

【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30年6月29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 平木 秀樹
【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】	D C 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30年 6月30日から平成30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		（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	（毎月）	アジア			ス））	（ ）
性	日々	オセアニア				
（ ）						
不動産投信	その他	中南米				
	（ ）					
その他資産		アフリカ				
（投資信託証券						
（株式一般）		中近東				
資産複合		（中東）				
（ ）						
資産配分		エマージ				
固定型		ング				
資産配分						
変更型						

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

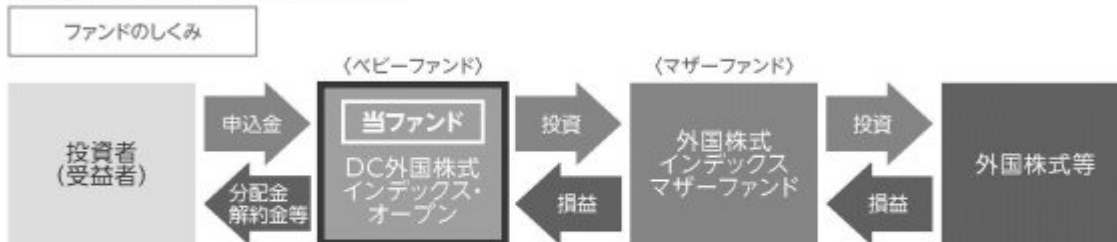
れにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

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

<ファンドの特色>

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

●原則として、為替ヘッジは行いません。



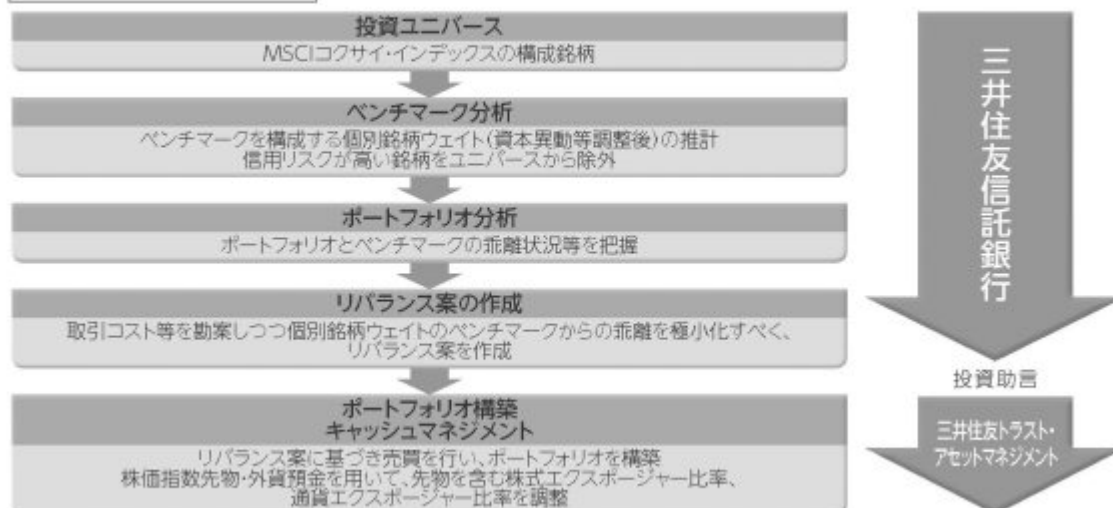
? ファミリーファンド方式とは

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。

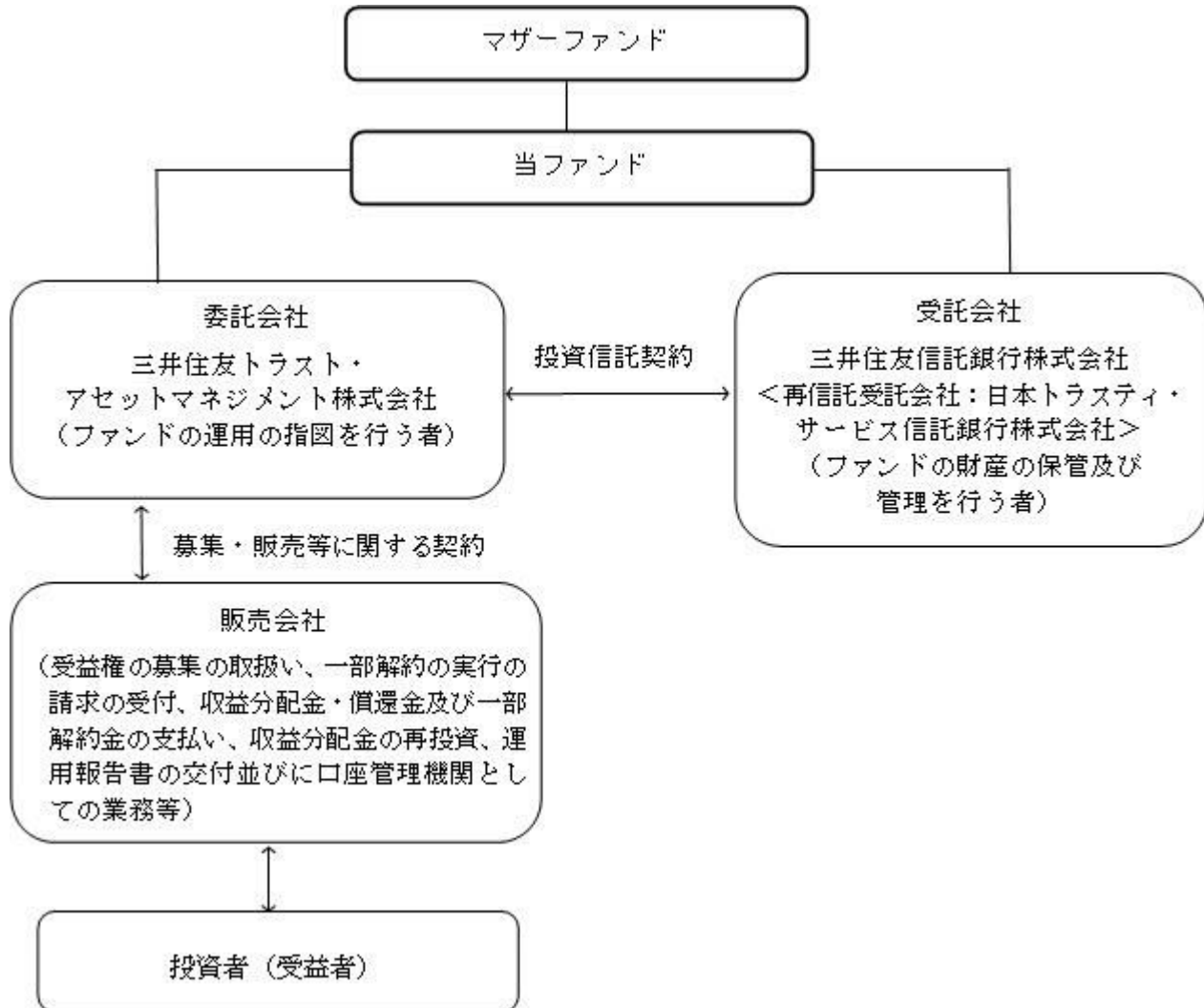
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(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30年 4月27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

当ファンドは、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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

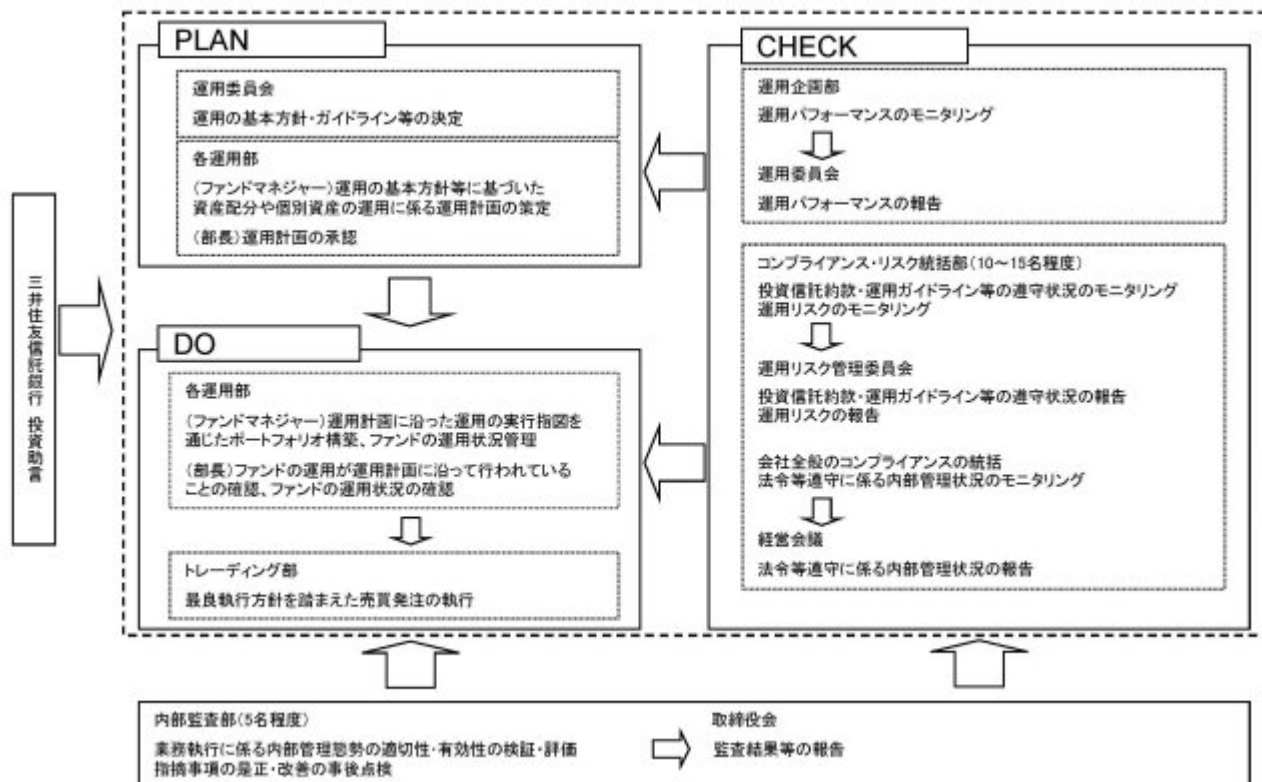
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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号口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、（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、

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払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したコンプライアンス・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。

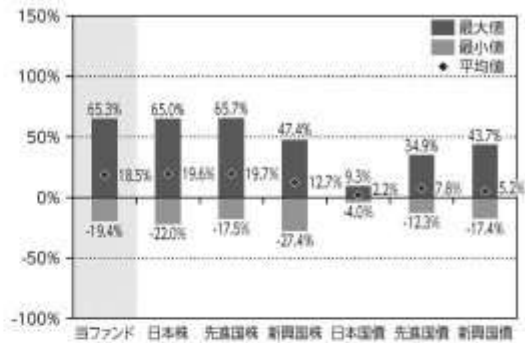
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【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

*2013年5月～2018年4月の5年間の各月末における最近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… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}
 新興国債… JPモルガン・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・ディバースファイド(円ベース)^{※6}

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

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

※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定期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、野村證券株式会社が、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 FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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、日々計上のうえ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30年 4月27日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2018年 4月27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	18,139,630,306	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,010,550	0.05
合計(純資産総額)		18,148,640,856	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	7,491,690,541	2.3740	17,785,535,642	2.4213	18,139,630,306	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

(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7期計算期間末	(2008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	(2009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	(2010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	(2011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	(2012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	(2013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	(2014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	(2015年 9月30日)	11,660,543,974	11,660,543,974	20,674	20,674
第15期計算期間末	(2016年 9月30日)	12,010,556,272	12,010,556,272	19,557	19,557
第16期計算期間末	(2017年10月 2日)	16,657,048,067	16,657,048,067	25,863	25,863
	2017年 4月末日	15,095,960,070		23,864	
	5月末日	15,405,687,427		24,208	
	6月末日	15,707,317,993		24,570	
	7月末日	15,869,563,655		24,738	
	8月末日	15,837,410,887		24,626	
	9月末日	16,585,792,523		25,755	
	10月末日	17,253,263,266		26,332	
	11月末日	17,363,023,647		26,494	
	12月末日	18,098,780,650		27,297	
	2018年 1月末日	18,533,420,800		27,583	
	2月末日	17,813,727,293		26,322	
	3月末日	17,257,322,193		25,186	
	4月末日	18,148,640,856		26,298	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2007年10月 2日～2008年 9月30日	0
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	0
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	0
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	0
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	0
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2007年10月 2日～2008年 9月30日	35.3
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	13.3
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	0.6
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	11.7
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	22.6
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	49.8
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	25.7
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1.1
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	5.4
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	32.2
第17期中間計算期間	2017年10月 3日～2018年 4月 2日	2.5

(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7期計算期間	2007年10月 2日～2008年 9月30日	879,668,207	321,508,548	1,904,022,099
第8期計算期間	2008年10月 1日～2009年 9月30日	1,067,367,697	285,659,994	2,685,729,802
第9期計算期間	2009年10月 1日～2010年 9月30日	1,267,126,214	490,484,020	3,462,371,996
第10期計算期間	2010年10月 1日～2011年 9月30日	1,373,095,152	651,309,411	4,184,157,737
第11期計算期間	2011年10月 1日～2012年10月 1日	1,321,582,335	827,989,915	4,677,750,157

第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1,531,761,261	1,406,635,777	4,802,875,641
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	1,521,908,168	1,052,984,543	5,271,799,266
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,857,940,393	1,489,664,884	5,640,074,775
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,413,274,013	912,179,071	6,141,169,717
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,664,339,529	1,365,115,383	6,440,393,863
第17期中間計算期間	2017年10月 3日～2018年 4月 2日	1,067,727,935	651,724,953	6,856,396,845

