

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年2月26日提出
【発行者名】	三井住友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 横山 邦男
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	外国株式指数ファンド
【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】	継続募集額(平成27年2月27日から平成28年2月25日まで) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

外国株式指数ファンド
以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

*ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、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。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（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なります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「外株指数」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

（５）【申込手数料】

無手数料です。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成27年2月27日から平成28年2月25日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの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】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ お申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません(また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。)

ニ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ホ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法お

よび当該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。

（参考：投資信託振替制度）

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

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】

- イ 当ファンドは、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」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本を除く世界各国の株式に投資します。
- ロ 当ファンドは、MSCI - KOKUSA I インデックス（円ベース）をベンチマークとして、当該指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

対象インデックス	その他の指数 (MSCI - KOKUSAI (円ベース))	目論見書または信託約款において、MSCI - KOKUSAI (円ベース) に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	---	--

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
		不動産投信	
		その他資産 ()	
	内外	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
株式	年1回	グローバル			
一般		(日本を除く)			
大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債		アジア			
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信 ()			ファンド・オブ・ファンズ	なし	
		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCI - KOKU SAI(円ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成21年10月19日 信託契約締結、設定、運用開始。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

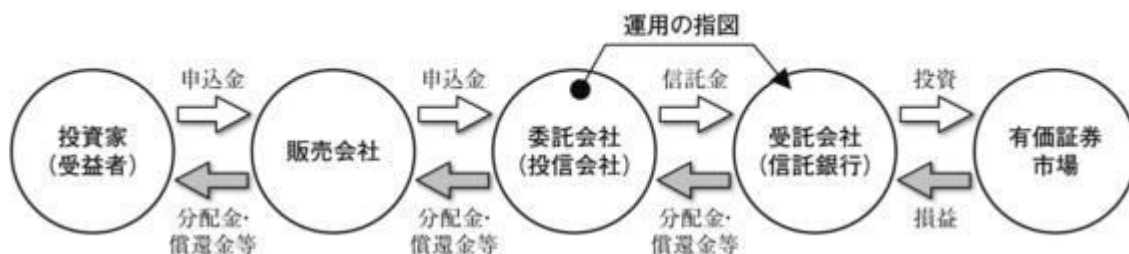
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

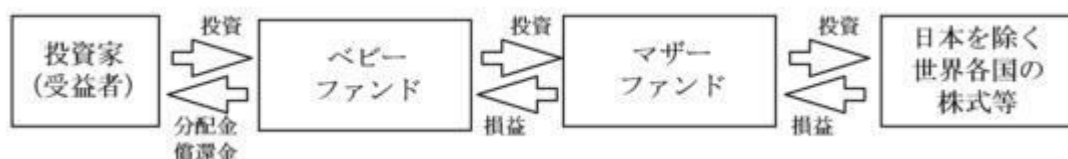
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成26年12月30日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
 昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録
 昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
 平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
 平成11年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
 平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
 平成14年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
 平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

(八) 大株主の状況

(平成26年12月30日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ハ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ニ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1 主として世界各国（日本を除く先進国・地域）の株式に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指します。

なお、運用の効率化のため、先物取引およびオプション取引等を利用することがあります。実際の運用は、外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて行います。

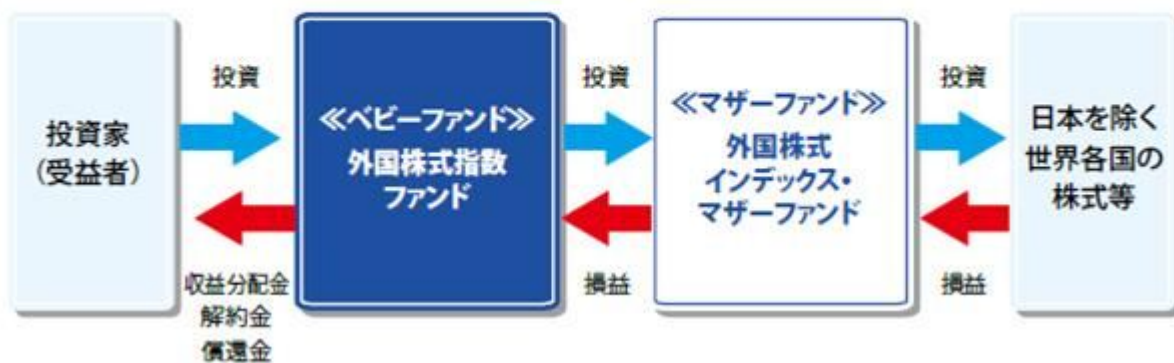
2 株式の実質組入比率は原則として高位を保ちます。

3 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

※資金動向、市況動向等によっては上記の運用ができないことがあります。

ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドである「外国株式インデックス・マザーファンド」の組入れを通じて、実際の運用を行います。



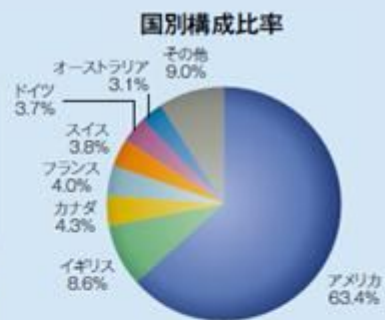
MSCI-KOKUSAIインデックスとは

- MSCI Inc.が発表するインデックスで、世界*の株式市場の動きを示す代表的な指標です。

*下記の日本を除く22の先進国・地域を対象とします(2014年12月末現在)。
オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イスラエル、イタリア、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、イギリス、アメリカ

- MSCI-KOKUSAIインデックスは、世界の株式市場を投資対象とする際に、運用目標や運用評価の基準(ベンチマーク)として、幅広く採用されています。

※同インデックスに関する知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。
また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。



(注)2014年12月末現在。
数値は四捨五入の関係上、合計が100%にならない場合があります。
(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

MSCI-KOKUSAIインデックスの概要(2014年12月末現在)

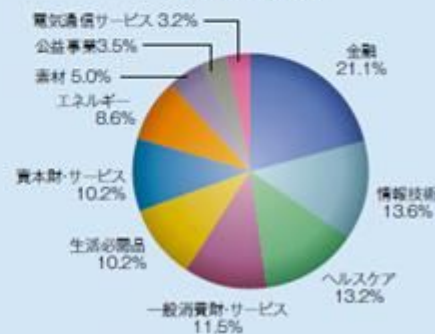
銘柄数:1,322

配当利回り:2.47%

予想PER:15.63倍

(注)配当利回りとは株価に対する年間配当金(実績)の割合。
予想PERとは株価の1株当たり予想利益に対する倍率。
PERとはPrice Earnings Ratioの略。
(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

業種別構成比率



(注)世界産業分類基準(GICS)による10セクターの分類。数値は四捨五入の関係上、合計が100%にならない場合があります。
(出所) FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、参考情報として記載した上記指数の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

MSCI-KOKUSAIインデックスの歩み



(注) データは1994年12月末～2014年12月末(月次)、1994年12月末を100として指数化。
上記の円ベースは、ベンチマークとは異なります。
(出所) FactSet等のデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、参考情報として記載した上記指数の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

運用プロセス



(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当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。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券（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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券（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かかる優先出資証券（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. 特定目的会社にかか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. 投資信託または外国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、有価証券にかかるものに限りません。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 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
21. 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号の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（ただし、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 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上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

(3) 【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

(イ) 計画 (Plan)

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

(ロ) 実行 (Do)

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

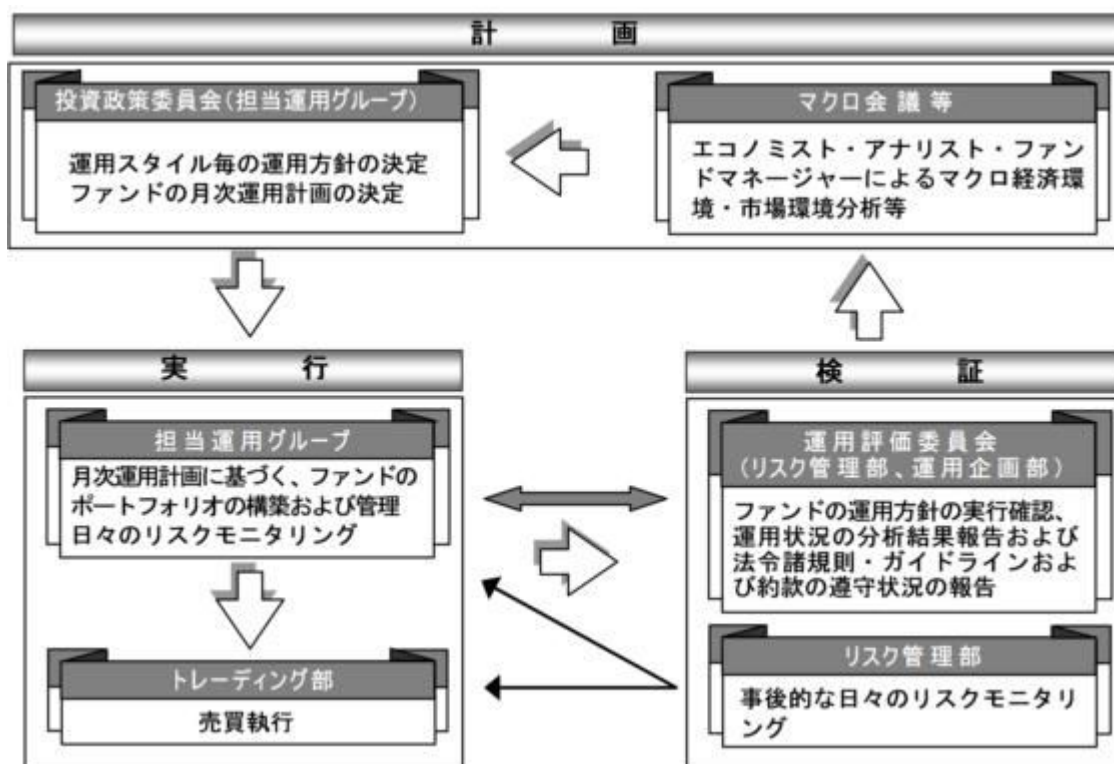
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(ハ) 検証 (Check)

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

【ファンドの運用体制】



リスク管理部は9名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年1回（原則として毎年11月30日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- イ 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、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、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ハ 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
 - （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場し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。
 - （ロ）上記（イ）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することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 信用取引の指図
 - （イ）委託会社は、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り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。
 - （ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総

額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

八 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、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および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かかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、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金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

二 スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本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。
 - (ロ) 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。
 - (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (二) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
 - (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、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および為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および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。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ヘ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り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、売り付けた有価証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ます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

チ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保

の提供の指図をするものとします。

- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに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、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。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は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。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ロ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

法令に基づく投資制限

イ 同一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第9条）

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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をする

ことができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

- デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

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

(参考情報：外国株式インデックス・マザーファンドの投資方針等)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI-KOKUSAインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCI-KOKUSAインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

(ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号に掲げるもの(ただし、投資法人債券は除きます。)に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に海外の株式を投資対象としています(マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。)。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式の値動き、当該発行者の経

営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。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。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

（ロ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ハ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

（ニ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（ホ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、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。

（ト）インデックスに連動しない要因・留意点

当ファンドは、MSCI-KOUSA I インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入る有価証券の売買のタイミング差、インデックス構

成銘柄と組入有価証券との誤差の影響等から、上記インデックスに連動しないことがあります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織(リスク管理部および法務コンプライアンス部)を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

【ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移】



【ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較】



※左グラフは2010年1月～2014年12月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期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、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの設定日が2009年10月19日であり、左右グラフのファンドの騰落率については各月末の直近1年間の騰落率であるため、2010年9月以前については、ベンチマークの騰落率を使用しております。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額およびベンチマークのデータをもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと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あり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国債・・・MSCIコクサイインデックス(クロス配当込み、円ベース)

新興国債・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(クロス配当込み、円ベース)

日本国債・・・NOMURA-BPI(国債)

先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料です。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、1口につき解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

(3)【信託報酬等】

純資産総額に年0.54%(税抜き0.5%)の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.22%	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	年0.22%	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0.06%	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00648%（税抜き0.006%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
 - (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）
- ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

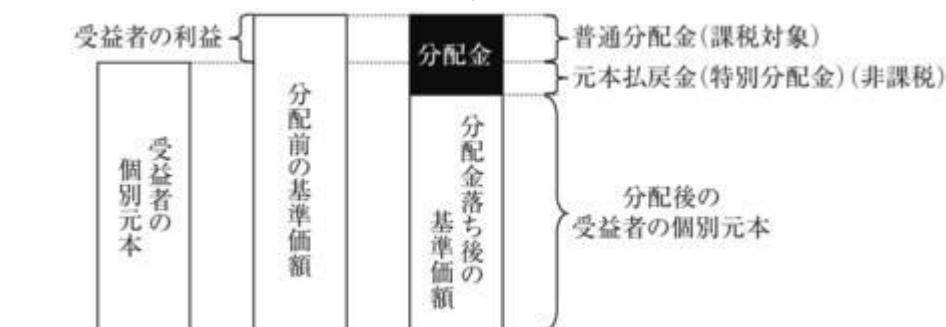
八 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金（課税対象）となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成26年12月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

外国株式指数ファンド

平成26年12月30日現在

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	923,425,208	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		387,081	0.04
合計(純資産総額)		923,038,127	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

外国株式指数ファンド

イ 主要投資銘柄

平成26年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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	321,930,417	2.8315	911,545,976	2.8684	923,425,208	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成26年12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

【投資不動産物件】

外国株式指数ファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

外国株式指数ファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

外国株式指数ファンド

年月日	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1期 (平成21年11月30日)	16,680,583	16,680,583	9,395	9,395
第2期 (平成22年11月30日)	166,837,388	166,837,388	9,653	9,653
第3期 (平成23年11月30日)	253,459,203	253,459,203	8,710	8,710
第4期 (平成24年11月30日)	344,130,833	344,130,833	10,927	10,927
第5期 (平成25年12月 2日)	558,875,489	558,875,489	17,142	17,142
第6期 (平成26年12月 1日)	882,528,437	882,528,437	21,825	21,825
平成25年12月末日	511,061,377		17,967	
平成26年 1月末日	551,323,492		17,072	
2月末日	596,354,799		17,657	
3月末日	612,508,426		17,838	
4月末日	630,173,679		18,075	
5月末日	632,973,937		18,265	
6月末日	657,094,644		18,488	
7月末日	701,196,067		18,740	
8月末日	721,471,452		19,019	
9月末日	751,350,885		19,563	
10月末日	807,182,335		19,452	

11月末日	881,600,908		21,802	
12月末日	923,038,127		22,071	

【分配の推移】

外国株式指数ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	平成21年10月19日～平成21年11月30日	0
第2期	平成21年12月1日～平成22年11月30日	0
第3期	平成22年12月1日～平成23年11月30日	0
第4期	平成23年12月1日～平成24年11月30日	0
第5期	平成24年12月1日～平成25年12月2日	0
第6期	平成25年12月3日～平成26年12月1日	0

【収益率の推移】

外国株式指数ファンド

	収益率（％）
第1期	6.1
第2期	2.7
第3期	9.8
第4期	25.5
第5期	56.9
第6期	27.3

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

（４）【設定及び解約の実績】

外国株式指数ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	18,933,877	1,178,876
第2期	189,623,130	34,538,300
第3期	163,367,596	45,196,352
第4期	101,935,383	78,016,662
第5期	191,664,261	180,574,469
第6期	224,467,135	146,116,864

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

外国株式インデックス・マザーファンド

平成26年12月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	アメリカ	117,210,047,842	57.25
	イギリス	16,054,401,199	7.84
	カナダ	8,415,737,550	4.11
	スイス	8,007,203,369	3.91
	ドイツ	7,433,193,432	3.63
	フランス	7,233,545,465	3.53
	オーストラリア	5,327,969,135	2.60
	オランダ	2,976,493,021	1.45
	スペイン	2,865,201,738	1.40
	アイルランド	2,592,983,720	1.27
	スウェーデン	2,456,943,381	1.20
	香港	2,148,323,822	1.05
	イタリア	1,658,928,204	0.81
	シンガポール	1,285,007,568	0.63
	デンマーク	1,227,738,437	0.60
	ジャージー	1,173,725,626	0.57
	ベルギー	1,051,522,995	0.51
	フィンランド	727,459,495	0.36
	キュラソー	723,203,319	0.35
	バミューダ	658,799,056	0.32
ノルウェー	514,884,618	0.25	
イスラエル	462,788,436	0.23	
ルクセンブルク	307,541,920	0.15	
ケイマン諸島	168,668,690	0.08	
オーストリア	160,474,879	0.08	

	ニュージーランド	127,857,425	0.06
	ポルトガル	124,507,671	0.06
	英ヴァージン諸島	99,622,878	0.05
	リベリア	85,571,477	0.04
	ガンジー	54,035,989	0.03
	マン島	31,647,280	0.02
	モーリシャス	15,529,226	0.01
	小計	193,381,558,863	94.45
投資証券	アメリカ	3,163,239,417	1.55
	オーストラリア	677,124,239	0.33
	イギリス	284,770,957	0.14
	フランス	257,715,663	0.13
	香港	116,985,586	0.06
	シンガポール	110,162,955	0.05
	カナダ	43,423,761	0.02
	オランダ	24,926,234	0.01
	小計	4,678,348,812	2.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,677,874,817	3.26
合計(純資産総額)		204,737,782,492	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	4,576,266,058	2.23
	買建	ドイツ	1,259,775,072	0.61
	買建	イギリス	578,672,690	0.28
	買建	オーストラリア	335,031,637	0.16
合計	買建		6,749,745,457	3.28

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		699,992,200	0.34

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成26年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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	318,979	14,337.01	4,573,205,592	13,731.85	4,380,171,941	2.14
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	227,260	10,914.59	2,480,451,315	11,219.58	2,549,763,683	1.25
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	416,997	5,763.49	2,403,360,333	5,720.09	2,385,263,497	1.17
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	149,934	13,049.53	1,956,569,356	12,697.53	1,903,791,688	0.93
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	264,191	6,567.56	1,735,091,301	6,715.84	1,774,264,618	0.87
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	533,463	3,193.36	1,703,544,474	3,098.13	1,652,740,392	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	143,957	10,901.33	1,569,323,699	11,167.75	1,607,676,075	0.79
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	171,352	8,836.58	1,514,167,369	8,921.84	1,528,776,841	0.75
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	200,367	7,252.28	1,453,119,190	7,589.82	1,520,751,067	0.74
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	122,192	11,388.29	1,391,559,153	11,321.30	1,383,373,511	0.68
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	100,859	13,124.27	1,323,701,606	13,660.72	1,377,807,164	0.67
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	336,764	3,755.13	1,264,593,441	3,784.06	1,274,336,697	0.62
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	220,144	6,098.62	1,342,575,592	5,732.15	1,261,898,980	0.62
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	37,316	35,248.92	1,315,348,699	32,886.00	1,227,173,976	0.60
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	560,189	2,054.17	1,150,724,558	2,183.16	1,222,982,497	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	263,744	4,490.48	1,184,339,135	4,482.04	1,182,113,531	0.58
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,016,681	1,191.38	1,211,254,529	1,159.39	1,178,738,903	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	275,292	4,265.05	1,174,136,622	4,111.96	1,131,989,830	0.55
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	61,028	17,924.57	1,093,901,238	18,329.62	1,118,620,507	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	209,515	5,404.25	1,132,272,801	5,166.77	1,082,516,445	0.53

アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	153,117	7,281.22	1,114,878,563	6,959.35	1,065,595,024	0.52
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	160,901	6,506.08	1,046,835,341	6,597.70	1,061,576,769	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	189,082	5,112.52	966,686,547	5,498.28	1,039,626,819	0.51
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	104,897	9,366.73	982,542,402	9,646.41	1,011,879,575	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	86,870	11,152.08	968,781,233	11,512.52	1,000,093,047	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,251	65,317.60	996,158,817	63,931.28	975,015,974	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,032	66,191.59	994,992,041	64,772.72	973,663,535	0.48
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	50,277	19,549.59	982,894,912	19,349.48	972,833,831	0.48
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	80,218	12,093.57	970,122,479	11,729.51	940,918,234	0.46
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	271,708	3,332.00	905,331,600	3,430.85	932,190,207	0.46

□ 種類別・業種別の投資比率

平成26年12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	8.30
		素材	4.84
		資本財	6.91
		商業・専門サービス	0.86
		運輸	2.02
		自動車・自動車部品	1.63
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.62
		メディア	3.02
		小売	3.22
		食品・生活必需品小売り	2.14
		食品・飲料・タバコ	5.94
		家庭用品・パーソナル用品	1.77
		ヘルスケア機器・サービス	3.39
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.42
		銀行	9.14
各種金融	4.09		
保険	4.18		

		不動産	0.76
		ソフトウェア・サービス	6.93
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.50
		電気通信サービス	3.05
		公益事業	3.37
		半導体・半導体製造装置	1.75
投資証券			2.29
合計			96.74

投資不動産物件

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

外国株式インデックス・マザーファンド

平成26年12月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (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	SPMINI 1503	買建	364	米ドル	37,354,755	4,503,115,715	37,961,560	4,576,266,058	2.23
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1503	買建	270	ユーロ	8,405,540	1,231,747,832	8,596,800	1,259,775,072	0.61
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200 1503	買建	25	オース トラリア ドル	3,295,312.5	323,171,296	3,416,250	335,031,637	0.16
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1503	買建	47	英ポンド	3,039,249	568,430,740	3,094,010	578,672,690	0.28

(注) 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。

平成26年12月30日現在

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	米ドル	買建	3,450,000.00	415,705,950	415,863,000	0.20
	カナダドル	買建	490,000.00	50,771,500	50,764,000	0.02
	ユーロ	買建	590,000.00	86,607,000	86,452,700	0.04
	英ポンド	買建	380,000.00	71,203,700	71,060,000	0.03
	スイスフラン	買建	220,000.00	26,849,200	26,796,000	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	540,000.00	8,295,900	8,321,400	0.00
	ノルウェークローネ	買建	120,000.00	1,941,500	1,939,200	0.00
	デンマーククローネ	買建	220,000.00	4,341,600	4,329,600	0.00

オーストラリアドル	買建	210,000.00	20,564,100	20,584,200	0.01
香港ドル	買建	560,000.00	8,697,352	8,696,800	0.00
シンガポールドル	買建	40,000.00	3,644,000	3,644,800	0.00
イスラエルシケル	買建	50,000.00	1,538,400	1,540,500	0.00

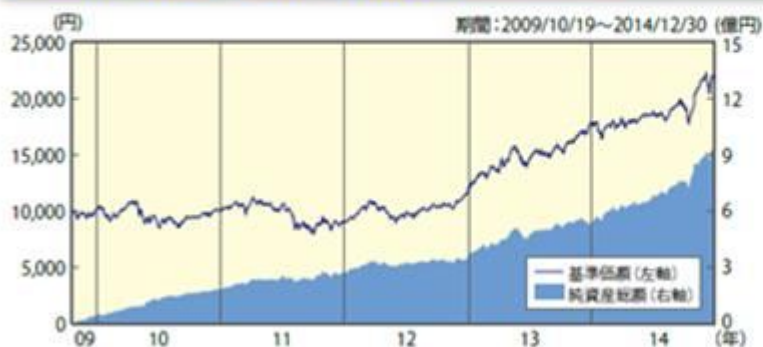
(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日2014年12月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	22,071円
純資産総額	9億円

分配の推移

決算期	分配金
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年11月	0円
2011年11月	0円
2010年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2009年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2009年10月19日)から年末までの騰落率を表示しています。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるとき

は、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただきます場合があります。

- (八) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、ニューヨークまたはロンドンの取引所の休業日に当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（0.3%）を差し引いた価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社(電話：0120-88-2976)にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、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け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、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。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、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。)を法令およ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「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(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)。なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「外株指数」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

平成21年10月19日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

イ 信託の終了

（イ）信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回る事となったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a. 分配金額は、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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決

算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

八 信託約款の変更等

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)

(ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの

意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 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。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

受益者は、持分にに応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかか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または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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）ならびに同規則第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6期（平成25年12月 3日から平成26年12月 1日まで）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【財務諸表】

【外国株式指数ファンド】

(1) 【貸借対照表】

	(単位 : 円)	
	第5期 (平成25年12月 2日現在)	第6期 (平成26年12月 1日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	287,537	125,036
親投資信託受益証券	560,235,877	884,513,842
流動資産合計	560,523,414	884,638,878
資産合計	560,523,414	884,638,878
負債の部		
流動負債		
未払解約金	287,241	125,001
未払受託者報酬	161,363	235,442
未払委託者報酬	1,183,247	1,726,510
その他未払費用	16,074	23,488
流動負債合計	1,647,925	2,110,441
負債合計	1,647,925	2,110,441
純資産の部		
元本等		
元本	326,019,588	404,369,859
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	232,855,901	478,158,578
元本等合計	558,875,489	882,528,437
純資産合計	558,875,489	882,528,437
負債純資産合計	560,523,414	884,638,878

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	平成24年12月 1日 至 平成25年12月 2日	自	平成25年12月 3日 至 平成26年12月 1日
営業収益				
受取利息		199		98
有価証券売買等損益		194,297,502		184,026,966
営業収益合計		194,297,701		184,027,064
営業費用				
受託者報酬		288,194		420,970
委託者報酬		2,113,297		3,086,981
その他費用		28,705		41,978
営業費用合計		2,430,196		3,549,929
営業利益又は営業損失 ()		191,867,505		180,477,135
経常利益又は経常損失 ()		191,867,505		180,477,135
当期純利益又は当期純損失 ()		191,867,505		180,477,135
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 ()		41,672,097		15,948,643
期首剰余金又は期首欠損金 ()		29,201,037		232,855,901
剰余金増加額又は欠損金減少額		81,335,430		187,117,361
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		81,335,430		187,117,361
剰余金減少額又は欠損金増加額		27,875,974		106,343,176
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		27,875,974		106,343,176
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		232,855,901		478,158,578

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第6期	
	自 平成25年12月 3日 至 平成26年12月 1日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成25年12月 3日から平成26年12月 1日までとなっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第5期		第6期	
	(平成25年12月 2日現在)		(平成26年12月 1日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	326,019,588口		404,369,859口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7142円	1口当たり純資産額	2.1825円
	(10,000口当たりの純資産額	17,142円)	(10,000口当たりの純資産額	21,825円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第5期		第6期	
	自 平成24年12月 1日 至 平成25年12月 2日		自 平成25年12月 3日 至 平成26年12月 1日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,926,240円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(139,269,168円)、収益調整金(61,416,664円)、および分配準備積立金(21,243,829円)より、分配対象収益は232,855,901円(1万口当たり7,142.38円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,879,574円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(149,648,918円)、収益調整金(201,388,620円)、および分配準備積立金(112,241,466円)より、分配対象収益は478,158,578円(1万口当たり11,824.74円)であります。分配を行っておりません。
----------	--	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自 平成25年12月 3日 至 平成26年12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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (平成26年12月 1日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第5期（自 平成24年12月 1日 至 平成25年12月 2日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	167,543,020円
合計	167,543,020円

第6期（自 平成25年12月 3日 至 平成26年12月 1日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	174,367,083円
合計	174,367,083円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（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。

（その他の注記）

項 目	第5期 （平成25年12月 2日現在）	第6期 （平成26年12月 1日現在）
期首元本額	314,929,796円	326,019,588円
期中追加設定元本額	191,664,261円	224,467,135円
期中一部解約元本額	180,574,469円	146,116,864円

（ 4 ）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	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	311,975,819	884,513,842	
合計		311,975,819	884,513,842	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

外国株式指数ファンドは、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月 2日現在）	（平成26年12月 1日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	2,278,126,899	829,513,654
コール・ローン	696,920,310	181,798,534
株式	232,938,954,261	200,949,370,489
投資証券	4,683,460,034	4,733,101,732
派生商品評価勘定	10,134,849	26,991,358
未収入金	12,247,474	4,918,326,026
未収配当金	499,398,671	433,029,352
未収利息	572	49
差入委託証拠金	1,315,705,480	1,166,289,677
流動資産合計	242,434,948,550	213,238,420,871
資産合計	242,434,948,550	213,238,420,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,142,647	3,220,504
前受金	-	24,861,694
未払金	962,530,048	1,243,469,723
未払解約金	882,201,908	206,234,517
流動負債合計	1,845,874,603	1,477,786,438
負債合計	1,845,874,603	1,477,786,438

（平成25年12月 2日現在）

（平成26年12月 1日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	108,558,675,380	74,690,132,511
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	132,030,398,567	137,070,501,922
元本等合計	240,589,073,947	211,760,634,433
純資産合計	240,589,073,947	211,760,634,433
負債純資産合計	242,434,948,550	213,238,420,871

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成25年12月 3日 至 平成26年12月 1日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成25年12月 2日現在）	（平成26年12月 1日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	108,558,675,380口	74,690,132,511口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2162円 (10,000口当たりの純資産額 22,162円)	1口当たり純資産額 2.8352円 (10,000口当たりの純資産額 28,352円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成25年12月 3日 至 平成26年12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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年12月 1日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月 2日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,215,717,154	-	2,224,618,356	8,901,202
	SP500 13/12	1,426,418,097	-	1,432,293,030	5,874,933
	DJ EUR 13/12	464,166,742	-	467,980,000	3,813,258
	FTSE 13/12	325,132,315	-	324,345,326	786,989
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	1,084,517,000	-	1,084,426,000	91,000
	米ドル	819,520,000	-	819,440,000	80,000
	ユーロ	180,914,500	-	180,908,000	6,500
	オーストラリアドル	84,082,500	-	84,078,000	4,500
合計		3,300,234,154	-	3,309,044,356	8,992,202

（平成26年12月 1日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,744,983,920	-	5,769,845,614	24,861,694
	SP500 1412	3,982,042,215	-	3,992,014,113	9,971,898
	DJ EUR 1412	1,130,412,060	-	1,146,072,111	15,660,051
	FTSE 1412	523,694,325	-	524,412,210	717,885
	SPI200 1412	108,835,320	-	107,347,180	1,488,140
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	152,427,100	-	152,408,600	18,500
	カナダドル	57,101,000	-	57,095,500	5,500
	スイスフラン	76,173,200	-	76,167,000	6,200
	スウェーデンクローナ	1,909,200	-	1,908,000	1,200
	ノルウェークローネ	505,200	-	505,200	-

デンマーククローネ	6,752,400	-	6,752,400	-
ニュージーランドドル	2,781,000	-	2,780,100	900
香港ドル	7,205,100	-	7,200,400	4,700
売建	510,312,660	-	511,385,000	1,072,340
米ドル	281,963,700	-	282,934,400	970,700
ユーロ	115,175,660	-	115,291,800	116,140
英ポンド	42,665,000	-	42,662,700	2,300
オーストラリアドル	68,374,000	-	68,360,400	13,600
イスラエルシケル	2,134,300	-	2,135,700	1,400
合計	6,407,723,680	-	6,433,639,214	23,770,854

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に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います。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います。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(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。

(その他の注記)

（平成25年12月 2日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	160,022,839,752円
同期中における追加設定元本額	2,519,494,212円
同期中における一部解約元本額	53,983,658,584円
平成25年12月 2日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	5,705,108,226円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	171,246,592円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	761,123,107円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	513,344,105円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	27,733,326円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,670,921円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,288,144円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,306,581円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,920,747円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,648,381円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,377,156円
外国株式指数ファンド	252,791,209円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	11,884,168円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	21,241,797,836円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	174,379,226円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	14,215,377,893円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	6,637,568,257円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,759,200,718円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	15,811,462,327円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	50,275,477円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	231,742,484円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	37,961,744円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,923,319,726円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	129,048,689円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	384,874,235円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,838,904,052円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	3,147,974,182円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	4,338,201,355円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	672,794,545円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,745,274,216円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	5,077,379,559円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	340,831,147円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,065,964,251円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	17,409,380,502円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	56,107,607円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	34,442,671円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	15,764,509円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	135,888,437円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	314,377,080円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	295,320,338円

S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	946,138円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	6,673,516円
合計	108,558,675,380円

(平成26年12月 1日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	108,558,675,380円
同期中における追加設定元本額	3,558,606,842円
同期中における一部解約元本額	37,427,149,711円
平成26年12月 1日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	7,218,053,555円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	156,419,849円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	694,912,070円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	485,630,554円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	33,048,194円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,372,866円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	4,329,278円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	5,401,234円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	9,149,276円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	4,498,394円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	10,040,534円
外国株式指数ファンド	311,975,819円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	38,564,424円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	12,247,853,458円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	112,288,435円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,777,868,852円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,394,734,365円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,084,646,722円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,855,634,740円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	39,937,480円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	200,381,560円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	26,226,513円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,662,270,927円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	106,877,412円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	309,935,295円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,494,310,783円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,723,666,877円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,483,367,738円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	392,781,280円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,375,301,798円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,762,002,851円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	272,982,416円
S M A M ・ バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	331,659,490円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,028,936,067円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	44,410,875円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	26,383,184円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,292,400円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	105,831,427円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	229,675,217円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	220,803,274円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	575,472円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	5,139,657円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 >	376,312円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	387,583,587円
合計	74,690,132,511円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	28,469	79.15	2,253,321.35	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,800	46.92	131,376.00	
	APACHE CORPORATION	21,563	64.09	1,381,972.67	
	BAKER HUGHES INC	24,776	57.00	1,412,232.00	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,293	33.04	736,560.72	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,443	51.28	586,797.04	
	CHENIERE ENERGY INC	12,863	65.99	848,829.37	
	CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	29,438	20.26	596,413.88	
	CHEVRON CORPORATION	105,879	108.87	11,527,046.73	
	CIMAREX ENERGY CO	4,866	104.95	510,686.70	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,725	9.00	159,525.00	
	CONCHO RESOURCES INC	6,189	95.25	589,502.25	
	CONOCOPHILLIPS	68,262	66.07	4,510,070.34	
	CONSOL ENERGY INC	12,655	39.13	495,190.15	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,714	40.98	234,159.72	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,638	128.83	339,853.54	
	DENBURY RESOURCES INC	21,916	8.26	181,026.16	
DEVON ENERGY CORPORATION	21,188	58.97	1,249,456.36		

DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	3,594	29.37	105,555.78
ENERGEN CORPORATION	4,400	59.72	262,768.00
ENSCO PLC-CL A	12,455	33.80	420,979.00
EOG RESOURCES INC	30,242	86.72	2,622,586.24
EQT CORPORATION	8,471	90.98	770,691.58
EXXON MOBIL CORPORATION	238,098	90.54	21,557,392.92
FMC TECHNOLOGIES INC	13,132	47.77	627,315.64
HALLIBURTON CO	47,618	42.20	2,009,479.60
HELMERICH & PAYNE INC	6,052	69.55	420,916.60
HESS CORPORATION	15,738	72.93	1,147,772.34
HOLLYFRONTIER CORP	9,973	40.82	407,097.86
KINDER MORGAN INC	85,992	41.35	3,555,769.20
KINDER MORGAN INC N	16,154	41.35	667,967.90
MARATHON OIL CORP	37,715	28.92	1,090,717.80
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	15,842	90.09	1,427,205.78
MURPHY OIL CORPORATION	9,071	48.42	439,217.82
NABORS INDUSTRIES LTD	15,776	13.12	206,981.12
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	23,996	67.04	1,608,691.84
NOBLE CORPORATION PLC	13,895	17.99	249,971.05
NOBLE ENERGY INC	20,341	49.18	1,000,370.38
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,963	79.77	3,506,928.51
OCEANEERING INTL INC	5,931	62.71	371,933.01
ONEOK INC	12,236	54.16	662,701.76
PHILLIPS 66	31,217	73.02	2,279,465.34
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,935	143.23	1,136,530.05
QEP RESOURCES INC	9,623	20.44	196,694.12
RANGE RESOURCES CORPORATION	9,739	65.65	639,365.35
SCHLUMBERGER LTD	72,117	85.95	6,198,456.15
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	19,747	32.18	635,458.46
SPECTRA ENERGY CORPORATION	37,514	37.88	1,421,030.32
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	8,900	19.31	171,859.00
TESORO CORPORATION	7,556	76.62	578,940.72
VALERO ENERGY CORP	28,839	48.61	1,401,863.79
WEATHERFORD INTL PLC	42,360	13.10	554,916.00
WHITING PETROLEUM CORP	6,889	41.77	287,753.53

