISA A	10,064	29.94	301,316.16
ILIAD SA	1,701	179.85	305,924.85
KPN (KON.)	228,559	3.27	747,387.93
ORANGE	143,323	13.42	1,924,111.27
PROXIMUS	10,096	30.57	308,685.20
TELECOM ITALIA ORD	744,942	1.07	803,047.47
TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.89	370,255.58
TELEFONICA	318,679	10.69	3,408,271.90
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	5.43	204,129.12
E.ON SE	139,487	7.31	1,020,486.89
ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	15.47	243,978.85
ENAGAS	15,285	25.04	382,812.82
ENDESA	24,774	18.67	462,530.58
ENEL	508,928	3.86	1,966,497.79
ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.62	200,242.25
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.17	505,619.12
ENGIE	101,605	14.17	1,439,742.85
FORTUM OYJ	33,469	13.42	449,153.98
GAS NATURAL SDG SA	26,546	17.12	454,600.25
IBERDROLA SA	389,295	5.86	2,282,825.88
RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,102	71.58	579,941.16
RWE STAMM	36,844	9.74	358,860.56

	SNAM SPA	150,885	4.44	669,929.40
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	15.64	324,946.65
	TERNA SPA	113,720	4.23	481,035.60
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	19.77	659,487.66
	ASML HOLDING NV	25,001	75.44	1,886,075.44
	INFINEON TECHNOLOGIES	80,647	9.55	770,743.37
	STMICROELECTRONICS	42,509	5.80	246,679.72
	ユーロ 小計	15,863,148		220,391,158.37 (29,746,194,645)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	7.04	184,508.55
	BG GROUP	244,857	9.49	2,325,162.07
	BP PLC	1,305,121	3.26	4,257,304.70
	PETROFAC LTD	16,711	7.62	127,421.37
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	278,357	15.37	4,278,347.09
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	174,787	15.43	2,696,963.41
	TULLOW OIL PLC	67,219	1.66	111,986.85
	ANGLO AMERICAN PLC	98,685	5.43	535,958.23
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	4.91	124,980.30
	BHP BILLITON PLC	151,979	9.79	1,487,874.41
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	26.56	230,142.40
	FRESNILLO PLC	17,743	5.96	105,836.99
	GLENCORE PLC	772,635	0.80	620,039.58
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,209	24.10	366,536.90
	MONDI PLC	27,264	13.31	362,883.84
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,987	38.44	230,140.28
	REXAM PLC	44,988	5.17	232,587.96
	RIO TINTO PLC REG	90,790	21.49	1,951,531.05
	ASHTREAD GROUP PLC	32,745	9.08	297,324.60
	BAE SYSTEMS PLC	220,702	4.36	964,247.03
	BUNZL PLC	24,824	17.39	431,689.36
	COBHAM PLC	72,398	2.77	200,542.46
	IMI PLC	17,506	9.44	165,344.17
	MEGGITT PLC	50,990	4.64	236,644.59
	MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.61	168,422.63
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	128,458	6.51	836,261.58
	SMITHS GROUP PLC	29,684	9.94	295,207.38
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	19.27	357,554.85
	WEIR GROUP PLC/THE	13,390	11.44	153,181.60
	WOLSELEY LTD	18,291	36.56	668,718.96
	AGGREKO PLC	19,830	8.76	173,710.80
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.91	175,563.09
	CAPITA GROUP PLC	47,099	11.90	560,478.10

EXPERIAN PLC	69,123	10.31	712,658.13
G4S PLC	100,693	2.27	228,975.88
INTERTEK GROUP PLC	10,210	23.46	239,526.60
EASYJET PLC	11,633	17.44	202,879.52
ROYAL MAIL PLC	60,548	4.51	273,434.76
NEW GKN	123,433	2.55	315,371.31
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	6.37	466,739.25
BURBERRY GROUP PLC	32,866	13.16	432,516.56
PERSIMMON PLC	22,640	19.99	452,573.60
TAYLOR WIMPAY PLC	233,248	1.93	450,401.88
CARNIVAL PLC	13,621	33.12	451,127.52
COMPASS GROUP PLC	115,480	10.15	1,172,122.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,502	22.09	386,619.18
MERLIN ENTERTAINME	48,554	3.65	177,659.08
TUI AG-DI	35,476	11.92	422,873.92
WHITBREAD PLC	12,809	45.77	586,267.93
WILLIAM HILL	55,917	3.45	193,081.40
ITV PLC	269,479	2.43	655,372.92
PEARSON	57,783	10.99	635,035.17
RELX PLC	78,856	10.95	863,473.20
SKY PLC	72,378	10.18	736,808.04
WPP PLC	90,562	13.25	1,199,946.50
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.11	274,426.65
KINGFISHER PLC	165,161	3.47	574,595.11
MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,812	4.88	570,509.80
NEXT PLC	10,193	74.70	761,417.10
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	7.40	133,986.07
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.56	262,443.12
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.29	199,176.85
TESCO	566,424	1.71	970,284.31
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,939	32.05	799,294.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO	133,236	35.21	4,691,239.56
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	13.67	191,366.33
DIAGEO	180,026	17.18	3,092,846.68
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	68,673	33.34	2,289,557.82
SABMILLER PLC	69,637	37.00	2,576,569.00
TATE & LYLE	29,189	5.77	168,566.47
RECKITT BENCKISER PLC	46,035	58.20	2,679,237.00
UNILEVER PLC	92,030	26.03	2,395,540.90
SMITH & NEPHEW PLC	62,775	11.22	704,335.50
ASTRAZENECA	90,369	41.29	3,731,787.85
GLAXOSMITHKLINE	347,785	12.37	4,303,839.37