(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	193,703,064,047	58.10
	イギリス	22,149,409,369	6.64
	フランス	13,063,332,430	3.92
	ドイツ	12,587,916,087	3.78
	カナダ	11,872,649,698	3.56
	スイス	10,766,262,559	3.23
	オーストラリア	7,594,944,745	2.28
	オランダ	6,408,060,609	1.92
	アイルランド	4,345,540,033	1.30
	スペイン	4,206,448,164	1.26
	スウェーデン	3,340,006,442	1.00
	香港	3,008,778,684	0.90
	イタリア	2,828,909,935	0.85
	デンマーク	2,211,687,003	0.66
	シンガポール	1,640,615,186	0.49
	ジャージー	1,577,424,640	0.47
	バミューダ	1,520,527,522	0.46
	ベルギー	1,437,800,223	0.43
	フィンランド	1,343,444,432	0.40
	ノルウェー	912,956,554	0.27
	ケイマン	911,901,268	0.27
	キュラソー	829,656,608	0.25
	イスラエル	589,678,194	0.18
ルクセンブルク	463,016,040	0.14	
オーストリア	332,390,435	0.10	
ニュージーランド	219,950,489	0.07	
ポルトガル	203,625,321	0.06	

	パナマ	191,011,292	0.06
	リベリア	171,464,414	0.05
	マン島	100,110,153	0.03
	英ヴァージン諸島	86,467,262	0.03
	パプアニューギニア	77,420,612	0.02
	モーリシャス	12,237,251	0.00
	小計	310,708,707,701	93.19
投資信託受益証券	オーストラリア	176,244,472	0.05
	香港	60,795,546	0.02
	シンガポール	17,064,832	0.01
	小計	254,104,850	0.08
投資証券	アメリカ	5,414,755,119	1.62
	オーストラリア	651,688,914	0.20
	フランス	402,987,163	0.12
	イギリス	297,436,649	0.09
	香港	166,648,518	0.05
	シンガポール	140,621,231	0.04
	カナダ	60,539,635	0.02
	小計	7,134,677,229	2.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,326,046,291	4.60
合計(純資産総額)		333,423,536,071	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	10,265,609,601	3.08
	買建	カナダ	720,800,910	0.22
	買建	ドイツ	2,573,925,979	0.77
	買建	イギリス	1,245,194,936	0.37
	買建	オーストラリア	693,837,259	0.21

(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		311,355,900	0.09

(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	409,491	16,820.25	6,887,741,072	17,957.45	7,353,417,024	2.21
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	584,648	7,699.78	4,501,663,999	10,307.33	6,026,160,454	1.81
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	32,676	109,953.85	3,592,852,021	165,988.92	5,423,854,146	1.63
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	190,361	16,670.00	3,173,319,330	19,044.39	3,625,310,267	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	9,358.22	2,591,966,879	12,039.43	3,334,586,391	1.00
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	214,843	13,882.19	2,982,493,485	13,997.89	3,007,349,433	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	338,335	8,876.59	3,003,262,163	8,842.04	2,991,571,942	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,114	106,267.16	2,668,793,595	113,728.37	2,856,174,385	0.86
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	23,818	108,588.26	2,586,355,363	114,085.94	2,717,299,121	0.81
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	791,346	2,549.14	2,017,252,195	3,288.15	2,602,067,911	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,464	18,264.26	1,853,165,769	21,545.23	2,186,065,267	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	373,935	3,991.95	1,492,730,454	5,801.01	2,169,203,479	0.65
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	373,750	5,727.24	2,140,559,430	5,734.31	2,143,199,857	0.64
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	248,716	9,138.29	2,272,841,219	8,449.67	2,101,570,014	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	151,790	11,477.22	1,742,128,564	13,583.45	2,061,832,938	0.62
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	144,929	10,395.61	1,506,626,301	13,896.19	2,013,962,080	0.60
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	77,581	19,547.81	1,516,538,759	25,919.23	2,010,839,821	0.60
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	477,201	3,526.03	1,682,627,061	4,029.54	1,922,904,097	0.58
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	393,079	3,444.52	1,353,970,442	4,834.36	1,900,286,770	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	93,339	16,972.99	1,584,242,627	20,308.48	1,895,573,401	0.57

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	329,757	4,967.21	1,637,975,265	5,441.25	1,794,292,255	0.54
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	490,614	4,160.44	2,041,170,818	3,619.48	1,775,770,014	0.53
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,602,916	1,028.60	1,648,759,469	1,080.25	1,731,557,750	0.52
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	20,904.24	945,666,084	37,484.08	1,695,705,105	0.51
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	9,528.86	1,932,510,218	7,955.21	1,613,364,826	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	212,257	6,791.72	1,441,591,916	7,564.83	1,605,688,758	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,690	4,957.72	1,604,765,285	4,674.71	1,513,157,689	0.45
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	177,940	8,689.21	1,546,158,955	8,412.09	1,496,848,006	0.45
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	13,426.20	1,008,670,293	19,481.79	1,463,608,888	0.44
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	218,364	7,069.27	1,543,674,462	6,496.48	1,418,598,123	0.43

(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	6.81
		素材	4.78
		資本財	7.04
		商業・専門サービス	1.00
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.52
		耐久消費財・アパレル	1.82
		消費者サービス	1.80
		メディア	2.05
		小売	4.29
		食品・生活必需品小売り	1.59
		食品・飲料・タバコ	4.62
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	4.13
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.50
		銀行	9.13
		各種金融	4.39
保険	3.99		
不動産	0.61		
ソフトウェア・サービス	10.42		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
		電気通信サービス	2.32
		公益事業	2.91
		半導体・半導体製造装置	2.87
		小計	93.19
投資信託受益証券			0.08
投資証券			2.14
合計			95.40

(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 EMIN	買建	702	アメリカドル	95,895,779	10,486,203,434	93,878,460	10,265,609,601	3.08
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	46	カナダドル	8,395,479	713,028,031	8,487,000	720,800,910	0.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	68	スイスフラン	5,856,686	647,398,070	5,971,080	660,043,183	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	420	ユーロ	13,830,060	1,830,961,643	14,456,400	1,913,882,796	0.57
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	57	オーストラリアドル	8,418,749	695,472,854	8,398,950	693,837,259	0.21
	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	111	イギリスポンド	7,800,511.25	1,187,003,797	8,182,920	1,245,194,936	0.37

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,250,000.00	245,987,100	245,951,900	0.07
	イギリスポンド	買建	320,000.00	48,687,040	48,688,000	0.01
	香港ドル	買建	1,200,000.00	16,718,400	16,716,000	0.01

(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：2018年4月27日

基準価額・純資産の推移



基準価額	26,298円
純資産総額	181.49億円

※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	2013年9月	2014年9月	2015年9月	2016年9月	2017年10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	2.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.8%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	1.6%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.1%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.9%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	0.9%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	0.9%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	0.8%
BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	銀行	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)



※2018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。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

<一部解約代金の支払い>

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより

ることとなります。

< 受付不可日 >

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

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16期計算期間(平成28年10月1日から平成29年10月2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15期 (平成28年 9月30日現在)	第16期 (平成29年10月 2日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	68,524,249	114,593,989
親投資信託受益証券	12,010,187,058	16,648,755,243
流動資産合計	12,078,711,307	16,763,349,232
資産合計	12,078,711,307	16,763,349,232
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,004,108	37,324,854
未払受託者報酬	3,862,339	5,113,350
未払委託者報酬	47,635,495	63,064,529
未払利息	170	214
その他未払費用	652,923	798,218
流動負債合計	68,155,035	106,301,165
負債合計	68,155,035	106,301,165
純資産の部		
元本等		
元本	6,141,169,717	6,440,393,863
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,869,386,555	10,216,654,204
(分配準備積立金)	2,276,044,548	4,602,962,463
元本等合計	12,010,556,272	16,657,048,067
純資産合計	12,010,556,272	16,657,048,067
負債純資産合計	12,078,711,307	16,763,349,232

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	平成27年10月 1日 至 平成28年 9月30日	自	平成28年10月 1日 至 平成29年10月 2日
営業収益				
受取利息		7,679		49
有価証券売買等損益		573,222,454		4,071,216,384
営業収益合計		573,214,775		4,071,216,433
営業費用				
支払利息		12,883		38,438
受託者報酬		7,836,004		9,580,059
委託者報酬		96,643,968		118,153,851
その他費用		654,562		798,732
営業費用合計		105,147,417		128,571,080
営業利益又は営業損失（ ）		678,362,192		3,942,645,353
経常利益又は経常損失（ ）		678,362,192		3,942,645,353
当期純利益又は当期純損失（ ）		678,362,192		3,942,645,353
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（ ）		3,308,198		473,918,786
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,020,469,199		5,869,386,555
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,503,206,312		2,235,060,216
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,503,206,312		2,235,060,216
剰余金減少額又は欠損金増加額		979,234,962		1,356,519,134
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		979,234,962		1,356,519,134
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,869,386,555		10,216,654,204

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は平成28年10月 1日から平成29年10月 2日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (平成28年 9月30日現在)	第16期 (平成29年10月 2日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,141,169,717口	6,440,393,863口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9557円 (19,557円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5863円 (25,863円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 平成27年10月 1日 至 平成28年 9月30日			第16期 自 平成28年10月 1日 至 平成29年10月 2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	- 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	- 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	2,771,882,855円
収益調整金額	C	6,491,267,535円	収益調整金額	C	7,363,407,562円
分配準備積立金額	D	2,276,044,548円	分配準備積立金額	D	1,831,079,608円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,767,312,083円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,966,370,025円
当ファンドの期末残存口数	F	6,141,169,717口	当ファンドの期末残存口数	F	6,440,393,863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	18,580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16期 自 平成28年10月 1日 至 平成29年10月 2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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第16期 (平成29年10月 2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15期	第16期
	自 平成27年10月 1日 至 平成28年 9月30日	自 平成28年10月 1日 至 平成29年10月 2日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,640,074,775円	6,141,169,717円
期中追加設定元本額	1,413,274,013円	1,664,339,529円
期中一部解約元本額	912,179,071円	1,365,115,383円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期	第16期
	(平成28年 9月30日現在)	(平成29年10月 2日現在)
	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	562,920,430	3,939,441,783
合計	562,920,430	3,939,441,783

（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	7,025,977,061	16,648,755,243	
合計		7,025,977,061	16,648,755,243	

(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)

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、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29年10月 2日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,029,867,712
コール・ローン	1,630,317,070
株式	308,774,096,094
投資信託受益証券	274,749,003
投資証券	7,687,941,233
派生商品評価勘定	104,784,563
未収入金	12,504,995
未収配当金	412,386,368
差入委託証拠金	1,661,710,807
流動資産合計	326,588,357,845
資産合計	326,588,357,845
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,754,224
前受金	97,459,309
未払解約金	264,896,339
未払利息	3,052
流動負債合計	369,112,924
負債合計	369,112,924
純資産の部	
元本等	

	平成29年10月 2日現在
項目	金額（円）
元本	137,670,547,577
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	188,548,697,344
元本等合計	326,219,244,921
純資産合計	326,219,244,921
負債純資産合計	326,588,357,845

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29年10月 2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29年10月 2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29年10月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,670,547,577口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3696円 (1万口当たり純資産額) (23,696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29年10月 2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29年10月 2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29年10月 2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29年10月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年10月 1日
期首元本額	139,771,484,726円
期中追加設定元本額	31,365,449,694円
期中一部解約元本額	33,466,386,843円
期末元本額	137,670,547,577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）	2,477,068,793円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,711,587円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,436,657,014円
世界経済インデックスファンド	7,084,426,983円
外国株式インデックス・オープン	857,525,202円
D C マイセレクション 2 5	915,139,848円
D C マイセレクション 5 0	4,616,898,330円
D C マイセレクション 7 5	5,021,342,307円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,025,977,061円
D C マイセレクション S 2 5	374,576,550円
D C マイセレクション S 5 0	1,829,293,770円
D C マイセレクション S 7 5	1,404,885,882円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	130,325,408円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	178,933,948円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	104,429,501円
D C 世界経済インデックスファンド	4,833,930,814円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	1,728,501,391円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,785,864円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,817,085円

区分	平成29年10月 2日現在
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	95,492,780円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	114,341,663円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	402,201,896円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	63,423,330円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	497,819,340円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,063,064,290円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	519,787,625円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,361,158,956円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,515,234,312円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	279,197,006円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	503,656,422円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	536,199,929円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	163,317,018円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,584,015,965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）	2,783,230,544円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,539,327,255円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,893,884,121円
コア投資戦略ファンド（成長型）	9,194,126,424円
分散投資コア戦略ファンドA	1,822,146,931円
分散投資コア戦略ファンドS	3,619,089,797円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	460,669,626円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	600,183,150円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,580,251,207円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	817,197,399円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	46,968,923円
S M T インデックスバランス・オープン	332,686,815円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,814,662,355円
外国株式S M T Bセクション（S M A専用）	29,088,539,281円
S M T 世界経済インデックス・オープン	303,696円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	590,190円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	30,850円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	137,552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）	1,996,057,450円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,306,326,141円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月 2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,889,878,676
投資信託受益証券	7,078,588

投資証券	34,235,948
合計	8,848,564,140

(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29年10月 2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	9,263,088,544	-	9,360,547,853	97,459,309
合計		9,263,088,544	-	9,360,547,853	97,459,309

(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29年10月 2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	1,345,893,870	-	1,346,464,900	571,030
	アメリカドル	876,572,600	-	877,350,600	778,000
	カナダドル	52,574,680	-	52,397,200	177,480
	ユーロ	179,316,450	-	179,550,000	233,550
	イギリスポンド	96,849,920	-	96,524,800	325,120
	スイスフラン	44,125,220	-	44,235,800	110,580
	スウェーデンク ローナ	21,668,400	-	21,590,400	78,000
	オーストラリアド ル	51,275,480	-	51,295,200	19,720
	香港ドル	23,511,120	-	23,520,900	9,780
	売建	84,570,000	-	84,570,000	-
	アメリカドル	84,570,000	-	84,570,000	-
	合計		1,430,463,870	-	1,431,034,900