WILLIAMS COS INC	39,469	51.75	2,042,520.75	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,127	143.83	1,744,226.41	
AIRGAS INC	3,636	115.63	420,430.68	
ALBEMARLE CORPORATION	4,625	59.04	273,060.00	
ALCOA INC	66,629	17.29	1,152,015.41	
ASHLAND INC	3,913	114.05	446,277.65	
AVERY DENNISON CORP	5,910	49.51	292,604.10	
BALL CORPORATION	7,163	67.07	480,422.41	
CELANESE CORPORATION	9,084	60.07	545,675.88	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,703	268.15	724,809.45	
CROWN HOLDINGS INC	8,532	49.50	422,334.00	
DOW CHEMICAL	66,675	48.67	3,245,072.25	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	50,690	71.40	3,619,266.00	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,365	82.92	693,625.80	
ECOLAB INC	15,391	108.95	1,676,849.45	
FMC CORPORATION	6,826	54.40	371,334.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	58,116	26.85	1,560,414.60	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,263	53.82	1,252,014.66	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,523	101.17	457,591.91	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,435	78.86	1,926,944.10	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,293	120.04	395,291.72	
MEADWESTVACO CORP	9,637	44.80	431,737.60	
MONSANTO CO	29,046	119.91	3,482,905.86	
MOSAIC CO/THE	18,647	45.77	853,473.19	
NEWMONT MINING CORP	26,108	18.40	480,387.20	
NUCOR CORP	18,161	53.63	973,974.43	
OWENS-ILLINOIS INC	8,965	25.64	229,862.60	
PPG INDUSTRIES INC	7,729	218.82	1,691,259.78	
PRAXAIR INC	16,524	128.38	2,121,351.12	
ROCK-TENN COMPANY CL A	7,410	56.81	420,962.10	
SEALED AIR CORP	11,262	39.53	445,186.86	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,503	244.86	1,102,604.58	
SIGMA-ALDRICH	6,398	136.60	873,966.80	
VULCAN MATERIALS CO	7,064	66.10	466,930.40	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,815	63.60	179,034.00	

3M COMPANY	34,201	160.09	5,475,238.09
AGCO CORP	4,954	42.19	209,009.26
AMETEK INC	13,343	50.96	679,959.28
BE AEROSPACE INC	6,262	77.87	487,621.94
BOEING CO	38,021	134.36	5,108,501.56
CATERPILLAR INC	33,537	100.60	3,373,822.20
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	5,371	50.03	268,711.13
CUMMINS INC	9,913	145.62	1,443,531.06
DANAHER CORP	34,845	83.56	2,911,648.20
DEERE & CO	19,348	86.62	1,675,923.76
DOVER CORP	9,470	76.99	729,095.30
EATON CORP PLC	26,716	67.83	1,812,146.28
EMERSON ELECTRIC CO	38,493	63.75	2,453,928.75
FASTENAL COMPANY	16,523	45.20	746,839.60
FLOWERVE CORPORATION	7,650	58.87	450,355.50
FLUOR CORP	9,363	61.99	580,412.37
GENERAL DYNAMICS CORP	15,649	145.36	2,274,738.64
GENERAL ELECTRIC CO	559,764	26.49	14,828,148.36
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	42,020	99.07	4,162,921.40
ILLINOIS TOOL WORKS	21,106	94.93	2,003,592.58
INGERSOLL-RAND PLC	15,356	63.06	968,349.36
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,290	46.45	338,620.50
JOY GLOBAL INC	6,011	49.04	294,779.44
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	5,188	124.60	646,424.80
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,901	191.56	2,854,435.56
MASCO CORP	21,437	24.20	518,775.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,800	140.93	1,522,044.00
PACCAR INC	20,089	67.02	1,346,364.78
PALL CORPORATION	6,006	96.11	577,236.66
PARKER HANNIFIN CORPORATION	8,382	129.03	1,081,529.46
PENTAIR PLC-REGISTERED	10,819	64.71	700,097.49
PRECISION CASTPARTS CORP	7,877	237.90	1,873,938.30
QUANTA SERVICES INC	10,839	30.50	330,589.50
RAYTHEON COMPANY	17,542	106.70	1,871,731.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,012	115.41	924,664.92

ROCKWELL COLLINS INC.	7,337	85.53	627,533.61
ROPER INDUSTRIES INC	5,376	157.82	848,440.32
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,135	49.57	452,821.95
SNAP-ON INC	3,055	135.33	413,433.15
SPX CORP	1,648	89.69	147,809.12
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,107	94.44	765,625.08
TEXTRON INC	15,664	43.32	678,564.48
TRANSDIGM GROUP INC	3,025	197.79	598,314.75
UNITED RENTALS INC	5,162	113.31	584,906.22
UNITED TECHNOLOGIES CORP	48,279	110.08	5,314,552.32
WABTEC CORP	5,100	88.49	451,299.00
WW GRAINGER INC	3,470	245.68	852,509.60
XYLEM INC	11,066	38.34	424,270.44
CINTAS CORP	5,948	73.15	435,096.20
DUN & BRADSTREET CORP	1,961	126.95	248,948.95
EQUIFAX INC	7,202	79.55	572,919.10
IHS INC-CLASS A	3,519	122.46	430,936.74
MANPOWERGROUP	4,458	66.86	298,061.88
NIELSEN NV	16,800	41.77	701,736.00
REPUBLIC SERVICES INC	15,678	39.61	621,005.58
ROBERT HALF INTL INC	7,741	56.79	439,611.39
STERICYCLE, INC.	5,008	128.92	645,631.36
THE ADT CORPORATION	10,726	34.94	374,766.44
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,710	112.96	419,081.60
TYCO INTERNATIONAL PLC	24,445	42.90	1,048,690.50
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,004	61.98	496,087.92
WASTE MANAGEMENT INC	25,089	48.73	1,222,586.97
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,472	48.53	508,206.16
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	8,380	73.74	617,941.20
CSX CORPORATION	54,975	36.49	2,006,037.75
DELTA AIR LINES INC	12,520	46.67	584,308.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,140	46.82	474,754.80
FEDEX CORP	15,175	178.18	2,703,881.50
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,601	23.74	560,287.74
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,395	82.53	445,249.35

KANSAS CITY SOUTHERN	6,457	118.94	767,995.58
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,391	111.64	1,941,531.24
SOUTHWEST AIRLINES	9,271	41.82	387,713.22
UNION PACIFIC CORP	49,899	116.77	5,826,706.23
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,700	61.23	349,011.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39,172	109.92	4,305,786.24
AUTOLIV INC	5,400	98.96	534,384.00
BORGWARNER INC	12,772	56.56	722,384.32
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,754	72.95	1,222,204.30
FORD MOTOR COMPANY	203,953	15.73	3,208,180.69
GENERAL MOTORS CO	72,206	33.43	2,413,846.58
HARLEY-DAVIDSON INC	12,359	69.68	861,175.12
JOHNSON CONTROLS INC	37,944	50.00	1,897,200.00
TESLA MOTORS INC	4,828	244.52	1,180,542.56
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,292	103.40	650,592.80
COACH INC	15,852	37.12	588,426.24
D.R.HORTON INC	17,613	25.49	448,955.37
FOSSIL GROUP INC	2,431	111.72	271,591.32
GARMIN LTD	6,916	57.30	396,286.80
HANESBRANDS INC	5,533	115.72	640,278.76
HASBRO INC	6,173	59.20	365,441.60
JARDEN CORP	9,645	44.15	425,826.75
LEGGETT & PLATT INC	8,415	42.09	354,187.35
LENNAR CORP-CL A	10,658	47.24	503,483.92
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	48.19	263,165.59
MATTEL INC	20,080	31.55	633,524.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	11,029	76.71	846,034.59
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,537	153.59	543,247.83
NEWELL RUBBERMAID INC	15,622	36.31	567,234.82
NIKE INC -CL B	38,268	99.29	3,799,629.72
POLARIS INDUSTRIES INC	3,576	156.71	560,394.96
PULTE GROUP INC	20,065	21.63	434,005.95
PVH CORP	4,700	127.14	597,558.00
RALPH LAUREN CORPORATION	3,676	184.90	679,692.40
TOLL BROTHERS INC	10,382	34.99	363,266.18

UNDER ARMOUR INC	9,441	72.49	684,378.09
VF CORP	18,815	75.17	1,414,323.55
WHIRLPOOL CORP	4,441	186.17	826,780.97
CARNIVAL CORP	22,007	44.16	971,829.12
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,768	663.62	1,173,280.16
DARDEN RESTAURANTS INC	7,021	56.99	400,126.79
H&R BLOCK INC	15,750	33.64	529,830.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23,182	26.22	607,832.04
LAS VEGAS SANDS CORP	22,886	63.69	1,457,609.34
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,686	78.79	999,529.94
MCDONALD'S CORPORATION	54,544	96.81	5,280,404.64
MGM MIRAGE	21,220	22.81	484,028.20
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	5,213	43.89	228,798.57
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,518	73.74	701,857.32
STARBUCKS CORP	42,591	81.21	3,458,815.11
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,700	79.00	845,300.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,945	83.36	578,935.20
WYNN RESORTS LTD	4,750	178.61	848,397.50
YUM! BRANDS INC	25,174	77.25	1,944,691.50
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	20.32	197,347.84
CBS CORP-CL B	26,643	54.88	1,462,167.84
CHARTER COMMUNICATTION-A	4,330	169.70	734,801.00
COMCAST CORP-CL A	119,585	57.04	6,821,128.40
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	23,816	56.81	1,352,986.96
DIRECTV	26,861	87.71	2,355,978.31
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	8,023	34.90	280,002.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	15,914	34.01	541,235.14
DISH NETWORK CORP.	12,039	79.41	956,016.99
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,848	20.29	443,295.92
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13,858	51.99	720,477.42
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,325	49.92	1,813,344.00
LIBERTY MEDIA CORP-A	5,806	36.77	213,486.62
LIBERTY MEDIA CORP-C	11,612	36.53	424,186.36
NEWS CORP-CLASS A	20,668	15.52	320,767.36
OMNICOM GROUP	14,538	77.27	1,123,351.26

SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,192	78.17	327,688.64
SIRIUS XM HOLDINGS INC	145,508	3.63	528,194.04
THE WALT DISNEY CO.	90,805	92.51	8,400,370.55
TIME WARNER CABLE, INC.	15,669	149.28	2,339,068.32
TIME WARNER INC	47,799	85.12	4,068,650.88
TWENTY-FIRST CE CL-A	76,852	36.80	2,828,153.60
TWENTY-FIRST CE CL-B	24,468	35.36	865,188.48
VIACOM INC-CLASS B	20,343	75.63	1,538,541.09
ADVANCE AUTO PARTS	3,928	147.08	577,730.24
AMAZON.COM INC	21,856	338.64	7,401,315.84
AUTONATION INC	4,300	59.44	255,592.00
AUTOZONE INC	1,864	577.71	1,076,851.44
BED BATH & BEYOND INC	11,352	73.37	832,896.24
BEST BUY COMPANY INC	15,681	39.41	617,988.21
CARMAX INC	12,939	56.98	737,264.22
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,100	50.61	258,111.00
DOLLAR GENERAL CORP	17,470	66.74	1,165,947.80
DOLLAR TREE INC	11,773	68.36	804,802.28
EXPEDIA INC	5,959	87.11	519,088.49
FAMILY DOLLAR STORES	5,804	79.05	458,806.20
FOOT LOCKER INC	7,571	57.29	433,742.59
GAMESTOP CORP-CL A	6,747	37.81	255,104.07
GAP INC/THE	12,463	39.60	493,534.80
GENUINE PARTS CO	8,219	102.78	844,748.82
HOME DEPOT INC	74,903	99.40	7,445,358.20
KOHL'S CORP	11,926	59.62	711,028.12
L BRANDS INC	13,442	80.90	1,087,457.80
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	24,098	29.15	702,456.70
LKQ CORPORATION	18,059	29.05	524,613.95
LOWE'S COMPANIES INC	55,713	63.83	3,556,160.79
MACY'S INC	20,153	64.91	1,308,131.23
NETFLIX INC	3,093	346.59	1,072,002.87
NORDSTROM INC	8,111	76.36	619,355.96
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,609	182.74	1,024,988.66
PETSMART INC	4,993	78.76	393,248.68

PRICELINE GROUP INC/THE	2,903	1,160.19	3,368,031.57
ROSS STORES INC	11,444	91.48	1,046,897.12
SIGNET JEWELERS LTD	4,054	130.96	530,911.84
STAPLES INC	34,362	14.06	483,129.72
TARGET CORP	33,884	74.00	2,507,416.00
TIFFANY & CO	7,034	107.92	759,109.28
TJX COMPANIES INC	38,208	66.16	2,527,841.28
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,068	76.93	620,671.24
TRIPADVISOR INC-W/I	7,172	73.65	528,217.80
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	3,420	126.49	432,595.80
URBAN OUTFITTERS, INC.	5,837	32.32	188,651.84
COSTCO WHOLESALE CORP	24,259	142.12	3,447,689.08
CVS HEALTH CORPORATION	64,375	91.36	5,881,300.00
KROGER CO	25,882	59.84	1,548,778.88
SAFEWAY INC	12,782	34.84	445,324.88
SYSCO CORP	32,810	40.26	1,320,930.60
WAL-MART STORES INC	89,717	87.54	7,853,826.18
WALGREEN CO	50,305	68.61	3,451,426.05
WHOLE FOODS MARKET INC	20,631	49.03	1,011,537.93
ALTRIA GROUP INC	110,208	50.26	5,539,054.08
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	35,441	52.68	1,867,031.88
BROWN-FORMAN CORPORATION	6,992	97.05	678,573.60
BUNGE LIMITED	8,416	90.77	763,920.32
CAMPBELL SOUP CO	11,696	45.28	529,594.88
COCA-COLA CO/THE	219,935	44.83	9,859,686.05
COCA-COLA ENTERPRISES INC	13,884	43.94	610,062.96
CONAGRA FOODS INC	24,061	36.52	878,707.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,957	96.40	959,854.80
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	10,914	74.00	807,636.00
GENERAL MILLS INC	34,186	52.75	1,803,311.50
HORMEL FOODS CORPORATION	8,006	53.08	424,958.48
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,924	102.57	607,624.68
KELLOGG CO	15,100	66.25	1,000,375.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	6,718	142.14	954,896.52
KRAFT FOODS GROUP INC	34,010	60.17	2,046,381.70

LORILLARD INC	19,578	63.14	1,236,154.92
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,922	74.33	514,512.26
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	11,392	103.84	1,182,945.28
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,238	77.35	637,209.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	95,218	39.20	3,732,545.60
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	7,792	112.15	873,872.80
PEPSICO INC	83,904	100.10	8,398,790.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	86,947	86.93	7,558,302.71
REYNOLDS AMERICAN INC	17,836	65.91	1,175,570.76
THE HERSHEY COMPANY	8,367	100.28	839,042.76
TYSON FOODS INC-CL A	17,523	42.34	741,923.82
AVON PRODUCTS INC	24,724	9.78	241,800.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,765	76.71	595,653.15
CLOROX COMPANY	7,510	101.62	763,166.20
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	51,556	69.59	3,587,782.04
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,697	130.02	480,683.94
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,779	74.14	947,435.06
HERBALIFE LTD	3,974	43.25	171,875.50
KIMBERLY-CLARK CORP	21,135	116.59	2,464,129.65
PROCTER & GAMBLE CO	151,011	90.43	13,655,924.73
ABBOTT LABORATORIES	83,295	44.51	3,707,460.45
AETNA INC	19,828	87.24	1,729,794.72
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,547	91.05	1,142,404.35
BARD(C.R.) INC	4,173	167.35	698,351.55
BAXTER INTERNATIONAL INC	30,288	73.00	2,211,024.00
BECTON DICKINSON & CO	10,955	140.33	1,537,315.15
BOSTON SCIENTIFIC CORP	75,565	12.87	972,521.55
CARDINAL HEALTH INC	19,004	82.19	1,561,938.76
CAREFUSION CORPORATION	11,343	59.17	671,165.31
CERNER CORP	17,655	64.40	1,136,982.00
CIGNA CORP	14,752	102.89	1,517,833.28
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,544	168.90	429,681.60
COVIDIEN PLC	25,390	101.00	2,564,390.00
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,790	76.53	749,228.70
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,361	54.98	459,687.78

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,929	129.68	768,872.72
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	42,058	83.15	3,497,122.70
HCA HOLDINGS, INC.	17,182	69.69	1,197,413.58
HENRY SCHEIN INC	4,877	137.20	669,124.40
HOLOGIC INC	13,288	26.80	356,118.40
HUMANA INC.	8,625	137.97	1,189,991.25
INTUITIVE SURGICAL INC	2,050	517.77	1,061,428.50
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,792	104.64	501,434.88
MALLINCKRODT PLC	6,721	92.22	619,810.62
MCKESSON CORP	13,227	210.76	2,787,722.52
MEDTRONIC INC	54,771	73.87	4,045,933.77
OMNICARE INC	5,368	70.32	377,477.76
PATTERSON COS INC	5,002	48.18	240,996.36
QUEST DIAGNOSTICS	7,894	65.31	515,557.14
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	3,573	57.82	206,590.86
RESMED INC	8,017	53.20	426,504.40
ST JUDE MEDICAL INC	15,984	67.96	1,086,272.64
STRYKER CORP	19,098	92.91	1,774,395.18
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,975	98.63	5,323,554.25
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,286	104.62	553,021.32
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,543	88.51	490,610.93
WELLPOINT INC	15,552	127.91	1,989,256.32
ZIMMER HOLDINGS INC	9,445	112.29	1,060,579.05
ABBVIE INC	88,496	69.20	6,123,923.20
ACTAVIS PLC	14,648	270.61	3,963,895.28
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,417	42.74	829,882.58
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,061	194.90	2,155,788.90
ALLERGAN INC	16,617	213.89	3,554,210.13
AMGEN INC	42,474	165.31	7,021,376.94
BIOGEN IDEC INC	13,204	307.69	4,062,738.76
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,307	89.72	745,304.04
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	92,704	59.05	5,474,171.20
CELGENE CORP	44,397	113.69	5,047,494.93
ELI LILLY & CO	56,228	68.12	3,830,251.36
ENDO INTERNATIONAL PLC	8,152	73.17	596,481.84

