【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】	2018年12月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長　橋詰　廣志
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣ外国株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

DC外国株式インデックス・オープン

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。

②三井住友トラスト・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。

③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】

2018年12月29日から2019年 6月28日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：http://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
＜申込みコース＞
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 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（株式 一般）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他 （　）	グローバル（日本を除く） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり（　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他（MSCI コクサイ・インデックス（円ベース））	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他（　　）

（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

①一般…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。

②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②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、為替のヘッジを行な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。

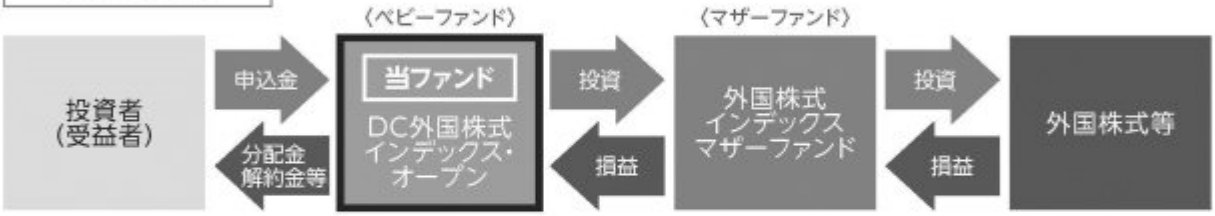
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜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。

ファンドのしくみ



？ 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。

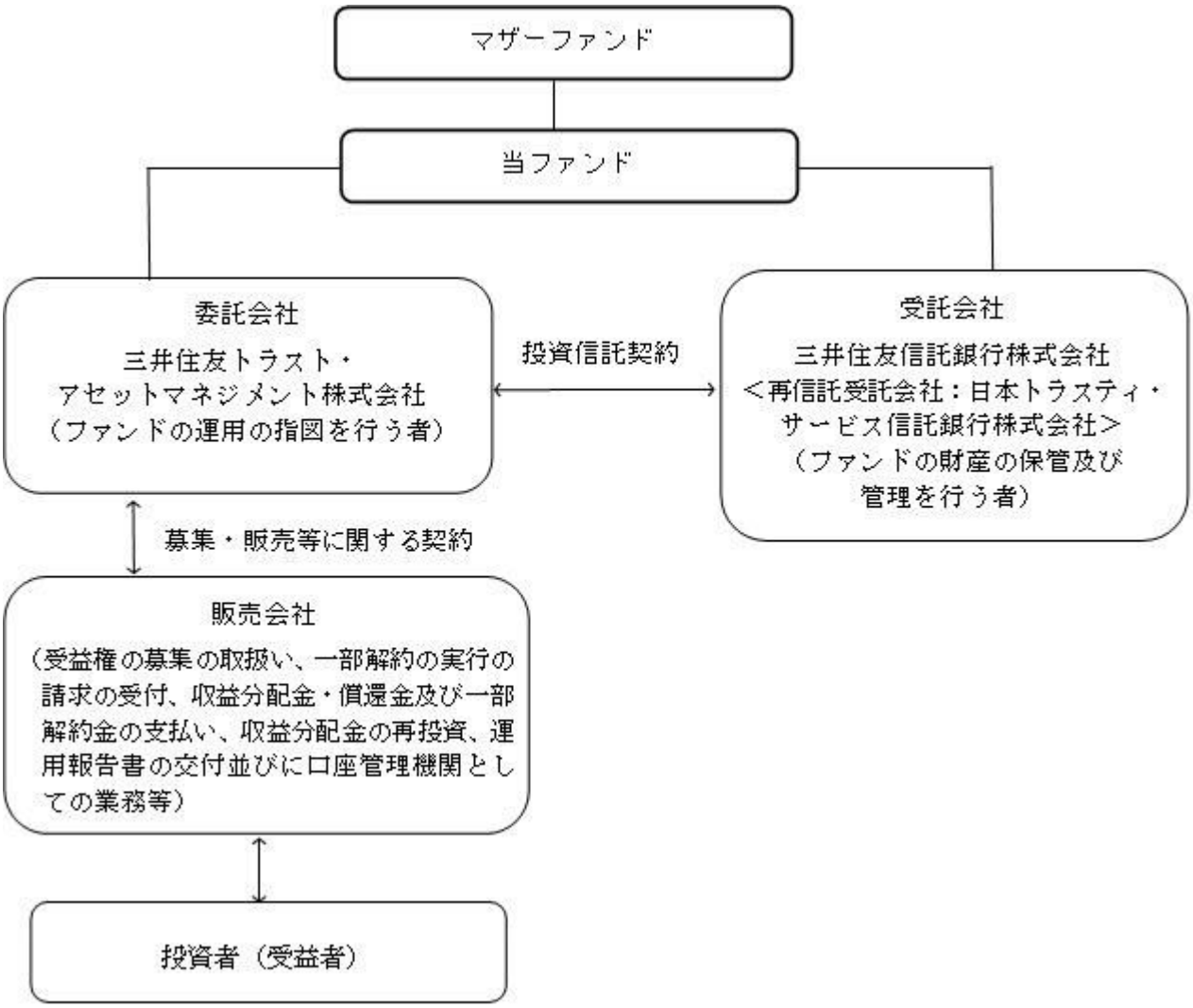
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2001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
2012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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2018年10月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999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
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007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）
2012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
2018年10月1日：	三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

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

①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。

②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す。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三

井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.株券または新株引受権証書
2.国債証券
3.地方債証券
4.特別の法律により法人の発行する債券
5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13.証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14.投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18.外国法人が発行する譲渡性預金証書
19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、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。

（ハ）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

（ニ）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（ハ）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

①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。
②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。
③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
④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。
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

①株式への投資割合には制限を設けません。
②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
③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。
④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。

⑤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。

⑥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。

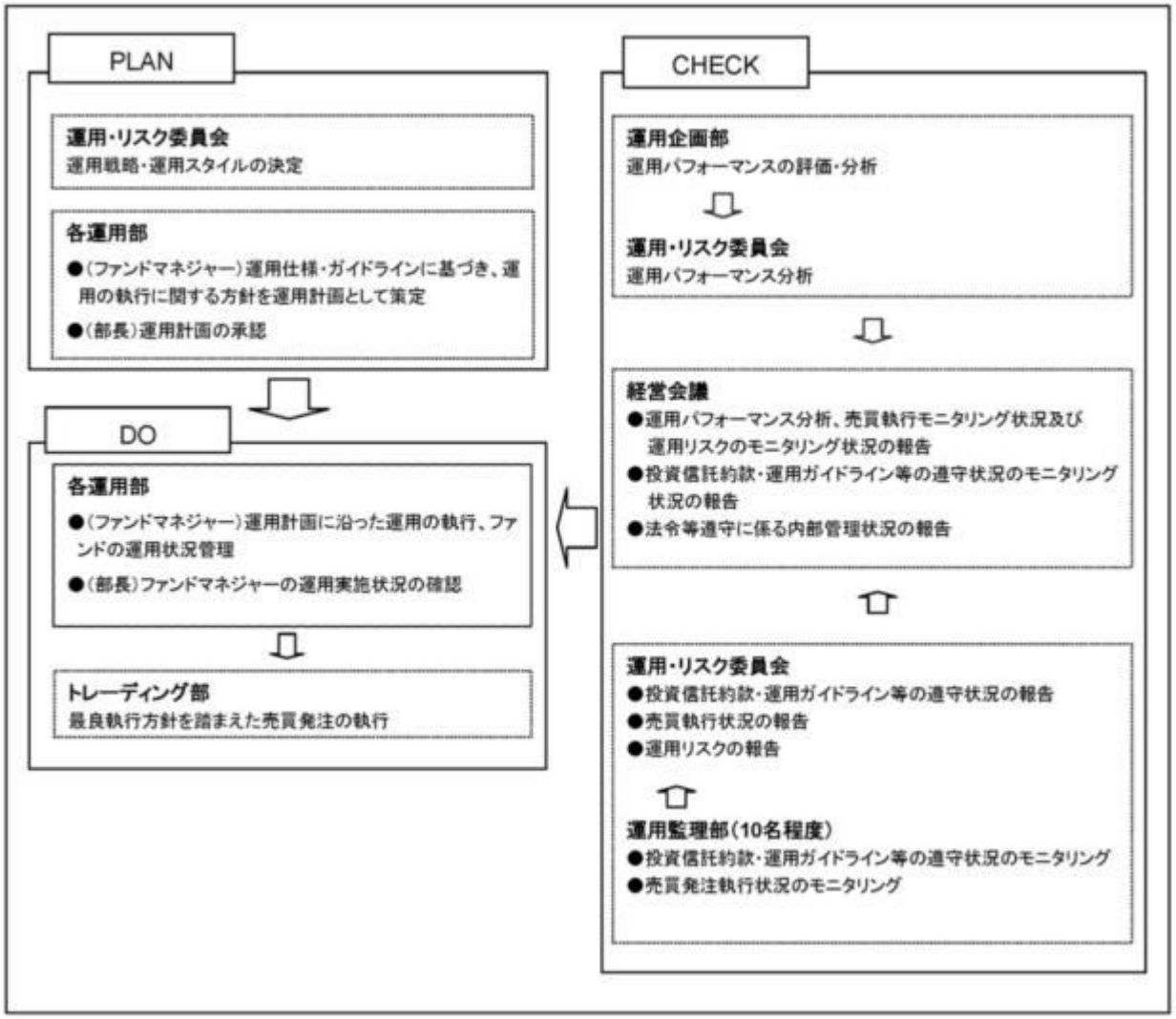
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧一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。

⑨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＞

①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」）

②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」）

③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」）

④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」）

⑤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」）

⑥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」）

⑦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」）

⑧委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

⑨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書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

⑩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）

⑪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）

⑫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）

⑬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。**

⑭委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第28条）

⑮委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資

金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36条）

⑯一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」）

⑰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①から⑦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①から⑦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⑪、⑫および⑭における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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＞

①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。

②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。

③分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

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

④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。

⑤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。

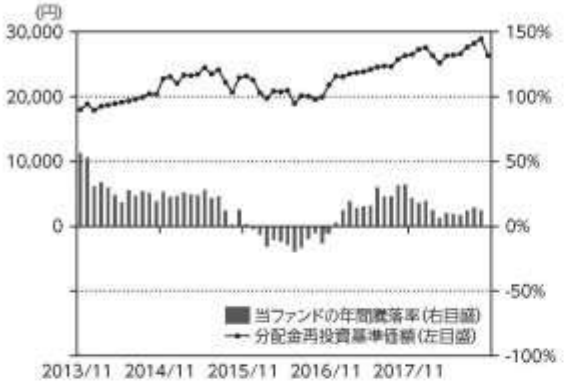
(2)リスクの管理体制

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運用監理部が、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・リスク委員会等に報告します。

〔参考情報〕

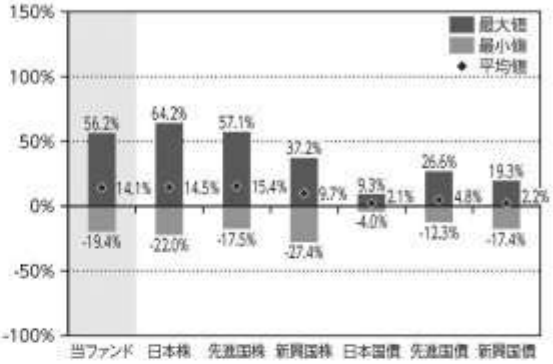
当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移



*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11月～2018年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数
日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)※1
先進国株… MSCIコクサイ・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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)※6
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している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買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
※5 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しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時に、信託財産留保額（※）の控除はありません。

※「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①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。）。

②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。

③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】

①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を含みます。）。

②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。

③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を含みます。）。

④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。

⑤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、2018年10月31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10月31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	19,220,008,885	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	9,449,743	0.05
合計(純資産総額)		19,229,458,628	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】

①【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	7,889,339,498	2.6691	21,057,441,708	2.4362	19,220,008,885	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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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
第17期計算期間末 (2018年10月 1日)	20,827,907,679	20,827,907,679	28,917	28,917
2017年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	—
5月末日	18,400,424,951	—	26,403	—
6月末日	18,708,069,928	—	26,601	—
7月末日	19,578,320,891	—	27,631	—
8月末日	20,164,674,913	—	28,207	—

9月末日	20,827,323,452	—	28,902	—
10月末日	19,229,458,628	—	26,342	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
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
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
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期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	11.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第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期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,965,600,718	1,203,377,289	7,202,617,292

(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	203,301,980,447	60.82
	イギリス	20,066,282,120	6.00
	フランス	11,783,370,627	3.52
	カナダ	11,755,329,440	3.52
	スイス	11,262,447,103	3.37
	ドイツ	10,728,881,155	3.21
	オーストラリア	7,353,454,373	2.20
	オランダ	5,494,241,333	1.64
	アイルランド	5,020,274,492	1.50
	スペイン	3,570,662,382	1.07
	スウェーデン	2,892,685,851	0.87
	香港	2,719,435,301	0.81
	イタリア	2,234,817,810	0.67
	デンマーク	1,945,548,464	0.58
	フィンランド	1,513,552,384	0.45
	ジャージー	1,412,695,363	0.42
	シンガポール	1,406,338,590	0.42
	バミューダ	1,318,688,713	0.39
	ベルギー	1,174,457,105	0.35
	ノルウェー	927,953,587	0.28
	ケイマン	725,292,352	0.22
	キュラソー	665,966,897	0.20
	イスラエル	638,243,680	0.19
	ルクセンブルク	407,922,715	0.12
	オーストリア	278,355,560	0.08
	ニュージーランド	272,970,529	0.08