(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	44,380	48.85	2,167,963.00	
	ANDEAVOR	11,677	103.15	1,204,482.55	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	19.90	370,856.40	
	APACHE CORP	29,810	45.80	1,365,298.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	31,676	36.62	1,159,975.12	
	CABOT OIL & GAS CORP	39,315	26.75	1,051,676.25	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	45.04	706,722.64	
	CHEVRON CORP	152,531	117.50	17,922,392.50	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	113.67	863,778.33	
	CONCHO RESOURCES INC	11,793	131.72	1,553,373.96	
	CONOCOPHILLIPS	99,645	50.05	4,987,232.25	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	38.61	295,250.67	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,346	98.70	330,250.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	40,715	36.71	1,494,647.65	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,511	97.96	735,777.56	
	EOG RESOURCES INC	46,361	96.74	4,484,963.14	
	EQT CORPORATION	13,878	65.24	905,400.72	
	EXXON MOBIL	341,013	81.98	27,956,245.74	
	HALLIBURTON CO	69,072	46.03	3,179,384.16	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	52.11	433,294.65	
	HESS CORP	23,898	46.89	1,120,577.22	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,448	35.97	447,754.56	
	KINDER MORGAN INC	162,488	19.18	3,116,519.84	
	MARATHON OIL CORP	71,172	13.56	965,092.32	
	MARATHON PETROLEUM CORP	41,702	56.08	2,338,648.16	
	MURPHY OIL CORP	13,898	26.56	369,130.88	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	35.73	1,083,012.03		
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	29.67	476,885.91		
NOBLE ENERGY INC	38,291	28.36	1,085,932.76		

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,334	64.21	3,938,256.14
ONEOK INC	30,874	55.41	1,710,728.34
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16,134	26.34	424,969.56
PHILLIPS 66	34,624	91.61	3,171,904.64
PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	147.54	1,984,413.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	21.87	216,294.30
RANGE RESOURCES CORP	20,891	19.57	408,836.87
SCHLUMBERGER	112,019	69.76	7,814,445.44
TARGA RESOURCES CORP	16,467	47.30	778,889.10
TECHNIPFMC PLC	36,005	27.92	1,005,259.60
VALERO ENERGY CORP	35,848	76.93	2,757,786.64
WILLIAMS COS	67,038	30.01	2,011,810.38
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,586	151.22	2,659,354.92
ALBEMARLE CORP	8,647	136.31	1,178,672.57
AVERY DENNISON CORP	7,457	98.34	733,321.38
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	28.92	509,165.52
BALL CORP	27,142	41.30	1,120,964.60
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	104.27	1,152,496.31
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,559	35.16	722,854.44
CROWN HOLDINGS INC	12,217	59.72	729,599.24
DOWDUPONT INC	183,235	69.23	12,685,359.05
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	90.49	1,073,030.42
ECOLAB INC	20,812	128.61	2,676,631.32
FMC CORP	10,402	89.31	929,002.62
FREEMONT-MCMORAN INC	111,396	14.04	1,563,999.84
INT'L PAPER CO	30,605	56.82	1,738,976.10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	142.91	867,463.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,660	99.05	2,739,723.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	206.23	1,028,881.47
MONSANTO CO	34,984	119.82	4,191,782.88
MOSAIC CO/THE	27,677	21.59	597,546.43
NEWMONT MINING CORP	42,952	37.51	1,611,129.52
NUCOR CORP	24,915	56.04	1,396,236.60
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,070	114.68	925,467.60
PPG INDUSTRIES INC	21,022	108.66	2,284,250.52
PRAXAIR INC	22,656	139.74	3,165,949.44
SEALED AIR CORP	14,689	42.72	627,514.08
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,776	358.04	2,426,079.04
STEEL DYNAMICS INC	18,273	34.47	629,870.31
VULCAN MATERIALS CO	10,740	119.60	1,284,504.00
WESTROCK CO	20,913	56.73	1,186,394.49
WR GRACE & CO	5,635	72.15	406,565.25

3 M COMPANY	48,002	209.90	10,075,619.80
ACUITY BRANDS INC	3,505	171.28	600,336.40
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	51.11	579,076.30
AGCO CORP	5,969	73.77	440,333.13
ALLEGION PLC	7,168	86.47	619,816.96
AMETEK INC	18,866	66.04	1,245,910.64
ARCONIC INC	30,141	24.88	749,908.08
BOEING CO	46,016	254.21	11,697,727.36
CATERPILLAR	46,823	124.71	5,839,296.33
CUMMINS INC	12,985	168.03	2,181,869.55
DEERE&CO	21,853	125.59	2,744,518.27
DOVER CORP	13,056	91.39	1,193,187.84
EATON CORP	35,279	76.79	2,709,074.41
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	62.84	3,200,252.68
FASTENAL CO	23,228	45.58	1,058,732.24
FLOWSERVE CORP	10,826	42.59	461,079.34
FLUOR CORP	11,267	42.10	474,340.70
FORTIVE CORP	24,294	70.79	1,719,772.26
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	67.23	861,216.30
GENERAL DYNAMICS CORP	20,743	205.58	4,264,345.94
GENERAL ELECTRIC CO	697,433	24.18	16,863,929.94
GRAINGER (WW) INC	4,749	179.75	853,632.75
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	36.07	549,201.82
HONEYWELL INTL INC	58,230	141.74	8,253,520.20
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,963	226.44	897,381.72
IDEX CORP	5,756	121.47	699,181.32
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	147.96	3,629,162.88
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	89.17	1,805,603.33
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	58.27	564,811.11
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	63.36	1,051,776.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	43.20	712,800.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	40.29	3,001,121.52
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	188.43	1,152,626.31
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	178.97	516,328.45
LOCKHEED MARTIN CORP	20,956	310.29	6,502,437.24
MASCO CORP	24,547	39.01	957,578.47
MIDDLEBY CORP	4,364	128.17	559,333.88
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,276	287.72	3,819,770.72
PACCAR INC	27,548	72.34	1,992,822.32
PARKER HANNIFIN CORP	10,942	175.02	1,915,068.84
PENTAIR PLC	13,583	67.96	923,100.68
RAYTHEON COMPANY	23,550	186.58	4,393,959.00

ROCKWELL AUTOMATION INC	10,405	178.21	1,854,275.05
ROCKWELL COLLIN	13,112	130.71	1,713,869.52
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	243.40	1,971,540.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	48.07	664,711.96
SMITH (A.O.) CORP	12,146	59.43	721,836.78
SNAP-ON INC	4,900	149.01	730,149.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	150.97	1,813,904.55
TEXTRON	21,877	53.88	1,178,732.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	255.65	1,041,006.80
UNITED RENTALS INC	6,446	138.74	894,318.04
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,214	116.08	7,105,721.12
WABCO HOLDINGS INC	3,841	148.00	568,468.00
WABTEC CORP	7,158	75.75	542,218.50
XYLEM INC	13,941	62.63	873,124.83
CINTAS CORP	7,034	144.28	1,014,865.52
EQUIFAX INC	9,276	105.99	983,163.24
IHS MARKIT LTD	33,011	44.08	1,455,124.88
MANPOWER GROUP	5,123	117.82	603,591.86
NIELSEN HOLDINGS PLC	29,941	41.45	1,241,054.45
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	66.06	1,219,533.66
ROBERT HALF INTL INC	11,558	50.34	581,829.72
ROLLINS INC	7,031	46.14	324,410.34
STERICYCLE INC	6,767	71.62	484,652.54
VERISK ANALYTICS INC	12,301	83.19	1,023,320.19
WASTE CONNECTIONS INC	21,610	69.96	1,511,835.60
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	78.27	2,734,049.37
AMERCO	602	374.90	225,689.80
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	47.49	471,100.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	76.10	871,192.80
CSX CORP	72,941	54.26	3,957,778.66
DELTA AIR LINES INC	15,095	48.22	727,880.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,281	59.86	914,720.66
FEDEX CORP	20,171	225.58	4,550,174.18
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	111.08	792,444.72
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	108.68	950,189.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	41.55	444,585.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	5,809	72.18	419,293.62
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	132.24	3,014,939.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,214	55.98	739,719.72
UNION PACIFIC CORP	64,308	115.97	7,457,798.76
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	60.88	365,462.64
UNITED PARCEL SERVICE B	55,410	120.09	6,654,186.90

AUTOLIV INC	7,451	123.60	920,943.60
BORGWARNER INC	18,147	51.23	929,670.81
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,954	98.40	2,061,873.60
FORD MOTOR COMPANY	295,438	11.97	3,536,392.86
GENERAL MOTORS CO	109,241	40.38	4,411,151.58
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	33.25	719,097.75
HARLEY-DAVIDSON	14,677	48.21	707,578.17
LEAR CORP	5,287	173.08	915,073.96
TESLA INC	10,571	341.10	3,605,768.10
COACH INC	22,032	40.28	887,448.96
DR HORTON INC	28,586	39.93	1,141,438.98
GARMIN LTD	9,564	53.97	516,169.08
HANESBRANDS INC	31,136	24.64	767,191.04
HASBRO INC	9,007	97.67	879,713.69
LEGGETT & PLATT INC	10,594	47.73	505,651.62
LENNAR CORP-CL A	16,492	52.80	870,777.60
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	62.25	527,382.00
MATTEL INC	27,399	15.48	424,136.52
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	47.85	666,072.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	247.51	1,252,895.62
NEWELL BRANDS INC	37,563	42.67	1,602,813.21
NIKE B	106,351	51.85	5,514,299.35
NVR INC	264	2,855.00	753,720.00
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	104.63	490,819.33
PULTE GROUP INC	24,602	27.33	672,372.66
PVH CORP	6,800	126.06	857,208.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	88.29	404,191.62
TOLL BROTHERS INC	11,211	41.47	464,920.17
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	16.48	262,856.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	15.02	244,570.66
VF CORP	26,718	63.57	1,698,463.26
WHIRLPOOL CORP	6,165	184.44	1,137,072.60
ARAMARK	19,980	40.61	811,387.80
BLOCK H & R INC	16,984	26.48	449,736.32
CARNIVAL CORPORATION	27,162	64.57	1,753,850.34
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	307.83	607,964.25
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	78.78	790,242.18
DOMINO'S PIZZA INC	4,088	198.55	811,672.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,573	69.45	1,150,994.85
LAS VEGAS SANDS CORP	30,845	64.16	1,979,015.20
MARRIOTT INTL A	26,066	110.26	2,874,037.16
MCDONALD'S CORP	65,456	156.68	10,255,646.08

MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	24.12	426,007.44
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,144	32.59	1,177,932.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	14,813	54.05	800,642.65
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	118.54	1,645,927.90
STARBUCKS CORP	115,910	53.71	6,225,526.10
VAIL RESORTS INC	2,987	228.12	681,394.44
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,943	105.41	837,271.63
WYNN RESORTS LTD	6,619	148.92	985,701.48
YUM BRANDS INC	27,230	73.61	2,004,400.30
CBS CORP-CL B	28,894	58.00	1,675,852.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	17,330	363.42	6,298,068.60
COMCAST CORP-CL A	380,023	38.48	14,623,285.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	12,804	21.29	272,597.16
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,945	20.26	343,305.70
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	54.23	987,962.14
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	20.79	703,408.86
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	95.30	825,583.90
LIBERTY GLOBAL PLC-A	19,082	33.91	647,070.62
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	32.70	1,513,061.70
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	41.87	637,805.71
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	41.90	267,489.60
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.26	443,931.54
OMNICOM GROUP	19,057	74.07	1,411,551.99
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,356	85.89	545,916.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	5.52	714,867.60
THE WALT DISNEY CO	125,167	98.57	12,337,711.19
TIME WARNER INC	62,319	102.45	6,384,581.55
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	83,186	26.38	2,194,446.68
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,931	25.79	952,450.49
VIACOM INC-CLASS B	26,755	27.84	744,859.20
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	99.20	613,651.20
AMAZON.COM	32,607	961.35	31,346,739.45
AUTONATION INC	5,015	47.46	238,011.90
AUTOZONE INC	2,370	595.11	1,410,410.70
BED BATH & BEYOND INC	12,615	23.47	296,074.05
BEST BUY COMPANY INC	21,836	56.96	1,243,778.56
CARMAX INC	14,253	75.81	1,080,519.93
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,851	27.01	212,055.51
DOLLAR GENERAL CORP	22,756	81.05	1,844,373.80
DOLLAR TREE INC	18,300	86.82	1,588,806.00
EXPEDIA INC	9,800	143.94	1,410,612.00
FOOT LOCKER INC	11,410	35.22	401,860.20

GAP	20,859	29.53	615,966.27
GENUINE PARTS CO	12,484	95.65	1,194,094.60
HOME DEPOT	96,452	163.56	15,775,689.12
KOHL'S CORP	15,495	45.65	707,346.75
L BRANDS INC	19,499	41.61	811,353.39
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	35,071	23.57	826,623.47
LKQ CORP	24,693	35.99	888,701.07
LOWES COMPANIES	69,142	79.94	5,527,211.48
MACY'S INC	25,926	21.82	565,705.32
NETFLIX INC	34,325	181.35	6,224,838.75
NORDSTROM INC	10,094	47.15	475,932.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,397	215.37	1,593,091.89
PRICELINE GROUP INC/THE	3,948	1,830.82	7,228,077.36
ROSS STORES INC	32,319	64.57	2,086,837.83
SIGNET JEWELERS LTD	5,407	66.55	359,835.85
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,075	59.01	2,482,845.75
TIFFANY & CO	10,306	91.78	945,884.68
TJX COMPANIES INC	52,399	73.73	3,863,378.27
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,274	63.29	713,531.46
TRIPADVISOR INC	10,393	40.53	421,228.29
ULTA BEAUTY INC	4,911	226.06	1,110,180.66
COSTCO WHOLESALE CORP	35,300	164.29	5,799,437.00
CVS HEALTH CORP	80,999	81.32	6,586,838.68
KROGER CO	73,364	20.06	1,471,681.84
SYSCO CORP	40,957	53.95	2,209,630.15
WAL-MART STORES	121,565	78.14	9,499,089.10
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	73,927	77.22	5,708,642.94
ALTRIA GROUP INC	155,248	63.42	9,845,828.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	42.51	1,894,543.17
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,638	54.30	849,143.40
BUNGE LIMITED	11,767	69.46	817,335.82
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	46.82	658,851.04
COCA-COLA CO	326,033	45.01	14,674,745.33
CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.74	1,121,618.82
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,015	199.45	2,795,291.75
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	88.47	1,314,221.85
GENERAL MILLS INC	46,814	51.76	2,423,092.64
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	109.17	1,222,704.00
HORMEL FOODS CORP	23,465	32.14	754,165.10
INGREDION INC	5,835	120.64	703,934.40
JM SMUCKER CO	9,562	104.93	1,003,340.66
KELLOGG CO	21,051	62.37	1,312,950.87