	SHIRE PLC	42,481	44.31	1,882,333.11
	BARCLAYS	1,221,961	2.39	2,920,486.79
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,419,653	4.85	6,893,125.14
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,165,025	0.73	3,055,462.34
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	229,139	3.08	707,122.95
	STANDARD CHARTERED PLC	187,165	6.24	1,168,096.76
	3I GROUP PLC	74,066	4.57	338,481.62
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	2.93	170,930.34
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	11.79	241,329.51
	ICAP PLC	43,892	4.47	196,197.24
	INVESTEC PLC	36,474	4.96	180,983.98
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	23,357	23.63	551,925.91
	SCHRODERS PLC	7,932	27.16	215,433.12
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	14.55	236,510.25
	AVIVA PIC	297,285	4.28	1,273,568.94
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94,822	3.66	347,617.45
	LEGAL & GENERAL GROUP	421,591	2.30	971,345.66
	OLD MUTUAL PLC	352,004	1.82	640,999.28
	PRUDENTIAL	187,754	13.30	2,498,066.97
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	3.91	275,137.31
	ST JAMES'S PLACE PLC	37,294	8.29	309,353.73
	STANDARD LIFE PLC	141,626	3.75	531,805.63
	SAGE GROUP PLC	80,156	4.91	393,886.58
	BT GROUP PLC	599,623	4.13	2,477,942.04
	INMARSAT PLC	33,632	9.75	328,080.16
	VODAFONE GROUP PLC	1,895,378	2.04	3,873,204.94
	CENTRICA PLC	347,128	2.22	773,401.18
	NATIONAL GRID PLC	268,349	9.00	2,417,556.14
	SEVERN TRENT PLC	15,457	21.36	330,161.52
	SSE PLC	69,212	14.37	994,576.44
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	9.05	456,833.80
	ARM HOLDINGS PLC	98,798	9.19	907,953.62
	イギリスポンド 小計	20,721,302		107,101,492.42 (19,477,477,411)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	12.14	276,743.44
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	393.50	187,699.50
	GIVAUDAN-REG	651	1,550.00	1,009,050.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	28,448	50.50	1,436,624.00
	SIKA AG-BR	138	2,952.00	407,376.00
	SYNGENTA AG	6,705	304.90	2,044,354.50
	ABB LTD	158,155	16.92	2,675,982.60
	GEBERIT AG-REG	2,683	292.30	784,240.90