	パナマ	215,388,993	0.06
	ポルトガル	183,807,063	0.05
	リベリア	160,107,943	0.05
	パプアニューギニア	73,483,913	0.02
	英ヴァージン諸島	71,471,992	0.02
	マン島	57,090,526	0.02
	モーリシャス	8,564,360	0.00
	小計	311,641,763,163	93.22
投資信託受益証券	オーストラリア	175,761,565	0.05
	香港	64,883,179	0.02
	小計	240,644,744	0.07
投資証券	アメリカ	6,103,405,989	1.83
	オーストラリア	550,399,003	0.16
	フランス	415,269,376	0.12
	イギリス	251,739,550	0.08
	香港	186,881,758	0.06
	シンガポール	134,799,837	0.04
	カナダ	63,207,872	0.02
	小計	7,705,703,385	2.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	14,701,967,613	4.40
合計(純資産総額)		334,290,078,905	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	9,884,455,035	2.96
	買建	カナダ	674,333,774	0.20
	買建	ドイツ	2,502,131,404	0.75
	買建	イギリス	1,141,663,747	0.34
	買建	オーストラリア	659,982,024	0.20

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	551,497,600	0.16
	売建	—	382,721,400	△0.11

(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	398,252	21,357.43	8,505,642,478	24,158.35	9,621,114,390	2.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	591,521	11,140.89	6,590,075,292	11,748.45	6,949,460,689	2.08
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	33,277	182,405.74	6,069,916,106	173,335.36	5,768,081,081	1.73
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	217,581	13,755.07	2,992,842,440	15,941.34	3,468,533,786	1.04
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	276,972	12,533.35	3,471,387,459	12,084.84	3,347,162,858	1.00
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	193,825	20,957.96	4,062,177,323	16,560.87	3,209,912,023	0.96
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	342,921	8,918.53	3,058,354,315	8,922.62	3,059,754,733	0.92
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	25,480	121,844.60	3,104,600,586	117,361.14	2,990,361,964	0.89
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	24,157	122,808.37	2,966,682,008	118,867.50	2,871,482,260	0.86
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	252,246	8,646.18	2,180,964,669	9,496.96	2,395,570,576	0.72
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	787,725	3,415.92	2,690,806,842	3,033.10	2,389,250,903	0.71
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	103,404	21,983.90	2,273,223,447	23,031.42	2,381,541,057	0.71
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	483,121	4,041.46	1,952,518,423	4,857.72	2,346,867,220	0.70
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,518	27,738.42	2,177,965,273	29,252.79	2,296,870,785	0.69
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	378,753	6,216.62	2,354,563,723	5,967.66	2,260,272,688	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	334,367	5,494.05	1,837,030,800	6,589.46	2,203,300,246	0.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	145,964	14,868.33	2,170,241,440	15,036.39	2,194,772,739	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	378,881	6,278.78	2,378,913,368	5,409.29	2,049,480,084	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	202,806	8,416.35	1,706,886,400	10,101.65	2,048,677,136	0.61

アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	587,152	3,605.86	2,117,191,243	3,451.03	2,026,280,458	0.61
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	390,187	4,899.62	1,911,770,994	5,049.13	1,970,105,199	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	154,681	13,843.73	2,141,362,347	12,554.87	1,942,000,001	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	94,571	21,162.21	2,001,331,918	19,960.94	1,887,726,284	0.56
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	6,692.53	1,461,408,364	8,253.25	1,802,214,037	0.54
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	45,238	40,783.79	1,844,977,246	39,630.80	1,792,818,429	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	328,376	4,803.20	1,577,255,832	5,394.57	1,771,448,566	0.53
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	180,510	8,530.59	1,539,856,991	9,796.55	1,768,376,576	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	75,127	21,651.91	1,626,643,358	21,262.29	1,597,372,797	0.48
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	373,142	3,596.00	1,341,820,498	4,271.03	1,593,702,393	0.48
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	121,890	11,570.69	1,410,351,501	12,997.71	1,584,291,798	0.47

(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	6.51
		素材	4.23
		資本財	6.60
		商業・専門サービス	1.03
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.21
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.74
		メディア	2.01
		小売	4.54
		食品・生活必需品小売り	1.60
		食品・飲料・タバコ	4.84
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	4.79
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.24
		銀行	8.24
		各種金融	4.16
		保険	3.64
		不動産	0.55

		ソフトウェア・サービス	11.06
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.59
		電気通信サービス	2.37
		公益事業	3.09
		半導体・半導体製造装置	2.69
		小計	93.22
投資信託受益証券	—	—	0.07
投資証券	—	—	2.31
合計			95.60

(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	650	アメリカドル	93,382,662.5	10,576,520,355	87,272,250	9,884,455,035	2.96
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	44	カナダドル	8,276,964	715,377,998	7,802,080	674,333,774	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	66	スイスフラン	5,868,672	660,988,527	5,837,040	657,425,815	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	457	ユーロ	15,180,856.5	1,949,677,400	14,363,510	1,844,705,589	0.55
	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	8,712,549	699,094,932	8,225,100	659,982,024	0.20
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	113	イギリスポンド	8,184,928.75	1,177,811,247	7,933,730	1,141,663,747	0.34

(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	2,426,000.00	273,346,800	274,738,800	0.08
	カナダドル	買建	590,000.00	50,983,670	50,987,800	0.02
	ユーロ	買建	400,000.00	51,365,600	51,372,000	0.02
	イギリスポンド	買建	520,000.00	74,859,660	74,822,800	0.02

	オーストラリアドル	買建	740,000.00	59,024,440	59,370,200	0.02
	香港ドル	買建	1,200,000.00	17,322,000	17,316,000	0.01
	シンガポールドル	買建	280,000.00	22,886,920	22,890,000	0.01
	ユーロ	売建	2,980,000.00	381,380,400	382,721,400	△0.11

(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10月31日

基準価額・純資産の推移

基準価額	26,342円
純資産総額	192.29億円

※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	2014年9月	2015年9月	2016年9月	2017年10月	2018年10月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

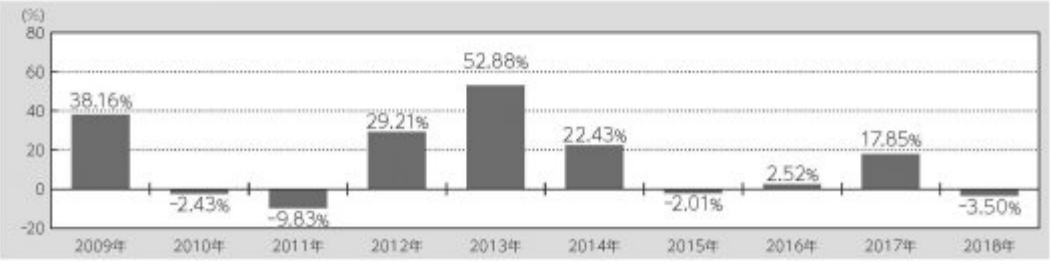
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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	2.9%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	2.1%
AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	1.7%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.0%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	銀行	1.0%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.0%
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	0.9%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.7%

※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ます。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拠ることとなります。

＜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1万口当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＞

①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。

②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。

③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。（2001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）

①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

②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。

③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。

④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）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。

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④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②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。

①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。

②上記①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。

③上記②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。

④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＞

①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。

②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＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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

①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。

②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

①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。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③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。

④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17期計算期間(2017年10月3日から2018年10月1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16期 （2017年10月 2日現在）	第17期 （2018年10月 1日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	114,593,989	139,008,351
親投資信託受益証券	16,648,755,243	20,817,500,398
未収入金	-	11,939,541
流動資産合計	16,763,349,232	20,968,448,290
資産合計	16,763,349,232	20,968,448,290
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,324,854	57,284,422
未払受託者報酬	5,113,350	6,170,109
未払委託者報酬	63,064,529	76,097,933
未払利息	214	347
その他未払費用	798,218	987,800
流動負債合計	106,301,165	140,540,611
負債合計	106,301,165	140,540,611
純資産の部		
元本等		
元本	6,440,393,863	7,202,617,292
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,216,654,204	13,625,290,387
（分配準備積立金）	4,602,962,463	5,872,580,889
元本等合計	16,657,048,067	20,827,907,679
純資産合計	16,657,048,067	20,827,907,679
負債純資産合計	16,763,349,232	20,968,448,290

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　2016年10月 1日 至　2017年10月 2日	第17期 自　2017年10月 3日 至　2018年10月 1日
営業収益		
受取利息	49	22
有価証券売買等損益	4,071,216,384	2,284,517,036
営業収益合計	4,071,216,433	2,284,517,058
営業費用		
支払利息	38,438	51,741
受託者報酬	9,580,059	11,853,994
委託者報酬	118,153,851	146,199,159
その他費用	798,732	989,550
営業費用合計	128,571,080	159,094,444
営業利益又は営業損失（△）	3,942,645,353	2,125,422,614
経常利益又は経常損失（△）	3,942,645,353	2,125,422,614
当期純利益又は当期純損失（△）	3,942,645,353	2,125,422,614
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（△）	473,918,786	109,065,571
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	2,235,060,216	3,313,140,618
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,235,060,216	3,313,140,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,356,519,134	1,920,861,478
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,356,519,134	1,920,861,478
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,216,654,204	13,625,290,387

（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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第17期計算期間は2017年10月 3日から2018年10月 1日までとなっております。

（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 (2018年10月 1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	7,202,617,292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 2.5863円 (1万口当たり純資産額) (25,863円)	1口当たり純資産額 2.8917円 (1万口当たり純資産額) (28,917円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第16期
自 2016年10月 1日
至 2017年10月 2日

分配金の計算過程

項目		
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	2,771,882,855円
収益調整金額	C	7,363,407,562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	11,966,370,025円
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	18,580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

第17期
自 2017年10月 3日
至 2018年10月 1日

分配金の計算過程

項目		
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	2,016,375,877円
収益調整金額	C	9,526,383,407円
分配準備積立金額	D	3,856,205,012円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,398,964,296円
当ファンドの期末残存口数	F	7,202,617,292口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	21,379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

（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17期 自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1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運用監理部が、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17期 (2018年10月 1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16期 自 2016年10月 1日 至 2017年10月 2日	第17期 自 2017年10月 3日 至 2018年10月 1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	1,965,600,718円
期中一部解約元本額	1,365,115,383円	1,203,377,289円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第16期 (2017年10月 2日現在)	第17期 (2018年10月 1日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,939,441,783	2,269,782,090
合計	3,939,441,783	2,269,782,090

（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	7,789,231,609	20,817,500,398	
合計		7,789,231,609	20,817,500,398	

(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

	2018年10月 1日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,038,225,770
コール・ローン	435,342,924
株式	343,200,267,590
投資信託受益証券	262,915,699
投資証券	7,826,228,568
派生商品評価勘定	142,928,532
未収入金	3,246,386
未収配当金	432,344,892
差入委託証拠金	2,721,838,437
流動資産合計	366,063,338,798
資産合計	366,063,338,798
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,472,444
前受金	140,428,288
未払解約金	105,806,442
未払利息	1,087
その他未払費用	369
流動負債合計	247,708,630
負債合計	247,708,630
純資産の部	

	2018年10月 1日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	136,878,559,539
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	228,937,070,629
元本等合計	365,815,630,168
純資産合計	365,815,630,168
負債純資産合計	366,063,338,798

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年10月 1日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。

	2018年10月 1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）

		2018年10月 1日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		136,878,559,539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	2.6726円
	(1万口当たり純資産額)	(26,726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

	2018年10月 1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。

	2018年10月 1日現在
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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、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。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、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

	2018年10月 1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。

（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	2018年10月 1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
期首元本額	137,670,547,577円
期中追加設定元本額	20,114,459,781円
期中一部解約元本額	20,906,447,819円
期末元本額	136,878,559,539円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,284,822,952円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	9,814,149円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	26,132,129,821円
世界経済インデックスファンド	7,182,262,377円
外国株式インデックス・オープン	870,308,386円
ＤＣマイセレクション２５	964,501,805円
ＤＣマイセレクション５０	4,636,279,976円
ＤＣマイセレクション７５	5,071,048,517円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	7,789,231,609円
ＤＣマイセレクションＳ２５	380,340,471円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,847,050,040円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,454,153,991円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	108,363,789円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	172,714,339円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	111,346,738円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,797,923,931円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,654,688,588円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,066,857円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,692,257円

区分	2018年10月 1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）	60,008,269円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	79,141,989円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	270,056,066円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	41,448,752円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	392,166,660円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	804,838,793円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	405,622,345円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,708,901,782円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,996,728,366円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	92,120,843円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	393,207,687円
グローバルバランスファンドＶＡ３５（適格機関投資家専用）	83,028,649円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	131,814,645円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,024,775,339円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	2,324,017,044円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,441,621,464円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,820,124,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,387,163,139円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,053,181,773円
分散投資コア戦略ファンドＳ	4,281,932,557円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	713,040,075円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	858,470,605円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,764,499,775円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	858,435,068円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	44,552,408円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	294,897,440円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,968,406,936円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	29,797,799,734円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	33,475,070円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	270,303,221円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	40,220,605円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	617,653円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	29,163,822円
グローバル経済コア	1,288,233,766円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	3,420,282円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	189,588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）	1,520,717,617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）	1,332,503,541円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	774,970,599円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2018年10月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,052,560,498
投資信託受益証券	15,761,674
投資証券	310,857,728
合計	14,379,179,900

(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

（2018年10月 1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	株価指数先物取引				
	買建	15,345,377,962	－	15,485,806,250	140,428,288
合計		15,345,377,962	－	15,485,806,250	140,428,288

(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。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2018年10月 1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	1,312,120,300	－	1,313,148,100	1,027,800
	アメリカドル	1,025,226,800	－	1,026,263,100	1,036,300
	カナダドル	88,604,000	－	88,600,000	△4,000
	ユーロ	198,289,500	－	198,285,000	△4,500
合計		1,312,120,300	－	1,313,148,100	1,027,800