KRAFT HEINZ CO/THE	48,860	77.55	3,789,093.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	102.64	952,088.64
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	81.64	1,232,764.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,487	40.66	4,899,001.42
MONSTER BEVERAGE CORP	31,093	55.25	1,717,888.25
PEPSICO INC	114,759	111.43	12,787,595.37
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,759	111.01	13,849,496.59
TYSON FOODS INC	22,220	70.45	1,565,399.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,126	48.45	1,023,554.70
CLOROX COMPANY	10,045	131.91	1,325,035.95
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,564	72.85	4,922,037.40
COTY INC-CL A	39,000	16.53	644,670.00
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	107.84	1,921,924.48
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	117.68	3,293,863.20
PROCTER & GAMBLE CO	205,388	90.98	18,686,200.24
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,894	105.92	200,612.48
ABBOTT LABORATORIES	138,584	53.36	7,394,842.24
AETNA INC	26,760	159.01	4,255,107.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,229	186.27	1,160,275.83
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	82.75	1,063,089.25
ANTHEM INC	21,018	189.88	3,990,897.84
BARD C R INC	5,875	320.50	1,882,937.50
BAXTER INTERNATIONAL	39,728	62.75	2,492,932.00
BECTON DICKINSON & CO	18,352	195.95	3,596,074.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	107,874	29.17	3,146,684.58
CARDINAL HEALTH	25,252	66.92	1,689,863.84
CENTENE CORP	13,787	96.77	1,334,167.99
CERNER CORP	23,088	71.32	1,646,636.16
CIGNA CORP	20,371	186.94	3,808,154.74
DANAHER CORP	49,843	85.78	4,275,532.54
DAVITA INC	13,384	59.39	794,875.76
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	59.81	1,066,651.54
DEXCOM INC	6,289	48.92	307,689.32
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	109.31	1,833,784.56
ENVISION HEALTHCARE	9,978	44.95	448,511.10
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	49,016	63.32	3,103,693.12
HCA HEALTHCARE INC	23,646	79.59	1,881,985.14
HENRY SCHEIN INC	12,492	81.99	1,024,219.08
HOLOGIC INC	21,094	36.69	773,938.86
HUMANA INC	11,797	243.63	2,874,103.11
IDEXX LABORATORIES INC	7,291	155.49	1,133,677.59
INTUITIVE SURGICAL INC	3,062	1,045.88	3,202,484.56

LABORATORY CRP OF AMER	7,953	150.97	1,200,664.41
MCKESSON CORP	16,655	153.61	2,558,374.55
MEDNAX INC	8,151	43.12	351,471.12
MEDTRONIC PLC	110,198	77.77	8,570,098.46
PATTERSON COMPANIES INC	7,082	38.65	273,719.30
QUEST DIAGNOSTICS	11,439	93.64	1,071,147.96
RESMED INC	11,925	76.96	917,748.00
STRYKER CORP	26,917	142.02	3,822,752.34
TELEFLEX INC	3,697	241.97	894,563.09
THE COOPER COS INC	4,109	237.11	974,284.99
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,513	195.85	15,180,921.05
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	110.94	804,093.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,822	100.06	782,669.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,988	56.41	450,603.08
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	117.09	1,880,816.67
ABBVIE INC	128,104	88.86	11,383,321.44
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	64.20	1,625,736.60
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	140.29	2,487,201.41
ALKERMES PLC	12,547	50.84	637,889.48
ALLERGAN PLC	27,062	204.95	5,546,356.90
AMGEN	59,185	186.45	11,035,043.25
BIOGEN INC	17,038	313.12	5,334,938.56
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	93.07	1,334,716.87
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,369	63.74	8,437,200.06
CELGENE CORP	62,865	145.82	9,166,974.30
GILEAD SCIENCES INC	105,215	81.02	8,524,519.30
ILLUMINA INC	11,836	199.20	2,357,731.20
INCYTE CORP	14,121	116.74	1,648,485.54
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	146.25	727,008.75
JOHNSON & JOHNSON	216,568	130.01	28,156,005.68
LILLY (ELI) & CO	80,004	85.54	6,843,542.16
MALLINCKRODT PLC	9,552	37.37	356,958.24
MERCK & CO	220,029	64.03	14,088,456.87
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	626.16	1,256,076.96
MYLAN NV	36,548	31.37	1,146,510.76
PERRIGO CO PLC	9,792	84.65	828,892.80
PFIZER	480,001	35.70	17,136,035.70
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,874	95.07	1,033,791.18
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,325	447.12	2,828,034.00
SEATTLE GENETICS INC	7,471	54.41	406,497.11
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1,458	112.69	164,302.02
TESARO INC	2,771	129.10	357,736.10

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,876	17.60	1,265,017.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,681	189.20	5,994,045.20
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	117.19	380,515.93
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,884	152.04	3,023,163.36
WATERS CORP	6,513	179.52	1,169,213.76
ZOETIS INC	39,710	63.76	2,531,909.60
BANK OF AMERICA CORP	799,189	25.34	20,251,449.26
BB&T CORP	64,293	46.94	3,017,913.42
CIT GROUP INC	10,713	49.05	525,472.65
CITIGROUP	221,153	72.74	16,086,669.22
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	37.87	1,515,178.70
COMERICA INC	14,625	76.26	1,115,302.50
EAST WEST BANCORP INC	10,794	59.78	645,265.32
FIFTH THIRD BANCORP	62,255	27.98	1,741,894.90
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	104.46	1,313,897.88
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	13.96	1,220,355.28
JPMORGAN CHASE & CO	285,238	95.51	27,243,081.38
KEY CORP	87,033	18.82	1,637,961.06
M & T BANK CORP	10,792	161.04	1,737,943.68
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	12.89	503,934.55
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	18.14	496,745.76
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,959	134.77	5,250,504.43
REGIONS FINL CORP	96,209	15.23	1,465,263.07
SIGNATURE BANK	4,354	128.04	557,486.16
SUNTRUST BANKS	38,353	59.77	2,292,358.81
SVB FINANCIAL GROUP	3,954	187.09	739,753.86
US BANCORP	135,655	53.59	7,269,751.45
WELLS FARGO & CO	381,231	55.15	21,024,889.65
ZIONS BANCORPORATION	15,186	47.18	716,475.48
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	189.83	841,516.39
ALLY FINANCIAL INC	36,028	24.26	874,039.28
AMERICAN EXPRESS	60,354	90.46	5,459,622.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,382	148.51	1,838,850.82
BANK NEW YORK CO	83,759	53.02	4,440,902.18
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100,212	183.32	18,370,863.84
BLACKROCK INC	9,743	447.09	4,355,997.87
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,275	84.66	3,240,361.50
CBOE HOLDINGS INC	7,588	107.63	816,696.44
CME GROUP INC	27,024	135.68	3,666,616.32
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	31,098	64.48	2,005,199.04
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,110	43.61	1,007,827.10
EATON VANCE CORP	10,061	49.37	496,711.57

FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	44.51	1,160,375.70
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,555	237.19	6,772,960.45
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,132	68.70	3,237,968.40
INVESCO LTD	30,943	35.04	1,084,242.72
LEUCADIA NATIONAL CORP	25,706	25.25	649,076.50
MOODY'S CORP	13,995	139.21	1,948,243.95
MORGAN STANLEY	111,836	48.17	5,387,140.12
MSCI INC	7,670	116.90	896,623.00
NASDAQ INC	9,070	77.57	703,559.90
NAVIENT CORP	23,616	15.02	354,712.32
NORTHERN TRUST CORP	17,320	91.93	1,592,227.60
PRICE T ROWE GROUP INC	18,992	90.65	1,721,624.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	84.33	837,565.56
S&P GLOBAL INC	20,491	156.31	3,202,948.21
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,249	43.74	4,166,191.26
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	61.06	659,570.12
STATE STREET CORP	30,456	95.54	2,909,766.24
SYNCHRONY FINANCIAL	65,163	31.05	2,023,311.15
TD AMERITRADE HOLDING CORP	22,142	48.80	1,080,529.60
VOYA FINANCIAL INC	16,094	39.89	641,989.66
AFLAC	32,201	81.39	2,620,839.39
ALLEGHANY CORP	1,276	554.01	706,916.76
ALLSTATE CORP	29,434	91.91	2,705,278.94
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	103.45	574,044.05
AMERICAN INT'L GROUP	74,267	61.39	4,559,251.13
AON PLC	20,775	146.10	3,035,227.50
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,102	98.50	995,047.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	61.55	921,526.60
ASSURANT INC	4,769	95.52	455,534.88
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	8,893	53.84	478,799.12
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.31	418,477.62
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	60.80	413,196.80
CHUBB LTD	37,318	142.55	5,319,680.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	76.57	950,463.41
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	228.39	765,791.67
FNF GROUP	20,786	47.46	986,503.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	55.43	1,588,734.66
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	73.48	1,307,209.20
LOEWS CORP	24,048	47.86	1,150,937.28
MARKEL CORP	1,132	1,067.98	1,208,953.36
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	83.81	3,422,632.78
METLIFE INC	74,757	51.95	3,883,626.15

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	64.34	1,489,792.70
PROGRESSIVE CORP	46,702	48.42	2,261,310.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,588	106.32	3,677,396.16
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	139.53	757,787.43
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	135.14	439,069.86
TORCHMARK CORP	9,592	80.09	768,223.28
TRAVELERS COS INC/THE	22,473	122.52	2,753,391.96
UNUM GROUP	18,574	51.13	949,688.62
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,506	154.23	1,620,340.38
WR BERKLEY CORP	8,610	66.74	574,631.40
XL GROUP LTD	20,644	39.45	814,405.80
CBRE GROUP INC-A	24,306	37.88	920,711.28
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	7.20	710,640.00
JONES LANG LASALLE INC	3,673	123.50	453,615.50
WEYERHAEUSER CO	58,857	34.03	2,002,903.71
ACCENTURE PLC-CL A	49,926	135.07	6,743,504.82
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,763	64.51	3,726,291.13
ADOBE SYSTEMS INC	39,838	149.18	5,943,032.84
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	14,178	48.72	690,752.16
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	221.55	889,744.80
ALPHABET INC-CL A	23,919	973.72	23,290,408.68
ALPHABET INC-CL C	25,095	959.11	24,068,865.45
ANSYS INC	6,865	122.73	842,541.45
AUTODESK INC	15,592	112.26	1,750,357.92
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,479	109.32	3,878,564.28
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	80.82	779,913.00
CA INC	26,520	33.38	885,237.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	39.47	851,959.95
CDK GLOBAL INC	10,687	63.09	674,242.83
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	114.02	1,231,530.02
CITRIX SYSTEMS INC	12,511	76.82	961,095.02
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,060	72.54	3,486,272.40
COSTAR GROUP INC	2,453	268.25	658,017.25
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	16,887	77.21	1,303,845.27
DXC TECHNOLOGY CO	23,243	85.88	1,996,108.84
EBAY	81,500	38.46	3,134,490.00
ELECTRONIC ARTS INC	25,039	118.06	2,956,104.34
FACEBOOK INC-A	190,001	170.87	32,465,470.87
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	26,732	93.39	2,496,501.48
FIRST DATA CORP- CLASS A	29,535	18.04	532,811.40
FISERV INC	16,892	128.96	2,178,392.32
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	154.77	1,108,617.51

FORTINET INC	10,871	35.84	389,616.64
GARTNER INC	7,002	124.41	871,118.82
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	95.03	1,189,110.39
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,658	145.08	10,396,142.64
INTUIT INC	19,275	142.14	2,739,748.50
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	102.79	614,581.41
LEIDOS HOLDINGS	10,999	59.22	651,360.78
MASTERCARD INC-CLASS A	76,297	141.20	10,773,136.40
MERCADOLIBRE INC	3,264	258.93	845,147.52
MICROSOFT CORP	589,215	74.49	43,890,625.35
NUANCE COMMUNICATIONS INC	23,427	15.72	368,272.44
ORACLE CORP	248,161	48.35	11,998,584.35
PAYCHEX INC	25,506	59.96	1,529,339.76
PAYPAL HOLDINGS INC	90,782	64.03	5,812,771.46
RED HAT INC	13,963	110.86	1,547,938.18
SABRE CORP	17,243	18.10	312,098.30
SALESFORCE.COM INC	54,514	93.42	5,092,697.88
SERVICENOW INC	13,794	117.53	1,621,208.82
SPLUNK INC	10,741	66.43	713,524.63
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,239	40.15	531,545.85
SYMANTEC CORP	48,508	32.81	1,591,547.48
SYNOPSYS INC	12,264	80.53	987,619.92
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	65.50	825,955.00
TWITTER INC	47,756	16.87	805,643.72
VANTIV INC - CL A	12,864	70.47	906,526.08
VERISIGN INC	7,289	106.39	775,476.71
VISA INC-CLASS A SHARES	148,424	105.24	15,620,141.76
VMWARE INC-CLASS A	5,821	109.19	635,594.99
WESTERN UNION CO	38,757	19.20	744,134.40
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	105.39	1,126,724.49
ZILLOW GROUP INC-C	7,786	40.21	313,075.06
AMPHENOL CORPORATION	24,215	84.64	2,049,557.60
APPLE INC	418,792	154.12	64,544,223.04
ARISTA NETWORKS INC	3,532	189.61	669,702.52
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	80.41	536,013.06
AVNET INC	10,936	39.30	429,784.80
CDW CORP/DE	12,482	66.00	823,812.00
CISCO SYSTEMS	402,060	33.63	13,521,277.80
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	33.21	495,924.93
CORNING	74,974	29.92	2,243,222.08
F5 NETWORKS INC	5,350	120.56	644,996.00
FLEX LTD	45,803	16.57	758,955.71