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	141.00	190,632.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,860	139.70	399,542.00
	SULZER AG-REG	1,607	95.95	154,191.65
	ADECCO	12,082	69.30	837,282.60
	SGS SA	406	1,674.00	679,644.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	123.50	502,892.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	37,577	73.70	2,769,424.90
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,199	352.00	774,048.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	67.35	265,224.30
	DUFREY AG-REG	2,999	111.20	333,488.80
	ARYZTA AG	5,619	41.26	231,839.94
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,033.00	136,356.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	5,570.00	345,340.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	68,290.00	478,030.00
	NESTLE SA - REGISTERED	230,102	71.20	16,383,262.40
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,452	122.30	422,179.60
	ACTELION LTD-REG	7,281	120.80	879,544.80
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	126.50	504,482.00
	NOVARTIS	162,383	87.35	14,184,155.05
	ROCHE HOLDING GENUSS	50,151	251.40	12,607,961.40
	CREDIT SUISSE GROUP AG	114,059	23.22	2,648,449.98
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,269	42.50	691,432.50
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	56.05	106,270.80
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,221	322.50	393,772.50
	UBS GROUP AG	266,462	17.76	4,732,365.12
	BALOISE HOLDING AG	3,877	110.00	426,470.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	212.70	522,816.60
	SWISS RE LTD	25,911	82.30	2,132,475.30
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,018	233.90	2,577,110.20
	SWISS PRIME SITE-REG	5,038	70.80	356,690.40
	SWISSCOM	1,834	479.00	878,486.00
	スイスフラン 小計	1,202,365		77,367,931.78 (9,559,581,650)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	103.50	1,468,768.50
	BOLIDEN AB	18,196	127.40	2,318,170.40
	ALFA LAVAL AB	19,284	135.10	2,605,268.40
	ASSA ABLOY AB-B	70,136	148.30	10,401,168.80
	ATLAS COPCO A	47,043	195.60	9,201,610.80
	ATLAS COPCO B	29,087	181.90	5,290,925.30
	SANDVIK AB	79,113	69.25	5,478,575.25
	SKANSKA B	28,530	161.70	4,613,301.00
	SKF AB-B	27,040	154.00	4,164,160.00

	VOLVO B	107,905	78.75	8,497,518.75	
	SECURITAS B	22,844	100.60	2,298,106.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	225.60	4,099,152.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	53.55	1,486,440.90	
	HENNES & MAURITZ B	68,398	299.10	20,457,841.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	280.50	1,607,265.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	248.50	3,083,885.00	
	SCA SV CELLULOSA B	41,445	230.20	9,540,639.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,725	183.50	2,335,037.50	
	NORDEA BANK AB	222,952	91.95	20,500,436.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	108,437	87.65	9,504,503.05	
	SVENSKA HANDELSBK A	106,324	119.00	12,652,556.00	
	SWEDBANK AB-A	64,426	184.00	11,854,384.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	143.70	1,838,210.40	
	INVESTOR AB-B SHS	32,558	284.00	9,246,472.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,104	234.30	4,241,767.20	
	ERICSSON (LM) B	219,832	79.25	17,421,686.00	
	HEXAGON AB-B SHS	18,602	249.00	4,631,898.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	500.00	2,164,500.00	
	TELE2 AB-B SHS	21,310	78.80	1,679,228.00	
	TELIASONERA AB	182,966	44.49	8,140,157.34	
	スウェーデンクローナ 小計	1,662,637		202,823,633.19 (2,900,377,954)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	23,438	49.51	1,160,415.38	
	STATOIL ASA	78,540	120.30	9,448,362.00	
	SUBSEA 7 SA	18,360	63.70	1,169,532.00	
	NORSK HYDRO	83,896	27.57	2,313,012.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	336.60	4,534,002.00	
	ORKLA	60,218	61.85	3,724,483.30	
	DNB ASA	70,441	107.70	7,586,495.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	112.00	1,509,872.00	
	TELENOR ASA	53,105	158.60	8,422,453.00	
	ノルウェークローネ 小計	414,949		39,868,628.10 (564,539,773)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S	17,281	282.20	4,876,698.20	
	VESTAS WIND SYSEMS	15,987	336.50	5,379,625.50	
	ISS A/S	9,103	221.20	2,013,583.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	245	9,760.00	2,391,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	10,050.00	5,105,400.00	
	DSV A/S	11,156	242.90	2,709,792.40	
	PANDORA A/S	8,093	771.00	6,239,703.00	
	CARLSBERG AS-B	8,005	498.50	3,990,492.50	