(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。

①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。

②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	67.41	2,991,655.80	
	ANDEAVOR	11,677	153.50	1,792,419.50	
	ANTERO RESOURCES CORP	18,636	17.71	330,043.56	
	APACHE CORP	29,810	47.67	1,421,042.70	
	BAKER HUGHES A GE CO	35,210	33.83	1,191,154.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	35,879	22.52	807,995.08	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	69.49	1,090,367.59	
	CHEVRON CORP	154,681	122.28	18,914,392.68	
	CIMAREX ENERGY CO	7,599	92.94	706,251.06	
	CONCHO RESOURCES INC	16,193	152.75	2,473,480.75	
	CONOCOPHILLIPS	96,082	77.40	7,436,746.80	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,647	68.28	522,137.16	
	DEVON ENERGY CORPORATION	43,420	39.94	1,734,194.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,239	135.19	1,113,830.41	
	EOG RESOURCES INC	46,520	127.57	5,934,556.40	
	EQT CORPORATION	22,120	44.23	978,367.60	
	EXXON MOBIL	342,921	85.02	29,155,143.42	
	HALLIBURTON CO	71,448	40.53	2,895,787.44	
	HELMERICH & PAYNE	8,315	68.77	571,822.55	
	HESS CORP	22,081	71.58	1,580,557.98	
	HOLLYFRONTIER CORP	14,110	69.90	986,289.00	
	KINDER MORGAN INC	157,150	17.73	2,786,269.50	
	MARATHON OIL CORP	65,596	23.28	1,527,074.88	
	MARATHON PETROLEUM CORP	38,566	79.97	3,084,123.02	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,311	43.08	1,305,797.88	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	16,073	28.83	463,384.59	
	NOBLE ENERGY INC	38,291	31.19	1,194,296.29	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	62,287	82.17	5,118,122.79	
	ONEOK INC	33,743	67.79	2,287,437.97	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	20,475	29.25	598,893.75	
	PHILLIPS 66	36,131	112.72	4,072,686.32	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	13,450	174.19	2,342,855.50	

PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	9,890	24.53	242,601.70	
SCHLUMBERGER	112,385	60.92	6,846,494.20	
TARGA RESOURCES CORP	16,467	56.31	927,256.77	
TECHNIPFMC PLC	36,005	31.25	1,125,156.25	
VALERO ENERGY CORP	35,381	113.75	4,024,588.75	
WILLIAMS COS	98,038	27.19	2,665,653.22	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,922	167.05	2,993,870.10	
ALBEMARLE CORP	8,647	99.78	862,797.66	
AVERY DENNISON CORP	7,457	108.35	807,965.95	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,606	29.16	513,390.96	
BALL CORP	27,142	43.99	1,193,976.58	
CELANESE CORP-SERIES A	11,053	114.00	1,260,042.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,721	54.44	964,731.24	
CHEMOURS CO/THE	15,493	39.44	611,043.92	
CROWN HOLDINGS INC	10,321	48.00	495,408.00	
DOWDUPONT INC	187,231	64.31	12,040,825.61	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,858	95.72	1,135,047.76	
ECOLAB INC	20,812	156.78	3,262,905.36	
FMC CORP	10,402	87.18	906,846.36	
FREEPORT-MCMORAN INC	111,396	13.92	1,550,632.32	
INT'L PAPER CO	30,605	49.15	1,504,235.75	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,070	139.12	844,458.40	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,720	102.51	2,739,067.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,989	181.95	907,748.55	
MOSAIC CO/THE	27,677	32.48	898,948.96	
NEWMONT MINING CORP	42,952	30.20	1,297,150.40	
NUCOR CORP	24,915	63.45	1,580,856.75	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,205	109.69	790,316.45	
PPG INDUSTRIES INC	19,958	109.13	2,178,016.54	
PRAXAIR INC	23,446	160.73	3,768,475.58	
SEALED AIR CORP	14,689	40.15	589,763.35	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,932	455.21	3,155,515.72	
STEEL DYNAMICS INC	18,273	45.19	825,756.87	
VULCAN MATERIALS CO	10,740	111.20	1,194,288.00	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,455	83.11	287,145.05	
WESTROCK CO	21,244	53.44	1,135,279.36	
3 M COMPANY	48,314	210.71	10,180,242.94	
ACUITY BRANDS INC	3,505	157.20	550,986.00	
AERCAP HOLDINGS NV	11,330	57.52	651,701.60	
AGCO CORP	4,669	60.79	283,828.51	
ALLEGION PLC	7,168	90.57	649,205.76	
AMETEK INC	18,866	79.12	1,492,677.92	

ARCONIC INC	36,550	22.01	804,465.50	
BOEING CO	45,238	371.90	16,824,012.20	
CATERPILLAR	48,537	152.49	7,401,407.13	
CUMMINS INC	12,421	146.07	1,814,335.47	
DEERE&CO	25,056	150.33	3,766,668.48	
DOVER CORP	12,008	88.53	1,063,068.24	
EATON CORP	35,279	86.73	3,059,747.67	
EMERSON ELECTRIC CO	50,927	76.58	3,899,989.66	
FASTENAL CO	23,228	58.02	1,347,688.56	
FLOWSERVE CORP	10,826	54.69	592,073.94	
FLUOR CORP	11,267	58.10	654,612.70	
FORTIVE CORP	25,813	84.20	2,173,454.60	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	52.36	670,731.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,062	204.72	4,107,092.64	
GENERAL ELECTRIC CO	704,286	11.29	7,951,388.94	
GRAINGER (WW) INC	3,976	357.41	1,421,062.16	
HARRIS CORP	9,793	169.21	1,657,073.53	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15,226	42.79	651,520.54	
HONEYWELL INTL INC	61,022	166.40	10,154,060.80	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	256.08	901,913.76	
IDEX CORP	5,756	150.66	867,198.96	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,528	141.12	3,461,391.36	
INGERSOLL-RAND PLC	20,249	102.30	2,071,472.70	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,693	76.50	741,514.50	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,600	62.75	1,041,650.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	16,500	36.30	598,950.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	74,488	35.00	2,607,080.00	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,117	212.62	1,300,596.54	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,885	218.40	630,084.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	345.96	7,226,066.52	
MASCO CORP	24,547	36.60	898,420.20	
MIDDLEBY CORP	4,364	129.35	564,483.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,479	317.37	4,277,830.23	
OWENS CORNING	7,979	54.27	433,020.33	
PACCAR INC	27,548	68.19	1,878,498.12	
PARKER HANNIFIN CORP	10,354	183.93	1,904,411.22	
PENTAIR PLC	13,583	43.35	588,823.05	
RAYTHEON COMPANY	23,492	206.66	4,854,856.72	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,511	187.52	1,971,022.72	
ROCKWELL COLLIN	13,112	140.47	1,841,842.64	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,100	296.21	2,399,301.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	49.55	685,177.40	

SMITH (A.O.) CORP	12,146	53.37	648,232.02	
SNAP-ON INC	4,900	183.60	899,640.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	8,481	91.67	777,453.27	
STANLEY BLACK&DECKER	12,015	146.44	1,759,476.60	
TEXTRON	21,877	71.47	1,563,549.19	
TRANSDIGM GROUP INC	4,072	372.30	1,516,005.60	
UNITED RENTALS INC	6,446	163.60	1,054,565.60	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,841	139.81	8,506,180.21	
WABCO HOLDINGS INC	3,841	117.94	453,007.54	
WABTEC CORP	7,158	104.88	750,731.04	
XYLEM INC	13,941	79.87	1,113,467.67	
CINTAS CORP	7,034	197.81	1,391,395.54	
COPART INC	17,540	51.53	903,836.20	
COSTAR GROUP INC	3,008	420.84	1,265,886.72	
EQUIFAX INC	9,276	130.57	1,211,167.32	
IHS MARKIT LTD	32,775	53.96	1,768,539.00	
MANPOWER GROUP	5,123	85.96	440,373.08	
NIELSEN HOLDINGS PLC	27,504	27.66	760,760.64	
REPUBLIC SERVICES INC	18,461	72.66	1,341,376.26	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	70.38	673,255.08	
ROLLINS INC	7,031	60.69	426,711.39	
STERICYCLE INC	6,767	58.68	397,087.56	
TRANSUNION	15,344	73.58	1,129,011.52	
VERISK ANALYTICS INC	12,301	120.55	1,482,885.55	
WASTE CONNECTIONS INC	20,408	79.77	1,627,946.16	
WASTE MANAGEMENT INC	34,931	90.36	3,156,365.16	
AMERCO	602	356.65	214,703.30	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9,920	41.33	409,993.60	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,448	97.92	1,120,988.16	
CSX CORP	68,519	74.05	5,073,831.95	
DELTA AIR LINES INC	15,095	57.83	872,943.85	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,803	73.53	1,014,934.59	
FEDEX CORP	20,716	240.79	4,988,205.64	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,134	118.94	848,517.96	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,743	113.28	990,407.04	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	34.48	368,936.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,799	180.50	4,115,219.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,245	161.26	845,808.70	
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,465	62.45	715,989.25	
UNION PACIFIC CORP	63,871	162.83	10,400,114.93	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,003	89.06	534,627.18	
UNITED PARCEL SERVICE B	55,212	116.75	6,446,001.00	

XPO LOGISTICS INC	10,037	114.17	1,145,924.29	
APTIV PLC	20,954	83.90	1,758,040.60	
AUTOLIV INC	6,639	86.68	575,468.52	
BORGWARNER INC	15,953	42.78	682,469.34	
FORD MOTOR COMPANY	299,765	9.25	2,772,826.25	
GENERAL MOTORS CO	101,158	33.67	3,405,989.86	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	21,627	23.39	505,855.53	
HARLEY-DAVIDSON	14,677	45.30	664,868.10	
LEAR CORP	5,287	145.00	766,615.00	
TESLA INC	10,369	264.77	2,745,400.13	
DR HORTON INC	28,586	42.18	1,205,757.48	
GARMIN LTD	9,564	70.05	669,958.20	
HANESBRANDS INC	31,136	18.43	573,836.48	
HASBRO INC	9,007	105.12	946,815.84	
LEGGETT & PLATT INC	10,594	43.79	463,911.26	
LENNAR CORP-CL A	23,545	46.69	1,099,316.05	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	162.49	1,376,615.28	
MATTEL INC	27,399	15.70	430,164.30	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,547	68.56	791,662.32	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	175.35	887,621.70	
NEWELL BRANDS INC	37,563	20.30	762,528.90	
NIKE B	105,293	84.72	8,920,422.96	
NVR INC	264	2,470.80	652,291.20	
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	100.95	473,556.45	
PULTE GROUP INC	21,959	24.77	543,924.43	
PVH CORP	5,820	144.40	840,408.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	4,578	137.55	629,703.90	
TAPESTRY INC	22,032	50.27	1,107,548.64	
TOLL BROTHERS INC	11,211	33.03	370,299.33	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	15,950	21.22	338,459.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	16,283	19.46	316,867.18	
VF CORP	26,718	93.45	2,496,797.10	
WHIRLPOOL CORP	5,324	118.75	632,225.00	
ARAMARK	19,980	43.02	859,539.60	
BLOCK H & R INC	16,984	25.75	437,338.00	
CARNIVAL CORPORATION	35,126	63.77	2,239,985.02	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,975	454.52	897,677.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,031	111.19	1,115,346.89	
DOMINO'S PIZZA INC	3,453	294.80	1,017,944.40	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,523	80.78	1,900,187.94	
LAS VEGAS SANDS CORP	32,341	59.33	1,918,791.53	
MARRIOTT INTL A	25,016	132.03	3,302,862.48	

MCDONALD'S CORP	63,834	167.29	10,678,789.86	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	21.15	373,551.30	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,656	27.91	1,246,348.96	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	17,838	57.43	1,024,436.34	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	13,885	129.94	1,804,216.90	
STARBUCKS CORP	113,248	56.84	6,437,016.32	
VAIL RESORTS INC	2,987	274.42	819,692.54	
WYNN RESORTS LTD	8,052	127.06	1,023,087.12	
YUM BRANDS INC	27,323	90.91	2,483,933.93	
CBS CORP-CL B	28,628	57.45	1,644,678.60	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	13,632	325.88	4,442,396.16	
COMCAST CORP-CL A	373,142	35.41	13,212,958.22	
DISCOVERY INC - A	12,804	32.00	409,728.00	
DISCOVERY INC-C	23,672	29.58	700,217.76	
DISH NETWORK CORPORATION-A	18,218	35.76	651,475.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	22.87	773,783.58	
LIBERTY BROADBAND-C	8,663	84.30	730,290.90	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	28.93	448,877.88	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	46,271	28.16	1,302,991.36	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,010	37.19	521,031.90	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	15,233	43.45	661,873.85	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.44	277,320.96	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,637	54.47	688,337.39	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	13.19	441,588.01	
OMNICOM GROUP	19,030	68.02	1,294,420.60	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129,505	6.32	818,471.60	
THE WALT DISNEY CO	121,890	116.94	14,253,816.60	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,135	46.33	3,990,634.55	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	36,459	45.82	1,670,551.38	
VIACOM INC-CLASS B	26,755	33.76	903,248.80	
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	168.33	1,041,289.38	
AMAZON.COM	33,277	2,003.00	66,653,831.00	
AUTOZONE INC	2,151	775.70	1,668,530.70	
BEST BUY COMPANY INC	21,836	79.36	1,732,904.96	
BOOKING HOLDINGS INC	3,909	1,984.00	7,755,456.00	
CARMAX INC	14,253	74.67	1,064,271.51	
DOLLAR GENERAL CORP	22,330	109.30	2,440,669.00	
DOLLAR TREE INC	19,550	81.55	1,594,302.50	
EXPEDIA GROUP INC	9,800	130.48	1,278,704.00	
GAP	16,326	28.85	471,005.10	
GENUINE PARTS CO	11,245	99.40	1,117,753.00	
HOME DEPOT	94,571	207.15	19,590,382.65	