FLIR SYSTEMS INC	11,686	38.91	454,702.26
HARRIS CORP	9,931	131.68	1,307,714.08
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	132,071	14.71	1,942,764.41
HP INC	135,166	19.96	2,697,913.36
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.83	871,190.32
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	84.87	1,071,059.40
NETAPP INC	23,085	43.76	1,010,199.60
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	144.10	1,039,105.10
SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	33.17	757,470.12
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	83.06	2,326,427.54
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	39.25	809,413.50
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	86.40	2,037,052.80
XEROX CORP	16,718	33.29	556,542.22
AT&T INC	493,720	39.17	19,339,012.40
CENTURYLINK INC	45,847	18.90	866,508.30
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	24,501	53.29	1,305,658.29
SPRINT CORP	64,825	7.78	504,338.50
T-MOBILE US INC	22,516	61.66	1,388,336.56
VERIZON COMMUNICATIONS	327,649	49.49	16,215,349.01
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.42	526,247.38
AES CORP	52,646	11.02	580,158.92
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	41.57	800,471.92
AMEREN CORPORATION	20,393	57.84	1,179,531.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	70.24	2,730,369.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	80.91	1,155,637.53
ATMOS ENERGY CORP	8,018	83.84	672,229.12
CENTERPOINT ENERGY INC	34,527	29.21	1,008,533.67
CMS ENERGY CORP	23,551	46.32	1,090,882.32
CONSOLIDATED EDISON INC	23,942	80.68	1,931,640.56
DOMINION ENERGY INC	50,217	76.93	3,863,193.81
DTE ENERGY COMPANY	14,355	107.36	1,541,152.80
DUKE ENERGY CORP	56,348	83.92	4,728,724.16
EDISON INTL	26,184	77.17	2,020,619.28
ENTERGY CORP	15,032	76.36	1,147,843.52
EVERSOURCE ENERGY	25,381	60.44	1,534,027.64
EXELON CORP	73,029	37.67	2,751,002.43
FIRSTENERGY CORP	35,696	30.83	1,100,507.68
NEXTERA ENERGY INC	37,675	146.55	5,521,271.25
NISOURCE INC	26,021	25.59	665,877.39
OGE ENERGY CORP	15,686	36.03	565,166.58
PG&E CORP	41,241	68.09	2,808,099.69
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	84.56	796,216.96

	PPL CORPORATION	53,473	37.95	2,029,300.35
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	46.25	1,878,027.50
	SCANA CORP	11,459	48.49	555,646.91
	SEMPRA ENERGY	18,704	114.13	2,134,687.52
	SOUTHERN CO	80,152	49.14	3,938,669.28
	UGI CORP	13,950	46.86	653,697.00
	WEC ENERGY GROUP INC	25,287	62.78	1,587,517.86
	WESTAR ENERGY INC	11,492	49.60	570,003.20
	XCEL ENERGY INC	40,763	47.32	1,928,905.16
	ADVANCED MICRO DEVICES	60,463	12.75	770,903.25
	ANALOG DEVICES	28,935	86.17	2,493,328.95
	APPLIED MATERIALS	85,715	52.09	4,464,894.35
	BROADCOM LTD	32,301	242.54	7,834,284.54
	INTEL CORP	378,637	38.08	14,418,496.96
	KLA-TENCOR CORP	12,266	106.00	1,300,196.00
	LAM RESEARCH CORP	12,814	185.04	2,371,102.56
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,834	17.90	641,428.60
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,468	47.71	1,119,658.28
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	89.78	1,672,062.72
	MICRON TECHNOLOGY	84,938	39.33	3,340,611.54
	NVIDIA CORP	47,884	178.77	8,560,222.68
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	113.09	3,085,434.47
	QORVO INC	10,609	70.68	749,844.12
	QUALCOMM	118,971	51.84	6,167,456.64
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	101.90	1,478,569.00
	TEXAS INSTRUMENTS	80,218	89.64	7,190,741.52
	XILINX INC	20,299	70.83	1,437,778.17
	アメリカドル 小計	24,617,761		1,768,372,696.21 (199,437,072,678)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	28.74	341,603.64
	ARC RESOURCES LTD	27,117	17.19	466,141.23
	CAMECO CORP	28,709	12.05	345,943.45
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	89,413	41.79	3,736,569.27
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	12.51	973,315.53
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	10.02	433,304.88
	ENBRIDGE	132,496	52.12	6,905,691.52
	ENCANA CORP	76,271	14.69	1,120,420.99
	HUSKY ENERGY INC	31,439	15.62	491,077.18
	IMPERIAL OIL	24,763	39.86	987,053.18
	INTER PIPELINE LTD	30,317	25.85	783,694.45
	KEYERA CORP	14,929	38.14	569,392.06
	PEMBINA PIPELINE CORP	31,251	43.78	1,368,168.78

PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,633	20.40	257,713.20
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	31.93	585,915.50
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	19.74	394,997.40
SUNCOR ENERGY	135,128	43.73	5,909,147.44
TOURMALINE OIL CORP	19,965	25.37	506,512.05
TRANSCANADA CORP	69,465	61.67	4,283,906.55
VERESEN INC	23,263	18.72	435,483.36
VERMILION ENERGY INC	10,067	44.35	446,471.45
AGNICO EAGLE MINES	17,661	56.39	995,903.79
AGRIUM INC	10,925	133.72	1,460,891.00
BARRICK GOLD CORP	94,395	20.08	1,895,451.60
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10,500	60.38	633,990.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	14.01	797,169.00
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	96.66	1,378,081.62
GOLDCORP INC	68,688	16.20	1,112,745.60
KINROSS GOLD CORP	107,615	5.29	569,283.35
METHANEX CORP	7,099	62.70	445,107.30
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	67,665	24.02	1,625,313.30
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	26.27	1,199,934.79
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	3.86	274,060.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	72.00	311,544.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	23.80	876,744.40
YAMANA GOLD INC	85,214	3.30	281,206.20
BOMBARDIER B	157,835	2.26	356,707.10
CAE INC	18,372	21.83	401,060.76
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	28.53	335,626.92
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	56.39	829,666.07
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,851	103.38	6,290,776.38
CP RAILWAY LIMITED	11,952	209.58	2,504,900.16
LINAMAR CORP	3,889	76.14	296,108.46
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	66.59	1,863,055.02
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	38.99	688,524.41
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	79.72	1,464,615.84
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	28.72	1,032,397.84
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	155.34	840,234.06
DOLLARAMA INC	9,011	136.53	1,230,271.83
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	56.90	1,938,184.70
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	22.08	253,897.92
JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	24.30	133,990.20
LOBLAW COMPANIES LTD	18,353	68.10	1,249,839.30
METRO INC	19,179	42.91	822,970.89
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	108.65	518,803.75

SAPUTO INC	15,941	43.19	688,491.79	
BANK MONTREAL	52,268	94.43	4,935,667.24	
BANK NOVA SCOTIA	96,884	80.20	7,770,096.80	
CANADIAN IMPERIAL BANK	34,855	109.17	3,805,120.35	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,163	60.05	1,691,188.15	
ROYAL BANK OF CANADA	116,630	96.54	11,259,460.20	
TORONTO-DOMINION BANK	148,114	70.25	10,405,008.50	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	72,078	51.52	3,713,458.56	
CI FINANCIAL CORP	18,671	27.29	509,531.59	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	28,986	9.25	268,120.50	
IGM FINANCIAL INC	7,685	41.94	322,308.90	
ONEX CORP	6,603	96.29	635,802.87	
THOMSON REUTERS CORP	22,284	57.25	1,275,759.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	649.33	1,496,705.65	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	35.91	854,227.08	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	56.50	464,995.00	
INTACT FINANCIAL CORP	10,466	103.07	1,078,730.62	
MANULIFE FINANCIAL CORP	159,761	25.31	4,043,550.91	
POWER CORP OF CANADA	29,774	31.71	944,133.54	
POWER FINANCIAL CORP	20,740	34.61	717,811.40	
SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	49.69	2,461,443.84	
FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	19.68	245,311.20	
CGI GROUP INC - CL A	17,309	64.70	1,119,892.30	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,524	680.74	1,037,447.76	
OPEN TEXT CORP	19,994	40.26	804,958.44	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,105	145.12	885,957.60	
BCE INC	12,539	58.46	733,029.94	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	64.34	1,858,203.54	
TELUS CORP	16,454	44.88	738,455.52	
ATCO LTD -CLASS I	5,241	45.80	240,037.80	
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.75	400,055.00	
EMERA INC	4,086	47.26	193,104.36	
FORTIS INC	34,128	44.78	1,528,251.84	
HYDRO ONE LTD	21,742	22.72	493,978.24	
カナダドル 小計	3,258,969		137,871,876.70 (12,456,724,059)	
ユーロ				
ENAGAS	18,299	23.82	435,973.67	
ENI	202,686	14.00	2,837,604.00	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	14.99	597,805.66	
NESTE OIL OYJ	11,490	36.95	424,555.50	
OMV AG	12,139	49.29	598,331.31	
REPSOL SA	95,819	15.59	1,493,818.21	

SAIPEM SPA	59,023	3.64	215,315.90
SNAM SPA	173,485	4.07	707,124.86
TENARIS SA	40,648	12.00	487,776.00
TOTAL SA	189,598	45.44	8,616,281.11
VOPAK	6,360	37.10	235,987.80
AIR LIQUIDE	31,020	112.85	3,500,607.00
AKZO NOBEL	19,791	78.12	1,546,072.92
ARCELORMITTAL	53,985	21.82	1,178,222.62
ARKEMA	5,896	103.75	611,710.00
BASF SE	73,878	90.04	6,651,975.12
COVESTRO AG	9,162	72.75	666,535.50
CRH PLC	67,624	32.27	2,182,564.60
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	30.22	406,579.88
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	50.09	288,618.58
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	86.97	992,066.79
IMERYS SA	3,000	76.45	229,350.00
K+S AG	14,355	23.05	330,882.75
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	69.26	956,619.12
LANXESS	7,293	66.76	486,880.68
LINDE AG	14,602	176.45	2,576,522.90
SOLVAY SA	6,365	126.40	804,536.00
STORA ENSO OYJ R	48,306	11.95	577,256.70
SYMRISE AG	10,667	64.27	685,568.09
THYSSEN KRUPP	29,964	25.07	751,347.30
UMICORE	8,516	69.99	596,034.84
UPM KYMMENE OYJ	44,370	22.93	1,017,404.10
VOESTALPINE AG	10,429	43.14	449,959.20
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,813	31.35	621,236.61
AIRBUS SE	46,178	80.41	3,713,172.98
ALSTOM	11,216	35.93	403,046.96
ANDRITZ AG	5,242	48.90	256,360.01
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	8,337	29.57	246,566.77
BOUYGUES ORD	16,815	40.15	675,122.25
BRENTAG AG	13,290	47.11	626,158.35
CNH INDUSTRIAL NV	85,910	10.16	872,845.60
DASSAULT AVIATION SA	213	1,368.45	291,479.85
EIFFAGE	6,079	87.60	532,520.40
FERROVIAL SA	36,974	18.62	688,640.75
GEA GROUP AG	15,822	38.49	608,988.78
HOCHTIEF AG	1,354	142.75	193,283.50
KION GROUP AG	5,887	80.97	476,670.39
KONE OYJ-B	26,924	44.80	1,206,195.20

LEGRAND SA	21,312	61.08	1,301,736.96
LEONARDO SPA	35,425	15.85	561,486.25
MAN SE	3,262	95.49	311,488.38
METSO OYJ	9,561	31.04	296,773.44
OSRAM LICHT AG	6,216	67.51	419,642.16
PRYSMIAN SPA	14,715	28.58	420,554.70
REXEL SA	24,339	14.64	356,322.96
SAFRAN SA	25,281	86.44	2,185,289.64
SAINT-GOBAIN	39,044	50.42	1,968,598.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	73.63	3,299,654.82
SIEMENS	61,516	119.20	7,332,707.20
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	11.04	193,188.09
THALES SA	8,109	95.78	776,680.02
VINCI S.A.	40,049	80.40	3,219,939.60
WARTSILA OYJ	11,462	59.90	686,573.80
ZODIAC AEROSPACE	17,832	24.46	436,259.88
BUREAU VERITAS SA	19,558	21.83	427,048.93
EDENRED	18,941	23.00	435,643.00
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	52.34	501,835.92
RELX NV	79,547	18.01	1,432,641.47
SOCIETE BIC SA	2,424	101.40	245,793.60
WOLTERS KLUWER	23,031	39.09	900,396.94
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	53,260	17.10	910,746.00
ADP	2,382	136.80	325,857.60
AENA SME SA	5,610	152.75	856,927.50
ATLANTIA SPA	37,004	26.71	988,376.84
BOLLORE	61,805	4.22	261,373.34
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,178	23.51	497,894.78
DEUTSCHE POST AG-REG	78,336	37.66	2,950,525.44
FRAPORT AG	3,561	80.34	286,090.74
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	36,478	10.20	372,075.60
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	6.74	312,345.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,678	85.83	2,289,772.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.38	376,221.58
CONTINENTAL AG	8,828	214.75	1,895,813.00
DAIMLER AG	77,275	67.47	5,213,744.25
FERRARI NV	9,947	93.50	930,044.50
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	15.16	1,311,991.88
MICHELIN	13,802	123.50	1,704,547.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	37.63	387,287.96
PEUGEOT SA	40,815	20.15	822,422.25
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	12,859	54.10	695,671.90