	COLOPLAST-B	8,335	464.70	3,873,274.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	544.50	808,038.00
	NOVO NORDISK A/S-B	140,075	357.30	50,048,797.50
	DANSKE BANK A/S	50,272	199.00	10,004,128.00
	TRYG A/S	9,828	127.30	1,251,104.40
	TDC A/S	52,498	34.41	1,806,456.18
	デンマーククローネ 小計	332,870		100,498,293.78 (1,818,014,134)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	30.21	623,202.09
	ORIGIN ENERGY LIMITED	84,565	6.10	515,846.50
	SANTOS	60,506	4.28	258,965.68
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	53,718	28.17	1,513,236.06
	WORLEYPARSONS LTD	15,026	5.86	88,052.36
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.14	195,174.41
	AMCOR	88,019	12.89	1,134,564.91
	BHP BILLITON LTD	230,444	21.61	4,979,894.84
	BORAL LIMITED	46,867	5.12	239,959.04
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	1.67	151,098.26
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	6.15	175,613.25
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.84	423,121.92
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	17.00	500,616.00
	NEWCREST MINING LIMITED	58,258	12.55	731,137.90
	ORICA LTD	29,211	14.86	434,075.46
	RIO TINTO LTD	31,029	46.52	1,443,469.08
	SOUTH32 LTD	354,855	1.38	491,474.17
	CIMIC GROUP LIMITED	5,336	23.45	125,129.20
	BRAMBLES LTD	116,593	9.70	1,130,952.10
	SEEK LTD	21,328	11.90	253,803.20
	ASCIANO GROUP	64,054	8.25	528,445.50
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.93	786,270.91
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	36,374	3.71	134,947.54
	TRANSURBAN GROUP	140,834	9.89	1,392,848.26
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	32,069	8.42	270,020.98
	CROWN RESORTS LTD	21,269	9.80	208,436.20
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	35.43	115,608.09
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.63	290,444.53
	TATTS GROUP LTD	93,361	3.71	346,369.31
	REA GROUP LTD	3,593	43.47	156,187.71
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.79	116,777.48	
WESFARMERS LTD	79,463	38.32	3,045,022.16	
WOOLWORTHS LTD	90,378	24.23	2,189,858.94	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	8.89	337,855.56	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	6.39	246,347.28	
	COCHLEAR LIMITED	3,856	81.76	315,266.56	
	HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.50	221,497.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	57.89	623,648.97	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	18.20	450,086.00	
	CSL LIMITED	33,087	87.80	2,905,038.60	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	198,527	26.38	5,237,142.26	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	11.39	277,654.03	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	9.72	303,312.60	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	121,510	70.15	8,523,926.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	187,643	29.20	5,479,175.60	
	WESTPAC BANKING	223,581	29.10	6,506,207.10	
	ASX LTD	12,620	37.08	467,949.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	21,772	75.00	1,632,900.00	
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	6.56	132,689.12	
	AMP LTD	217,702	5.42	1,179,944.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	175,295	4.74	830,898.30	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.38	510,538.56	
	QBE INSURANCE GROUP	100,546	12.70	1,276,934.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	95,154	11.99	1,140,896.46	
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	10.48	322,962.16	
	TELSTRA CORP	308,815	5.49	1,695,394.35	
	TPG TELECOM LTD	20,000	10.14	202,800.00	
	AGL ENERGY LTD	50,606	16.23	821,335.38	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.34	161,709.35	
	オーストラリアドル 小計	4,875,939		66,794,734.92 (5,614,765,417)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	6.76	314,678.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	5.01	306,411.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.30	160,716.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	2.99	434,892.51	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.86	286,560.18	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.10	232,142.40	
	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.57	158,983.07	
	ニュージーランドドル 小計	506,423		1,894,384.56 (144,787,811)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	194,496	98.60	19,177,305.60	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	9.85	975,150.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	14.38	1,236,680.00	
	MTR CORP	94,000	33.35	3,134,900.00	
	LI & FUNG	378,800	5.55	2,102,340.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	28.50	2,664,750.00	

	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	28.80	1,339,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	19.86	3,495,360.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	9.27	622,944.00	
	SANDS CHINA LTD	174,000	24.25	4,219,500.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	6.76	662,480.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.47	722,040.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	8.87	911,836.00	
	WH GROUP LTD	476,500	3.84	1,829,760.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	25.30	2,144,428.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	262,500	22.40	5,880,000.00	
	HANG SENG BANK	54,100	139.50	7,546,950.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	4.65	595,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,300	177.70	14,447,010.00	
	AIA GROUP LTD	863,200	39.35	33,966,920.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	188,996	55.35	10,460,928.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.14	2,965,220.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	86,360	45.85	3,959,606.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	31.45	1,258,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	21.40	823,900.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	399,500	7.49	2,992,255.00	
	SINO LAND CO	235,400	11.54	2,716,516.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,000	98.95	11,874,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	84.35	3,416,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	21.50	1,487,800.00	
	WHARF HOLDINGS	99,000	43.15	4,271,850.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	33.30	2,164,500.00	
	PCCW LTD	232,000	3.95	916,400.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	68.10	2,792,100.00	
	CLP HOLDINGS	133,000	65.15	8,664,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	491,679	14.44	7,099,844.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,500	71.50	7,042,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	48.80	673,440.00	
	香港ドル 小計	6,258,091		183,254,988.96 (2,836,787,229)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.75	758,025.00	
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.40	119,025.20	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.45	196,650.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	2.26	137,634.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	2.96	322,640.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.13	150,290.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.80	406,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES	32,833	10.70	351,313.10	