KOHLS CORP	12,602	74.55	939,479.10	
L BRANDS INC	19,499	30.30	590,819.70	
LKQ CORP	24,693	31.67	782,027.31	
LOWES COMPANIES	66,782	114.82	7,667,909.24	
MACY'S INC	25,926	34.73	900,409.98	
NETFLIX INC	35,175	374.13	13,160,022.75	
NORDSTROM INC	10,094	59.81	603,722.14	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,603	347.32	2,293,353.96	
QURATE RETAIL INC	35,071	22.21	778,926.91	
ROSS STORES INC	30,239	99.10	2,996,684.90	
TARGET (DAYTON HUDSON)	41,836	88.21	3,690,353.56	
TIFFANY & CO	9,326	128.97	1,202,774.22	
TJX COMPANIES INC	51,517	112.02	5,770,934.34	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,456	90.88	859,361.28	
TRIPADVISOR INC	10,393	51.07	530,770.51	
ULTA BEAUTY INC	4,911	282.12	1,385,491.32	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,674	234.88	8,379,109.12	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	33,900	9.00	305,100.00	
KROGER CO	72,735	29.11	2,117,315.85	
SYSCO CORP	40,229	73.25	2,946,774.25	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	67,797	72.90	4,942,401.30	
WALMART INC	119,581	93.91	11,229,851.71	
ALTRIA GROUP INC	152,862	60.31	9,219,107.22	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,567	50.27	2,240,383.09	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,040	50.55	1,114,122.00	
BUNGE LIMITED	11,767	68.71	808,510.57	
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,072	36.63	515,457.36	
COCA-COLA CO	328,376	46.19	15,167,687.44	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	17,076	45.47	776,445.72	
CONAGRA BRANDS INC	33,243	33.97	1,129,264.71	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,018	215.62	3,022,561.16	
GENERAL MILLS INC	44,875	42.92	1,926,035.00	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,200	102.00	1,142,400.00	
HORMEL FOODS CORP	23,465	39.40	924,521.00	
INGREDION INC	5,835	104.96	612,441.60	
JM SMUCKER CO	9,442	102.61	968,843.62	
KELLOGG CO	21,051	70.02	1,473,991.02	
KRAFT HEINZ CO/THE	49,892	55.11	2,749,548.12	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,276	131.75	1,222,113.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	15,100	61.50	928,650.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	120,242	42.96	5,165,596.32	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,932	58.28	2,035,836.96	

PEPSICO INC	115,115	111.80	12,869,857.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,990	81.54	10,273,224.60	
TYSON FOODS INC	24,363	59.53	1,450,329.39	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,083	59.37	1,132,957.71	
CLOROX COMPANY	10,045	150.41	1,510,868.45	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,784	66.95	4,538,138.80	
COTY INC-CL A	39,000	12.56	489,840.00	
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,822	145.32	2,589,893.04	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,990	113.64	3,180,783.60	
PROCTER & GAMBLE CO	202,806	83.23	16,879,543.38	
ABBOTT LABORATORIES	142,028	73.36	10,419,174.08	
ABIOMED INC	3,502	449.75	1,575,024.50	
AETNA INC	26,686	202.85	5,413,255.10	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,264	391.22	2,450,602.08	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,847	92.22	1,184,750.34	
ANTHEM INC	20,871	274.05	5,719,697.55	
BAXTER INTERNATIONAL	42,071	77.09	3,243,253.39	
BECTON DICKINSON & CO	21,729	261.00	5,671,269.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,569	38.50	4,333,906.50	
CARDINAL HEALTH	25,252	54.00	1,363,608.00	
CENTENE CORP	16,736	144.78	2,423,038.08	
CERNER CORP	23,088	64.41	1,487,098.08	
CIGNA CORP	19,408	208.25	4,041,716.00	
CVS HEALTH CORP	81,494	78.72	6,415,207.68	
DANAHER CORP	50,460	108.66	5,482,983.60	
DAVITA INC	11,875	71.63	850,606.25	
DENTSPLY SIRONA INC	17,834	37.74	673,055.16	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,776	174.10	2,920,701.60	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,189	95.01	4,388,416.89	
HCA HEALTHCARE INC	23,027	139.12	3,203,516.24	
HENRY SCHEIN INC	12,492	85.03	1,062,194.76	
HOLOGIC INC	21,094	40.98	864,432.12	
HUMANA INC	11,281	338.52	3,818,844.12	
IDEXX LABORATORIES INC	7,205	249.66	1,798,800.30	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,061	574.00	5,201,014.00	
LABORATORY CRP OF AMER	7,953	173.68	1,381,277.04	
MCKESSON CORP	16,655	132.65	2,209,285.75	
MEDTRONIC PLC	110,187	98.37	10,839,095.19	
QUEST DIAGNOSTICS	10,532	107.91	1,136,508.12	
RESMED INC	10,895	115.34	1,256,629.30	
STRYKER CORP	27,181	177.68	4,829,520.08	
TELEFLEX INC	3,697	266.09	983,734.73	

THE COOPER COS INC	4,135	277.15	1,146,015.25	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,518	266.04	20,888,928.72	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	127.84	926,584.32	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,026	111.93	786,420.18	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,761	108.87	1,062,680.07	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,063	131.47	2,111,802.61	
ABBVIE INC	122,922	94.58	11,625,962.76	
AGILENT TECHNOLOGIES	25,323	70.54	1,786,284.42	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,729	139.01	2,464,508.29	
ALKERMES PLC	12,547	42.44	532,494.68	
ALLERGAN PLC	26,330	190.48	5,015,338.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,399	87.52	647,560.48	
AMGEN	54,777	207.29	11,354,724.33	
BIOGEN INC	17,262	353.31	6,098,837.22	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,341	96.97	1,390,646.77	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,920	62.08	8,251,673.60	
CELGENE CORP	61,389	89.49	5,493,701.61	
GILEAD SCIENCES INC	106,635	77.21	8,233,288.35	
ILLUMINA INC	12,043	367.06	4,420,503.58	
INCYTE CORP	14,121	69.08	975,478.68	
IQVIA HOLDINGS INC	13,021	129.74	1,689,344.54	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	168.13	835,774.23	
JOHNSON & JOHNSON	217,581	138.17	30,063,166.77	
LILLY (ELI) & CO	79,730	107.31	8,555,826.30	
MERCK & CO	218,364	70.94	15,490,742.16	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,006	608.98	1,221,613.88	
MYLAN NV	42,644	36.60	1,560,770.40	
NEKTAR THERAPEUTICS	13,507	60.96	823,386.72	
PERRIGO CO PLC	11,333	70.80	802,376.40	
PFIZER	483,121	44.07	21,291,142.47	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,550	404.04	2,646,462.00	
SEATTLE GENETICS INC	9,601	77.12	740,429.12	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,690	21.54	1,738,062.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,238	244.08	7,868,651.04	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,247	127.88	415,226.36	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,799	192.74	4,008,799.26	
WATERS CORP	6,513	194.68	1,267,950.84	
ZOETIS INC	39,742	91.56	3,638,777.52	
BANK OF AMERICA CORP	787,725	29.46	23,206,378.50	
BB&T CORP	64,293	48.54	3,120,782.22	
CIT GROUP INC	10,713	51.61	552,897.93	
CITIGROUP	208,262	71.74	14,940,715.88	

CITIZENS FINANCIAL GROUP	40,010	38.57	1,543,185.70	
COMERICA INC	14,360	90.20	1,295,272.00	
EAST WEST BANCORP INC	10,794	60.37	651,633.78	
FIFTH THIRD BANCORP	58,217	27.92	1,625,418.64	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	12,578	96.00	1,207,488.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	87,418	14.92	1,304,276.56	
JPMORGAN CHASE & CO	276,972	112.84	31,253,520.48	
KEY CORP	87,033	19.89	1,731,086.37	
M & T BANK CORP	11,745	164.54	1,932,522.30	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	39,095	10.37	405,415.15	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,384	17.12	468,814.08	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,899	136.19	5,161,464.81	
REGIONS FINL CORP	96,209	18.35	1,765,435.15	
SIGNATURE BANK	4,354	114.84	500,013.36	
SUNTRUST BANKS	38,353	66.79	2,561,596.87	
SVB FINANCIAL GROUP	4,390	310.83	1,364,543.70	
US BANCORP	127,580	52.81	6,737,499.80	
WELLS FARGO & CO	378,753	52.56	19,907,257.68	
ZIONS BANCORPORATION	15,186	50.15	761,577.90	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,433	136.72	606,079.76	
ALLY FINANCIAL INC	36,028	26.45	952,940.60	
AMERICAN EXPRESS	59,473	106.49	6,333,279.77	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,850	147.66	1,749,771.00	
BANK NEW YORK CO	81,361	50.99	4,148,597.39	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,404	214.11	22,139,830.44	
BLACKROCK INC	9,812	471.33	4,624,689.96	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,702	94.93	3,768,910.86	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,470	95.96	908,741.20	
CME GROUP INC	27,733	170.21	4,720,433.93	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,565	76.45	2,260,244.25	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,108	52.39	1,105,848.12	
EATON VANCE CORP	10,061	52.56	528,806.16	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	30.41	792,788.70	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,328	224.24	6,576,510.72	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,906	74.89	3,512,790.34	
INVESCO LTD	30,943	22.88	707,975.84	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	25,706	21.96	564,503.76	
MOODY'S CORP	14,116	167.20	2,360,195.20	
MORGAN STANLEY	108,682	46.57	5,061,320.74	
MSCI INC	6,934	177.41	1,230,160.94	
NASDAQ INC	9,070	85.80	778,206.00	
NORTHERN TRUST CORP	17,320	102.13	1,768,891.60	

PRICE T ROWE GROUP INC	20,066	109.18	2,190,805.88	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,932	92.05	914,240.60	
S&P GLOBAL INC	20,491	195.39	4,003,736.49	
SCHWAB (CHARLES) CORP	98,603	49.15	4,846,337.45	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,802	61.10	660,002.20	
STATE STREET CORP	29,345	83.78	2,458,524.10	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,347	31.08	1,875,584.76	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23,404	52.83	1,236,433.32	
VOYA FINANCIAL INC	14,081	49.67	699,403.27	
AFLAC	61,894	47.07	2,913,350.58	
ALLEGHANY CORP	1,276	652.53	832,628.28	
ALLSTATE CORP	28,446	98.70	2,807,620.20	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,549	110.97	615,772.53	
AMERICAN INT'L GROUP	72,511	53.24	3,860,485.64	
AON PLC	20,163	153.78	3,100,666.14	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,551	29.81	1,029,965.31	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,972	74.44	1,114,515.68	
ASSURANT INC	4,769	107.95	514,813.55	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13,347	51.66	689,506.02	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	57.71	421,398.42	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,796	44.24	300,655.04	
CHUBB LTD	37,790	133.64	5,050,255.60	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,413	76.81	953,442.53	
EVEREST RE GROUP LTD	3,353	228.47	766,059.91	
FNF GROUP	20,786	39.35	817,929.10	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,662	49.96	1,431,953.52	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,790	67.66	1,203,671.40	
LOEWS CORP	22,051	50.23	1,107,621.73	
MARKEL CORP	1,132	1,188.49	1,345,370.68	
MARSH & MCLENNAN COS	40,838	82.72	3,378,119.36	
METLIFE INC	71,520	46.72	3,341,414.40	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,155	58.59	1,356,651.45	
PROGRESSIVE CORP	46,702	71.04	3,317,710.08	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,546	101.32	3,398,880.72	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	5,431	144.56	785,105.36	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	133.58	434,001.42	
TORCHMARK CORP	8,473	86.69	734,524.37	
TRAVELERS COS INC/THE	21,811	129.71	2,829,104.81	
UNUM GROUP	18,574	39.07	725,686.18	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,930	140.94	1,540,474.20	
WR BERKLEY CORP	7,296	79.93	583,169.28	
CBRE GROUP INC-A	26,855	44.10	1,184,305.50	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.62	653,394.00	
JONES LANG LASALLE INC	3,673	144.32	530,087.36	
WEYERHAEUSER CO	62,107	32.27	2,004,192.89	
ACCENTURE PLC-CL A	52,076	170.20	8,863,335.20	
ACTIVISION BLIZZARD INC	57,926	83.19	4,818,863.94	
ADOBE SYSTEMS INC	39,430	269.95	10,644,128.50	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	14,178	73.15	1,037,120.70	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,016	236.16	948,418.56	
ALPHABET INC-CL A	24,157	1,207.08	29,159,431.56	
ALPHABET INC-CL C	25,480	1,193.47	30,409,615.60	
ANSYS INC	6,865	186.68	1,281,558.20	
AUTODESK INC	18,086	156.11	2,823,405.46	
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,768	150.66	5,388,806.88	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,650	131.95	1,273,317.50	
CA INC	26,520	44.15	1,170,858.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,585	45.32	978,232.20	
CDK GLOBAL INC	10,687	62.56	668,578.72	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,801	117.67	1,270,953.67	
CITRIX SYSTEMS INC	11,352	111.16	1,261,888.32	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	48,020	77.15	3,704,743.00	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	15,827	97.12	1,537,118.24	
DXC TECHNOLOGY CO	23,498	93.52	2,197,532.96	
EBAY	78,686	33.02	2,598,211.72	
ELECTRONIC ARTS INC	25,070	120.49	3,020,684.30	
FACEBOOK INC-A	193,825	164.46	31,876,459.50	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,125	109.07	2,958,523.75	
FIRST DATA CORP- CLASS A	39,258	24.47	960,643.26	
FISERV INC	33,784	82.38	2,783,125.92	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,163	227.84	1,632,017.92	
FORTINET INC	10,871	92.27	1,003,067.17	
GARTNER INC	7,002	158.50	1,109,817.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,513	127.40	1,594,156.20	
GODADDY INC - CLASS A	12,570	83.39	1,048,212.30	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	216.72	1,379,206.08	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,706	151.21	11,296,294.26	
INTUIT INC	19,851	227.40	4,514,117.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,979	160.08	957,118.32	
LEIDOS HOLDINGS	10,999	69.16	760,690.84	
MASTERCARD INC-CLASS A	75,127	222.61	16,724,021.47	
MERCADOLIBRE INC	3,264	340.47	1,111,294.08	
MICROSOFT CORP	591,521	114.37	67,652,256.77	
ORACLE CORP	250,503	51.56	12,915,934.68	