GILEAD SCIENCES INC	84,180	100.32	8,444,937.60
HOSPIRA INC	10,089	59.64	601,707.96
ILLUMINA INC	7,763	190.89	1,481,879.07
INCYTE CORP	8,151	75.55	615,808.05
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,229	177.09	571,823.61
JOHNSON & JOHNSON	157,535	108.25	17,053,163.75
MEDIVATION INC	4,057	115.89	470,165.73
MERCK & CO. INC.	160,716	60.40	9,707,246.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,655	293.26	485,345.30
MYLAN INC	20,710	58.61	1,213,813.10
PERRIGO CO PLC	7,552	160.19	1,209,754.88
PFIZER INC	353,439	31.15	11,009,624.85
PHARMACYCLICS INC	3,386	139.39	471,974.54
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,432	416.11	1,844,199.52
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	3,294	102.69	338,260.86
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,330	129.29	2,887,045.70
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,313	117.88	1,569,336.44
WATERS CORP	4,743	115.90	549,713.70
ZOETIS INC	28,117	44.93	1,263,296.81
BANK OF AMERICA CORP	585,975	17.04	9,985,014.00
BB & T CORPORATION	40,093	37.59	1,507,095.87
CIT GROUP INC	9,868	48.80	481,558.40
CITIGROUP INC	168,883	53.97	9,114,615.51
COMERICA INC	10,546	46.61	491,549.06
FIFTH THIRD BANCORP	46,647	20.12	938,537.64
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	51.53	365,863.00
HUDSON CITY BANCORP INC	24,896	9.79	243,731.84
HUNTINGTON BANCSHARES INC	46,577	10.11	470,893.47
JPMORGAN CHASE & CO	209,740	60.16	12,617,958.40
KEYCORP	48,725	13.50	657,787.50
M & T BANK CORP	6,641	126.02	836,898.82
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	25,864	15.89	410,978.96
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,000	14.78	266,040.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,649	87.47	2,680,868.03
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	80,864	10.07	814,300.48

SUNTRUST BANKS INC	29,212	39.29	1,147,739.48
US BANCORP	99,973	44.20	4,418,806.60
WELLS FARGO & COMPANY	276,670	54.48	15,072,981.60
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,225	203.59	656,577.75
ALLY FINANCIAL INC	19,351	23.78	460,166.78
AMERICAN EXPRESS COMPANY	52,288	92.42	4,832,456.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,468	131.77	1,379,368.36
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	62,410	40.03	2,498,272.30
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	64,048	148.69	9,523,297.12
BLACKROCK INC	7,328	359.08	2,631,338.24
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31,387	83.20	2,611,398.40
CME GROUP INC.	17,816	84.64	1,507,946.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,790	65.55	1,690,534.50
EATON VANCE CORP	7,200	41.79	300,888.00
FRANKLIN RESOURCES INC	22,551	56.86	1,282,249.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,172	188.41	4,177,426.52
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,412	225.99	1,449,047.88
INVESCO LIMITED	25,372	40.36	1,024,013.92
LEGG MASON INC	5,828	56.75	330,739.00
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	18,435	23.13	426,401.55
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	14,774	93.46	1,380,778.04
MOODY'S CORP	10,824	101.01	1,093,332.24
MORGAN STANLEY	82,338	35.18	2,896,650.84
NASDAQ STOCK MARKET INC	7,302	44.91	327,932.82
NAVIENT CORPORATION	22,825	20.96	478,412.00
NORTHERN TRUST CORP	12,514	67.73	847,573.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,761	56.30	380,644.30
SCHWAB (CHARLES) CORP	65,700	28.32	1,860,624.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,870	39.63	351,518.10
STATE STREET CORP	23,229	76.73	1,782,361.17
SYNCHRONY FINANCIAL	8,299	29.01	240,753.99
T ROWE PRICE GROUP INC	14,709	83.47	1,227,760.23
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,306	34.61	529,740.66
ACE LIMITED	18,466	114.34	2,111,402.44
AFLAC INC	25,361	59.73	1,514,812.53

ALLEGHANY CORPORATION	917	456.54	418,647.18
ALLSTATE CORP	24,273	68.15	1,654,204.95
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	80,699	54.80	4,422,305.20
AON PLC	15,731	92.49	1,454,960.19
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	8,038	57.32	460,738.16
ASSURANT INC	4,530	67.59	306,182.70
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,302	50.05	315,415.10
CHUBB CORP	13,447	103.05	1,385,713.35
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,693	50.95	442,908.35
EVEREST RE GROUP LTD	2,388	175.39	418,831.32
FNF GROUP	14,714	32.40	476,733.60
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	29,830	9.09	271,154.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,529	41.30	1,054,347.70
LINCOLN NATIONAL CORP	13,994	56.63	792,480.22
LOEWS CORPORATION	19,062	41.64	793,741.68
MARSH & MCLENNAN COS	30,777	56.59	1,741,670.43
METLIFE INC	54,023	55.61	3,004,219.03
PARTNERRE LTD	2,297	116.51	267,623.47
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,434	53.27	875,439.18
PROGRESSIVE CORP	31,378	27.24	854,736.72
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,204	84.98	2,141,835.92
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,640	97.92	258,508.80
TORCHMARK CORPORATION	7,768	53.75	417,530.00
TRAVELERS COS INC(THE)	18,990	104.45	1,983,505.50
UNUM GROUP	13,692	33.22	454,848.24
VOYA FINANCIAL INC	10,875	41.88	455,445.00
W.R.BERKLEY CORPORATION	6,084	52.24	317,828.16
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,834	42.71	420,010.14
XL GROUP PLC	14,846	35.52	527,329.92
CBRE GROUP INC-A	16,260	33.74	548,612.40
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,638	83.09	1,548,631.42
REALOGY HOLDINGS CORP	8,997	46.02	414,041.94
WEYERHAEUSER CO	29,581	35.31	1,044,505.11
ACCENTURE PLC-CL A	35,297	86.33	3,047,190.01
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,083	21.65	607,996.95

ADOBE SYSTEMS INC	26,992	73.68	1,988,770.56
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,769	64.61	631,175.09
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,179	285.87	908,780.73
ANSYS INC	5,145	83.52	429,710.40
AUTODESK INC	12,924	62.00	801,288.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,891	85.64	2,302,945.24
CA INC	18,979	31.15	591,195.85
CITRIX SYSTEMS INC	9,197	66.31	609,853.07
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	34,110	53.99	1,841,598.90
COMPUTER SCIENCES CORP	8,766	63.38	555,589.08
CONCUR TECHNOLOGIES INC	2,493	128.81	321,123.33
EBAY INC	61,826	54.88	3,393,010.88
ELECTRONIC ARTS INC	17,970	43.93	789,422.10
EQUINIX INC	2,917	227.17	662,654.89
FACEBOOK INC-A	109,904	77.70	8,539,540.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,959	61.19	976,531.21
FIREEYE INC	4,072	30.29	123,340.88
FISERV INC	13,711	71.49	980,199.39
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,491	151.89	682,137.99
GOOGLE INC-CL A	15,781	549.08	8,665,031.48
GOOGLE INC-CL C	16,010	541.83	8,674,698.30
INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,778	162.17	8,559,008.26
INTUIT INC	15,080	93.87	1,415,559.60
LINKEDIN CORP-A	5,966	226.27	1,349,926.82
MASTERCARD INC-CL A	56,080	87.29	4,895,223.20
MICROSOFT CORP	436,976	47.81	20,891,822.56
NETSUITE INC	2,000	105.75	211,500.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,621	15.13	236,345.73
ORACLE CORPORATION	198,450	42.41	8,416,264.50
PAYCHEX INC	17,968	47.41	851,862.88
RACKSPACE HOSTING INC	6,279	45.91	288,268.89
RED HAT INC	10,431	62.15	648,286.65
SALESFORCE.COM, INC.	33,324	59.87	1,995,107.88
SERVICENOW INC	7,818	63.96	500,039.28
SYMANTEC CORPORATION	38,148	26.09	995,281.32

SYNOPSYS INC	9,267	43.39	402,095.13
TERADATA CORP	9,269	45.14	418,402.66
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,409	32.99	343,392.91
TWITTER INC	20,164	41.74	841,645.36
VANTIV INC-CL A	7,426	33.74	250,553.24
VERISIGN INC	6,641	60.10	399,124.10
VISA INC	27,531	258.19	7,108,228.89
VMWARE INC	4,729	87.96	415,962.84
WESTERN UNION COMPANY	31,285	18.58	581,275.30
WORKDAY INC-CLASS A	5,722	87.05	498,100.10
XEROX CORP	60,772	13.96	848,377.12
YAHOO! INC	52,164	51.74	2,698,965.36
AMPHENOL CORPORATION -CL A	17,955	53.63	962,926.65
APPLE INC	334,527	118.93	39,785,296.11
ARROW ELECTRONICS INC	5,088	58.44	297,342.72
AVNET INC	8,075	43.79	353,604.25
CISCO SYSTEMS INC	285,174	27.64	7,882,209.36
CORNING INC	74,754	21.02	1,571,329.08
EMC CORP/MASS	113,435	30.35	3,442,752.25
F5 NETWORKS INC	4,326	129.19	558,875.94
FLEXTRONICS INTL LTD	34,288	11.09	380,253.92
FLIR SYSTEMS INC	8,521	31.73	270,371.33
HARRIS CORP	5,694	71.67	408,088.98
HEWLETT-PACKARD CO	104,586	39.06	4,085,129.16
JUNIPER NETWORKS INC	22,707	22.16	503,187.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,747	65.72	837,732.84
NETAPP INC	18,105	42.55	770,367.75
PALO ALTO NETWORKS INC	3,533	123.00	434,559.00
QUALCOMM INC	93,236	72.90	6,796,904.40
SANDISK CORP	12,538	103.46	1,297,181.48
SEAGATE TECHNOLOGY	18,656	66.11	1,233,348.16
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,565	67.47	712,820.55
TE CONNECTIVITY LTD	23,351	64.20	1,499,134.20
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,945	28.12	420,328.12
WESTERN DIGITAL CORP	12,431	103.27	1,283,749.37

AT&T INC	288,992	35.38	10,224,536.96
CENTURYLINK INC	32,441	40.77	1,322,619.57
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	56,000	7.05	394,800.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,558	50.00	777,900.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,487	121.67	910,943.29
SPRINT CORP	44,034	5.12	225,454.08
T-MOBILE US INC	12,874	29.19	375,792.06
VERIZON COMMUNICATIONS INC	231,091	50.59	11,690,893.69
WINDSTREAM HOLDINGS INC	36,866	10.11	372,715.26
AES CORPORATION	39,828	13.87	552,414.36
ALLIANT ENERGY CORP	6,174	62.87	388,159.38
AMEREN CORPORATION	13,289	43.11	572,888.79
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,766	57.55	1,597,933.30
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,295	53.05	546,149.75
CALPINE CORP	20,101	22.96	461,518.96
CENTERPOINT ENERGY INC	23,324	23.94	558,376.56
CMS ENERGY CORPORATION	15,997	33.10	529,500.70
CONSOLIDATED EDISON INC	15,819	63.15	998,969.85
DOMINION RESOURCES INC/VA	32,101	72.55	2,328,927.55
DTE ENERGY COMPANY	10,178	81.46	829,099.88
DUKE ENERGY CORP	39,966	80.90	3,233,249.40
EDISON INTERNATIONAL	16,752	63.56	1,064,757.12
ENTERGY CORP	9,620	83.90	807,118.00
EXELON CORP	48,080	36.17	1,739,053.60
FIRSTENERGY CORP	22,617	36.88	834,114.96
INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	4,300	72.84	313,212.00
MDU RESOURCES GROUP INC	9,220	24.52	226,074.40
NEXTERA ENERGY INC	24,575	104.39	2,565,384.25
NISOURCE INC	17,471	41.84	730,986.64
NORTHEAST UTILITIES	17,671	50.64	894,859.44
NRG ENERGY INC	19,084	31.26	596,565.84
OGE ENERGY CORP	11,302	35.69	403,368.38
P G & E CORPORATION	26,875	50.50	1,357,187.50
PEPCO HOLDINGS INC	12,800	27.50	352,000.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	6,744	63.23	426,423.12

	PPL CORPORATION	36,931	35.53	1,312,158.43	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	28,904	41.78	1,207,609.12	
	SCANA CORP	7,515	57.03	428,580.45	
	SEMPRA ENERGY	12,751	111.73	1,424,669.23	
	SOUTHERN CO	49,341	47.43	2,340,243.63	
	WISCONSIN ENERGY CORP	13,335	49.40	658,749.00	
	XCEL ENERGY INC	28,139	33.94	955,037.66	
	ALTERA CORPORATION	17,205	37.62	647,252.10	
	ANALOG DEVICES INC	17,570	54.64	960,024.80	
	APPLIED MATERIALS INC	69,203	24.05	1,664,332.15	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	14,111	93.40	1,317,967.40	
	BROADCOM CORP-CL A	30,244	43.13	1,304,423.72	
	CREE INC	7,358	36.34	267,389.72	
	INTEL CORP	275,899	37.25	10,277,237.75	
	KLA-TENCOR CORPORATION	9,042	69.44	627,876.48	
	LAM RESEARCH CORP	9,063	82.64	748,966.32	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	13,480	46.03	620,484.40	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	22,713	14.32	325,250.16	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,785	29.57	466,762.45	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,206	45.15	505,950.90	
	MICRON TECHNOLOGY INC	59,876	35.95	2,152,542.20	
	NVIDIA CORP	30,670	20.97	643,149.90	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	60,188	54.42	3,275,430.96	
	XILINX INC	15,306	45.44	695,504.64	
	米ドル 小計	17,457,407		1,058,635,637.78 (125,861,190,975)	
カナダドル	ALTAGAS LTD	7,500	42.38	317,850.00	
	ARC RESOURCES LTD	18,047	27.04	487,990.88	
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	10,179	24.19	246,230.01	
	CAMECO CORP	23,811	21.26	506,221.86	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	60,042	37.96	2,279,194.32	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	24,518	14.54	356,491.72	
	CENOVUS ENERGY INC	41,842	25.67	1,074,084.14	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,786	29.68	676,288.48	
	ENBRIDGE INC	46,927	52.50	2,463,667.50	

ENCANA CORP	41,794	18.02	753,127.88
ENERPLUS CORP	13,590	14.84	201,675.60
HUSKY ENERGY INC	18,209	24.18	440,293.62
IMPERIAL OIL LTD	16,757	49.58	830,812.06
INTER PIPELINE LTD	19,052	32.62	621,476.24
KEYERA CORP	4,603	84.99	391,208.97
MEG ENERGY CORPORATION	8,587	18.57	159,460.59
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	18,164	11.05	200,712.20
PARAMOUNT RESOURCES LTD	3,281	37.28	122,315.68
PEMBINA PIPELINE CORP	18,218	38.96	709,773.28
PENN WEST PETROLEUM LTD	30,053	4.07	122,315.71
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,690	33.58	291,810.20
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,411	34.42	255,086.62
SUNCOR ENERGY INC	82,957	36.11	2,995,577.27
TALISMAN ENERGY INC	60,153	5.45	327,833.85
TOURMALINE OIL CORP	10,145	38.00	385,510.00
TRANSCANADA CORP	38,885	54.45	2,117,288.25
VERMILION ENERGY INC	5,586	53.28	297,622.08
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,631	26.68	310,315.08
AGRIUM INC	8,150	110.38	899,597.00
BARRICK GOLD CORP	64,601	13.54	874,697.54
ELDORADO GOLD CORPORATION	38,218	7.13	272,494.34
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	35,370	18.60	657,882.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,768	57.21	501,617.28
GOLDCORP INC	47,178	22.40	1,056,787.20
KINROSS GOLD CORP	73,243	3.17	232,180.31
METHANEX CORPORATION	5,655	57.52	325,275.60
NEW GOLD INC	27,084	4.56	123,503.04
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,369	39.31	1,783,455.39
SILVER WHEATON CORPORATION	20,420	22.58	461,083.60
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	29,597	17.64	522,091.08
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	36,017	3.72	133,983.24
YAMANA GOLD INC	51,365	4.13	212,137.45
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	4.36	350,949.48
CAE INC	16,932	15.14	256,350.48

FINNING INTERNATIONAL INC	9,139	25.37	231,856.43
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,151	43.22	395,506.22
CANADIAN NATL RAILWAY CO	45,343	81.23	3,683,211.89
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,664	220.56	2,131,491.84
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,103	122.30	1,480,196.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,984	66.12	461,782.08
TIM HORTONS INC	7,010	95.31	668,123.10
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,938	30.87	677,226.06
THOMSON REUTERS CORP	20,243	45.60	923,080.80
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,045	128.31	519,013.95
DOLLARAMA INC	6,930	53.58	371,309.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	24,455	40.50	990,427.50
EMPIRE CO LTD A	2,745	83.17	228,301.65
LOBLAW COMPANIES LTD	12,325	61.51	758,110.75
METRO INC	4,833	89.31	431,635.23
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	100.75	249,154.75
SAPUTO INC	15,292	33.15	506,929.80
CATAMARAN CORPORATION	12,066	57.77	697,052.82
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	17,586	166.40	2,926,310.40
BANK OF MONTREAL	35,652	83.86	2,989,776.72
BANK OF NOVA SCOTIA	68,060	70.50	4,798,230.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,827	106.49	2,324,357.23
NATIONAL BANK OF CANADA	17,956	53.13	954,002.28
ROYAL BANK OF CANADA	80,133	83.16	6,663,860.28
TORONTO-DOMINION BANK	102,290	57.62	5,893,949.80
CI FINANCIAL CORP	14,311	33.87	484,713.57
IGM FINANCIAL INC	5,296	47.52	251,665.92
ONEX CORPORATION	4,665	64.89	302,711.85
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,174	581.00	682,094.00
GREAT-WEST LIFECO INC	16,674	33.87	564,748.38
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	5,692	47.41	269,857.72
INTACT FINANCIAL CORPORATION	7,714	79.38	612,337.32
MANULIFE FINANCIAL CORP	104,114	22.77	2,370,675.78
POWER CORP OF CANADA	22,880	32.43	741,998.40
POWER FINANCIAL CORP	14,030	35.75	501,572.50

	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,345	42.43	1,414,828.35	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	31,663	57.49	1,820,305.87	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	18.72	74,880.00	
	CGI GROUP INC - CL A	12,761	41.68	531,878.48	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,027	331.56	340,512.12	
	OPEN TEXT CORPORATION	6,339	67.70	429,150.30	
	BLACKBERRY LIMITED	27,051	11.85	320,554.35	
	BCE INC	15,338	53.34	818,128.92	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,778	45.77	905,239.06	
	TELUS CORPORATION	12,290	43.28	531,911.20	
	ATCO LTD-CLASS I	5,051	47.70	240,932.70	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,384	39.96	255,104.64	
	FORTIS INC	14,821	40.61	601,880.81	
	TRANSALTA CORP	16,343	11.14	182,061.02	
	カナダドル 小計	2,234,862		85,810,960.26 (8,908,893,894)	
ユーロ	ENI SPA	143,068	16.07	2,299,102.76	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	21,982	9.80	215,423.60	
	NESTE OIL OYJ	7,560	19.08	144,244.80	
	OMV AG	8,399	23.26	195,360.74	
	REPSOL SA	56,524	18.05	1,020,258.20	
	SAIPEM	13,459	11.51	154,913.09	
	TECHNIP S.A.	6,525	52.30	341,257.50	
	TENARIS S.A.	26,519	13.30	352,702.70	
	TOTAL SA	119,082	44.99	5,357,499.18	
	VOPAK	3,334	40.40	134,693.60	
	AIR LIQUIDE	18,992	101.20	1,921,990.40	
	AKZO NOBEL	13,536	55.56	752,060.16	
	ARCELOR MITTAL	56,442	9.86	556,800.33	
	ARKEMA	2,963	54.72	162,135.36	
	BASF SE	50,984	73.01	3,722,341.84	
	CRH PLC	41,878	19.00	795,682.00	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	4,800	33.27	159,696.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	7,746	60.97	472,273.62	
	IMERYS SA	2,213	60.80	134,550.40	