	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.74	314,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	97,700	3.83	374,191.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	26.95	161,700.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.31	129,890.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	116,700	2.52	294,084.00	
	DBS GROUP	128,600	16.37	2,105,182.00	
	OCBC BANK	220,100	8.74	1,923,674.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	90,900	18.55	1,686,195.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	7.19	395,450.00	
	CAPITALAND LTD	205,500	2.74	563,070.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	7.73	185,520.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	2.03	505,470.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,500	6.00	195,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	582,643	3.55	2,068,382.65	
	STARHUB LTD	38,000	3.44	130,720.00	
	シンガポールドル 小計	3,638,239		13,474,605.95 (1,133,079,614)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	845.40	367,749.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	19.71	645,620.76	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	945.10	152,161.10	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	59,539	226.00	13,455,814.00	
	BANK HAPOLIM BM	80,056	19.59	1,568,297.04	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	14.62	1,388,739.18	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	45.81	375,642.00	
	AZRIELI GROUP	1,780	155.00	275,900.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	215.50	723,649.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	7.50	837,247.50	
	イスラエルシェケル 小計	392,907		19,790,819.58 (604,213,721)	
	合 計	81,152,718		228,769,237,105 (228,769,237,105)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	182,595.00	
		アメリカドル 小計	329,000	182,595.00 (21,904,096)	
オーストラリアドル	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	633,207.50	
		LEND LEASE GROUP	44,009	537,349.89	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	418,893.28	

		オーストラリアドル 小計	189,263	1,589,450.67 (133,609,223)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,703,570.00
		香港ドル 小計	187,000	1,703,570.00 (26,371,263)
		投資信託受益証券合計	705,263	181,884,582 (181,884,582)
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,115	430,632.45
		AMERICAN TOWER CORPORATION	30,408	2,645,800.08
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,023	682,724.25
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,140	1,579,483.40
		BOSTON PROPERTIES	10,612	1,246,591.64
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	299,568.90
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	438,081.33
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,973	140,563.99
		CROWN CASTLE INTL CORP	24,087	1,867,465.11
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,665	614,017.45
		DUKE REALTY CORP	26,052	498,114.24
		EQUINIX INC	3,960	1,065,160.80
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	26,298	1,934,217.90
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,774	1,047,511.08
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,671	587,675.31
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,879	659,592.01
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	40,144	1,026,482.08
		HCP INC	31,928	1,191,233.68
		HEALTH CARE REIT INC	25,401	1,710,249.33
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	52,693	810,945.27
		IRON MOUNTAIN INC	14,074	427,286.64
		KIMCO REALTY CORP	29,179	702,630.32
		LIBERTY PROPERTY TRUST	9,708	302,889.60
		MACERICH CO/THE	9,059	694,553.53
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,594	457,151.42
		PROLOGIS INC	36,172	1,401,303.28
		PUBLIC STORAGE	10,592	2,216,481.92
		REALTY INCOME CORP	16,219	764,077.09
		REGENCY CENTERS CORP	6,051	373,891.29
		SIMON PROPERTY GROUP	22,304	4,068,918.72
		SL GREEN REALTY CORP	7,346	800,346.70
		UDR INC	18,412	629,690.40
		VENTAS INC	22,897	1,279,484.36
		VEREIT INC	67,784	519,903.28

	VORNADO REALTY TRUST	11,805	1,069,887.15	
	アメリカドル 小計	720,833	36,184,606.00 (4,340,705,335)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	191,558.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	265,324.73	
	カナダドル 小計	19,938	456,883.03 (40,817,929)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	177,685.20	
	GECINA SA	2,522	270,610.60	
	ICADE	2,845	168,993.00	
	KLEPIERRE	13,726	546,226.17	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,974	1,589,723.30	
	ユーロ 小計	28,377	2,753,238.27 (371,604,569)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	66,079	542,838.98	
	HAMMERSON PLC	51,215	313,691.87	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	236,193.64	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,520	697,456.80	
	SEGRO PLC	48,938	206,763.05	
	イギリスポンド 小計	296,241	1,996,944.34 (363,164,297)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	523,075.40	
	FEDERATION CENTRES	254,887	675,450.55	
	GOODMAN GROUP	119,536	681,355.20	
	GPT GROUP	136,015	599,826.15	
	MIRVAC GROUP	241,410	409,189.95	
	SCENTRE GROUP	389,348	1,483,415.88	
	STOCKLAND	150,322	577,236.48	
	WESTFIELD CORP	144,920	1,412,970.00	
	オーストラリアドル 小計	1,510,528	6,362,519.61 (534,833,398)	
香港ドル	LINK REIT	163,000	6,748,200.00	
	香港ドル 小計	163,000	6,748,200.00 (104,462,136)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	315,324.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	189,475.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	141,000	266,490.00	
	SUNTEC REIT	173,000	257,770.00	
	シンガポールドル 小計	595,300	1,029,059.00 (86,533,571)	
	投資証券合計	3,334,217	5,842,121,235 (5,842,121,235)	