PAYCHEX INC	25,506	73.65	1,878,516.90	
PAYPAL HOLDINGS INC	91,607	87.84	8,046,758.88	
RED HAT INC	13,963	136.28	1,902,877.64	
SABRE CORP	17,243	26.08	449,697.44	
SALESFORCE.COM INC	55,092	159.03	8,761,280.76	
SERVICENOW INC	13,794	195.63	2,698,520.22	
SPLUNK INC	11,773	120.91	1,423,473.43	
SQUARE INC - A	22,319	99.01	2,209,804.19	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17,681	56.83	1,004,811.23	
SYMANTEC CORP	48,508	21.28	1,032,250.24	
SYNOPSYS INC	12,264	98.61	1,209,353.04	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,552	137.99	1,318,080.48	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,610	98.74	1,245,111.40	
TWITTER INC	55,701	28.46	1,585,250.46	
VERISIGN INC	7,289	160.12	1,167,114.68	
VISA INC-CLASS A SHARES	145,964	150.09	21,907,736.76	
VMWARE INC-CLASS A	5,821	156.06	908,425.26	
WESTERN UNION CO	38,757	19.06	738,708.42	
WORKDAY INC-CLASS A	10,691	145.98	1,560,672.18	
WORLDPAY INC-CLASS A	23,418	101.27	2,371,540.86	
ZILLOW GROUP INC-C	9,962	44.25	440,818.50	
AMPHENOL CORPORATION	24,215	94.02	2,276,694.30	
APPLE INC	398,252	225.74	89,901,406.48	
ARISTA NETWORKS INC	4,324	265.86	1,149,578.64	
ARROW ELECTRONICS INC	6,666	73.72	491,417.52	
AVNET INC	10,936	44.77	489,604.72	
CDW CORP/DE	12,482	88.92	1,109,899.44	
CISCO SYSTEMS	390,187	48.65	18,982,597.55	
COGNEX CORP	12,660	55.82	706,681.20	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	14,933	30.76	459,339.08	
CORNING	71,752	35.30	2,532,845.60	
F5 NETWORKS INC	5,350	199.42	1,066,897.00	
FLEX LTD	40,465	13.12	530,900.80	
FLIR SYSTEMS INC	11,686	61.47	718,338.42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	129,736	16.31	2,115,994.16	
HP INC	134,066	25.77	3,454,880.82	
IPG PHOTONICS CORP	3,207	156.07	500,516.49	
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	29.97	938,180.88	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,853	66.28	1,050,736.84	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,620	130.14	1,642,366.80	
NETAPP INC	20,821	85.89	1,788,315.69	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,211	225.26	1,624,349.86	

SEAGATE TECHNOLOGY	22,836	47.35	1,081,284.60	
TE CONNECTIVITY LTD	28,009	87.93	2,462,831.37	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	20,622	43.46	896,232.12	
WESTERN DIGITAL CORP	23,577	58.54	1,380,197.58	
XEROX CORP	16,718	26.98	451,051.64	
AT&T INC	587,152	33.58	19,716,564.16	
CENTURYLINK INC	73,994	21.20	1,568,672.80	
SPRINT CORP	64,825	6.54	423,955.50	
T-MOBILE US INC	28,273	70.18	1,984,199.14	
VERIZON COMMUNICATIONS	334,367	53.39	17,851,854.13	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	15,289	34.72	530,834.08	
AES CORP	52,646	14.00	737,044.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	19,256	42.57	819,727.92	
AMEREN CORPORATION	18,723	63.22	1,183,668.06	
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,872	70.88	2,755,247.36	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,283	87.97	1,256,475.51	
ATMOS ENERGY CORP	9,385	93.91	881,345.35	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,441	27.65	869,343.65	
CMS ENERGY CORP	21,593	49.00	1,058,057.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,571	76.19	1,948,254.49	
DOMINION ENERGY INC	53,227	70.28	3,740,793.56	
DTE ENERGY COMPANY	14,355	109.13	1,566,561.15	
DUKE ENERGY CORP	57,060	80.02	4,565,941.20	
EDISON INTL	26,184	67.68	1,772,133.12	
ENTERGY CORP	13,854	81.13	1,123,975.02	
EVERGY INC	21,492	54.92	1,180,340.64	
EVERSOURCE ENERGY	25,381	61.44	1,559,408.64	
EXELON CORP	77,742	43.66	3,394,215.72	
FIRSTENERGY CORP	39,519	37.17	1,468,921.23	
NEXTERA ENERGY INC	37,780	167.60	6,331,928.00	
NISOURCE INC	26,021	24.92	648,443.32	
OGE ENERGY CORP	15,686	36.32	569,715.52	
PG&E CORP	41,241	46.01	1,897,498.41	
PINNACLE WEST CAPITAL	9,416	79.18	745,558.88	
PPL CORPORATION	53,473	29.26	1,564,619.98	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,606	52.79	2,143,590.74	
SCANA CORP	11,459	38.89	445,640.51	
SEMPRA ENERGY	19,952	113.75	2,269,540.00	
SOUTHERN CO	81,059	43.60	3,534,172.40	
UGI CORP	13,950	55.48	773,946.00	
VISTRA ENERGY CORP	29,561	24.88	735,477.68	
WEC ENERGY GROUP INC	25,287	66.76	1,688,160.12	

	XCEL ENERGY INC	40,763	47.21	1,924,421.23	
	ADVANCED MICRO DEVICES	77,168	30.89	2,383,719.52	
	ANALOG DEVICES	30,277	92.46	2,799,411.42	
	APPLIED MATERIALS	84,218	38.65	3,255,025.70	
	BROADCOM INC	33,321	246.73	8,221,290.33	
	INTEL CORP	378,881	47.29	17,917,282.49	
	KLA-TENCOR CORP	12,266	101.71	1,247,574.86	
	LAM RESEARCH CORP	12,814	151.70	1,943,883.80	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	37,753	19.30	728,632.90	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,829	56.39	1,230,937.31	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,624	78.91	1,469,619.84	
	MICRON TECHNOLOGY	92,766	45.23	4,195,806.18	
	NVIDIA CORP	46,674	281.02	13,116,327.48	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	27,283	85.50	2,332,696.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	18.43	663,406.28	
	QORVO INC	10,609	76.89	815,726.01	
	QUALCOMM	107,270	72.03	7,726,658.10	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,510	90.71	1,316,202.10	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,005	107.29	8,476,446.45	
	XILINX INC	20,299	80.17	1,627,370.83	
アメリカドル 小計		24,839,242		2,048,571,506.45 (233,373,266,014)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	27,117	14.40	390,484.80	
	CAMECO CORP	28,709	14.73	422,883.57	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,090	42.20	4,223,798.00	
	CENOVUS ENERGY INC	77,803	12.97	1,009,104.91	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	43,244	8.22	355,465.68	
	ENBRIDGE	138,840	41.68	5,786,851.20	
	ENCANA CORP	76,271	16.93	1,291,268.03	
	HUSKY ENERGY INC	31,439	22.68	713,036.52	
	IMPERIAL OIL	24,763	41.80	1,035,093.40	
	INTER PIPELINE LTD	30,317	22.40	679,100.80	
	KEYERA CORP	14,929	34.61	516,692.69	
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,276	43.89	1,855,493.64	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	18,350	22.69	416,361.50	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	20,010	15.40	308,154.00	
	SUNCOR ENERGY	134,041	49.98	6,699,369.18	
	TOURMALINE OIL CORP	19,965	22.74	454,004.10	
	TRANSCANADA CORP	70,703	52.26	3,694,938.78	
	VERMILION ENERGY INC	10,067	42.56	428,451.52	
	AGNICO EAGLE MINES	17,661	44.12	779,203.32	
	BARRICK GOLD CORP	94,395	14.29	1,348,904.55	

CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	58.22	764,952.58	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,900	14.71	836,999.00	
FRANCO-NEVADA CORP	14,257	80.80	1,151,965.60	
GOLDCORP INC	68,688	13.16	903,934.08	
KINROSS GOLD CORP	107,615	3.52	378,804.80	
LUNDIN MINING CORP	62,243	6.84	425,742.12	
METHANEX CORP	7,099	101.96	723,814.04	
NUTRIEN LTD	51,428	74.58	3,835,500.24	
TECK RESOURCES LTD-CL B	45,677	31.13	1,421,925.01	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	71,000	2.75	195,250.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	73.51	318,077.77	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,838	22.60	832,538.80	
BOMBARDIER B	157,835	4.60	726,041.00	
CAE INC	18,372	26.22	481,713.84	
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	31.55	371,154.20	
SNC-LAVALIN GROUP INC	14,713	52.67	774,933.71	
WSP GLOBAL INC	9,471	70.69	669,504.99	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,539	115.90	7,016,470.10	
CP RAILWAY LIMITED	11,959	273.23	3,267,557.57	
LINAMAR CORP	3,889	59.51	231,434.39	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,978	67.85	1,898,307.30	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.30	693,998.70	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,372	76.48	1,405,090.56	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,947	25.17	904,785.99	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	151.34	818,598.06	
DOLLARAMA INC	26,700	40.69	1,086,423.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	34,063	64.61	2,200,810.43	
EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	23.54	270,686.46	
LOBLAW COMPANIES LTD	15,618	66.36	1,036,410.48	
METRO INC	19,179	40.18	770,612.22	
WESTON (GEORGE) LTD	4,775	97.77	466,851.75	
SAPUTO INC	20,412	38.42	784,229.04	
AURORA CANNABIS INC	53,000	12.41	657,730.00	
BANK MONTREAL	52,905	106.54	5,636,498.70	
BANK NOVA SCOTIA	96,431	76.99	7,424,222.69	
CANADIAN IMPERIAL BANK	35,345	121.03	4,277,805.35	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,228	64.51	1,820,988.28	
ROYAL BANK OF CANADA	116,879	103.54	12,101,651.66	
TORONTO-DOMINION BANK	148,256	78.49	11,636,613.44	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	68,319	57.49	3,927,659.31	
CI FINANCIAL CORP	18,671	20.51	382,942.21	
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.50	272,817.50	

	ONEX CORP	6,603	88.33	583,242.99	
	THOMSON REUTERS CORP	22,284	58.94	1,313,418.96	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,305	701.74	1,617,510.70	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.34	745,515.92	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	8,230	51.65	425,079.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,466	107.40	1,124,048.40	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	160,538	23.09	3,706,822.42	
	POWER CORP OF CANADA	29,774	28.06	835,458.44	
	POWER FINANCIAL CORP	20,740	29.59	613,696.60	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	49,536	51.35	2,543,673.60	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	12,465	19.50	243,067.50	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.62	576,028.00	
	CGI GROUP INC - CL A	21,192	83.28	1,764,869.76	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,701	949.87	1,615,728.87	
	OPEN TEXT CORP	19,994	49.15	982,705.10	
	SHOPIFY INC - CLASS A	7,342	212.30	1,558,706.60	
	BCE INC	12,539	52.33	656,165.87	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,881	66.43	1,918,564.83	
	TELUS CORP	16,454	47.61	783,374.94	
	ALTAGAS INCOME LTD	11,886	20.55	244,257.30	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	37.75	197,847.75	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.76	327,890.24	
	EMERA INC	4,086	40.16	164,093.76	
	FORTIS INC	34,128	41.88	1,429,280.64	
	HYDRO ONE LTD	21,742	19.64	427,012.88	
カナダドル 小計		3,293,712		144,610,768.73 (12,813,960,217)	
ユーロ	ENAGAS	18,299	23.25	425,451.75	
	ENI	202,686	16.28	3,300,133.45	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,867	17.09	681,327.03	
	NESTE OIL OYJ	11,086	71.20	789,323.20	
	OMV AG	12,139	48.39	587,406.21	
	REPSOL SA	110,036	17.16	1,888,767.94	
	SNAM SPA	173,485	3.58	622,637.66	
	TENARIS SA	40,648	14.43	586,550.64	
	TOTAL SA	195,662	55.84	10,925,766.08	
	VOPAK	6,360	42.44	269,918.40	
	AIR LIQUIDE	34,556	113.30	3,915,194.80	
	AKZO NOBEL	19,791	80.54	1,593,967.14	
	ARCELORMITTAL	53,985	26.80	1,446,798.00	
	ARKEMA	5,335	106.70	569,244.50	
	BASF SE	73,727	76.55	5,643,801.85	