K+S AG	9,644	24.13	232,757.94
KONINKLIJKE DSM NV	9,888	52.87	522,778.56
LAFARGE SA	10,753	57.18	614,856.54
LANXESS	5,489	39.93	219,203.21
LINDE AG	10,416	151.75	1,580,628.00
SOLVAY SA	3,141	110.50	347,080.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	28,852	7.12	205,570.50
SYMRISE AG	6,446	48.06	309,826.99
THYSSENKRUPP AG	25,398	21.27	540,342.45
UMICORE	6,244	32.70	204,178.80
UPM-KYMMENE OYJ	28,690	13.35	383,011.50
VOESTALPINE AG	6,670	33.40	222,778.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,023	28.41	284,803.54
AIRBUS GROUP NV	32,326	48.99	1,583,812.37
ALSTOM RGPT	11,766	28.12	330,918.75
ANDRITZ AG	4,044	43.46	175,752.24
BOSKALIS WESTMINSTER NV	4,309	45.12	194,443.62
BOUYGUES SA	10,515	30.25	318,131.32
BRENTAG AG	8,299	44.29	367,562.71
CNH INDUSTRIAL NV	53,303	6.29	335,542.38
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	25,984	36.94	959,848.96
FERROVIAL SA	22,639	16.48	373,090.72
FERROVIAL SA-RTS	24,509	0.38	9,362.43
FINMECCANICA SPA	24,044	7.80	187,543.20
GEA GROUP AG	10,225	38.43	392,946.75
KONE OYJ-B	17,831	37.00	659,747.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	53,957	24.25	1,308,727.03
LEGRAND SA	15,173	42.16	639,769.54
MAN SE	2,168	91.65	198,697.20
METSO OYJ	6,269	24.93	156,286.17
OCI NV	4,649	28.83	134,053.91
OSRAM LICHT AG	4,638	33.40	154,909.20
PRYSMIAN SPA	12,296	14.45	177,677.20
REXEL SA	16,046	14.89	238,924.94
SAFRAN SA	15,205	52.03	791,116.15

SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,943	65.60	1,898,660.80
SIEMENS AG-REG	44,047	95.16	4,191,512.52
THALES SA	6,075	42.67	259,220.25
VALLOUREC	5,478	26.66	146,070.87
VINCI S.A.	27,962	43.47	1,215,647.95
WARTSILA OYJ-B SHARES	7,635	36.02	275,012.70
ZARDOYA OTIS SA	11,776	8.57	100,920.32
ZODIAC AEROSPACE	10,335	26.65	275,427.75
BIC	1,337	107.20	143,326.40
BUREAU VERITAS SA	11,223	19.18	215,313.25
EDENRED	11,277	23.19	261,513.63
RANDSTAD HOLDING NV	7,572	39.68	300,494.82
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	22,678	17.21	390,288.38
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,647	98.69	162,542.43
ATLANTIA SPA	22,079	20.28	447,762.12
BOLLORE	318	397.00	126,246.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,550	14.35	208,865.25
DEUTSCHE POST AG-REG	54,748	26.71	1,462,592.82
FRAPORT AG	2,468	49.11	121,215.82
GROUPE EUROTUNNEL SA	24,524	10.39	254,926.98
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	57,182	5.74	328,624.95
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	8.56	14,178.67
TNT EXPRESS NV	24,478	5.42	132,670.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,370	91.95	1,689,121.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	68.28	196,578.12
CONTINENTAL AG	6,214	169.20	1,051,408.80
DAIMLER AG	54,554	67.80	3,698,761.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	48,903	10.03	490,497.09
MICHELIN (CGDE)-B	10,604	73.95	784,165.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	22.71	126,676.38
PIRELLI & C.	11,369	11.41	129,720.29
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	8,901	70.04	623,426.04
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	10.30	216,815.00
RENAULT SA	10,723	64.52	691,847.96
VALEO	4,009	98.95	396,690.55

VOLKSWAGEN AG	1,615	181.90	293,768.50
VOLKSWAGEN AG PFD	8,938	185.20	1,655,317.60
ADIDAS AG	11,267	64.50	726,721.50
CHRISTIAN DIOR SA	3,236	154.00	498,344.00
HUGO BOSS AG	2,083	105.90	220,589.70
KERING	4,224	166.10	701,606.40
LUXOTTICA GROUP SPA	9,923	43.00	426,689.00
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	15,420	144.50	2,228,190.00
ACCOR SA	9,735	37.93	369,297.22
SODEXO	5,414	81.12	439,183.68
ALTICE SA	4,569	54.10	247,182.90
AXEL SPRINGER SE	2,125	47.35	100,629.37
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,141	26.59	243,104.89
JC DECAUX S.A.	2,962	26.45	78,344.90
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	1,067	111.55	119,023.85
LAGARDERE S.C.A.	7,266	22.80	165,664.80
NUMERICABLE-SFR	5,832	33.61	196,013.52
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	13,409	34.35	460,599.15
PUBLICIS GROUPE	10,413	59.06	614,991.78
REED ELSEVIER NV	39,398	19.77	778,898.46
RTL GROUP	2,200	77.44	170,368.00
SES	17,260	29.92	516,419.20
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,885	45.97	132,623.45
WOLTERS KLUWER-CVA	17,248	23.56	406,449.12
INDITEX	61,114	23.41	1,430,984.31
CARREFOUR SA	35,716	25.44	908,793.62
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,582	77.49	277,569.18
COLRUYT NV	4,338	37.40	162,241.20
DELHAIZE GROUP	6,008	58.79	353,210.32
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	31,663	5.59	176,996.17
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,071	8.17	90,450.07
KONINKLIJKE AHOLD NV	51,066	14.20	725,392.53
METRO AG	8,936	27.31	244,042.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	44,869	94.46	4,238,325.74
DANONE	32,550	56.75	1,847,212.50

HEINEKEN HOLDING NV	5,730	54.99	315,092.70
HEINEKEN NV	13,033	63.25	824,337.25
KERRY GROUP PLC-A	8,897	59.69	531,061.93
PERNOD-RICARD SA	11,825	95.31	1,127,040.75
REMY COINTREAU	1,273	60.47	76,978.31
UNILEVER NV-CVA	90,835	32.75	2,975,300.42
BEIERSDORF AG	5,960	71.58	426,616.80
HENKEL AG & CO KGAA	6,653	79.64	529,844.92
HENKEL AG & CO KGAA	9,930	89.22	885,954.60
L'OREAL	13,851	137.20	1,900,357.20
CELESIO AG	1,870	26.80	50,116.00
ESSILOR INTERNATIONAL	11,648	90.30	1,051,814.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	12,847	59.39	762,983.33
FRESENIUS SE & CO KGAA	21,263	43.59	926,960.48
BAYER AG	46,008	120.95	5,564,667.60
GRIFOLS S.A.	8,356	35.82	299,353.70
MERCK KGAA	7,201	80.08	576,656.08
ORION OYJ	5,809	27.58	160,212.22
QIAGEN N.V.	13,423	19.21	257,922.94
SANOFI	66,138	77.86	5,149,504.68
UCB SA	7,069	63.08	445,912.52
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	331,667	8.63	2,864,939.54
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,717,395	0.08	142,543.78
BANCO DE SABADELL SA	204,350	2.28	466,122.35
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.12	22,548.72
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,047	11.09	211,231.23
BANCO POPULAR ESPANOL	101,575	4.42	448,961.50
BANCO SANTANDER SA	691,071	7.24	5,009,573.67
BANK OF IRELAND	1,586,216	0.33	523,451.28
BANKIA SA	253,996	1.41	358,134.36
BANKINTER,S.A.	37,894	7.20	273,102.05
BNP PARIBAS	58,688	51.56	3,025,953.28
CAIXABANK	129,048	4.44	573,102.16
CAIXABANK SA-RTS	106,512	0.05	5,751.64
COMMERZBANK AG	55,954	12.30	688,513.97

CREDIT AGRICOLE SA	55,145	11.30	623,414.22
ERSTE GROUP BANK AG	17,092	21.78	372,263.76
INTESA SANPAOLO	662,099	2.47	1,640,681.32
INTESA SANPAOLO-RSP	57,797	2.16	125,072.70
KBC GROUPE SA	13,991	46.00	643,586.00
NATIXIS	50,869	5.68	289,037.65
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,561	16.64	109,175.04
SOCIETE GENERALE	40,826	39.89	1,628,549.14
UNICREDIT SPA	248,285	5.94	1,476,054.32
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	56,319	6.18	348,051.42
DEUTSCHE BANK AG -REG	77,640	26.28	2,040,767.40
DEUTSCHE BOERSE AG	10,521	58.75	618,108.75
EURAZEO	1,748	55.95	97,800.60
EXOR SPA	6,651	35.80	238,105.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,130	72.75	300,457.50
ING GROEP NV-CVA	213,521	11.78	2,515,277.38
MEDIOBANCA SPA	33,045	7.20	237,924.00
WENDEL	1,660	94.75	157,285.00
AEGON NV	101,813	6.31	642,745.46
AGEAS	12,405	28.76	356,767.80
ALLIANZ SE-REG	25,324	138.45	3,506,107.80
ASSICURAZIONI GENERALI	66,903	17.39	1,163,443.17
AXA SA	102,282	19.41	1,985,805.03
CNP ASSURANCES	10,242	14.89	152,503.38
DELTA LLOYD NV	11,163	18.48	206,348.05
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,577	71.76	256,685.52
MAPFRE SA	43,669	2.95	128,867.21
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,870	165.65	1,634,965.50
NN GROUP NV	6,663	24.41	162,677.14
SAMPO OYJ-A SHS	25,695	39.67	1,019,320.65
SCOR SE	8,802	25.09	220,842.18
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.30	114,914.90
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	1,864	40.00	74,569.32
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN	12,600	25.89	326,277.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	19.30	312,470.73

IMMOFINANZ AG	45,326	2.41	109,280.98
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,334	32.01	747,038.01
ATOS	4,509	57.13	257,599.17
CAP GEMINI SA	7,894	58.93	465,193.42
DASSAULT SYSTEMES SA	7,341	52.57	385,916.37
GEMALTO	4,684	68.32	320,010.88
SAP SE	51,029	56.68	2,892,323.72
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,020	35.42	248,683.50
ALCATEL-LUCENT	154,115	2.86	441,231.24
NOKIA OYJ	212,879	6.69	1,424,160.51
BELGACOM SA	9,280	31.74	294,593.60
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	175,878	13.70	2,409,528.60
ELISA OYJ	8,666	23.32	202,091.12
ILIAD SA	1,518	197.50	299,805.00
KONINKLIJKE KPN NV	176,807	2.67	472,074.69
ORANGE S.A.	101,689	14.16	1,440,424.68
TELECOM ITALIA SPA	544,021	0.90	492,883.02
TELECOM ITALIA-RNC	363,508	0.71	258,999.45
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,936	4.21	134,674.11
TELEFONICA S.A.	235,572	12.88	3,034,167.36
TELEFONICA S.A.-RTS	233,892	0.36	86,072.25
VIVENDI SA	67,785	20.48	1,388,236.80
E.ON SE	109,940	14.25	1,567,194.70
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	135,112	3.29	445,734.48
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	13,732	24.07	330,597.90
ENAGAS	10,716	26.93	288,581.88
ENEL GREEN POWER SPA	101,336	1.93	196,085.16
ENEL SPA	363,036	3.88	1,408,579.68
FORTUM OYJ	24,063	20.18	485,591.34
GAS NATURAL SDG SA	19,893	22.78	453,162.54
GDF SUEZ	81,739	19.81	1,619,658.28
IBERDROLA SA	277,425	5.94	1,649,569.05
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	6,468	73.67	476,497.56
RWE AG	28,532	29.13	831,137.16
SNAM SPA	109,056	4.26	465,014.78

	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,655	14.26	208,980.30
	TERNA SPA	90,699	3.88	352,274.91
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,735	14.66	348,073.77
	ASML HOLDING NV	19,997	84.93	1,698,345.21
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	63,809	7.87	502,687.30
	STMICROELECTRONICS NV	36,191	6.02	218,123.15
	ユーロ 小計	14,166,216		176,054,068.39 (26,024,312,389)
英債券	AMEC FOSTER WHEELER PLC	20,038	9.34	187,255.11
	BG GROUP PLC	193,529	9.00	1,742,148.05
	BP PLC	1,024,932	4.20	4,306,764.26
	PETROFAC LIMITED	14,971	8.25	123,510.75
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	219,449	21.32	4,679,749.92
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	136,104	22.23	3,025,591.92
	TULLOW OIL PLC	54,088	4.26	230,414.88
	ANGLO AMERICAN PLC	78,329	13.21	1,035,117.73
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.37	143,265.43
	BHP BILLITON PLC	116,688	15.17	1,770,156.96
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,169	24.54	200,467.26
	FRESNILLO PLC	11,248	7.12	80,085.76
	GLENCORE PLC	586,889	3.20	1,880,392.35
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,611	33.26	386,181.86
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,058	42.53	215,116.74
	REXAM PLC	44,341	4.52	200,598.68
	RIO TINTO PLC	71,965	29.92	2,153,552.62
	ASHTED GROUP PLC	26,529	10.54	279,615.66
	BAE SYSTEMS PLC	178,393	4.81	858,248.72
	BUNZL PLC	17,795	17.86	317,818.70
	COBHAM PLC	62,443	3.01	188,328.08
	IMI PLC	16,100	11.81	190,141.00
	MEGGITT PLC	44,518	5.03	223,925.54
	MELROSE INDUSTRIES PLC	68,846	2.58	178,104.60
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	106,660	8.42	898,610.50
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	10,053,630	0.00	10,053.63
	SMITHS GROUP PLC	23,298	11.57	269,557.86

TRAVIS PERKINS PLC	14,281	18.07	258,057.67
WEIR GROUP PLC/THE	12,257	18.76	229,941.32
WOLSELEY PLC	14,904	35.90	535,053.60
AGGREKO PLC	13,848	15.33	212,289.84
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	14,816	11.37	168,457.92
CAPITA PLC	34,892	10.70	373,344.40
EXPERIAN PLC	56,354	10.13	570,866.02
G4S PLC	93,353	2.76	258,027.69
INTERTEK GROUP PLC	8,190	23.35	191,236.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	22,801	3.79	86,415.79
EASYJET PLC	7,630	16.53	126,123.90
ROYAL MAIL PLC	37,660	4.17	157,343.48
GKN PLC	98,428	3.45	339,871.88
BURBERRY GROUP PLC	24,684	16.50	407,286.00
PERSIMMON PLC	17,395	15.33	266,665.35
CARNIVAL PLC	9,886	28.20	278,785.20
COMPASS GROUP PLC	95,464	10.90	1,040,557.60
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	13,210	27.10	357,991.00
TUI TRAVEL PLC	32,000	4.44	142,304.00
WHITBREAD PLC	9,658	45.87	443,012.46
WILLIAM HILL PLC	45,985	3.35	154,049.75
ITV PLC	215,575	2.14	461,761.65
PEARSON PLC	44,031	12.31	542,021.61
REED ELSEVIER PLC	65,704	11.13	731,285.52
SKY PLC	57,511	9.32	536,002.52
WPP PLC	75,393	13.40	1,010,266.20
DIXONS CARPHONE PLC	50,564	4.23	214,037.41
KINGFISHER PLC	139,018	3.12	433,736.16
MARKS & SPENCER GROUP PLC	88,539	4.88	432,513.01
NEXT PLC	8,254	67.75	559,208.50
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,318	6.60	120,990.39
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.33	149,817.12
TESCO PLC	443,093	1.86	826,146.89
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	118,375	1.78	211,299.37
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,769	32.03	633,201.07

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	103,637	37.94	3,932,505.96
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,449	14.52	195,279.48
DIAGEO PLC	139,335	19.81	2,760,226.35
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	54,106	29.60	1,601,537.60
SABMILLER PLC	53,454	35.64	1,905,100.56
TATE & LYLE PLC	24,694	6.03	149,028.29
UNILEVER PLC	72,474	27.06	1,961,146.44
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	36,742	52.55	1,930,792.10
SMITH & NEPHEW PLC	51,084	11.10	567,032.40
ASTRAZENECA PLC	70,131	47.80	3,352,261.80
GLAXOSMITHKLINE PLC	269,672	14.85	4,004,629.20
SHIRE PLC	33,712	45.57	1,536,255.84
BARCLAYS PLC	909,185	2.45	2,228,867.02
HSBC HOLDINGS PLC	1,067,255	6.37	6,798,414.35
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,165,104	0.80	2,543,161.06
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	146,488	3.95	579,067.06
STANDARD CHARTERED PLC	138,675	9.37	1,299,523.42
3I GROUP PLC	52,538	4.44	233,268.72
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	56,027	4.49	252,065.47
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,262	9.75	129,370.81
ICAP PLC	27,845	4.16	116,057.96
INVESTEC PLC	32,289	5.92	191,150.88
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	13,405	22.55	302,282.75
SCHRODERS PLC	7,800	26.95	210,210.00
ADMIRAL GROUP PLC	11,057	12.40	137,106.80
AVIVA PLC	167,091	5.08	848,822.28
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	84,323	2.94	248,331.23
FRIENDS LIFE GROUP LTD	77,938	3.69	287,747.09
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	328,984	2.46	811,603.52
OLD MUTUAL PLC	263,271	2.00	527,331.81
PRUDENTIAL PLC	142,068	15.48	2,199,212.64
RSA INSURANCE GROUP PLC	57,101	4.68	267,346.88
STANDARD LIFE PLC	133,437	4.24	565,772.88
SAGE GROUP PLC/THE	59,127	4.07	240,706.01
BT GROUP PLC	462,075	4.10	1,895,431.65