合計		6,024,005,817 (6,024,005,817)	
----	--	----------------------------------	--

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601銘柄	97.1%			62.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.9%	1.8%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.6%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	98.8%			12.7%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.2%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.2%			8.3%
	投資証券 5銘柄			1.8%	0.2%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			4.1%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	89.4%			2.4%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 8銘柄			8.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.6%			1.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 23銘柄	92.9%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間(平成27年10月1日から平成28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】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (平成27年 9月30日現在)	第15期中間計算期間 (平成28年 3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	78,360,601
コール・ローン	86,161,589	1,901,793
親投資信託受益証券	11,660,162,655	12,254,339,860
未収入金	-	573,176
未収利息	15	-
流動資産合計	11,746,324,259	12,335,175,430
資産合計	11,746,324,259	12,335,175,430
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,886,994	27,134,545
未払受託者報酬	4,216,693	3,973,665
未払委託者報酬	52,005,753	49,008,473
その他未払費用	670,845	331,077
流動負債合計	85,780,285	80,447,760
負債合計	85,780,285	80,447,760
純資産の部		
元本等		
元本	5,640,074,775	5,879,062,270
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	6,020,469,199	6,375,665,400
(分配準備積立金)	2,661,205,384	2,439,702,082
元本等合計	11,660,543,974	12,254,727,670
純資産合計	11,660,543,974	12,254,727,670
負債純資産合計	11,746,324,259	12,335,175,430

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 3月31日	第15期中間計算期間 自 平成27年10月 1日 至 平成28年 3月31日
営業収益		
受取利息	11,601	7,654
有価証券売買等損益	1,556,874,712	143,732,064
営業収益合計	1,556,886,313	143,739,718
営業費用		
受託者報酬	3,834,937	3,973,665
委託者報酬	47,297,562	49,008,473
その他費用	319,518	331,077
営業費用合計	51,452,017	53,313,215
営業利益又は営業損失（ ）	1,505,434,296	90,426,503
経常利益又は経常損失（ ）	1,505,434,296	90,426,503
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,505,434,296	90,426,503
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（ ）	104,498,038	33,022,076
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,512,206,549	6,020,469,199
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,201,983,221	833,039,068
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,201,983,221	833,039,068
剰余金減少額又は欠損金増加額	743,132,089	535,247,294
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	743,132,089	535,247,294
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,371,993,939	6,375,665,400

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第14期 (平成27年 9月30日現在)	第15期中間計算期間 (平成28年 3月31日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,640,074,775口	5,879,062,270口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0674円 (20,674円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0845円 (20,845円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第15期中間計算期間 (平成28年 3月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第15期中間計算期間 (平成28年 3月31日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第14期 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日	第15期中間計算期間 自 平成27年10月 1日 至 平成28年 3月31日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,271,799,266円	5,640,074,775円
期中追加設定元本額	1,857,940,393円	736,896,683円
期中一部解約元本額	1,489,664,884円	497,909,188円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を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の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 3月31日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,744,505,512
金銭信託	299,466,036

	平成28年 3月31日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	7,267,970
株式	245,162,801,790
投資信託受益証券	284,591,403
投資証券	6,680,128,898
派生商品評価勘定	113,014,673
未収入金	32,149,703
未収配当金	524,960,443
差入委託証拠金	2,034,032,998
流動資産合計	259,882,919,426
資産合計	259,882,919,426
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,220,152
前受金	97,615,271
未払解約金	79,572,659
流動負債合計	192,408,082
負債合計	192,408,082
純資産の部	
元本等	
元本	137,774,066,130
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	121,916,445,214
元本等合計	259,690,511,344
純資産合計	259,690,511,344
負債純資産合計	259,882,919,426

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

平成28年 3月31日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 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28年 3月31日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,774,066,130口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8849円 (1万口当たり純資産額) (18,849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28年 3月31日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成28年 3月31日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年10月 1日
期首元本額	130,465,120,039円
期中追加設定元本額	14,186,798,598円
期中一部解約元本額	6,877,852,507円
期末元本額	137,774,066,130円