COVESTRO AG	16,178	69.86	1,130,195.08	
CRH PLC	71,124	28.18	2,004,274.32	
EVONIK INDUSTRIES AG	13,454	30.85	415,055.90	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	48.12	277,267.44	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,407	67.32	767,919.24	
IMERYS SA	3,000	63.60	190,800.00	
K+S AG	14,355	18.08	259,538.40	
KONINKLIJKE DSM NV	15,234	91.24	1,389,950.16	
LANXESS	7,293	63.08	460,042.44	
LINDE AG - TENDER	15,262	203.70	3,108,869.40	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,565	34.06	666,383.90	
SOLVAY SA	5,511	115.50	636,520.50	
STORA ENSO OYJ R	47,237	16.47	778,229.57	
SYMRISE AG	9,083	78.62	714,105.46	
THYSSEN KRUPP	33,044	21.74	718,376.56	
UMICORE	17,605	48.17	848,032.85	
UPM KYMMENE OYJ	43,990	33.80	1,486,862.00	
VOESTALPINE AG	8,140	39.40	320,716.00	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,591	36.68	755,277.88	
AIRBUS SE	46,842	108.18	5,067,367.56	
ALSTOM	13,816	38.49	531,777.84	
ANDRITZ AG	5,242	50.25	263,410.50	
BOUYGUES ORD	16,815	37.23	626,022.45	
BRENNTAG AG	11,626	53.16	618,038.16	
CNH INDUSTRIAL NV	76,653	10.35	793,358.55	
DASSAULT AVIATION SA	213	1,594.00	339,522.00	
EIFFAGE	6,079	96.16	584,556.64	
FERROVIAL SA	37,634	17.87	672,519.58	
GEA GROUP AG	13,382	30.68	410,559.76	
HOCHTIEF AG	1,354	142.80	193,351.20	
KION GROUP AG	5,887	52.94	311,657.78	
KONE OYJ-B	26,924	46.02	1,239,042.48	
LEGRAND SA	21,312	62.78	1,337,967.36	
LEONARDO SPA	35,425	10.38	367,711.50	
MAN SE	3,262	93.65	305,486.30	
METSO OYJ	9,561	30.54	291,992.94	
MTU AERO ENGINES AG	3,907	194.10	758,348.70	
OSRAM LICHT AG	7,440	34.26	254,894.40	
PRYSMIAN SPA	14,715	20.06	295,182.90	
REXEL SA	24,339	12.93	314,824.96	
SAFRAN SA	27,252	120.70	3,289,316.40	
SAINT-GOBAIN	39,044	37.14	1,450,289.38	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,814	69.30	3,105,610.20	
SIEMENS	61,389	110.34	6,773,662.26	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	17,491	10.90	190,651.90	
THALES SA	8,109	122.35	992,136.15	
VINCI S.A.	40,049	82.02	3,284,818.98	
WARTSILA OYJ	34,386	16.79	577,340.94	
BUREAU VERITAS SA	19,558	22.23	434,774.34	
EDENRED	18,941	32.83	621,833.03	
RANDSTAD NV	9,588	45.98	440,856.24	
SOCIETE BIC SA	2,424	78.85	191,132.40	
TELEPERFORMANCE	4,523	162.50	734,987.50	
WOLTERS KLUWER	23,031	53.68	1,236,304.08	
ADP	2,382	193.90	461,869.80	
AENA SME SA	5,610	149.50	838,695.00	
ATLANTIA SPA	42,039	17.87	751,236.93	
BOLLORE	61,805	3.72	229,914.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,929	21.16	358,217.64	
DEUTSCHE POST AG-REG	78,592	30.71	2,413,560.32	
FRAPORT AG	3,561	76.10	270,992.10	
GETLINK	36,478	11.00	401,258.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	46,342	7.40	343,023.48	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,892	77.71	2,089,777.32	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	67.70	337,890.70	
CONTINENTAL AG	8,828	149.95	1,323,758.60	
DAIMLER AG	74,263	54.35	4,036,194.05	
FAURECIA	5,945	51.84	308,188.80	
FERRARI NV	9,947	118.60	1,179,714.20	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	86,543	15.14	1,310,607.19	
MICHELIN	13,802	102.95	1,420,915.90	
NOKIAN RENKAAT OYJ	10,292	35.29	363,204.68	
PEUGEOT SA	46,029	23.23	1,069,253.67	
PIRELLI & C SPA	39,097	7.22	282,593.11	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,634	58.00	674,772.00	
RENAULT SA	15,041	74.50	1,120,554.50	
SCHAEFFLER AG	15,247	11.01	167,869.47	
VALEO SA	19,350	37.40	723,690.00	
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,780	151.60	2,240,648.00	
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	150.10	389,359.40	
ADIDAS AG	14,964	210.90	3,155,907.60	
HERMES INTERNATIONAL	2,561	570.60	1,461,306.60	
HUGO BOSS AG	4,852	66.32	321,784.64	
KERING	6,060	461.70	2,797,902.00	

LUXOTTICA GROUP SPA	13,319	58.52	779,427.88	
LVMH	22,399	304.60	6,822,735.40	
MONCLER SPA	15,736	37.10	583,805.60	
PUMA AG	772	425.00	328,100.00	
SEB SA	2,075	146.60	304,195.00	
ACCOR	14,931	44.22	660,248.82	
PADDY POWER PLC	7,143	73.50	525,010.50	
SODEXO	7,035	91.34	642,576.90	
AXEL SPRINGER SE	3,827	57.95	221,774.65	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	20.36	243,831.36	
JC DECAUX SA	4,674	31.50	147,231.00	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	19,174	22.37	428,922.38	
PUBLICIS GROUPE	17,601	51.48	906,099.48	
RTL GROUP	3,513	61.60	216,400.80	
SES	31,369	18.90	592,874.10	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,998	47.42	237,005.16	
VIVENDI	83,098	22.17	1,842,282.66	
INDITEX	86,470	26.11	2,257,731.70	
ZALANDO SE	9,155	33.51	306,784.05	
CARREFOUR	43,442	16.50	716,793.00	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	36.22	133,543.14	
COLRUYT SA	4,160	48.75	202,800.00	
JERONIMO MARTINS	20,234	12.68	256,668.29	
KONINKLIJKE AHOLD NV	100,535	19.75	1,985,566.25	
METRO AG	13,712	13.50	185,112.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,839	75.22	4,576,309.58	
DANONE (GROUPE)	48,771	66.70	3,253,025.70	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	42,526	7.33	311,928.21	
HEINEKEN HOLDING NV	8,980	78.00	700,440.00	
HEINEKEN NV	20,246	80.76	1,635,066.96	
KERRY GROUP PLC-A	13,146	95.25	1,252,156.50	
PERNOD-RICARD	17,495	141.30	2,472,043.50	
REMY COINTREAU	1,575	112.20	176,715.00	
BEIERSDORF AG	7,693	97.18	747,605.74	
HENKEL AG & CO KGAA	8,618	91.45	788,116.10	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,314	101.05	1,446,429.70	
LOREAL	20,321	207.70	4,220,671.70	
UNILEVER NV-CVA	125,731	47.96	6,030,687.41	
BIOMERIEUX	3,246	71.80	233,062.80	
ESSILOR INTERNATIONAL	17,239	127.45	2,197,110.55	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,996	88.58	1,594,085.68	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,850	63.24	2,140,674.00	

KONINKLIJKE PHILIPS	74,460	39.23	2,921,438.10	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,246	139.80	453,790.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,500	37.87	473,437.50	
BAYER	72,150	76.51	5,520,196.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	971	489.00	474,819.00	
GRIFOLS SA	22,128	24.26	536,825.28	
IPSEN	2,722	144.80	394,145.60	
MERCK KGAA	10,480	89.00	932,720.00	
ORION OYJ-CLASS B	7,975	32.62	260,144.50	
QIAGEN N.V.	17,548	32.60	572,064.80	
RECORDATI SPA	7,493	29.16	218,495.88	
SANOFI	91,271	76.56	6,987,707.76	
UCB (GROUPE)	10,465	77.40	809,991.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	33,189	23.45	778,282.05	
BANCO BILBAO VIZCAYA	541,619	5.49	2,973,488.31	
BANCO DE SABADELL SA	442,961	1.33	593,124.77	
BANCO SANTANDER SA	1,302,544	4.33	5,647,179.51	
BANKIA SA	110,053	3.37	371,648.98	
BANKINTER SA	58,881	7.93	467,044.09	
BNP PARIBAS	90,844	52.71	4,788,387.24	
CAIXABANK	277,342	3.93	1,092,172.79	
COMMERZBANK AG	80,494	8.97	722,433.65	
CREDIT AGRICOLE SA	92,834	12.38	1,149,841.92	
ERSTE GROUP BANK AG	23,108	35.78	826,804.24	
ING GROEP NV-CVA	314,846	11.18	3,521,237.66	
INTESA SANPAOLO	1,163,318	2.20	2,560,462.91	
KBC GROEP NV	20,232	64.10	1,296,871.20	
MEDIOBANCA	53,990	8.60	464,529.96	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	24.80	309,752.00	
SOCIETE GENERALE	63,719	36.97	2,355,691.43	
UNICREDIT SPA	163,189	12.96	2,115,582.19	
AMUNDI SA	4,764	64.54	307,468.56	
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,156	9.82	1,583,841.16	
DEUTSCHE BOERSE	15,552	115.40	1,794,700.80	
EURAZEO SA	3,198	67.85	216,984.30	
EXOR NV	7,813	57.82	451,747.66	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	90.30	564,104.10	
NATIXIS	69,996	5.84	409,056.62	
WENDEL	2,023	128.20	259,348.60	
AEGON	133,499	5.58	745,992.41	
AGEAS	16,065	46.31	743,970.15	
ALLIANZ SE-REG	36,019	192.00	6,915,648.00	

ASSICURAZIONI GENERALI	101,649	14.88	1,512,537.12	
AXA	157,703	23.15	3,650,824.45	
CNP ASSURANCES	11,830	20.76	245,590.80	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,706	121.70	572,720.20	
MAPFRE SA	90,939	2.70	245,717.17	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,665	190.75	2,415,848.75	
NN GROUP NV	23,899	38.43	918,438.57	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	6.88	316,812.87	
SAMPO OYJ-A SHS	36,213	44.60	1,615,099.80	
SCOR SE	13,354	40.00	534,160.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	27,553	41.32	1,138,489.96	
VONOVIA SE	40,469	42.08	1,702,935.52	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,186	80.02	2,895,603.72	
ATOS SE	7,634	102.50	782,485.00	
CAPGEMINI SA	13,238	108.40	1,434,999.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,469	128.75	1,347,883.75	
DELIVERY HERO SE	8,671	41.42	359,152.82	
SAP SE	78,835	106.00	8,356,510.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	6,830	93.42	638,058.60	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	40.75	387,654.75	
WIRECARD AG	9,864	186.70	1,841,608.80	
INGENICO GROUP	4,681	65.44	306,324.64	
NOKIA OYJ	458,694	4.77	2,191,181.23	
1&1 DRILLISCH AG	3,773	41.90	158,088.70	
DEUTSCHE TELEKOM	268,918	13.88	3,733,926.43	
ELISA A	11,722	36.53	428,204.66	
ILIAD SA	2,053	112.50	230,962.50	
KPN (KON.)	261,596	2.27	594,346.11	
ORANGE	164,543	13.73	2,259,998.10	
PROXIMUS	13,141	20.58	270,441.78	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.52	445,884.69	
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.46	217,866.11	
TELEFONICA	377,880	6.81	2,576,385.84	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	66,967	3.64	243,826.84	
E.ON SE	183,255	8.78	1,608,978.90	
ELECTRICITE DE FRANCE	49,736	15.12	752,257.00	
ENDESA	24,774	18.61	461,044.14	
ENEL	656,974	4.41	2,898,569.28	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	193,242	3.17	614,123.07	
ENGIE	151,158	12.66	1,914,416.07	
FORTUM OYJ	38,328	21.59	827,501.52	
IBERDROLA SA	476,207	6.33	3,018,199.96	

	INNOGY SE	11,000	38.49	423,390.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	26,034	23.51	612,059.34	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	32,882	18.04	593,191.28	
	RWE STAMM	42,828	21.25	910,095.00	
	SUEZ	28,043	12.24	343,246.32	
	TERNA SPA	105,905	4.60	487,268.90	
	UNIPER SE	14,751	26.51	391,049.01	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,742	17.19	786,304.98	
	ASML HOLDING NV	33,413	160.90	5,376,151.70	
	INFINEON TECHNOLOGIES	90,743	19.57	1,775,840.51	
	STMICROELECTRONICS	57,598	15.67	902,560.66	
ユーロ 小計		15,446,524		315,074,313.76 (41,649,673,535)	
イギリスポンド	BP PLC	1,616,893	5.89	9,528,350.44	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	373,089	26.36	9,836,491.48	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	304,218	26.89	8,180,422.02	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	54,000	7.71	416,664.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,426	17.23	1,506,349.98	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	8.55	306,568.80	
	BHP BILLTTON PLC	168,203	16.71	2,811,008.53	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,243	52.02	532,840.86	
	FRESNILLO PLC	17,743	8.21	145,741.00	
	GLENCORE PLC	943,407	3.31	3,129,281.01	
	JOHNSON MATTHEY PLC	14,111	35.62	502,633.82	
	MONDI PLC	27,192	21.04	572,119.68	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	7,294	54.50	397,523.00	
	RIO TINTO PLC REG	96,058	38.80	3,727,050.40	
	ASHTEAD GROUP PLC	42,021	24.37	1,024,051.77	
	BAE SYSTEMS PLC	256,884	6.29	1,617,855.43	
	BUNZL PLC	27,712	24.13	668,690.56	
	DCC PLC	7,320	69.65	509,838.00	
	FERGUSON PLC	19,208	65.15	1,251,401.20	
	MEGGITT PLC	66,268	5.66	375,341.95	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	408,486	1.99	816,563.51	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	133,813	9.87	1,321,269.56	
	SMITHS GROUP PLC	28,628	14.95	428,131.74	
	TRAVIS PERKINS PLC	18,555	10.65	197,703.52	
	WEIR GROUP PLC/THE	18,586	17.63	327,671.18	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	7.23	142,380.39	
	EXPERIAN PLC	75,041	19.70	1,478,682.90	
	G4S PLC	132,555	2.42	320,783.10	
	INTERTEK GROUP PLC	12,430	49.92	620,505.60	