	INMARSAT PLC	25,159	7.94	199,888.25	
	VODAFONE GROUP PLC	1,472,059	2.33	3,443,882.03	
	CENTRICA PLC	286,448	2.84	815,231.00	
	NATIONAL GRID PLC	211,005	9.30	1,962,346.50	
	SEVERN TRENT PLC	13,551	20.43	276,846.93	
	SSE PLC	55,729	16.40	913,955.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	35,691	9.05	323,182.00	
	ARM HOLDINGS PLC	76,790	9.14	702,244.55	
	英ポンド 小計	25,816,356		94,680,968.53 (17,563,319,662)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	21,735	20.46	444,698.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	358.50	150,928.50	
	GIVAUDAN-REG	516	1,722.00	888,552.00	
	HOLCIM LTD-REG	12,570	71.35	896,869.50	
	SIKA AG	126	3,678.00	463,428.00	
	SYNGENTA AG	5,264	318.30	1,675,531.20	
	ABB LTD	122,757	21.69	2,662,599.33	
	GEBERIT AG-REG	2,227	336.60	749,608.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,048	135.00	141,480.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,395	137.80	330,031.00	
	SULZER AG	1,443	107.90	155,699.70	
	ADECCO SA-REG	9,888	67.85	670,900.80	
	SGS SA	306	2,090.00	639,540.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,822	130.10	367,142.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	29,108	90.85	2,644,461.80	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,747	477.50	834,192.50	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,816	88.95	250,483.20	
	ARYZTA AG	4,891	77.10	377,096.10	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	127	1,034.00	131,318.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	57	4,867.00	277,419.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	57,720.00	346,320.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	179,855	72.55	13,048,480.25	
	SONOVA HOLDING AG	2,928	146.20	428,073.60	
	ACTELION LTD	5,817	114.90	668,373.30	
	LONZA GROUP AG-REG	3,103	113.60	352,500.80	

	NOVARTIS AG-REG SHS	128,262	93.50	11,992,497.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	39,239	289.40	11,355,766.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	85,306	25.82	2,202,600.92	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,156	43.78	575,969.68	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,916	76.90	147,340.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,070	277.50	296,925.00	
	UBS GROUP AG	210,985	17.35	3,660,589.75	
	BALOISE HOLDING AG	2,805	126.20	353,991.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,689	221.40	373,944.60	
	SWISS RE AG	19,286	82.60	1,593,023.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,416	302.80	2,548,364.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	74.50	222,233.50	
	SWISSCOM AG-REG	1,246	586.50	730,779.00	
	スイスフラン 小計	930,332		65,649,752.93 (8,065,728,644)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,237	105.10	1,391,208.70	
	BOLIDEN AB	15,063	126.00	1,897,938.00	
	ALFA LAVAL AB	17,594	148.40	2,610,949.60	
	ASSA ABLOY AB-B	18,760	405.20	7,601,552.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	39,193	215.00	8,426,495.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,365	198.10	4,232,406.50	
	SANDVIK AB	56,437	78.10	4,407,729.70	
	SKANSKA AB-B SHS	21,504	160.60	3,453,542.40	
	SKF AB-B SHARES	24,265	153.60	3,727,104.00	
	VOLVO AB-B SHS	84,545	81.60	6,898,872.00	
	SECURITAS AB-B SHS	15,832	90.05	1,425,671.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,210	221.60	2,927,336.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,506	54.90	1,400,279.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,505	319.40	16,770,097.00	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	288.00	1,022,400.00	
	SWEDISH MATCH AB	11,029	257.50	2,839,967.50	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	32,935	175.90	5,793,266.50	
	ELEKTA AB-B SHS	23,109	76.00	1,756,284.00	
	GETINGE AB-B SHS	11,418	172.60	1,970,746.80	
NORDEA BANK AB	167,145	93.15	15,569,556.75		

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	84,093	98.50	8,283,160.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	27,200	364.20	9,906,240.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	50,380	195.60	9,854,328.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,794	131.80	1,159,049.20	
	INVESTOR AB-B SHS	26,367	280.10	7,385,396.70	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,493	258.70	3,749,339.10	
	ERICSSON LM-B SHS	170,170	93.90	15,978,963.00	
	HEXAGON AB-B SHS	14,360	237.00	3,403,320.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	620.50	2,083,018.50	
	TELE2 AB-B SHS	16,838	96.55	1,625,708.90	
	TELIASONERA AB	139,652	53.20	7,429,486.40	
	スウェーデンクローナ 小計	1,223,906		166,981,413.75 (2,656,674,292)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LID	21,887	100.50	2,199,643.50	
	STATOIL ASA	61,909	132.50	8,202,942.50	
	SUBSEA 7 SA	18,247	69.90	1,275,465.30	
	NORSK HYDRO ASA	72,459	41.08	2,976,615.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,449	298.30	3,116,936.70	
	ORKLA ASA	42,614	52.20	2,224,450.80	
	DNB ASA	54,404	116.50	6,338,066.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,814	120.30	1,300,924.20	
	TELENOR ASA	42,636	148.10	6,314,391.60	
	ノルウェークローネ 小計	335,419		33,949,436.32 (572,048,001)	
デンマークク ローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	13,384	262.90	3,518,653.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,229	220.40	2,695,271.60	
	ISS A/S	4,073	169.00	688,337.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	216	12,230.00	2,641,680.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	418	12,480.00	5,216,640.00	
	DSV A/S	9,120	187.40	1,709,088.00	
	PANDORA A/S	6,314	531.00	3,352,734.00	
	CARLSBERG AS-B	6,295	533.00	3,355,235.00	
	COLOPLAST-B	6,814	518.50	3,533,059.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	864	429.20	370,828.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	111,452	272.90	30,415,250.80	

	DANSKE BANK A/S	38,370	170.00	6,522,900.00	
	TRYG A/S	1,001	690.00	690,690.00	
	TDC A/S	45,454	48.50	2,204,519.00	
	デンマーククローネ 小計	256,004		66,914,886.80 (1,328,929,651)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	7,464	30.25	225,786.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	62,423	12.25	764,681.75	
	SANTOS LTD	53,628	10.10	541,642.80	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	40,582	35.75	1,450,806.50	
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,351	11.12	148,463.12	
	ALUMINA LTD	146,977	1.67	245,451.59	
	AMCOR LIMITED	68,587	12.16	834,017.92	
	BHP BILLITON LTD	178,972	30.92	5,533,814.24	
	BORAL LIMITED	44,844	4.89	219,287.16	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	83,530	2.94	245,578.20	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	28,325	6.85	194,026.25	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	2.85	243,407.10	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,958	12.10	277,791.80	
	NEWCREST MINING LIMITED	43,341	10.34	448,145.94	
	ORICA LIMITED	21,033	18.20	382,800.60	
	RIO TINTO LIMITED	24,662	59.10	1,457,524.20	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	4,188	20.13	84,304.44	
	ALS LTD	24,500	5.04	123,480.00	
	BRAMBLES LIMITED	88,496	9.72	860,181.12	
	SEEK LIMITED	17,538	17.09	299,724.42	
	ASCIANO LTD	53,896	5.88	316,908.48	
	AURIZON HOLDINGS LTD	131,108	4.61	604,407.88	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	26,232	1.92	50,365.44	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	42,587	5.64	240,190.68	
	CROWN RESORTS LTD	19,825	14.38	285,083.50	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	40.43	107,139.50	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	47,660	4.08	194,452.80		
TATTS GROUP LTD	81,135	3.41	276,670.35		
REA GROUP LTD	3,058	45.42	138,894.36		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LIMITED RIGHTS-N	1,056	1.80	1,900.80		

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	3.69	85,803.57
	METCASH LTD	63,234	2.61	165,040.74
	WESFARMERS LIMITED NEW	64,072	41.42	2,653,862.24
	WOOLWORTHS LIMITED	69,239	31.12	2,154,717.68
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	31,699	9.14	289,728.86
	TREASURY WINE ESTATES LTD	35,541	4.74	168,464.34
	COCHLEAR LIMITED	3,067	69.55	213,309.85
	HEALTHSCOPE LTD	53,691	2.61	140,133.51
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,779	54.15	421,232.85
	SONIC HEALTHCARE LTD	23,062	17.45	402,431.90
	CSL LIMITED	26,123	82.57	2,156,976.11
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	152,886	31.92	4,880,121.12
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	21,298	12.32	262,391.36
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,713	12.77	341,125.01
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	90,159	80.72	7,277,634.48
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	131,050	32.60	4,272,230.00
	WESTPAC BANKING CORPORATION	172,622	32.55	5,618,846.10
	ASX LTD	9,980	36.00	359,280.00
	MACQUARIE GROUP LTD	16,138	58.43	942,943.34
	AMP LIMITED	170,930	5.64	964,045.20
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	124,629	6.37	793,886.73
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	76,505	10.86	830,844.30
	SUNCORP GROUP LTD	72,061	14.34	1,033,354.74
	COMPUTERSHARE LIMITED	27,158	11.55	313,674.90
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	245,592	5.69	1,397,418.48
	TPG TELECOM LTD	13,145	7.41	97,404.45
	AGL ENERGY LIMITED	35,263	13.11	462,297.93
	オーストラリアドル 小計	3,256,901		55,496,128.73 (5,580,135,743)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	41,477	8.19	339,696.63
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,820	3.87	204,413.40
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,000	8.01	176,220.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	101,822	3.06	311,575.32
	CONTACT ENERGY LIMITED	17,965	6.13	110,125.45
	MERIDIAN ENERGY LTD	71,571	1.72	123,102.12

	MIGHTY RIVER POWER	39,907	3.00	119,721.00	
	ニュージーランドドル 小計	347,562		1,384,853.92 (128,375,958)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	118,000	97.20	11,469,600.00	
	NWS HOLDINGS LTD	67,500	14.36	969,300.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	74,000	17.08	1,263,920.00	
	MTR CORPORATION	80,000	31.15	2,492,000.00	
	LI & FUNG LTD	317,200	8.62	2,734,264.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	84,500	24.80	2,095,600.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	37,000	27.80	1,028,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	134,000	52.95	7,095,300.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	62,400	23.45	1,463,280.00	
	SANDS CHINA LTD	134,000	46.45	6,224,300.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD-RTS	9,142	0.33	3,062.57	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	10.74	687,360.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	120,000	15.40	1,848,000.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	25.30	1,973,400.00	
	WH GROUP LIMITED	158,500	4.59	727,515.00	
	BANK OF EAST ASIA	63,220	32.50	2,054,650.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	197,000	27.40	5,397,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	43,800	129.20	5,658,960.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY	146,000	8.18	1,194,280.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	62,100	168.90	10,488,690.00	
	AIA GROUP LTD	667,600	44.80	29,908,480.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	79,000	142.30	11,241,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	131,000	23.30	3,052,300.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	61,120	52.00	3,178,240.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	38,000	35.85	1,362,300.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	27.95	768,625.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	317,333	9.26	2,938,503.58	
	SINO LAND CO	162,200	12.72	2,063,184.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	93,000	113.40	10,546,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	37,500	106.60	3,997,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	68,600	24.10	1,653,260.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	88,000	55.95	4,923,600.00	

	WHEELLOCK&COMPANY LTD	46,000	39.00	1,794,000.00	
	PCCW LIMITED	270,000	5.20	1,404,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	57.40	1,951,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	107,600	67.45	7,257,620.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	350,431	18.38	6,440,921.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	76,000	74.05	5,627,800.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	78.95	963,190.00	
	香港ドル 小計	4,717,446		167,942,905.93 (2,574,564,747)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	78,400	9.00	705,600.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	1.22	300,615.00	
	SEBFCORP INDUSTRIES LTD	54,820	4.57	250,527.40	
	SEBFCORP MARINE LTD	55,400	3.13	173,402.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	96,000	3.37	323,520.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.22	110,250.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.60	278,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	34,266	10.78	369,387.48	
	GENTING SINGAPORE PLC	320,000	1.14	364,800.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	93,250	4.29	400,042.50	
	CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	42.59	255,540.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	378,600	0.46	174,156.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	113,000	3.21	362,730.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,000	19.83	1,864,020.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	165,000	10.48	1,729,200.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	72,000	24.00	1,728,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	52,000	7.32	380,640.00	
	CAPITALAND LTD	137,000	3.32	454,840.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.06	211,260.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	180,000	2.62	471,600.00	
KEPPEL LAND LTD	43,000	3.37	144,910.00		
UOL GROUP LIMITED	32,000	6.73	215,360.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,015	3.90	1,712,158.50		
STARHUB LIMITED	37,000	4.14	153,180.00		
	シンガポールドル 小計	2,944,151		13,133,938.88 (1,193,087,007)	

イスラエルシュケル	DELEK GROUP LTD	213	1,268.00	270,084.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,983	26.40	765,151.20	
	ISRAEL CORPORATION LTD/THE	115	1,912.00	219,880.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	48,549	223.10	10,831,281.90	
	BANK HAPOALIM BM	61,837	19.25	1,190,362.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	72,754	13.66	993,819.64	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,000	41.05	410,500.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,300	184.00	607,200.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	119,157	7.01	835,886.35	
イスラエルシュケル 小計		344,908		16,124,165.34	(492,109,526)
合 計		74,031,470		200,949,370,489	(200,949,370,489)

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 602銘柄	59.4%	62.6%
カナダドル	株式 93銘柄	4.2%	4.4%
ユーロ	株式 235銘柄	12.3%	13.0%
英ポンド	株式 105銘柄	8.3%	8.7%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.8%	4.0%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.3%	1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	0.6%	0.7%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.6%	2.8%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式 24銘柄	0.6%	0.6%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.2%	0.2%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20,581	474,906.57	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES	50,757	477,115.80	
		AMERICAN TOWER CORP	22,151	2,326,076.51	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	52,984	610,375.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,335	1,179,394.65	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,561	1,109,848.04	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,755	364,613.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,908	555,695.16	
		DUKE REALTY CORP	18,773	364,947.12	
		EQUITY RESIDENTIAL	19,100	1,353,044.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,397	687,586.77	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,046	536,742.36	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,451	788,108.76	
		HCP, INC.	25,656	1,149,388.80	
		HEALTH CARE REIT INC	18,327	1,349,966.82	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	42,304	983,144.96	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	323,000	221,255.00	
		IRON MOUNTAIN INC	8,269	314,304.69	
		KIMCO REALTY CORPORATION	22,451	571,377.95	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	249,959.70	
		MACERICH COMPANY/THE	8,319	657,866.52	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	10,548	439,640.64	
		PROLOGIS INC	27,697	1,171,029.16	
		PUBLIC STORAGE	8,192	1,537,064.96	
		RAYONIER INC	7,400	201,872.00	
		REALTY INCOME CORPORATION	11,892	552,502.32	
		REGENCY CENTERS CORP	5,415	332,914.20	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	17,553	3,173,582.40	
		SL GREEN REALTY CORP	5,242	608,805.88	
		UDR INC	14,748	453,943.44	
VENTAS INC	15,968	1,142,510.40			
VORNADO REALTY TRUST	9,444	1,053,572.64			
	米ドル 合計		839,289	26,993,157.30 (3,209,216,471)	

カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,500	193,205.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,647	236,063.10
カナダドル 合計		17,147	429,268.10 (44,566,614)
ユーロ	CORIO NV	4,225	171,894.12
	FONCIERE DES REGIONS	1,550	118,993.50
	GECINA SA	1,793	194,988.75
	ICADE	2,488	160,053.04
	KLEPIERRE	5,667	204,522.03
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,553	1,180,012.50
ユーロ 合計		21,276	2,030,463.94 (300,143,179)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,382	409,973.76
	HAMMERSON PLC	45,216	281,695.68
	INTU PROPERTIES PLC	54,855	195,777.49
	LAND SECURITIES GROUP PLC	44,733	531,428.04
	SEGRO PLC	46,280	181,556.44
英ポンド 合計		244,466	1,600,431.41 (296,880,026)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,583	382,348.21
	AUSNET SERVICES	95,413	125,945.16
	DEXUS PROPERTY GROUP	54,481	387,359.91
	FEDERATION CENTRES	90,000	249,300.00
	GOODMAN GROUP	98,927	539,152.15
	GPT GROUP	96,787	400,698.18
	LEND LEASE GROUP	32,578	499,420.74
	MIRVAC GROUP	210,942	370,203.21
	NOVION PROPERTY GROUP	124,971	266,188.23
	SCENTRE GROUP	300,206	1,041,714.82
	STOCKLAND	130,583	538,001.96
	SYDNEY AIRPORT	57,042	253,266.48
	TRANSURBAN GROUP	97,725	812,094.75
	WESTFIELD CORP	113,561	941,420.69
オーストラリアドル 合計		1,551,799	6,807,114.49

				(684,455,361)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD		139,000	1,341,350.00
	LINK REIT		126,500	6,249,100.00
香港ドル 合計			265,500	7,590,450.00 (116,361,598)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		107,000	250,380.00
	CAPITACOMMERCIAL TRUST		79,000	133,115.00
	CAPITAMALL TRUST		125,000	247,500.00
	SUNTEC REIT		135,000	265,950.00
シンガポールドル 合計			446,000	896,945.00 (81,478,483)
合計				4,733,101,732 (4,733,101,732)

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 32銘柄	1.5%	67.8%
カナダドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.1%	6.3%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	6.3%
オーストラリアドル	投資証券 14銘柄	0.3%	14.5%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.7%

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)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

外国株式指数ファンド

平成26年12月30日現在

資産総額	923,425,216円
負債総額	387,089円
純資産総額（ - ）	923,038,127円
発行済口数	418,211,182口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2071円
（1万口当たり純資産額）	（22,071円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情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は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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またはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金およ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】