RENAULT SA	13,675	83.11	1,136,529.25
SCHAEFFLER AG	15,247	13.65	208,121.55
VALEO SA	19,350	62.78	1,214,793.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	138.00	2,039,640.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	143.25	371,590.50
ADIDAS AG	14,964	191.40	2,864,109.60
HERMES INTERNATIONAL	2,561	426.55	1,092,394.55
HUGO BOSS AG	4,852	74.59	361,910.68
KERING	6,060	337.05	2,042,523.00
LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	47.29	629,855.51
LVMH	22,335	233.45	5,214,105.75
SEB SA	2,075	155.20	322,040.00
ACCOR	14,931	42.03	627,624.58
PADDY POWER PLC	6,543	84.42	552,360.06
SODEXO	7,035	105.50	742,192.50
ALTICE NV -A	38,810	16.94	657,635.45
ALTICE NV -B	5,879	16.90	99,355.10
AXEL SPRINGER SE	3,827	54.37	208,073.99
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	25.06	300,118.56
JC DECAUX SA	4,674	31.68	148,072.32
LAGADERE S.C.A	9,057	28.32	256,539.52
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	28.83	552,882.29
PUBLICIS GROUPE	15,618	59.09	922,867.62
RTL GROUP	3,513	64.24	225,675.12
SES	31,369	18.51	580,640.19
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	55.98	279,788.04
VIVENDI	83,098	21.42	1,779,959.16
INDITEX	86,470	31.88	2,757,095.95
ZALANDO SE	9,155	42.40	388,172.00
CARREFOUR	43,442	17.09	742,640.99
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	50.18	185,013.66
COLRUYT SA	4,160	43.33	180,273.60
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	4.93	228,066.09
JERONIMO MARTINS	20,234	16.69	337,705.46
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	15.82	1,590,463.70
METRO AG	13,712	17.88	245,239.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	61,288	101.30	6,208,474.40
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	35.47	605,771.10
DANONE (GROUPE)	46,629	66.37	3,094,766.73
HEINEKEN HOLDING NV	7,650	79.50	608,175.00
HEINEKEN NV	18,465	83.65	1,544,597.25
KERRY GROUP PLC-A	12,346	81.29	1,003,606.34

PERNOD-RICARD	17,080	117.05	1,999,214.00
REMY COINTREAU	1,575	100.20	157,815.00
BEIERSDORF AG	7,693	91.03	700,293.79
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	102.95	887,223.10
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	115.15	1,648,257.10
LOREAL	20,170	179.90	3,628,583.00
UNILEVER NV-CVA	131,000	50.04	6,555,240.00
ESSILOR INTERNATIONAL	16,203	104.75	1,697,264.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,540	82.77	1,451,785.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,527	68.25	2,288,217.75
KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	34.93	2,600,887.80
BAYER	66,488	115.30	7,666,066.40
EUROFINS SCIENTIFIC	971	534.60	519,096.60
GRIFOLS SA	22,128	24.65	545,455.20
IPSEN	2,722	112.45	306,088.90
MERCK KGAA	10,480	94.12	986,377.60
ORION OYJ-CLASS B	7,975	39.26	313,098.50
QIAGEN N.V.	17,548	26.63	467,303.24
RECORDATI SPA	7,493	39.00	292,227.00
SANOFI	91,978	84.01	7,727,071.78
UCB (GROUPE)	10,465	60.23	630,306.95
ABN AMRO GROUP NV-CVA	30,932	25.34	783,816.88
BANCO BILBAO VIZCAYA	540,507	7.56	4,086,773.42
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.76	782,269.12
BANCO SANTANDER SA	1,294,930	5.90	7,649,151.51
BANKIA SA	78,000	4.08	318,240.00
BANKINTER SA	58,881	8.00	471,283.52
BNP PARIBAS	90,643	68.25	6,186,384.75
CAIXABANK	277,342	4.24	1,175,930.08
COMMERZBANK AG	89,792	11.51	1,033,505.92
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	15.38	1,427,786.92
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	36.54	844,481.86
ING GROEP NV-CVA	313,872	15.60	4,896,403.20
INTESA SANPAOLO	1,004,854	2.99	3,006,523.16
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.80	182,000.00
KBC GROEP NV	20,232	71.70	1,450,634.40
MEDIOBANCA	41,923	9.08	380,660.84
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	28.35	354,153.95
SOCIETE GENERALE	61,696	49.53	3,056,111.36
UNICREDIT SPA	162,227	18.02	2,923,330.54
DEUTSCHE BANK NAMEN	167,110	14.63	2,444,819.30
DEUTSCHE BOERSE	15,552	91.71	1,426,273.92

EURAZEO SA	3,046	75.63	230,368.98
EXOR NV	9,778	53.65	524,589.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	89.00	555,983.00
NATIXIS	69,996	6.77	473,872.92
WENDEL	2,023	137.05	277,252.15
AEGON	133,499	4.92	657,883.07
AGEAS	16,065	39.76	638,744.40
ALLIANZ SE-REG	36,898	189.95	7,008,775.10
ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	15.76	1,601,988.24
AXA	156,617	25.59	4,007,829.03
CNP ASSURANCES	11,830	19.83	234,588.90
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	101.95	479,776.70
MAPFRE SA	90,939	2.75	250,446.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,779	180.90	2,311,721.10
NN GROUP NV	25,728	35.41	911,028.48
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.23	286,798.05
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	44.72	1,619,445.36
SCOR SE	13,354	35.47	473,733.15
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.97	187,878.08
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	35.92	989,703.76
VONOVIA SE	37,270	36.00	1,341,720.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,210	54.99	1,936,197.90
ATOS SE	7,634	131.25	1,001,962.50
CAPGEMINI SA	13,366	99.16	1,325,372.56
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	85.59	896,041.71
GEMALTO	6,158	37.79	232,741.61
SAP SE	79,025	92.69	7,324,827.25
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	52.67	501,049.71
INGENICO GROUP	4,681	80.20	375,416.20
NOKIA OYJ	458,694	5.08	2,330,165.52
DEUTSCHE TELEKOM	262,460	15.78	4,142,931.10
ELISA A	12,839	36.42	467,596.38
ILIAD SA	2,053	224.85	461,617.05
KPN (KON.)	261,596	2.90	759,936.38
ORANGE	156,887	13.86	2,174,453.82
PROXIMUS	13,141	29.15	383,125.85
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.79	675,647.46
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.63	299,013.49
TELEFONICA	359,839	9.19	3,307,640.08
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	4.74	317,959.31
E.ON SE	178,193	9.57	1,706,376.16
ELECTRICITE DE FRANCE	40,498	10.27	416,116.95

	ENDESA	24,774	19.07	472,564.05
	ENEL	655,540	5.09	3,339,976.30
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.18	615,475.77
	ENGIE	137,841	14.37	1,980,775.17
	FORTUM OYJ	38,513	16.89	650,484.57
	GAS NATURAL SDG SA	26,034	18.73	487,616.82
	IBERDROLA SA	467,107	6.57	3,069,827.20
	INNOGY SE	11,000	37.65	414,205.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	17.78	584,641.96
	RWE STAMM	42,828	19.22	823,154.16
	SUEZ	28,043	15.44	433,124.13
	TERNA SPA	105,905	4.94	523,382.51
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,819	19.55	719,811.45
	ASML HOLDING NV	30,069	144.05	4,331,439.45
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	21.27	1,930,103.61
	STMICROELECTRONICS	53,368	16.37	873,634.16
	ユーロ 小計	15,387,255		317,100,562.49 (42,174,374,811)
イギリスポンド	BP PLC	1,580,851	4.77	7,545,401.82
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	359,572	22.48	8,084,976.42
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	300,901	22.94	6,904,173.44
	ANGLO AMERICAN PLC	108,396	13.39	1,451,964.42
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	9.49	340,273.44
	BHP BILLITON PLC	168,203	13.14	2,211,028.43
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	37.93	388,516.99
	FRESNILLO PLC	17,743	14.05	249,289.15
	GLENCORE PLC	979,109	3.42	3,348,552.78
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,720	34.20	571,824.00
	MONDI PLC	27,192	20.05	545,199.60
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	73.15	533,556.10
	RIO TINTO PLC REG	99,109	34.73	3,442,055.57
	ASHTREAD GROUP PLC	42,818	17.99	770,295.82
	BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.31	1,622,222.46
	BUNZL PLC	27,712	22.67	628,231.04
	COBHAM PLC	197,992	1.45	288,474.34
	DCC PLC	7,320	72.45	530,334.00
	FERGUSON PLC	20,276	48.96	992,712.96
	IMI PLC	23,923	12.43	297,362.89
	MEGGITT PLC	66,268	5.21	345,256.28
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	8.87	1,186,921.31
	SMITHS GROUP PLC	34,243	15.77	540,012.11
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	14.48	268,676.40

WEIR GROUP PLC/THE	18,586	19.65	365,214.90
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.27	162,959.57
CAPITA GROUP PLC	53,334	5.65	301,337.10
EXPERIAN PLC	76,879	14.99	1,152,416.21
G4S PLC	132,555	2.78	368,900.56
INTERTEK GROUP PLC	12,430	49.82	619,262.60
RELX PLC	87,723	16.37	1,436,025.51
EASYJET PLC	11,633	12.17	141,573.61
ROYAL MAIL PLC	75,133	3.84	288,660.98
NEW GKN	148,431	3.46	513,571.26
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	87,767	6.14	539,328.21
BURBERRY GROUP PLC	35,328	17.60	621,772.80
PERSIMMON PLC	22,676	25.82	585,494.32
TAYLOR WIMPAY PLC	270,596	1.95	529,015.18
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	37.17	393,964.83
CARNIVAL PLC	15,765	47.43	747,733.95
COMPASS GROUP PLC	127,044	15.83	2,011,106.52
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	39.48	551,298.72
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.45	290,011.59
TUI AG-DI	31,155	12.66	394,422.30
WHITBREAD PLC	14,664	37.66	552,246.24
ITV PLC	295,435	1.74	516,124.94
PEARSON	66,305	6.12	405,786.60
SKY PLC	83,042	9.15	759,834.30
WPP PLC	103,971	13.85	1,439,998.35
DIXONS CARPHONE PLC	83,240	1.93	160,986.16
KINGFISHER PLC	187,310	2.98	559,120.35
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	3.53	478,019.44
NEXT PLC	11,202	52.60	589,225.20
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.34	393,580.62
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.37	352,888.96
TESCO	656,079	1.87	1,227,851.84
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	31.93	921,020.85
BRITISH AMERICAN TOBACCO	184,683	46.72	8,628,389.76
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	25.25	353,474.75
DIAGEO	202,311	24.53	4,962,688.83
IMPERIAL BRANDS PLC	76,724	31.84	2,442,892.16
TATE & LYLE	40,576	6.48	263,135.36
RECKITT BENCKISER PLC	53,694	68.13	3,658,172.22
UNILEVER PLC	102,945	43.19	4,446,194.55
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.73	308,315.53
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	6.50	195,175.50

	SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.48	957,443.96
	ASTRAZENECA	101,741	49.55	5,041,266.55
	GLAXOSMITHKLINE	392,835	14.88	5,847,348.97
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,207	12.11	147,826.77
	SHIRE PLC	72,022	37.88	2,728,193.36
	BARCLAYS	1,365,547	1.93	2,640,285.12
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,616,258	7.37	11,913,437.71
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,793,747	0.67	3,924,104.84
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.68	792,890.89
	STANDARD CHARTERED PLC	258,738	7.41	1,918,801.00
	3I GROUP PLC	79,251	9.13	723,561.63
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	14.80	302,941.20
	INVESTEC PLC	54,280	5.45	295,826.00
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,018	38.30	996,489.40
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,114	8.30	92,301.77
	SCHRODERS PLC	8,614	33.55	288,999.70
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.46	512,835.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	4.33	958,611.55
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	18.17	295,353.35
	AVIVA PIC	318,261	5.14	1,637,452.84
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.63	413,467.74
	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.59	1,261,603.98
	OLD MUTUAL PLC	397,509	1.94	771,962.47
	PRUDENTIAL	208,409	17.86	3,723,226.78
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	6.23	539,131.74
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	3.92	314,039.25
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	23.87	836,309.32
	SAGE GROUP PLC	89,321	6.98	623,907.18
	WORLDPAY GROUP PLC	157,060	4.07	639,234.20
	BT GROUP PLC	663,615	2.83	1,884,002.98
	INMARSAT PLC	33,632	6.43	216,421.92
	VODAFONE GROUP PLC	2,139,989	2.08	4,468,297.03
	CENTRICA PLC	440,558	1.87	823,843.46
	NATIONAL GRID PLC	275,549	9.24	2,547,726.05
	SEVERN TRENT PLC	18,112	21.73	393,573.76
	SSE PLC	80,824	13.97	1,129,111.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	8.54	503,215.05
	イギリス債券 小計	24,800,699		151,821,550.80 (22,899,244,507)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	644.00	432,768.00
	GIVAUDAN-REG	740	2,107.00	1,559,180.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	36,604	56.60	2,071,786.40