RELX PLC	162,365	16.16	2,623,818.40	
EASYJET PLC	11,633	13.14	152,857.62	
ROYAL MAIL PLC	75,133	4.77	358,459.54	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	71,452	5.67	405,132.84	
BURBERRY GROUP PLC	35,328	20.15	711,859.20	
PERSIMMON PLC	26,389	23.65	624,099.85	
TAYLOR WIMPEY PLC	270,596	1.71	464,883.92	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,599	36.79	389,937.21	
CARNIVAL PLC	13,721	47.64	653,668.44	
COMPASS GROUP PLC	126,022	17.06	2,149,935.32	
GVC HOLDINGS PLC	42,500	9.18	390,362.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,964	47.80	667,479.20	
MERLIN ENTERTAINME	65,098	4.00	260,652.39	
TUI AG-DI	37,945	14.73	558,929.85	
WHITBREAD PLC	14,664	47.17	691,700.88	
INFORMA PLC	100,899	7.62	769,052.17	
ITV PLC	295,435	1.57	466,344.14	
PEARSON	66,305	8.90	590,114.50	
SKY PLC	83,042	17.29	1,435,796.18	
WPP PLC	98,371	11.24	1,106,181.89	
KINGFISHER PLC	170,994	2.58	441,164.52	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	135,263	2.88	390,639.54	
NEXT PLC	11,202	54.94	615,437.88	
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	2.59	436,116.25	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	3.21	477,342.03	
TESCO	786,019	2.39	1,884,873.56	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	28,845	22.90	660,550.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	186,419	35.84	6,682,189.05	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.13	469,294.80	
DIAGEO	200,277	27.19	5,445,531.63	
IMPERIAL BRANDS PLC	76,948	26.71	2,055,281.08	
RECKITT BENCKISER PLC	53,639	70.16	3,763,312.24	
UNILEVER PLC	99,877	42.16	4,210,814.32	
CONVATEC GROUP PLC	112,565	2.32	261,601.06	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,027	4.29	128,815.83	
NMC HEALTH PLC	9,509	33.94	322,735.46	
SMITH & NEPHEW PLC	71,027	13.99	994,022.86	
ASTRAZENECA	101,347	59.63	6,043,321.61	
GLAXOSMITHKLINE	403,375	15.36	6,199,067.00	
SHIRE PLC	74,526	46.23	3,445,709.61	
BARCLAYS	1,365,547	1.71	2,345,736.63	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,634,371	6.69	10,947,016.95	

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,929,966	0.59	3,514,690.84	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND	295,524	2.50	738,810.00	
	STANDARD CHARTERED PLC	233,519	6.36	1,486,114.91	
	3I GROUP PLC	79,251	9.41	745,910.41	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	22.35	457,482.15	
	INVESTEC PLC	54,280	5.39	292,894.88	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,296	45.86	1,205,934.56	
	SCHRODERS PLC	8,614	30.95	266,603.30	
	ST JAMES'S PLACE PLC	44,750	11.44	511,940.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	221,133	3.05	676,445.84	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.80	338,104.00	
	AVIVA PIC	318,261	4.89	1,557,887.59	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.23	368,322.88	
	LEGAL & GENERAL GROUP	485,419	2.62	1,272,768.61	
	PRUDENTIAL	212,799	17.59	3,744,198.40	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	86,538	5.75	497,593.50	
	AUTO TRADER GROUP PLC	80,010	4.46	357,324.66	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	35,036	14.29	500,839.62	
	SAGE GROUP PLC	89,321	5.86	523,778.34	
	BT GROUP PLC	663,615	2.25	1,495,124.59	
	VODAFONE GROUP PLC	2,177,524	1.64	3,582,026.98	
	CENTRICA PLC	440,558	1.54	682,424.34	
	NATIONAL GRID PLC	272,668	7.91	2,157,894.55	
	SEVERN TRENT PLC	18,112	18.49	334,890.88	
	SSE PLC	80,824	11.46	926,243.04	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,890	7.04	414,585.60	
イギリスポンド 小計		24,593,938		155,036,590.35 (23,018,282,569)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	25.54	444,344.92	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	672	585.00	393,120.00	
	GIVAUDAN-REG	740	2,413.00	1,785,620.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,334	48.45	1,954,182.30	
	SIKA AG-BR	10,500	142.90	1,500,450.00	
	ABB LTD	149,127	23.19	3,458,255.13	
	GEBERIT AG-REG	3,021	455.20	1,375,159.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,479	236.80	350,227.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,989	244.60	731,109.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,224	51.54	681,564.96	
	SGS SA	437	2,584.00	1,129,208.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,965	155.50	616,557.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,495	80.00	3,319,600.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	390.30	969,114.90	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	76.50	301,257.00	
	DUFRY AG-REG	2,548	110.65	281,936.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	1,860.00	297,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	80,500.00	644,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	75	6,880.00	516,000.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	252,246	81.82	20,638,767.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,140	195.30	808,542.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	779	738.00	574,902.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,757	335.00	1,928,595.00	
	NOVARTIS	180,510	84.40	15,235,044.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,037	237.75	13,560,546.75	
	VIFOR PHARMA AG	3,601	170.15	612,710.15	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,677	14.75	3,122,235.75	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,254	49.11	847,343.94	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,397	78.85	267,853.45	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,491	778.50	1,160,743.50	
	UBS GROUP AG	317,371	15.50	4,919,250.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,877	149.70	580,386.90	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,949	372.00	1,097,028.00	
	SWISS RE LTD	26,239	90.60	2,377,253.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,305	310.20	3,817,011.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	6,277	83.65	525,071.05	
	TEMENOS AG - REG	5,252	159.20	836,118.40	
	SWISSCOM	2,064	445.40	919,305.60	
スイスフラン 小計		1,408,816		94,578,015.82 (10,981,453,416)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	340.20	4,827,778.20	
	BOLIDEN AB	20,141	247.90	4,992,953.90	
	ALFA LAVAL AB	25,639	241.00	6,178,999.00	
	ASSA ABLOY AB-B	80,295	178.65	14,344,701.75	
	ATLAS COPCO A	53,833	256.20	13,792,014.60	
	ATLAS COPCO B	29,972	237.15	7,107,859.80	
	EPIROC AB-A	53,833	99.30	5,345,616.90	
	EPIROC AB-B	29,972	91.50	2,742,438.00	
	SANDVIK AB	87,313	157.75	13,773,625.75	
	SKANSKA B	28,530	174.55	4,979,911.50	
	SKF AB-B	28,335	175.35	4,968,542.25	
	VOLVO B	123,214	157.10	19,356,919.40	
	SECURITAS B	22,844	154.75	3,535,109.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	196.00	3,561,320.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.70	2,930,498.40	
	HENNES & MAURITZ B	73,962	164.24	12,147,518.88	

	ICA GRUPPEN AB	5,730	282.00	1,615,860.00	
	SWEDISH MATCH AB	15,149	455.00	6,892,795.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	48,571	223.40	10,850,761.40	
	NORDEA BANK AB	244,135	96.86	23,646,916.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,710	99.24	13,765,580.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,177	112.25	13,489,868.25	
	SWEDBANK AB-A	71,353	220.30	15,719,065.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	197.50	2,526,420.00	
	INVESTOR AB-B SHS	36,752	410.70	15,094,046.40	
	KINNEVIK AB - B	18,104	269.10	4,871,786.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	299.60	2,181,088.00	
	ERICSSON (LM) B	248,169	78.88	19,575,570.72	
	HEXAGON AB-B SHS	21,504	521.00	11,203,584.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,194	510.50	3,162,037.00	
	TELE2 AB-B SHS	33,266	107.00	3,559,462.00	
	TELIA CO AB	235,437	40.82	9,610,538.34	
スウェーデンクローナ 小計		1,992,279		282,351,187.24 (3,616,918,708)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	10,311	345.40	3,561,419.40	
	EQUINOR ASA	92,696	229.50	21,273,732.00	
	NORSK HYDRO	106,150	48.86	5,186,489.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	399.70	5,383,959.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	6,971	282.00	1,965,822.00	
	MARINE HARVEST	32,238	188.55	6,078,474.90	
	ORKLA	69,804	68.76	4,799,723.04	
	DNB ASA	80,217	171.25	13,737,161.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	137.20	2,548,352.80	
	TELENOR ASA	60,821	159.10	9,676,621.10	
ノルウェークローネ 小計		491,252		74,211,754.49 (1,037,480,327)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,401	652.00	4,825,452.00	
	NOVOZYMES A/S	17,687	352.60	6,236,436.20	
	VESTAS WIND SYSYEMS	17,720	434.40	7,697,568.00	
	ISS A/S	14,253	226.00	3,221,178.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	8,425.00	2,519,075.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	9,020.00	4,582,160.00	
	DSV A/S	14,599	584.00	8,525,816.00	
	PANDORA A/S	8,431	401.10	3,381,674.10	
	CARLSBERG AS-B	8,236	770.40	6,345,014.40	
	COLOPLAST-B	9,476	656.80	6,223,836.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	7,420	241.40	1,791,188.00	
	GENMAB A/S	4,512	1,010.00	4,557,120.00	

	H LUNDBECK A/S	4,871	396.70	1,932,325.70	
	NOVO NORDISK A/S-B	143,942	302.40	43,528,060.80	
	DANSKE BANK A/S	59,378	168.70	10,017,068.60	
	TRYG A/S	9,828	159.90	1,571,497.20	
	ORSTED A/S	15,908	436.30	6,940,660.40	
デンマーククローネ 小計		344,469		123,896,131.20 (2,196,678,406)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	29.90	616,807.10	
	OIL SEARCH LTD	118,781	9.03	1,072,592.43	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	134,202	8.26	1,108,508.52	
	SANTOS	156,437	7.26	1,135,732.62	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,916	38.58	2,967,419.28	
	ALUMINA LIMITED	170,458	2.77	472,168.66	
	AMCOR	88,486	13.68	1,210,488.48	
	BHP BILLITON LTD	258,265	34.63	8,943,716.95	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	16.98	837,589.44	
	BORAL LIMITED	81,732	6.91	564,768.12	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	134,676	3.92	527,929.92	
	INCITEC PIVOT LTD	150,599	3.98	599,384.02	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,363	20.96	783,128.48	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,159	19.41	1,187,096.19	
	ORICA LTD	29,211	17.03	497,463.33	
	RIO TINTO LTD	32,522	78.76	2,561,432.72	
	SOUTH32 LTD	408,172	3.92	1,600,034.24	
	CIMIC GROUP LIMITED	9,220	51.36	473,539.20	
	BRAMBLES LTD	129,297	10.90	1,409,337.30	
	SEEK LTD	26,358	20.76	547,192.08	
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.11	655,491.57	
	TRANSURBAN GROUP	214,921	11.22	2,411,413.62	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,725	28.44	1,243,539.00	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	13.69	415,190.32	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	5,523	53.20	293,823.60	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	53.16	173,461.08	
	TABCORP HOLDINGS LTD	166,846	4.87	812,540.02	
	HARVEY NORMAN HDG LTD-RIGHTS	2,656	0.80	2,124.80	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	45,163	3.52	158,973.76	
	WESFARMERS LTD	93,277	49.85	4,649,858.45	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,821	28.08	2,887,213.68	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	46,130	9.76	450,228.80	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	58,375	17.49	1,020,978.75	
	COCHLEAR LIMITED	4,811	200.64	965,279.04	
	HEALTHSCOPE LTD	140,279	2.10	294,585.90	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,248	54.93	672,782.64	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,777	24.91	791,565.07	
	CSL LIMITED	36,265	201.11	7,293,254.15	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	234,871	28.18	6,618,664.78	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	35,600	11.02	392,312.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	42,434	10.75	456,165.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	140,283	71.41	10,017,609.03	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	222,533	27.81	6,188,642.73	
	WESTPAC BANKING	277,750	27.93	7,757,557.50	
	AMP LTD	244,230	3.19	779,093.70	
	ASX LTD	15,814	63.66	1,006,719.24	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	44,068	11.20	493,561.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	26,778	126.04	3,375,099.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	182,556	7.32	1,336,309.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.91	624,229.92	
	QBE INSURANCE GROUP	113,093	11.12	1,257,594.16	
	SUNCORP GROUP LIMITED	102,921	14.46	1,488,237.66	
	COMPUTERSHARE LIMITED	32,564	19.95	649,651.80	
	REA GROUP LTD	3,593	85.93	308,746.49	
	TELSTRA CORP	342,339	3.19	1,092,061.41	
	TPG TELECOM LTD	31,475	8.54	268,796.50	
	AGL ENERGY LTD	51,344	19.50	1,001,208.00	
	AUSNET SERVICES	120,230	1.62	195,373.75	
オーストラリアドル 小計		5,850,694		99,616,268.14 (8,193,438,054)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	76,644	6.54	501,251.76	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	84,950	7.30	620,135.00	
	A2 MILK CO LTD	66,854	11.26	752,776.04	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,508	15.05	684,895.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.00	508,438.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	4.05	589,068.45	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	3.28	363,137.04	
ニュージーランドドル 小計		566,266		4,019,701.69 (303,085,507)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	212,996	90.20	19,212,239.20	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	15.48	1,532,520.00	
	MTR CORP	114,000	41.20	4,696,800.00	
	MINTH GROUP LTD	46,000	32.30	1,485,800.00	
	LI & FUNG	554,800	1.75	970,900.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	50.00	5,950,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	68,500	21.75	1,489,875.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	198,000	49.65	9,830,700.00	