区分	平成28年 3月31日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,329,605,315円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,594,807円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,353,277,221円
世界経済インデックスファンド	2,667,113,158円
マイセレクション25	4,768,378円
マイセレクション50	20,265,196円
マイセレクション75	22,725,089円
外国株式インデックス・オープン	1,107,864,062円
D C マイセレクション25	880,827,309円
D C マイセレクション50	4,690,818,237円
D C マイセレクション75	4,920,477,898円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,501,320,951円
D C マイセレクションS25	381,281,567円
D C マイセレクションS50	1,796,483,401円
D C マイセレクションS75	1,311,906,969円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	155,468,171円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	175,742,525円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	92,074,751円
D C 世界経済インデックスファンド	2,620,038,243円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,881,832,222円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	37,613,796円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	24,799,158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）	132,324,804円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	204,122,084円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	700,347,247円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	145,294,729円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	721,906,720円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,533,845,302円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	718,787,871円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,606,026,827円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,813,683,448円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,992,016,686円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	710,610,093円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	677,553,030円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	208,054,203円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,738,050,203円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	3,697,587,115円
外国株式ファンド・シリーズ1	961,204,028円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,854,948,310円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,142,609,995円
分散投資コア戦略ファンドA	880,933,806円

区分	平成28年 3月31日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,988,401,713円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	199,423,914円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	294,573,536円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,031,770,541円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	631,262,123円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	41,890,663円
S M T インデックスバランス・オープン	258,837,216円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,991,663,273円
外国株式S M T Bセクション（S M A専用）	29,273,109,646円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,627,328,580円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成28年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,475,406,835	-	7,573,022,106	97,615,271
	合計	7,475,406,835	-	7,573,022,106	97,615,271

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成28年 3月31日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	263,128,150	-	263,307,400	179,250
	アメリカドル	195,969,600	-	196,040,400	70,800
	ユーロ	50,961,450	-	51,076,000	114,550
	イギリスポンド	16,197,100	-	16,191,000	6,100
	合計	263,128,150	-	263,307,400	179,250

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC外国株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

(平成28年 4月28日現在)

資産総額	12,312,523,367円
負債総額	17,932,001円
純資産総額(-)	12,294,591,366円
発行済口数	5,929,792,626口
1口当たり純資産額(/)	2.0734円
(1万口当たり純資産額)	(20,734円)

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成28年 4月28日現在)

資産総額	263,643,486,339円
負債総額	401,448,697円
純資産総額(-)	263,242,037,642円
発行済口数	140,309,805,717口
1口当たり純資産額(/)	1.8761円
(1万口当たり純資産額)	(18,761円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成28年 4月28日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成28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28年4月28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	457	7,993,999
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	35	157,005
単位型公社債投資信託	0	0
合計	492	8,151,005

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（自平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第30期事業年度の中間会計期間（自平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)	当事業年度 (平成27年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,353	13,868
未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	62,500	65,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)

営業収益				
委託者報酬	22,773,831		28,159,652	
運用受託報酬	55,511		8,732	
営業収益合計	22,829,342		28,168,384	
営業費用				
支払手数料	10,451,296		12,922,655	
広告宣伝費	76,961		130,384	
公告費	-		880	
調査費	5,091,105		5,994,577	
調査費	259,236		279,702	
委託調査費	4,830,390		5,712,946	
図書費	1,479		1,928	
営業雑経費	1,264,334		1,299,065	
通信費	17,246		17,456	
印刷費	327,214		330,921	
協会費	22,524		23,182	
諸会費	773		105	
情報機器関連費	837,859		857,009	
その他営業雑経費	58,716		70,390	
営業費用合計	16,883,698		20,347,563	
一般管理費				
給料	2,201,964		2,185,555	
役員報酬	102,330		89,055	
給料・手当	1,846,450		1,839,000	
賞与	253,183		257,499	
退職給付費用	72,029		71,270	
役員退職慰労金	1,070		-	
福利費	207,122		212,286	
交際費	2,758		4,491	
旅費交通費	45,973		55,788	
租税公課	42,862		42,868	
不動産賃借料	130,938		130,938	
寄付金	3,385		-	
減価償却費	119,445		129,285	
諸経費	1	219,615	1	212,345
一般管理費合計	3,047,165		3,044,830	
営業利益	2,898,479		4,775,990	

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日	(自 平成26年4月 1日
	至 平成26年3月31日)	至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846

貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,775		1,936
営業外収益合計		16,027		18,203
営業外費用				
長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381

当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
-------	--------	-----------	-----------	-----------	------------

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	〃	27,866	〃

2. 外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成27年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
(2) 未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-

(3) 投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
(4) 未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
(5) 未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1) 現金及び預金	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を 超えるもの			
その他	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・レアルコース）	3,178,319千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内 容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディ ングス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員 の 兼任	経営指導 料の支払	73,276	-	-