イ 資本金の額および株式数

	平成26年12月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

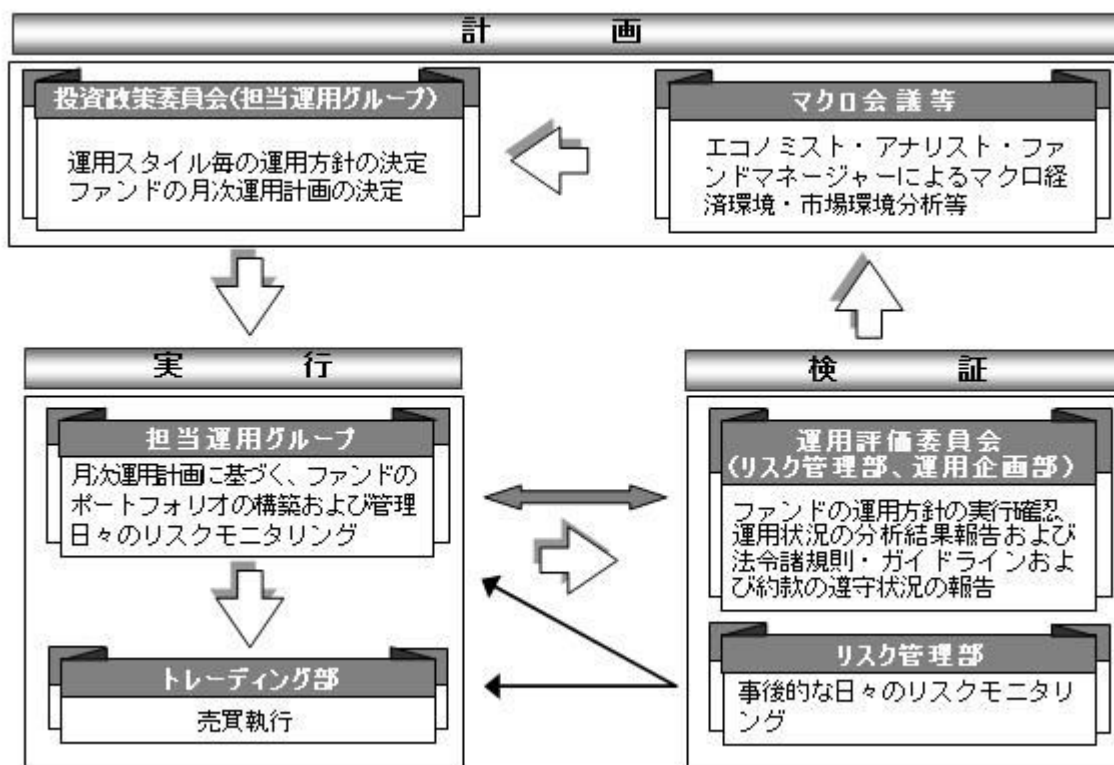
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



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を行っています。

平成26年12月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成26年12月30日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	35 (12)	158,628 (51,063)
	追加型	418 (173)	5,083,960 (3,005,003)
	計	453 (185)	5,242,588 (3,056,066)
公社債投資信託	単位型	20 (20)	80,236 (80,236)
	追加型	4 (1)	256,044 (177,257)
	計	24 (21)	336,280 (257,493)
合計		477 (206)	5,578,868 (3,313,559)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

2 当社は、第29期（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第30期中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 17,748,821	20,615,467
有価証券	3,999,613	4,999,802
前払費用	260,095	257,741
未収入金	7,550	4,026

未収委託者報酬		3,641,029	4,128,531
未収運用受託報酬		439,648	934,710
未収投資助言報酬	2	470,228	453,941
未収収益		12,379	11,700
繰延税金資産		230,101	548,658
その他の流動資産		15,233	4,577
流動資産計		26,824,700	31,959,157
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		138,920	124,723
器具備品		153,518	204,970
有形固定資産合計		292,438	329,694
無形固定資産			
ソフトウェア		487,128	517,480
ソフトウェア仮勘定		1,805	4,595
電話加入権		115	103
商標権		809	468
無形固定資産合計		489,857	522,646
投資その他の資産			
投資有価証券		6,914,557	6,843,224
関係会社株式		234,311	353,036
長期差入保証金		553,412	541,904
長期前払費用		13,881	41,193
会員権		9,480	9,480
繰延税金資産		409,440	463,476
投資その他の資産合計		8,135,083	8,252,316
固定資産計		8,917,379	9,104,657
資産合計		35,742,080	41,063,815

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,693	61,327
未払金		
未払収益分配金	425	671
未払償還金	149,880	143,230
未払手数料	2	2,138,441
その他未払金	127,465	203,170
未払費用	1,235,323	1,615,419
未払消費税等	93,482	215,390
未払法人税等	630,796	1,623,022
賞与引当金	253,750	926,263
その他の流動負債	-	8
流動負債計	4,438,695	6,926,944
固定負債		
退職給付引当金	1,605,470	1,802,340
固定負債計	1,605,470	1,802,340
負債合計	6,044,166	8,729,285
(純資産の部)		
株主資本		

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	16,718,237	19,227,103
利益剰余金合計	18,539,441	21,048,308
株主資本計	29,168,425	31,677,292
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	529,488	657,238
評価・換算差額等計	529,488	657,238
純資産合計	29,697,914	32,334,530
負債・純資産合計	35,742,080	41,063,815

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成24年4月1日	(自	平成25年4月1日
	至	平成25年3月31日)	至	平成26年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		24,965,627		30,300,842
運用受託報酬		2,123,129		3,773,696
投資助言報酬		1,675,512		2,117,669
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		5,000
投資法人運用受託報酬		28,389		26,625
サービス支援手数料		39,868		24,883
その他		51,597		56,406
営業収益計		28,889,125		36,305,122
営業費用				
支払手数料		12,702,099		15,695,322
広告宣伝費		323,773		276,591
公告費		5,176		5,637
調査費				
調査費		628,953		1,028,700
委託調査費		2,491,384		3,053,376
営業雑経費				
通信費		34,811		38,776
印刷費		208,926		262,934
協会費		27,115		14,337
諸会費		13,918		32,186
情報機器関連費		1,992,553		2,277,699
販売促進費		14,507		40,388
その他		103,926		117,451
営業費用計		18,547,147		22,843,403

一般管理費		
給料		
役員報酬	145,461	140,440
給料・手当	4,393,347	4,900,885
賞与	767,474	786,372
賞与引当金繰入額	253,750	926,263
交際費	17,677	24,915
寄付金	24	82
事務委託費	252,472	303,945
旅費交通費	184,318	196,933
租税公課	83,374	100,575
不動産賃借料	670,888	546,821
退職給付費用	173,008	330,002
固定資産減価償却費	189,990	227,090
諸経費	260,890	258,736
一般管理費計	7,392,682	8,743,067
営業利益	2,949,295	4,718,652
営業外収益		
受取配当金	36,741	50,559
有価証券利息	3,643	2,660
受取利息	5,921	5,190
時効成立分配金・償還金	961	5,958
原稿・講演料	2,696	2,456
還付加算金	78	182
雑収入	4,508	3,692
営業外収益計	54,551	70,701
営業外費用		
為替差損	25,770	29,406
雑損失	-	38
営業外費用計	25,770	29,444
経常利益	2,978,076	4,759,909
特別利益		
投資有価証券償還益	-	8,250
投資有価証券売却益	52,516	310,894
負ののれん発生益	-	186,047
企業結合に係る特定勘定取崩益	-	2,870
特別利益計	52,516	508,062
特別損失		
固定資産除却損	1	2,409
投資有価証券償還損		3,224
投資有価証券評価損		18,303
投資有価証券売却損		61,282
関係会社株式評価損		610
合併関連費用		70,655
事務所移転費用		13,795
特別損失計		170,280
税引前当期純利益	2,860,311	5,238,102
法人税、住民税及び事業税	1,223,890	2,147,762
法人税等調整額	119,459	282,886
法人税等合計	1,104,430	1,864,875
当期純利益	1,755,881	3,373,226

（ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	15,791,435	17,612,639	28,241,623
当期変動額									
剰余金の配当			-				829,080	829,080	829,080
当期純利益			-				1,755,881	1,755,881	1,755,881
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	926,801	926,801	926,801
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425

	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	76,327	76,327	28,317,951
当期変動額			
剰余金の配当		-	829,080
当期純利益		-	1,755,881
株主資本以外の項 目の当期変動額 （純額）	453,160	453,160	453,160
当期変動額合計	453,160	453,160	1,379,962
当期末残高	529,488	529,488	29,697,914

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425
当期変動額									
剰余金の配当			-				864,360	864,360	864,360
当期純利益			-				3,373,226	3,373,226	3,373,226
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,508,866	2,508,866	2,508,866
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292

	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	529,488	529,488	29,697,914
当期変動額			

剰余金の配当		-	864,360
当期純利益		-	3,373,226
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	127,749	127,749	127,749
当期変動額合計	127,749	127,749	2,636,616
当期末残高	657,238	657,238	32,334,530

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（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）

時価のないもの

移動平均法による原価法

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。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

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

消費税等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)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

(1)概要

退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充の改正等について改正されました。

(2)適用予定日

退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から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

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

(会計上の見積りの変更)

当社は、賞与引当金の計上基準について、業績を反映したものに変更したため、見積りの方法を将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益がそれぞれ553,173千円減少しております。

(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25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
建物	223,463千円	241,339千円
器具備品	698,449千円	704,790千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
現金及び預金	13,031,110千円	14,959,545千円
未収投資助言報酬	289,597千円	290,426千円
未払手数料	446,096千円	360,659千円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
当座貸越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc	45,184千円	27,470千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

建物	1,889千円	- 千円
器具備品	519千円	864千円
ソフトウェア	- 千円	5,853千円
計	2,409千円	6,717千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年 6月25日 定時株主総会	普通株式	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成25年 6月24日開催の第28回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成26年 6月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原 資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余 金	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年 3月31日)	当事業年度 (平成26年 3月31日)
1年以内	516,612	525,188

1年超	1,218,728	751,482
合計	1,735,341	1,276,671

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、全額出資の海外子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

有価証券、投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

有価証券及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、総務人事部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

(4) 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、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（平成25年3月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	17,748,821	17,748,821	-
(2)未収委託者報酬	3,641,029	3,641,029	-
(3)未収運用受託報酬	439,648	439,648	-
(4)未収投資助言報酬	470,228	470,228	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,613	3,999,200	413
その他有価証券	6,881,219	6,881,219	-
(6)長期差入保証金	553,412	553,412	-
資産計	33,733,972	33,733,559	413
(1)未払金			
未払手数料	1,899,876	1,899,876	-
負債計	1,899,876	1,899,876	-

当事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,615,467	20,615,467	-
(2)未収委託者報酬	4,128,531	4,128,531	-
(3)未収運用受託報酬	934,710	934,710	-
(4)未収投資助言報酬	453,941	453,941	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,802	4,999,500	302
その他有価証券	6,811,166	6,811,166	-
(6)長期差入保証金	541,904	541,904	-
資産計	38,485,524	38,485,221	302
(1)未払金			
未払手数料	2,138,441	2,138,441	-
負債計	2,138,441	2,138,441	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び(4)未収投資助言報酬

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

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

(1)未払金

未払手数料

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

(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)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	33,040	31,760
合計	33,338	32,058
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	234,311	353,036
合計	234,311	353,036

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成25年3月31日)

(単位:千円)

区分	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	17,748,821	-	-	-
未収委託者報酬	3,641,029	-	-	-
未収運用受託報酬	439,648	-	-	-
未収投資助言報酬	470,228	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	27,733	525,679	-	-
合計	26,327,460	525,679	-	-

当事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

区分	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	20,615,467	-	-	-
未収委託者報酬	4,128,531	-	-	-
未収運用受託報酬	934,710	-	-	-
未収投資助言報酬	453,941	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	5,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	23,475	518,429	-	-
合計	31,156,125	518,429	-	-

(有価証券関係)

1.満期保有目的の債券

前事業年度(平成25年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

(1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの			
国債	3,999,613	3,999,200	413
小計	3,999,613	3,999,200	413
合計	3,999,613	3,999,200	413

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの			
国債	4,999,802	4,999,500	302
小計	4,999,802	4,999,500	302
合計	4,999,802	4,999,500	302

2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成25年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,311千円）は、市場価格がなく、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、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、610千円です。

当事業年度（平成26年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式353,036千円）は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

3. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	6,212,805	5,419,133	793,672
小計	6,212,805	5,419,133	793,672
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託等	668,413	670,000	1,586
小計	668,413	670,000	1,586
合計	6,881,219	6,089,133	792,086

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 33,338千円）については、市場価格がなく、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、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、18,303千円です。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

投資信託等	420,480	424,165	3,684
小計	420,480	424,165	3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 32,058千円)については、市場価格がなく、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、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,280千円です。

4. 当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24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,042,233	52,516	61,282

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

(退職給付関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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、退職一時金制度を設けております。

2. 退職給付債務の額

(単位：千円)

退職給付債務	1,605,470
退職給付引当金	<u>1,605,470</u>

3. 退職給付費用の額

(単位：千円)

勤務費用	171,214
利息費用	22,339
数理計算上の差異の費用処理額	36,910
その他	16,364
退職給付費用	<u>173,008</u>

(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

退職給付見込額の期間配分方法	勤務期間を基準とする方法
割引率	1.5%
過去勤務債務の額の処理年数	1年(発生時において費用処理する方法)
数理計算上の差異の処理年数	1年(発生時において費用処理する方法)

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

退職給付債務の期首残高	1,605,470
勤務費用	184,549
利息費用	25,192
数理計算上の差異の発生額	21,670
過去勤務費用の発生額	27,157
退職給付の支払額	93,535
その他	75,176
退職給付債務の期末残高	1,802,340

(注) その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に記載された退職給付引当金の調整表
(単位：千円)

非積立型の退職給付債務	1,802,340
未認識数理計算上の差異	-
未認識過去勤務費用	-
退職給付引当金	1,802,340

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：千円)
勤務費用	184,549
利息費用	25,192
数理計算上の差異の費用処理額	21,670
過去勤務費用の費用処理額	27,157
その他	114,773
退職給付費用合計	330,002

(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	1.5%
--------------------------------	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、43,539千円であります。

(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

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	96,450	330,120
未払事業税	56,165	123,029
調査費	48,698	62,002
その他	10,598	33,507
繰延税金資産小計	230,101	548,658
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	230,101	548,658

固定の部

繰延税金資産

退職給付引当金	572,189	642,354
特定外国子会社留保金額	226,275	226,680
ソフトウェア償却	75,827	105,651
投資有価証券評価損	51,622	50,143
その他	6,428	6,970
繰延税金資産小計	932,342	1,031,799
評価性引当額	260,304	233,276
繰延税金資産合計	672,038	798,523
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	262,597	334,588
その他	-	457
繰延税金負債合計	262,597	335,046
繰延税金資産の純額	409,440	1,012,135

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
法定実効税率	-	38.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	-	0.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.3
住民税均等割	-	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.7
負ののれん発生益	-	1.3
企業結合に係る特定勘定取崩	-	1.5
その他	-	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	35.6

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が廃止されることとなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等にかかる繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年3月31日までについては、従来の38.0%から35.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額及び法人税等調整額が、それぞれ40,739千円減少しております。

(企業結合等関係)

取得による企業結合

(1) 企業結合の概要

被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 トヨタアセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業等

企業結合を行った主な理由

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、合併致しました。

企業結合日

平成25年4月1日

企業結合の法的形式

当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式
 結合後企業の名称
 三井住友アセットマネジメント株式会社
 取得した議決権比率
 100%
 取得企業を決定するに至った根拠
 当社が現金を対価として株式を取得したことによっております。

(2)財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間
 平成25年4月1日から平成26年3月31日まで

(3)被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	760,008千円
取得に直接要した費用	2,145千円
取得原価	762,153千円

(4)株式の種類別の交換比率及びその算定方法並びに交付した株式数
 当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

(5)発生したのれんの金額及び発生原因
 負ののれん
 186,047千円
 発生原因
 受け入れた資産及び引き受けた負債の純額が、被取得企業の取得の対価算定時の企業評価に基づく投資額を上回ったことによります。

(6)企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	1,604,153千円
固定資産	258,107千円
資産合計	1,862,260千円
流動負債	619,705千円
固定負債	75,176千円
負債合計	694,881千円

(7)企業結合が当事業年度の開始の日に完了したと仮定した場合の当事業年度の損益計算書に及ぼす影響の概算額及びその算定方法
 企業結合が当事業年度の開始日に完了しているため、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成24年4月1日至平成25年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計

外部顧客への売上高	24,965,627	2,123,129	1,675,512	124,856	28,889,125
-----------	------------	-----------	-----------	---------	------------

(2)地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

(2)地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.報告セグメントごとの負のれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1.親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,030,024	未払手数料	345,107
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,063,467	未収投資助言報酬	289,597

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	1,620,156	未払手数料	195,174

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接 50	投信の販売委託 役員兼任	出資の引受	118,725	-	-

(注) 1. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	1,683,555.22円	1,833,023.27円
1株当たり当期純利益金額	99,539.78円	191,226.00円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,755,881	3,373,226
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	1,755,881	3,373,226
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はございません。

(参考情報) トヨタアセットマネジメント株式会社の財務諸表

1. 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を四捨五入して表示しております。
2. 当社は、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に準じて、第24期事業年度(平成24年4月1日から平成25年3月31日まで)の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。
3. 当社は平成25年4月1日付で三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社として合併しております。なお、財務諸表中に記載されている「当社」は、合併前のトヨタアセットマネジメント株式会社を指しております。

独立監査人の監査報告書

平成25年5月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

荒川

進



当監査法人は、貴社の委嘱に基づき、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に準じて、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第24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、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、トヨタアセットマネジメント株式会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は平成25年4月1日付で合併している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
資産の部		
流動資産		

現金及び預金		501,562		994,987
有価証券		643,270		-
前払費用		21,817		23,419
未収委託者報酬		372,005		437,440
未収運用受託報酬		92,258		110,402
未収還付法人税等		-		5,415
繰延税金資産		19,857		22,654
その他		-		9,836
流動資産合計		1,650,770		1,604,153
固定資産				
有形固定資産				
建物	*1	17,684	*1	697
器具備品	*1	8,726	*1	3,264
有形固定資産合計		26,411		3,961
無形固定資産				
ソフトウェア		7,672		12,075
その他		1,207		38
無形固定資産合計		8,879		12,113
投資その他の資産				
投資有価証券		40,477		42,695
長期差入保証金		70,406		52,610
長期預け金		574		-
繰延税金資産		35,810		146,728
投資その他の資産合計		147,266		242,033
固定資産合計		182,555		258,108
資産合計		1,833,325		1,862,261

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	8,489	7,801
未払代行手数料	202,085	237,521
未払金	606	201,189
未払費用	93,163	121,583
未払法人税等	6,403	-
未払消費税等	9,154	4,755
賞与引当金	27,000	46,857
流動負債合計	346,901	619,705
固定負債		
退職給付引当金	100,461	75,177
固定負債合計	100,461	75,177
負債合計	447,362	694,882
純資産の部		
株主資本		
資本金	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金	29,284	29,788
その他利益剰余金		

別途積立金	109,000	109,000
繰越利益剰余金	647,689	427,764
利益剰余金合計	785,973	566,552
株主資本合計	1,385,973	1,166,552
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	10	827
評価・換算差額等合計	10	827
純資産合計	1,385,963	1,167,379
負債・純資産合計	1,833,325	1,862,261