	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	12.40	833,280.00	
	SANDS CHINA LTD	202,800	35.45	7,189,260.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	11.64	1,140,720.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	7.24	955,680.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	18.00	2,534,400.00	
	WH GROUP LTD	699,000	5.51	3,851,490.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	29.20	3,187,472.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	310,000	37.20	11,532,000.00	
	HANG SENG BANK	61,100	212.60	12,989,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,900	224.00	21,705,600.00	
	AIA GROUP LTD	968,600	69.90	67,705,140.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	215,996	58.75	12,689,765.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	81,000	20.80	1,684,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.30	2,646,900.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	113,844	39.35	4,479,761.40	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	59,000	39.55	2,333,450.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	64,500	26.55	1,712,475.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	491,500	10.68	5,249,220.00	
	SINO LAND CO	235,400	13.42	3,159,068.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	132,000	114.00	15,048,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	85.75	3,472,875.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	29.65	2,852,330.00	
	WHARF HOLDINGS	91,000	21.30	1,938,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	50.50	4,595,500.00	
	WHEELOCK & CO LTD	65,000	46.95	3,051,750.00	
	PCCW LTD	357,000	4.56	1,627,920.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	50,000	62.00	3,100,000.00	
	CLP HOLDINGS	133,500	91.65	12,235,275.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	737,913	15.54	11,467,168.02	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	111,000	54.50	6,049,500.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23,700	79.70	1,888,890.00	
香港ドル 小計		7,660,909		280,076,683.62 (4,075,115,746)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.96	781,608.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	107,000	3.09	330,630.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.56	388,040.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	199,900	1.24	247,876.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	166,500	2.43	404,595.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,333	9.74	422,063.42	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	51,200	5.22	267,264.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	425,000	1.06	450,500.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	127,100	2.87	364,777.00	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,900	31.99	316,701.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.25	104,750.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.22	575,092.00	
	DBS GROUP	145,600	26.09	3,798,704.00	
	OCBC BANK	260,000	11.44	2,974,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	110,700	27.08	2,997,756.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,300	7.37	459,151.00	
	CAPITALAND LTD	187,100	3.37	630,527.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	31,200	9.11	284,232.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.89	327,275.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.63	453,091.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	640,943	3.24	2,076,655.32	
シンガポールドル 小計		3,459,876		18,655,687.74 (1,554,951,573)	
イスラエルシェケル	FRUTAROM	3,032	376.50	1,141,548.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	67,756	22.20	1,504,183.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,460	461.20	673,352.00	
	BANK HAPOALIM BM	84,067	26.64	2,239,544.88	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,794	23.99	2,777,898.06	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	63.72	522,504.00	
	AZRIELI GROUP	4,323	186.80	807,536.40	
	NICE LTD	4,894	411.50	2,013,881.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	154,606	4.18	646,716.89	
イスラエルシェケル 小計		444,132		12,327,164.43 (385,963,518)	
合　計		90,392,109		343,200,267,590 (343,200,267,590)	

(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	オーストラリアドル	APA GROUP	89,571	893,918.58	
		LENDLEASE GROUP	44,009	865,216.94	
		SYDNEY AIRPORT	89,860	619,135.40	
	オーストラリアドル 小計		223,440	2,378,270.92 (195,612,783)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,741,950.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	268,000	2,883,680.00	
	香港ドル 小計		488,500	4,625,630.00 (67,302,916)	
投資信託受益証券合計			711,940	262,915,699 (262,915,699)	

投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	35,976	670,232.88	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,479	1,066,573.41	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	35,899	5,216,124.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	96,808	990,345.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,806	1,957,506.90	
		BOSTON PROPERTIES	12,302	1,514,253.18	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,000	397,670.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,092	663,598.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	32,801	3,651,735.33	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,824	1,892,363.52	
		DUKE REALTY CORP	29,929	849,085.73	
		EQUINIX INC	6,496	2,812,053.44	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	28,719	1,902,920.94	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,077	1,252,546.67	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,092	874,370.88	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,029	762,487.63	
		HCP INC	36,011	947,809.52	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	59,388	1,253,086.80	
		INVITATION HOMES INC	24,000	549,840.00	
		IRON MOUNTAIN INC	20,489	707,280.28	
		KIMCO REALTY CORP	35,407	592,713.18	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,822	499,479.50	
		MACERICH CO/THE	10,128	559,977.12	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,716	873,168.88	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	11,020	493,916.40	
		PROLOGIS INC	50,653	3,433,766.87	
		PUBLIC STORAGE	12,835	2,587,921.05	
		REALTY INCOME CORP	21,691	1,234,000.99	
		REGENCY CENTERS CORP	11,717	757,738.39	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,366	1,504,460.58	
		SIMON PROPERTY GROUP	26,119	4,616,533.25	
		SL GREEN REALTY CORP	8,067	786,774.51	
		UDR INC	20,960	847,412.80	
		VENTAS INC	27,813	1,512,470.94	
		VEREIT INC	77,798	564,813.48	
		VORNADO REALTY TRUST	13,295	970,535.00	
		WELLTOWER INC	29,615	1,904,836.80	
	アメリカドル 小計		889,239	53,672,405.83 (6,114,360,472)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	187,870.85	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	382,293.20	

		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5,631	171,801.81	
	カナダドル 小計		30,576	741,965.86 (65,745,594)	
	ユーロ	COVIVIO	3,578	321,125.50	
		GECINA SA	3,549	510,346.20	
		ICADE	2,845	226,462.00	
		KLEPIERRE	17,225	525,879.25	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,790	1,869,043.80	
	ユーロ 小計		37,987	3,452,856.75 (456,433,133)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	489,825.55	
		HAMMERSON PLC	61,184	279,427.32	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	58,550	517,230.70	
		SEGRO PLC	81,695	521,050.71	
	イギリスポンド 小計		280,843	1,807,534.28 (268,364,614)	
	オーストラリアドル	DEXUS	74,090	782,390.40	
		GOODMAN GROUP	140,271	1,453,207.56	
		GPT GROUP	136,015	708,638.15	
		MIRVAC GROUP	306,089	737,674.49	
		SCENTRE GROUP	426,663	1,693,852.11	
		STOCKLAND	207,412	860,759.80	
		VICINITY CENTERS	291,115	762,721.30	
	オーストラリアドル 小計		1,581,655	6,999,243.81 (575,687,803)	
	香港ドル	LINK REIT	179,500	13,830,475.00	
	香港ドル 小計		179,500	13,830,475.00 (201,233,411)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197,500	521,400.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243,000	432,540.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	200,300	444,666.00	
		SUNTEC REIT	173,000	333,890.00	
	シンガポールドル 小計		813,800	1,732,496.00 (144,403,541)	
投資証券合計			3,813,600	7,826,228,568 (7,826,228,568)	
合計				8,089,144,267 (8,089,144,267)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　598銘柄	97.4%	—	—	66.4%
	投資証券　37銘柄	—	—	2.6%	1.7%
カナダドル	株式　87銘柄	99.5%	—	—	3.6%
	投資証券　3銘柄	—	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式　236銘柄	98.9%	—	—	11.9%
	投資証券　5銘柄	—	—	1.1%	0.1%
イギリスポンド	株式　97銘柄	98.8%	—	—	6.6%
	投資証券　4銘柄	—	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式　38銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　32銘柄	100.0%	—	—	1.0%
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　17銘柄	100.0%	—	—	0.6%
オーストラリアドル	株式　58銘柄	91.4%	—	—	2.3%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	2.2%	—	0.1%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.4%	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	93.8%	—	—	1.2%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.5%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式　21銘柄	91.5%	—	—	0.4%
	投資証券　4銘柄	—	—	8.5%	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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ外国株式インデックス・オープン】

【純資産額計算書】

（2018年10月31日現在）

Ⅰ　資産総額	19,274,896,022円
Ⅱ　負債総額	45,437,394円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,229,458,628円
Ⅳ　発行済口数	7,299,993,566口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6342円
（1万口当たり純資産額）	（26,342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10月31日現在）

Ⅰ　資産総額	335,929,836,319円
Ⅱ　負債総額	1,639,757,414円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	334,290,078,905円
Ⅳ　発行済口数	137,216,058,236口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4362円
（1万口当たり純資産額）	（24,362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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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ます。）に支払います。

⑥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（2018年10月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数：12,000株
発行済株式総数　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。
取締役の選任決議は、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、監査等委員以外の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、監査等委員である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３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）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。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２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。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）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（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、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、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役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。

②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・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク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運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

［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執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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・リスク委員会（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れます。

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運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

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。

委託会社の機構は2018年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年10月31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	520	11,058,229
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	235,004
単位型公社債投資信託	0	0
合計	588	11,293,233

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(2)　委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　平成29年4月1日至　平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）		当事業年度 （平成30年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		20,260,630		23,973,152
前払費用		143,622		157,614
未収委託者報酬		5,252,944		5,373,307
繰延税金資産		61,677		94,211
その他		5,474		9,842
流動資産合計		25,724,348		29,608,128
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	47,993	※1	36,782
器具備品	※1	73,765	※1	79,655
その他	※1	2,830	※1	1,912
有形固定資産合計		124,589		118,350
無形固定資産				
ソフトウェア		221,499		210,679
その他		6,656		4,377
無形固定資産合計		228,156		215,056
投資その他の資産				
投資有価証券		71,153		42,802
長期前払費用		9,828		7,810
長期貸付金		19,838		17,088
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		137,359		154,422
その他		145		70
貸倒引当金		△19,838		△17,088
投資その他の資産合計		243,485		230,105
固定資産合計		596,231		563,512
資産合計		26,320,580		30,171,641

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）	当事業年度 （平成30年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591

未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
固定負債		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	71,500	74,500
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	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△1,134	182
評価・換算差額等合計	△1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	30,245,448	29,206,178

営業収益合計		30,245,448		29,206,178
営業費用				
支払手数料		12,880,325		12,544,178
広告宣伝費		95,688		175,296
公告費		3,094		－
調査費		6,239,223		6,008,380
調査費		360,520		396,842
委託調査費		5,876,937		5,609,496
図書費		1,766		2,041
営業雑経費		1,460,885		1,474,361
通信費		24,920		33,158
印刷費		370,785		368,414
協会費		30,665		36,616
諸会費		105		105
情報機器関連費		943,725		942,093
その他営業雑経費		90,684		93,973
営業費用合計		20,679,217		20,202,216
一般管理費				
給料		1,874,710		2,006,157
役員報酬		89,520		84,130
給料・手当		1,526,244		1,649,268
賞与		258,946		272,758
退職給付費用		76,106		84,944
福利費		221,018		239,702
交際費		5,612		5,831
旅費交通費		61,961		73,807
租税公課		106,691		102,158
不動産賃借料		113,697		124,629
減価償却費		134,710		119,300
業務委託費	※1	486,690	※1	484,841
諸経費		223,685		246,326
一般管理費合計		3,304,885		3,487,699
営業利益		6,261,346		5,516,262

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
営業外収益		
受取利息	4,669	2,136
収益分配金	129	116
投資有価証券売却益	307	499
貸倒引当金戻入	3,000	2,750
その他	1,591	4,351
営業外収益合計	9,697	9,854
営業外費用		

長期前払費用償却	※1	4,644	※1	―
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		―		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		―		51,569
特別損失合計		―		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		△50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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				
	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	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

当事業年度（自　平成29年4月1日　至　平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		△33,000	△30,000	△30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	―	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	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
当期変動額			
剰余金の配当			△30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907

当期末残高	182	182	25,592,216

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。

未適用の会計基準等

・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　平成30年2月16日）
・「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30年2月16日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類１）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

平成31年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）

建　　物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	〃	325,834	〃
そ の 他	1,759	〃	2,677	〃
計	362,567	〃	392,342	〃

（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28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	〃	―	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30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

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30年6月29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30年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成30年3月31日	平成30年6月29日

（リース取引関係）

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

①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。

②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。

③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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成30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	23,973,152	23,973,152	－
（2）未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	－
（3）投資有価証券 その他有価証券	42,799	42,799	－
（4）未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	－
（5）未払法人税等	(838,596)	(838,596)	－

（*）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29年3月31日	平成30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、「(3)投資有価証券 その他有価証券」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

当事業年度（平成30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	23,973,152	－	－	－
未収委託者報酬	5,373,307	－	－	－

投資有価証券 　投資信託	－	12,846	21,065	496

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（平成30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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	23,576	25,037	△1,461
小計	23,576	25,037	△1,461
合計	42,799	42,536	262

（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

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30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
62,968	499	2,224

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付債務	437,197	496,696
（2）退職給付引当金	437,197	496,696

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
（1）退職給付費用	76,106	84,944

（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14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

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29年3月31日）		当事業年度 （平成30年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	〃	5,232	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	〃	32,511	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	〃	152,088	〃
その他	6,972	〃	23,674	〃
繰延税金資産 合計	205,870	〃	255,547	〃
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	〃
その他	-	〃	△80	〃
繰延税金負債 合計	△6,833	〃	△6,913	〃
繰延税金資産の純額	199,037	〃	248,633	〃

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おります。

当事業年度（自 平成29年4月1日　至 平成30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）	2,945,175千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

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㈱	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
① 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。
② 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29年4月1日　至 平成30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㈱	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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

（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
① 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。
② 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）

当事業年度（平成30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29年3月31日）	当事業年度（平成30年3月31日）
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

(注）１．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　平成28年4月1日 至　平成29年3月31日）	当事業年度 （自　平成29年4月1日 至　平成30年3月31日）
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

当社は2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2018年12月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2018年3月末日現在）

③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）（2018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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：2000年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（2018年3月末日現在）

④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。

⑤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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載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30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 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30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

（注）１．上記は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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

２０１８年１１月３０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　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１０月１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２０１８年１０月１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

（注）１．上記は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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。