	SIKA AG-BR	175	7,205.00	1,260,875.00
	ABB LTD	160,712	23.94	3,847,445.28
	GEBERIT AG-REG	3,021	458.10	1,383,920.10
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	208.30	391,812.30
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,528	213.90	754,639.20
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	75.40	997,089.60
	SGS SA	437	2,323.00	1,015,151.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,674	179.30	838,048.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	88.50	3,672,307.50
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	402.80	1,000,152.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	77.15	303,816.70
	DUFREY AG-REG	2,548	153.80	391,882.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	208	1,484.00	308,672.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	67,150.00	537,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	5,525.00	414,375.00
	NESTLE SA - REGISTERED	249,909	81.10	20,267,619.90
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	164.30	680,202.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	697	622.00	433,534.00
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	254.00	1,462,278.00
	NOVARTIS	178,679	82.90	14,812,489.10
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,439	247.20	13,951,720.80
	VIFOR PHARMA AG	3,601	114.00	410,514.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	196,823	15.33	3,017,296.59
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,803	57.30	1,077,411.90
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	80.50	273,458.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,482	657.00	973,674.00
	UBS GROUP AG	296,299	16.55	4,903,748.45
	BALOISE HOLDING AG	3,877	153.20	593,956.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,456	341.10	837,741.60
	SWISS RE LTD	25,692	87.70	2,253,188.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,137	295.40	3,585,269.80
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	87.05	546,412.85
	SWISSCOM	2,064	496.20	1,024,156.80
	スイスフラン 小計	1,344,952		92,285,794.17 (10,742,989,299)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	178.20	2,528,836.20
	BOLIDEN AB	23,656	275.70	6,521,959.20
	ALFA LAVAL AB	25,732	198.90	5,118,094.80
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	186.00	14,934,870.00
	ATLAS COPCO A	53,833	344.90	18,567,001.70
	ATLAS COPCO B	29,972	315.80	9,465,157.60
	SANDVIK AB	87,313	140.50	12,267,476.50

	SKANSKA B	28,530	188.70	5,383,611.00	
	SKF AB-B	28,335	177.50	5,029,462.50	
	VOLVO B	123,214	157.00	19,344,598.00	
	SECURITAS B	22,844	136.40	3,115,921.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	276.60	5,025,822.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	83.80	3,244,065.60	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	211.00	15,605,982.00	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	306.10	1,753,953.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	285.70	4,328,069.30	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	221.60	10,763,333.60	
	GETINGE AB-B SHS	15,845	152.70	2,419,531.50	
	NORDEA BANK AB	244,135	110.40	26,952,504.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	122,484	107.30	13,142,533.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	122.90	14,769,753.30	
	SWEDBANK AB-A	71,353	225.20	16,068,695.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	206.30	2,638,989.60	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	402.30	14,785,329.60	
	KINNEVIK AB - B	18,104	265.60	4,808,422.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,640	651.00	2,369,640.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	46.77	11,606,864.13	
	HEXAGON AB-B SHS	21,517	403.70	8,686,412.90	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	537.50	3,329,275.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,524	93.20	3,124,436.80	
	TELIA CO AB	199,107	38.36	7,637,744.52	
	スウェーデンクローナ 小計	1,872,002		275,338,347.15 (3,810,682,724)	
ノルウェークローネ	STATOIL ASA	92,696	159.30	14,766,472.80	
	NORSK HYDRO	106,150	57.90	6,146,085.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	356.70	4,804,749.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	188.00	1,310,548.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	5,995	205.20	1,230,174.00	
	MARINE HARVEST	32,238	157.50	5,077,485.00	
	ORKLA	70,520	81.70	5,761,484.00	
	DNB ASA	80,217	160.50	12,874,828.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	138.60	2,574,356.40	
	TELENOR ASA	60,821	168.40	10,242,256.40	
	ノルウェークローネ 小計	487,652		64,788,439.10 (916,108,528)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	540.00	3,996,540.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	323.10	5,714,669.70	
	VESTAS WIND SYSEMS	17,720	565.00	10,011,800.00	
	ISS A/S	14,253	253.20	3,608,859.60	

	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	11,570.00	3,459,430.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	11,960.00	6,075,680.00	
	DSV A/S	14,599	476.30	6,953,503.70	
	PANDORA A/S	8,431	621.50	5,239,866.50	
	CARLSBERG AS-B	8,236	689.00	5,674,604.00	
	COLOPLAST-B	10,121	511.00	5,171,831.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	166.20	1,233,204.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,390.00	6,271,680.00	
	H LUNDBECK A/S	4,871	363.30	1,769,634.30	
	NOVO NORDISK A/S-B	149,975	301.00	45,142,475.00	
	DANSKE BANK A/S	60,834	251.80	15,318,001.20	
	TRYG A/S	9,828	145.40	1,428,991.20	
	TDC A/S	72,376	36.89	2,669,950.64	
	DONG ENERGY A/S	13,830	360.40	4,984,332.00	
	デンマーククローネ 小計	422,901		134,725,052.84 (2,407,536,694)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	32.10	662,190.90	
	OIL SEARCH LTD	118,781	7.00	831,467.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	7.48	1,003,830.96	
	SANTOS	156,437	4.02	628,876.74	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,670	29.10	1,765,497.00	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.20	375,007.60	
	AMCOR	88,486	15.21	1,345,872.06	
	BHP BILLITON LTD	257,888	25.78	6,648,352.64	
	BLUESCOPE STEEL LTD	39,204	10.97	430,067.88	
	BORAL LIMITED	104,098	6.77	704,743.46	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	5.14	692,234.64	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.60	542,156.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	17.72	662,072.36	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	21.02	1,285,562.18	
	ORICA LTD	29,211	19.77	577,501.47	
	RIO TINTO LTD	34,814	66.53	2,316,175.42	
	SOUTH32 LTD	408,172	3.27	1,334,722.44	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	44.21	407,616.20	
	BRAMBLES LTD	129,297	9.00	1,163,673.00	
	SEEK LTD	26,358	16.61	437,806.38	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.90	781,486.30	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	34,155	5.83	199,123.65	
	TRANSURBAN GROUP	162,844	11.88	1,934,586.72	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	21.00	918,225.00	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	11.31	343,009.68	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	45.82	253,063.86	

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.01	146,867.63	
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.27	267,861.37	
	TATTS GROUP LTD	124,218	3.98	494,387.64	
	REA GROUP LTD	3,593	67.00	240,731.00	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.88	175,232.44	
	WESFARMERS LTD	89,270	41.33	3,689,529.10	
	WOOLWORTHS LTD	102,821	25.21	2,592,117.41	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	7.73	356,584.90	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	13.69	799,153.75	
	COCHLEAR LIMITED	5,007	159.21	797,164.47	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	1.67	234,265.93	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	62.28	762,805.44	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	20.91	664,457.07	
	CSL LIMITED	36,350	133.96	4,869,446.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	235,060	29.60	6,957,776.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	12.98	462,088.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	11.61	492,658.74	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,090	75.25	10,466,522.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	215,407	31.50	6,785,320.50	
	WESTPAC BANKING	270,036	31.92	8,619,549.12	
	AMP LTD	244,230	4.83	1,179,630.90	
	ASX LTD	15,814	52.43	829,128.02	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	12.45	548,646.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,204	90.92	2,382,467.68	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	6.37	1,162,881.72	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.92	626,375.04	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	10.01	1,132,060.93	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	13.05	1,343,119.05	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	14.47	471,201.08	
	TELSTRA CORP	342,339	3.49	1,194,763.11	
	TPG TELECOM LTD	31,475	4.87	153,283.25	
	AGL ENERGY LTD	51,344	23.37	1,199,909.28	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.69	203,188.70	
	オーストラリアドル 小計	5,827,986		90,546,096.31 (8,008,802,218)	
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	62,607	7.99	500,229.93	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	6.44	547,078.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	9.27	336,658.59	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	3.65	530,888.85	
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	5.50	324,296.50	
	MERCURY NZ LTD	61,741	3.39	209,301.99	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.84	314,497.68	

	ニュージーランドドル 小計	560,571		2,762,951.54 (224,545,071)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	99.85	21,267,650.60	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.22	1,506,780.00	
	MTR CORP	114,000	45.60	5,198,400.00	
	LI & FUNG	554,800	3.92	2,174,816.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	41.70	4,962,300.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	29.70	2,034,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	180,000	55.00	9,900,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	18.72	1,257,984.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	40.65	8,243,820.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	14.48	1,419,040.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.15	943,800.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	21.05	2,163,940.00	
	I-CABLE COMMUNICATION LTD	28,840	0.25	7,354.20	
	WH GROUP LTD	699,000	8.30	5,801,700.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	33.75	3,684,150.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	302,000	37.95	11,460,900.00	
	HANG SENG BANK	61,100	190.40	11,633,440.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	6.23	797,440.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	91,500	210.00	19,215,000.00	
	AIA GROUP LTD	971,200	57.60	55,941,120.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	216,496	64.65	13,996,466.40	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	28.05	2,272,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.54	3,207,420.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	104,495	51.75	5,407,616.25	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	36.75	2,168,250.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	32.35	1,245,475.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	11.22	5,514,630.00	
	SINO LAND CO	235,400	13.72	3,229,688.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	126.90	14,847,300.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	75.80	3,069,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	26.50	2,549,300.00	
	WHARF HOLDINGS	104,000	69.60	7,238,400.00	
WHEELLOCK & CO LTD	65,000	54.95	3,571,750.00		
PCCW LTD	357,000	4.23	1,510,110.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	67.20	3,360,000.00		
CLP HOLDINGS	133,500	80.05	10,686,675.00		
HONG KONG & CHINA GAS	670,830	14.68	9,847,784.40		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	67.65	7,509,150.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	112.50	2,666,250.00		
		7,510,017		273,512,299.85	

香港ドル 小計				(3,949,517,609)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.49	728,827.00
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	57,000	2.96	168,720.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.44	374,960.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	199,900	1.43	285,857.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.08	346,320.00
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	10.04	435,063.32
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	4.61	236,032.00
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.17	497,250.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.72	345,712.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	39.34	389,466.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.37	157,125.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	114,800	3.18	365,064.00
	DBS GROUP	139,600	20.82	2,906,472.00
	OCBC BANK	245,300	11.16	2,737,548.00
	UNITED OVERSEAS BANK	103,800	23.50	2,439,300.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.39	460,397.00
	CAPITALAND LTD	187,100	3.58	669,818.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	11.33	353,496.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	189,100	3.30	624,030.00
	UOL GROUP LIMITED	32,500	8.12	263,900.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.68	2,358,670.24	
STARHUB LTD	38,000	2.60	98,800.00	
シンガポールドル 小計		3,504,876		17,242,827.56 (1,430,120,117)
イスラエルシェケル	FRUTAROM	2,247	272.90	613,206.30
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	15.51	508,045.56
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	521.60	761,536.00
	BANK HAPOLIM BM	93,717	24.79	2,323,244.43
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	18.71	2,166,505.74
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	63.26	518,732.00
	AZRIELI GROUP	4,323	198.40	857,683.20
	NICE LTD	4,894	287.80	1,408,493.20
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.91	760,352.30
イスラエルシェケル 小計		417,997		9,917,798.73 (316,377,779)
合 計		90,013,638		308,774,096,094 (308,774,096,094)

(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	472,900	203,347.00	
	アメリカドル 小計		472,900	203,347.00	(22,933,474)
	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	747,917.85	
		LENLEASE GROUP	44,009	788,641.28	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	638,904.60	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,175,463.73	(192,419,766)
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,569,960.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,543,320.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,113,280.00	(59,395,763)
	投資信託受益証券合計			1,184,840	274,749,003
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	27,108	587,701.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,450	886,326.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	33,878	4,630,445.04	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	81,997	999,543.43	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,928,006.52	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,511,669.76	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,572	461,953.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	648,563.40	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	44,000	552,640.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,462	3,245,550.76	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,392	1,466,345.36	
		DUKE REALTY CORP	29,929	862,553.78	
		EQUINIX INC	6,288	2,806,334.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,893,443.67	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,289,710.31	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	806,552.64	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	748,862.09	
		GGP INC	48,203	1,001,176.31	
		HCP INC	39,255	1,092,466.65	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,098,084.12	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	797,022.10	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	692,206.85	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	485,411.32	
		MACERICH CO/THE	10,128	556,736.16	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,565	1,022,307.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	459,093.20			
PROLOGIS INC	41,651	2,643,172.46			

	PUBLIC STORAGE	12,636	2,703,977.64	
	REALTY INCOME CORP	21,691	1,240,508.29	
	REGENCY CENTERS CORP	11,717	726,922.68	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,349,172.30	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,139	4,047,630.39	
	SL GREEN REALTY CORP	8,067	817,348.44	
	UDR INC	20,960	797,108.80	
	VENTAS INC	27,813	1,811,460.69	
	VEREIT INC	77,798	644,945.42	
	VORNADO REALTY TRUST	13,295	1,022,119.60	
	WELLTOWER INC	29,615	2,081,342.20	
	アメリカドル 小計	925,218	52,416,415.52 (5,911,523,342)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	203,660.70	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	370,675.70	
	SMART REAL ESTATE INVSTMENT	5,631	165,776.64	
	カナダドル 小計	30,576	740,113.04 (66,869,213)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	203,025.90	
	GECINA SA	3,549	486,922.80	
	ICADE	2,845	214,712.15	
	KLEPIERRE	18,936	628,864.56	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	8,071	1,660,608.25	
	ユーロ 小計	35,711	3,194,133.66 (424,819,776)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	84,399	508,081.98	
	HAMMERSON PLC	61,184	328,558.08	
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	169,392.14	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	569,398.75	
	SEGRO PLC	81,695	437,885.20	
	イギリスポンド 小計	359,317	2,013,316.15 (303,668,474)	
オーストラリアドル	DEXUS	74,090	703,855.00	
	GOODMAN GROUP	140,271	1,155,833.04	
	GPT GROUP	136,015	674,634.40	
	MIRVAC GROUP	306,089	700,943.81	
	SCENTRE GROUP	426,663	1,676,785.59	
	STOCKLAND	207,412	891,871.60	
	VICINITY CENTERS	291,115	774,365.90	
	WESTFIELD CORP	161,441	1,265,697.44	
	オーストラリアドル 小計	1,743,096	7,843,986.78 (693,800,630)	