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
経営指導料
取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内 容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員 の 兼任	投信販売 代行手数料 等の支払	6,745,672	未払 手数料	794,830
							投資助言費 用の 支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信販売代行手数料
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
投資助言費用
各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内 容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員 の 兼任	投信販売 代行手数料 等の支払	8,852,826	未払 手数料	1,374,578
							投資助言費用 の支払	3,428,200	その他 未払金	381,755

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第30期中間会計期間末
(平成27年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	14,016,702
未収委託者報酬	5,141,677
繰延税金資産	106,209
その他流動資産	141,365
流動資産合計	19,405,955

固定資産

有形固定資産

建物	1	59,944
器具備品	1	102,740

その他有形固定資産	1	4,207
有形固定資産合計		166,892
無形固定資産		195,428
投資その他の資産		
投資有価証券		58,796
長期貸付金		24,338
会員権		25,000
その他の投資		1,137
繰延税金資産		124,183
貸倒引当金		24,338
投資その他の資産合計		209,117
固定資産合計		571,438
資産合計		19,977,393
負債の部		
流動負債		
未払金		2,781,753
未払費用		77,994
未払法人税等		1,090,560
賞与引当金		100,008
その他流動負債	2	189,082
流動負債合計		4,239,399
固定負債		
退職給付引当金		368,901
資産除去債務		12,816
その他固定負債		3,552
固定負債合計		385,270
負債合計		4,624,670

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(平成27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		68,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		12,536,088
利益剰余金合計		14,704,588
株主資本合計		15,354,588
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,864
評価・換算差額等合計		1,864

純資産合計	15,352,723
負債・純資産合計	19,977,393

中間損益計算書

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		16,237,885
営業収益合計		16,237,885
営業費用		11,383,551
一般管理費	1	1,638,696
営業利益		3,215,638
営業外収益	2	12,278
営業外費用		14,137
経常利益		3,213,780
税引前中間純利益		3,213,780
法人税、住民税及び事業税		1,061,497
法人税等調整額		3,185
法人税等合計		1,064,682
中間純利益		2,149,097

中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

(単位：千円)

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			2,149,097	2,149,097	2,149,097

株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)					
当中間期変動額合計	3,000	-	2,116,097	2,119,097	2,119,097
当中間期末残高	68,500	2,100,000	12,536,088	14,704,588	15,354,588

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,149,097
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	5,100	5,100	5,100
当中間期変動額合計	5,100	5,100	2,113,997
当中間期末残高	1,864	1,864	15,352,723

重要な会計方針

第30期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p> その他有価証券</p> <p> 時価のあるもの</p> <p> 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p> 時価のないもの</p> <p> 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産</p> <p> 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p> 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。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金</p> <p> 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。</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p> 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。</p>

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

第30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。)及び「事業分離等に関する会計基準」(企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。)等を当中間会計期間から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当中間会計期間の期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する中間会計期間の中間財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項(4)及び事業分離等会計基準第57 - 4項(4)に定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間末
(平成27年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	49,628千円
器具備品	239,367千円
その他有形固定資産	382千円
計	289,378千円

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30期中間会計期間
(自 平成27年4月1日
至 平成27年9月30日)

1 減価償却実施額

有形固定資産	26,652千円
--------	----------

無形固定資産	34,155千円
2 営業外収益の主要項目 受取利息	3,919千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

平成27年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照
ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	14,016,702	14,016,702	-
(2)未収委託者報酬	5,141,677	5,141,677	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,793	58,793	-
(4)未払金	(2,781,753)	(2,781,753)	-
(5)未払法人税等	(1,090,560)	(1,090,560)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金、並びに(5)未払法人税等

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

ます。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（平成27年9月30日）

その他有価証券

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他	7,156	6,560	596
小計	7,156	6,560	596
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの その他	51,636	54,986	3,349
小計	51,636	54,986	3,349
合計	58,793	61,546	2,753

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

(デリバティブ取引関係)

第30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	2,010,428千円

（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いません。

（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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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30期中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
1株当たり純資産額	5,117,574円52銭
1株当たり中間純利益	716,365円75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いません。	

（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30期中間会計期間 （自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）	
中間純利益	2,149,097千円
普通株式に係る中間純利益	2,149,097千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の実取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成28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27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27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。
損保ジャパン日本興亜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27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みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27年11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26年10月1日から平成27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27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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 白川 芳樹
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
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27年4月1日から平成28年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年5月31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27年10月1日から平成28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28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27年10月1日から平成28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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。