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)	当事業年度 (自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,177,306	1,203,017
運用受託報酬	273,573	306,131
投資助言報酬	*1 529,665	*1 430,339
営業収益合計	1,980,544	1,939,488
営業費用		
支払手数料	550,329	572,174
広告宣伝費	6,366	100
調査費	147,633	138,401
委託調査費	114,623	123,589
委託計算費	42,128	41,985
営業雑経費		
通信費	5,816	5,390
印刷費	21,775	21,494
協会費	4,239	4,591
諸会費	874	763
その他営業雑経費	3,651	3,738
営業費用合計	897,433	912,225
一般管理費		
給料		
役員報酬	83,127	73,927
給料・手当	*1 488,251	*1 475,070
賞与	*1 99,845	*1 100,723
賞与引当金繰入	27,000	46,857
福利厚生費	93,480	90,095
交際費	6,181	10,415
旅費交通費	16,469	23,984
租税公課	9,114	7,490
不動産賃借料	89,783	76,034
退職給付費用	*1 32,884	*1 37,467
固定資産減価償却費	13,584	11,128
業務委託費	49,845	58,172
諸経費	40,787	42,151
一般管理費合計	1,050,351	1,053,511
営業利益又は営業損失 ()	32,760	26,248

営業外収益		
受取利息	36	52
有価証券利息	547	392
受取配当金	529	988
その他営業外収益	1,203	1,050
営業外収益合計	2,315	2,481
営業外費用		
雑損失	336	1,115
営業外費用合計	336	1,115
経常利益又は経常損失（ ）	34,739	24,882
特別利益		
投資有価証券売却益	71	-
特別利益合計	71	-
特別損失		
役員退職慰労金	7,750	40,700
固定資産除売却損	*2 1,020	*2 881
合併関連費用	-	*3 261,274
特別損失合計	8,770	302,855
税引前当期純利益又は税引前 当期純損失（ ）	26,040	327,736
法人税、住民税及び事業税	15,259	823
法人税等調整額	5,146	114,178
法人税等合計	20,405	113,355
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,635	214,381

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)	(自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	600,000	600,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	27,760	29,284
当期変動額		
利益準備金の積立	1,524	504
当期変動額合計	1,524	504
当期末残高	29,284	29,788
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	109,000	109,000
当期変動額		

当期変動額合計	-	-
当期末残高	109,000	109,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	658,818	647,689
当期変動額		
利益準備金の積立	1,524	504
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失()	5,635	214,381
当期変動額合計	11,129	219,925
当期末残高	647,689	427,764
利益剰余金合計		
当期首残高	795,578	785,973
当期変動額		
利益準備金の積立	-	-
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失()	5,635	214,381
当期変動額合計	9,605	219,421
当期末残高	785,973	566,552
株主資本合計		
当期首残高	1,395,578	1,385,973
当期変動額		
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失()	5,635	214,381
当期変動額合計	9,605	219,421
当期末残高	1,385,973	1,166,552
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	111	10
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	121	837
当期変動額合計	121	837
当期末残高	10	827
評価・換算差額等合計		
当期首残高	111	10
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	121	837
当期変動額合計	121	837
当期末残高	10	827
純資産合計		
当期首残高	1,395,689	1,385,963
当期変動額		
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失()	5,635	214,381
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	121	837
当期変動額合計	9,726	218,584
当期末残高	1,385,963	1,167,379

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

決算日の市場価格等による時価法（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）を採用しております。なお、預金と同様の性格を有する有価証券については、移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込み利用可能期間（5年）による定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に備えて、支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職金規程に基づく自己都合要支給額の全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

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

減価償却方法の変更

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

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
*1	有形固定資産の減価償却累計額	*1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物 63,978千円		建物 1,071千円
	器具備品 57,853千円		器具備品 22,826千円
	計 121,831千円		計 23,897千円

（損益計算書関係）

前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
*1	関係会社との取引額	*1	関係会社との取引額
	投資助言報酬 529,665千円		投資助言報酬 430,339千円
	給料・手当 107,355千円		給料・手当 77,490千円
	賞与 31,907千円		賞与 18,286千円
	退職給付費用 4,200千円		退職給付費用 4,857千円

*2 固定資産除売却損は、器具備品1,020千円 であります。	*2 固定資産除売却損は、建物881千円であり ます。
	*3 合併関連費用は三井住友アセットマネジメ ント株式会社との合併にかかる費用であり、 以下の通りです。 希望退職関連費用 205,102千円 固定資産除売却損 21,460千円 原状回復費用 17,365千円 IT関連費用 8,026千円 その他 9,321千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	15,240	1,270	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

(2) 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	配当の原資	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

(2) 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
該当事項はありません。

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については、合理的な理由がある場合を除いて、銀行預金及び安全性の高い有価証券に限定しており、投機的な取引は行わない方針であります。また、資金調達については、運転資金及び設備投資資金に関しては、原則として自己資金で賄う方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収運用受託報酬には、顧客の信用リスクが存在します。資産管理部門及び営業部門において、日常の営業活動により、顧客等の信用状況を把握するとともに、債権回収の期日管理を行い、経理部門でその回収を確認することで、回収懸念の軽減ないしは早期把握に努めています。

また、未収委託者報酬には、運用を委託されている投資信託の運用資産が悪化した場合に回収できず、当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績等からリスクは非常に低いものと考えております。

有価証券及び投資有価証券は、当社設定・運用の短期公社債投資信託並びに株式投資信託であり、組入れ有価証券について市場価格の変動リスク及び信用リスク等が存在します。当該リスクに対しては、日々、時価を把握し、組入れ有価証券の発行体の財務状況等の把握等により、リスク管理を実施するとともに、定期的に保有継続について検討を行っています。

長期差入保証金は、建物賃貸借契約に係る敷金であり、差し入れ先の信用リスクに晒されています。差し入れ先の信用状況を定期的に把握することを通じて、リスクの軽減を図っています。

営業債務である未払費用は、全て1年以内に支払期日が到来します。これらには、流動性リスクが存在します。当社は、現状、自己資金が充分であります。キャッシュ・フローの管理等を通じて、リスクの軽減を図っています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

前事業年度(平成24年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	501,562	501,562	
(2)有価証券	643,270	643,270	
(3)未収委託者報酬	372,005	372,005	
(4)未収運用受託報酬	92,258	92,258	
(5)投資有価証券	40,477	40,477	
(6)長期差入保証金	70,406	69,389	1,016
資産計	1,719,978	1,718,962	1,016
(1)未払代行手数料	202,085	202,085	
(2)未払費用	93,163	93,163	
負債計	295,248	295,248	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、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。

(2)有価証券及び(5)投資有価証券

有価証券及び投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、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。

(6)長期差入保証金

長期差入保証金（敷金）の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金（敷金）の返還予定

時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)金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ます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(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

(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	501,562	-	-	-
未収委託者報酬	372,005	-	-	-
未収運用受託報酬	92,258	-	-	-
長期差入保証金	-	-	70,406	-
合計	965,825	-	70,406	-

当事業年度(平成25年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありませぬ。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	994,987	994,987	
(2)未収委託者報酬	437,440	437,440	
(3)未収運用受託報酬	110,402	110,402	
(4)投資有価証券	42,695	42,695	
(5)長期差入保証金	52,610	52,135	475
資産計	1,638,134	1,637,659	475
(1)未払代行手数料	237,521	237,521	
(2)未払金	201,189	201,189	
(3)未払費用	121,583	121,583	
負債計	560,293	560,293	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、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。

(2)未収委託者報酬及び(3)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、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。

(4)投資有価証券

投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(5)長期差入保証金

長期差入保証金(敷金)の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金(敷金)の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料、(2)未払金及び(3)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿

価額によっております。

(注2)金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ます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(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

(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	994,987	-	-	-
未収委託者報酬	437,440	-	-	-
未収運用受託報酬	110,402	-	-	-
長期差入保証金	50,935	1,675	-	-
合計	1,593,764	1,675	-	-

(有価証券関係)

その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日)

(単位：千円)

	種類	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ないもの	投資信託	683,747	683,762	15
合計		683,747	683,762	15

その他有価証券の前事業年度中の売却額は515千円であり、売却益は71千円であります。

当事業年度(平成25年3月31日)

(単位：千円)

	種類	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	投資信託	42,695	41,410	1,285
合計		42,695	41,410	1,285

その他有価証券の当事業年度中の売却額は643,584千円であり、売却損益は生じておりません。

(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)

前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
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、退職一時金制度を採用しております。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 100,461千円 (2)退職給付引当金 100,461千円	2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 75,177千円 (2)退職給付引当金 75,177千円
3. 退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 32,884千円 (2)退職給付費用 32,884千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。	3. 退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 37,467千円 (2)退職給付費用 37,467千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)																																																						
<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td> 未払事業税</td><td style="text-align: right;">1,023</td></tr> <tr><td> 少額固定資産</td><td style="text-align: right;">71</td></tr> <tr><td> 賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">10,263</td></tr> <tr><td> 未払費用</td><td style="text-align: right;">8,270</td></tr> <tr><td> 退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">35,804</td></tr> <tr><td> 資産除去債務</td><td style="text-align: right;">1,476</td></tr> <tr><td> その他</td><td style="text-align: right;">235</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">57,142</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">1,475</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">55,667</td></tr> </table>	繰延税金資産		未払事業税	1,023	少額固定資産	71	賞与引当金超過額	10,263	未払費用	8,270	退職給付引当金超過額	35,804	資産除去債務	1,476	その他	235	繰延税金資産小計	57,142	評価性引当額	1,475	繰延税金資産の純額	55,667	<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td> 未払事業税</td><td style="text-align: right;">66</td></tr> <tr><td> 賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">17,810</td></tr> <tr><td> 未払費用</td><td style="text-align: right;">4,581</td></tr> <tr><td> 退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">26,793</td></tr> <tr><td> 資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,665</td></tr> <tr><td> 税務上の繰越欠損金</td><td style="text-align: right;">112,728</td></tr> <tr><td> その他</td><td style="text-align: right;">613</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">170,256</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">417</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">169,839</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td> その他有価証券評価差額</td><td style="text-align: right;">457</td></tr> <tr><td> 金</td><td></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">169,382</td></tr> </table>	繰延税金資産		未払事業税	66	賞与引当金超過額	17,810	未払費用	4,581	退職給付引当金超過額	26,793	資産除去債務	7,665	税務上の繰越欠損金	112,728	その他	613	繰延税金資産小計	170,256	評価性引当額	417	繰延税金資産合計	169,839	繰延税金負債		その他有価証券評価差額	457	金		繰延税金負債合計	457	繰延税金資産の純額	169,382
繰延税金資産																																																							
未払事業税	1,023																																																						
少額固定資産	71																																																						
賞与引当金超過額	10,263																																																						
未払費用	8,270																																																						
退職給付引当金超過額	35,804																																																						
資産除去債務	1,476																																																						
その他	235																																																						
繰延税金資産小計	57,142																																																						
評価性引当額	1,475																																																						
繰延税金資産の純額	55,667																																																						
繰延税金資産																																																							
未払事業税	66																																																						
賞与引当金超過額	17,810																																																						
未払費用	4,581																																																						
退職給付引当金超過額	26,793																																																						
資産除去債務	7,665																																																						
税務上の繰越欠損金	112,728																																																						
その他	613																																																						
繰延税金資産小計	170,256																																																						
評価性引当額	417																																																						
繰延税金資産合計	169,839																																																						
繰延税金負債																																																							
その他有価証券評価差額	457																																																						
金																																																							
繰延税金負債合計	457																																																						
繰延税金資産の純額	169,382																																																						
<p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">10.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">3.2%</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">24.9%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">78.4%</td></tr> </table>	法定実効税率	40.7%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	10.6%	住民税均等割	3.2%	評価性引当額	0.2%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	24.9%	その他	0.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	78.4%	<p>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</p> <p>税引前当期純損失であるため、記載を省略しております。</p>																																						
法定実効税率	40.7%																																																						
(調整)																																																							
交際費等永久に損金に算入されない項目	10.6%																																																						
住民税均等割	3.2%																																																						
評価性引当額	0.2%																																																						
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	24.9%																																																						
その他	0.7%																																																						
税効果会計適用後の法人税等の負担率	78.4%																																																						

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）

が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。

これに伴い、繰延税金資産の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.6%になります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額が6,474千円、その他有価証券評価差額金が1千円、それぞれ減少し、法人税等調整額が6,473千円増加しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社は「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り、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）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益の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みであるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益（千円）	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	529,665	-

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益の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みであるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益（千円）	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	430,339	-

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	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）
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	東京都渋谷区	100,005百万円	損害保険業	(被所有)直接50%	投資顧問契約	投資助言報酬(注1)	529,665		
						役員の兼任等	出向者人件費(注2)	112,755		

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	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）
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	東京都渋谷区	100,005百万円	損害保険業	(被所有)直接50%	投資顧問契約	投資助言報酬(注1)	430,339		
						役員の兼任等	出向者人件費(注2)	82,689		

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額 115,496.94円 1株当たり当期純利益 469.62円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 97,281.58円 1株当たり当期純損失 17,865.08円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 5,635千円 普通株式に係る当期純利益 5,635千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	1株当たり当期純損失の算定上の基礎 損益計算書上の当期純損失 214,381千円 普通株式に係る当期純損失 214,381千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。
普通株式の期中平均株式数 12,000株	普通株式の期中平均株式数 12,000株

(重要な後発事象)

当事業年度(自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)

三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、三井住友アセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日として三井住友アセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意をし、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立致しました。

合併の目的

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、合併致しました。

合併する相手会社の概要(平成24年3月期)

名称	三井住友アセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	2,000,000千円
純資産	28,317,951千円
総資産	33,452,870千円
営業利益	2,871,423千円
当期純利益	1,662,477千円

合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、三井住友アセットマネジメント株式会社が当社の全株式を取得した後に行い、三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社とする吸収合併方式であり、当社は解散致しました。合併後の名称は、三井住友アセットマネジメント株式会社であります。

合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

三井住友アセットマネジメント株式会社は、当社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

	第30期中間会計期間 (平成26年 9月30日)
資産の部	

流動資産		
現金及び預金		18,997,518
有価証券		4,999,874
前払費用		304,294
未収委託者報酬		4,589,508
未収運用受託報酬		1,002,478
未収投資助言報酬		455,043
未収収益		13,850
繰延税金資産		521,146
その他		11,538
流動資産合計		30,895,252
固定資産		
有形固定資産	1	316,982
無形固定資産		506,741
投資その他の資産		
投資有価証券		7,334,420
その他		1,602,919
投資その他の資産合計		8,937,340
固定資産合計		9,761,063
資産合計		40,656,316
負債の部		
流動負債		
預り金		54,173
未払金		2,451,219
未払費用		2,016,536
未払法人税等		750,683
前受収益		1,510
賞与引当金		1,003,986
その他	2	301,269
流動負債合計		6,579,379
固定負債		
退職給付引当金		2,578,112
固定負債合計		2,578,112
負債合計		9,157,492
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		18,272,843
利益剰余金合計		20,094,047
株主資本合計		30,723,031
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		775,791

評価・換算差額等合計	775,791
純資産合計	31,498,823
負債純資産合計	40,656,316

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		14,854,036
運用受託報酬		1,784,363
投資助言報酬		997,024
その他の営業収益		50,034
営業収益計		17,685,459
営業費用		11,335,716
一般管理費	1	4,468,747
営業利益		1,880,995
営業外収益	2	20,303

営業外費用	3	6,317
経常利益		<u>1,894,982</u>
特別利益	4	197,263
特別損失		1,823
税引前中間純利益		<u>2,090,422</u>
法人税、住民税及び事業税		729,776
法人税等調整額		23,662
法人税等合計		<u>753,439</u>
中間純利益		<u>1,336,983</u>

(3)中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更 による累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当中間期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
中間純利益							1,336,983	1,336,983	1,336,983
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	515,216	515,216	515,216

当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,272,843	20,094,047	30,723,031
---------	-----------	-----------	-----------	---------	--------	-----------	------------	------------	------------

	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	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更 による累積的影 響額			439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当中間期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
中間純利益			1,336,983
株主資本以外の項 目の当中間期変動 額(純額)	118,553	118,553	118,553
当中間期変動額合計	118,553	118,553	396,663
当中間期末残高	775,791	775,791	31,498,823

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(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)

時価のないもの

移動平均法による原価法

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。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ13,457千円減少しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間 (平成26年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	983,696千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額17,535千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	54,319千円
無形固定資産	79,993千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	9,738千円
受取利息	2,831千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	6,317千円

4. 特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益	193,313千円
------------------------------	-----------

(中間株主資本等変動計算書関係)

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2. 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)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

(リース取引関係)

第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	544,850千円
1年超	1,631,694千円
合 計	2,176,544千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

平成26年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	18,997,518	18,997,518	-
(2)未収委託者報酬	4,589,508	4,589,508	-
(3)未収運用受託報酬	1,002,478	1,002,478	-
(4)未収投資助言報酬	455,043	455,043	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,874	4,999,500	374
その他有価証券	7,319,862	7,319,862	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	552,079	552,079	-
資産計	37,916,364	37,915,990	374
(1)未払金			
未払手数料	2,261,403	2,261,403	-
負債計	2,261,403	2,261,403	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬 及び(4) 未収投資助言報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 投資その他の資産

長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払金

未払手数料

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

(注2) 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

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	14,260
合計	14,558
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	353,036
合計	353,036

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	4,999,874	4,999,500	374
小計	4,999,874	4,999,500	374
合計	4,999,874	4,999,500	374

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 353,036千円）は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
----	------------	------	----

(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,979,830	5,792,552	1,187,277
小計	6,979,830	5,792,552	1,187,277
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	340,032	343,595	3,563
小計	340,032	343,595	3,563
合計	7,319,862	6,136,147	1,183,714

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 14,558千円）については、市場価格がなく、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、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 売上高	14,854,036	1,784,363	997,024	50,034	17,685,459

(2)地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

（1株当たり情報）

第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,785,647円61銭
1株当たり中間純利益	75,792円69銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。また、「会計方針の変更」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が、24,889円9銭減少し、1株当たり中間純利益金額は、762円88銭減少しております。</p>	
（注）1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	31,498,823千円
普通株式に係る純資産額	31,498,823千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,336,983千円
普通株式に係る中間純利益	1,336,983千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（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。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、

投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

平成26年6月26日に開催された定時株主総会において、株主総会および取締役会の招集者と議長について、取締役社長に加えて取締役会長も招集者および議長となることができることとする定款の変更が決議されました。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実 該当ありません。

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】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成26年9月末現在）
- (ハ) 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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成26年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	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。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、平成26年9月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有しています。

第3【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月13日

三井住友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

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫

公認会計士 辰 巳 幸 久

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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26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

平成27年1月20日

三井住友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 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式指数ファンドの平成25年12月3日から平成26年12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、外国株式指数ファンドの平成26年12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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年11月28日

三井住友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

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

公認会計士 池 ヶ 谷 正 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アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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