香港ドル	LINK REIT	179,500	11,362,350.00	
香港ドル 小計		179,500	11,362,350.00 (164,072,334)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	525,350.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	236,665.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	200,300	400,600.00	
	SUNTEC REIT	173,000	322,645.00	
シンガポールドル 小計		713,800	1,485,260.00 (123,187,464)	
投資証券合計		3,987,218	7,687,941,233 (7,687,941,233)	
合計			7,962,690,236 (7,962,690,236)	

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 602銘柄	97.1%			63.0%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 38銘柄			2.9%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.5%			3.9%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 232銘柄	99.0%			13.3%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
イギリスポンド	株式 103銘柄	98.7%			7.2%
	投資証券 5銘柄			1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 36銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	90.0%			2.5%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.2%		0.1%
	投資証券 8銘柄			7.8%	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 39銘柄	94.6%			1.2%

	投資信託受 2銘柄 益証券		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.9%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	92.1%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(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17期中間計算期間(2017年10月3日から2018年4月2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せん。

【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16期 (2017年10月 2日現在)	第17期中間計算期間 (2018年 4月 2日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	114,593,989	100,489,575
親投資信託受益証券	16,648,755,243	17,279,034,697
流動資産合計	16,763,349,232	17,379,524,272
資産合計	16,763,349,232	17,379,524,272
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,324,854	15,596,991
未払受託者報酬	5,113,350	5,683,885
未払委託者報酬	63,064,529	70,101,226
未払利息	214	278
その他未払費用	798,218	474,281
流動負債合計	106,301,165	91,856,661
負債合計	106,301,165	91,856,661
純資産の部		
元本等		
元本	6,440,393,863	6,856,396,845
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	10,216,654,204	10,431,270,766
(分配準備積立金)	4,602,962,463	4,170,981,041
元本等合計	16,657,048,067	17,287,667,611
純資産合計	16,657,048,067	17,287,667,611
負債純資産合計	16,763,349,232	17,379,524,272

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2016年10月 1日 至 2017年 3月31日	第17期中間計算期間 自 2017年10月 3日 至 2018年 4月 2日
営業収益		
受取利息	40	18
有価証券売買等損益	2,631,642,557	399,926,219
営業収益合計	2,631,642,597	399,926,201
営業費用		
支払利息	16,897	22,630
受託者報酬	4,466,709	5,683,885
委託者報酬	55,089,322	70,101,226
その他費用	372,297	474,285
営業費用合計	59,945,225	76,282,026
営業利益又は営業損失（ ）	2,571,697,372	476,208,227
経常利益又は経常損失（ ）	2,571,697,372	476,208,227
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,571,697,372	476,208,227
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（ ）	201,953,046	37,711,300
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,869,386,555	10,216,654,204
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,147,029,842	1,766,074,735
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,147,029,842	1,766,074,735
剰余金減少額又は欠損金増加額	697,807,353	1,037,538,646
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	697,807,353	1,037,538,646
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,688,353,370	10,431,270,766

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第17期中間計算期間は2017年10月3日から2018年4月2日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2017年10月2日現在)	第17期中間計算期間 (2018年4月2日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,440,393,863口	6,856,396,845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) 2.5863円 (25,863円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5214円 (25,214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17期中間計算期間 (2018年4月2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

	第17期中間計算期間 (2018年 4月 2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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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16期 自 2016年10月 1日 至 2017年10月 2日	第17期中間計算期間 自 2017年10月 3日 至 2018年 4月 2日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,141,169,717円	6,440,393,863円
期中追加設定元本額	1,664,339,529円	1,067,727,935円
期中一部解約元本額	1,365,115,383円	651,724,953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

	2018年 4月 2日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	14,376,407,255
コール・ローン	1,340,956,225
株式	298,282,672,249
投資信託受益証券	242,625,515
投資証券	7,015,487,756
派生商品評価勘定	19,491,471
未収入金	91,833,033
未収配当金	450,687,366
前払金	375,513,222
差入委託証拠金	1,225,037,254
流動資産合計	323,420,711,346
資産合計	323,420,711,346
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	395,707,175
未払金	5,146,110,924
未払解約金	18,333,943
未払利息	3,713
その他未払費用	8,572
流動負債合計	5,560,164,327
負債合計	5,560,164,327
純資産の部	
元本等	
元本	137,002,310,223
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	180,858,236,796
元本等合計	317,860,547,019
純資産合計	317,860,547,019
負債純資産合計	323,420,711,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 4月 2日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2018年 4月 2日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2018年 4月 2日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,002,310,223口

		2018年 4月 2日現在	
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)	2.3201円 (23,201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

		2018年 4月 2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)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項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。 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。		

(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	2018年 4月 2日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2017年10月 3日

区分	2018年 4月 2日現在
期首元本額	137,670,547,577円
期中追加設定元本額	11,931,394,988円
期中一部解約元本額	12,599,632,342円
期末元本額	137,002,310,223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）	2,386,520,433円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,289,263円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,883,434,188円
世界経済インデックスファンド	6,890,508,649円
外国株式インデックス・オープン	799,420,593円
D C マイセレクション 2 5	1,001,904,906円
D C マイセレクション 5 0	4,640,412,542円
D C マイセレクション 7 5	5,092,660,057円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,447,538,769円
D C マイセレクション S 2 5	386,029,825円
D C マイセレクション S 5 0	1,809,164,256円
D C マイセレクション S 7 5	1,422,803,883円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	120,041,649円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	179,674,260円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	111,690,946円
D C 世界経済インデックスファンド	5,339,624,579円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,707,276,732円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	21,766,541円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,113,767円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	63,085,715円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	93,779,174円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	331,121,088円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	52,708,023円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	445,729,713円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	945,540,698円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	454,199,331円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,971,874,930円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,305,801,126円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	157,917,965円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	439,423,060円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	392,560,003円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	142,266,318円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,145,242,342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）	2,573,580,843円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,462,498,342円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,306,071,226円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,430,177,721円

区分	2018年 4月 2日現在
分散投資コア戦略ファンドA	2,029,147,262円
分散投資コア戦略ファンドS	4,029,113,144円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	566,071,711円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	701,386,440円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,144,870,945円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	854,905,465円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	44,776,454円
SMT インデックスバランス・オープン	317,668,895円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	2,100,204,230円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	29,692,073,665円
SMT 世界経済インデックス・オープン	9,335,945円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	237,173,923円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	27,763,888円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	385,846円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	19,592,438円
グローバル経済コア	1,217,531,870円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	2,150,928円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	48,752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）	1,711,616,591円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,317,038,375円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2018年 4月 2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	12,624,728,247	-	12,249,215,025	375,513,222
合計		12,624,728,247	-	12,249,215,025	375,513,222

(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

（2018年 4月 2日現在）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,293,345,782	-	1,292,643,300	702,482
	アメリカドル	441,875,200	-	442,166,400	291,200
	カナダドル	18,121,400	-	18,139,000	17,600
	ユーロ	414,017,070	-	413,802,000	215,070
	イギリスポンド	196,053,180	-	195,530,600	522,580
	スイスフラン	95,906,170	-	95,786,800	119,370
	スウェーデンク ローナ	22,204,350	-	22,242,500	38,150
	オーストラリアド ル	75,205,292	-	75,210,000	4,708
	香港ドル	29,963,120	-	29,766,000	197,120
	売建	20,952,000	-	20,952,000	-
	ユーロ	20,952,000	-	20,952,000	-
	合計		1,314,297,782	-	1,313,595,300

(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】

(2018年 4月27日現在)

資産総額	18,179,404,485円
負債総額	30,763,629円
純資産総額(-)	18,148,640,856円
発行済口数	6,901,275,348口
1口当たり純資産額(/)	2.6298円
(1万口当たり純資産額)	(26,298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

(2018年 4月27日現在)

資産総額	333,838,415,357円
負債総額	414,879,286円
純資産総額(-)	333,423,536,071円
発行済口数	137,707,018,027口
1口当たり純資産額(/)	2.4213円
(1万口当たり純資産額)	(24,213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30年 4月27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30年 6月29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30年4月27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	505	9,972,357
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	225,863
単位型公社債投資信託	0	0
合計	568	10,198,220

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。

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31期事業年度（自平成28年4月1日 至平成29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32期事業年度の間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）の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28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		16,534,066		20,260,630
前払費用		102,445		143,622
未収委託者報酬		5,528,610		5,252,944
繰延税金資産		121,367		61,677
その他		5,566		5,474
流動資産合計		22,292,056		25,724,348
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	55,487	1	47,993
器具備品	1	90,924	1	73,765
その他	1	3,748	1	2,830
有形固定資産合計		150,160		124,589
無形固定資産				
ソフトウェア		215,175		221,499
その他		5,886		6,656
無形固定資産合計		221,062		228,156
投資その他の資産				
投資有価証券		63,797		71,153
長期前払費用		8,021		9,828
長期貸付金		22,838		19,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		123,235		137,359
その他		235		145
貸倒引当金		22,838		19,838
投資その他の資産合計		220,289		243,485
固定資産合計		591,512		596,231
資産合計		22,883,569		26,320,580

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）	当事業年度 （平成29年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
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	68,500	71,500
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	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

（自 平成27年4月 1日
至 平成28年3月31日）（自 平成28年4月 1日
至 平成29年3月31日）

営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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
	利益準備金	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	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563

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	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	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
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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
	利益準備金	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	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
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	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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。

会計方針の変更

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28千円増加しております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

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28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
	建 物	54,302	千円	62,231
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

（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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	業務委託費	39,733	千円	39,286
長期前払費用償却	27,866	"	4,644	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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

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28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28年3月31日	平成28年6月30日

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28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29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29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29年3月31日	平成29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）

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28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	16,534,066	16,534,066	-
(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（*）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29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	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（*）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28年3月31日	平成29年3月31日
非上場株式	3	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）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

当事業年度（平成29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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

（有価証券関係）

1. その他有価証券

前事業年度（平成28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	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

当事業年度（平成29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	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

（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27年4月1日 至 平成28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
20,015	350	365

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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
-----	---------	---------

12,699	307	604
--------	-----	-----

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付債務	389,941	437,197
(2) 退職給付引当金	389,941	437,197

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付費用	73,742	76,106

(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14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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。

(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27年4月1日 至 平成28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）	3,979,867千円

（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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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）	3,568,158千円

（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）

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

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27年4月1日 至 平成28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	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(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28年4月1日 至 平成29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	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(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28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29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05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いません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円

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32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		22,430,598
未収委託者報酬		5,219,968
繰延税金資産		79,306
その他流動資産		138,600
流動資産合計		27,868,472
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	39,695
器具備品	1	74,492
その他有形固定資産	1	2,371
有形固定資産合計		116,559
無形固定資産		
投資その他の資産		220,928
投資有価証券		72,823
長期貸付金		18,588
会員権		25,000
その他の投資		6,424
繰延税金資産		144,499
貸倒引当金		18,588
投資その他の資産合計		248,747
固定資産合計		586,236
資産合計		28,454,709
負債の部		
流動負債		
未払金		2,893,700
未払費用		97,854
未払法人税等		958,933
賞与引当金		101,223
その他流動負債	2	126,412
流動負債合計		4,178,123
固定負債		
退職給付引当金		464,737
資産除去債務		13,260
その他固定負債		1,569
固定負債合計		479,568
負債合計		4,657,692

(単位：千円)

第32期中間会計期間末
（平成29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		74,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		20,972,132
利益剰余金合計		23,146,632
株主資本合計		23,796,632
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		384
評価・換算差額等合計		384
純資産合計		23,797,016
負債・純資産合計		28,454,709

中間損益計算書

（単位：千円）

第32期中間会計期間
（自 平成29年4月1日
至 平成29年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		14,889,835
営業収益合計		14,889,835
営業費用		10,297,526
一般管理費	1	1,725,338
営業利益		2,866,970
営業外収益	2	6,124
営業外費用		8,308
経常利益		2,864,786
税引前中間純利益		2,864,786
法人税、住民税及び事業税		912,037
法人税等調整額		25,439
法人税等合計		886,598
中間純利益		1,978,187

中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			1,978,187	1,978,187	1,978,187
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	1,945,187	1,948,187	1,948,187
当中間期末残高	74,500	2,100,000	20,972,132	23,146,632	23,796,632

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,978,187
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	1,519	1,519	1,519
当中間期変動額合計	1,519	1,519	1,949,707
当中間期末残高	384	384	23,797,016

重要な会計方針

<p>第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）</p>
<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>

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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間末 (平成29年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 60,917千円
	器具備品 309,829千円
	その他有形固定資産 2,218千円
	計 372,965千円
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32期中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 16,811千円
	無形固定資産 41,202千円

2 営業外収益の主要項目 受取利息	1,314千円
----------------------	---------

（中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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29年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成29年3月31日	平成29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32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

平成29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	22,430,598	22,430,598	-
(2)未収委託者報酬	5,219,968	5,219,968	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	72,820	72,820	-
(4)未払金	(2,893,700)	(2,893,700)	-
(5)未払法人税等	(958,933)	(958,933)	-

(*)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 其他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第32期中間会計期間末（平成29年9月30日）

其他有価証券

（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	20,229	18,356	1,872
小計	20,229	18,356	1,872
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	52,590	53,909	1,318
小計	52,590	53,909	1,318
合計	72,820	72,266	554

（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「其他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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）	1,564,703千円

（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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29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32期中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	7,932,338円90銭
1株当たり中間純利益	659,395円97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32期中間会計期間 （自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）
中間純利益	1,978,187千円
普通株式に係る中間純利益	1,978,187千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

府令で定めるものを除きます。)。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成30年 6月29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29年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成29年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北海道銀行	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29年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書

（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、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29年 6月 2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28年4月1日から平成29年3月31日までの第31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29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29年12月1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28年10月1日から平成29年10月2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29年10月2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29年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	藤澤 孝 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29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29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29年4月1日から平成29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

2018年6月1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

松崎雅則

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2017年10月3日から2018年4月2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、DC外国株式インデックス・オープンの2018年4月2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（2017年10月3日から2018年4月2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

(注) 1. 上記は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いません。