

【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6月30日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長 鈴木 郁也 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝3丁目3番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志 |
| 【電話番号】 | 03-6737-0521 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | DCマイセレクション25 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DCマイセレクション25

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

平成27年 7月 1日から平成27年12月28日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

国内株式、国内債券、外国株式及び外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長を目指します。

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

| | | | | | | |
|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|---------------------|--------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 年2回 年4回 | グロ ー バ ル (日本を 含む) | ファミリ ー ファン ド ファン ド・ オブ・ファ ンズ | あり () なし | 日経225 TOPIX その他 () | ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型 その他 () |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 () | 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 | 日本 北米 欧州 アジア オセアニ ア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) | | | | |
| 不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、短期 金融資産)資産 配分固定型)) | その他 () | | | | | |
| 資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型 | | エマ ー ジ ング | | | | |

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉と

する旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

る旨の記載があるものをいう。

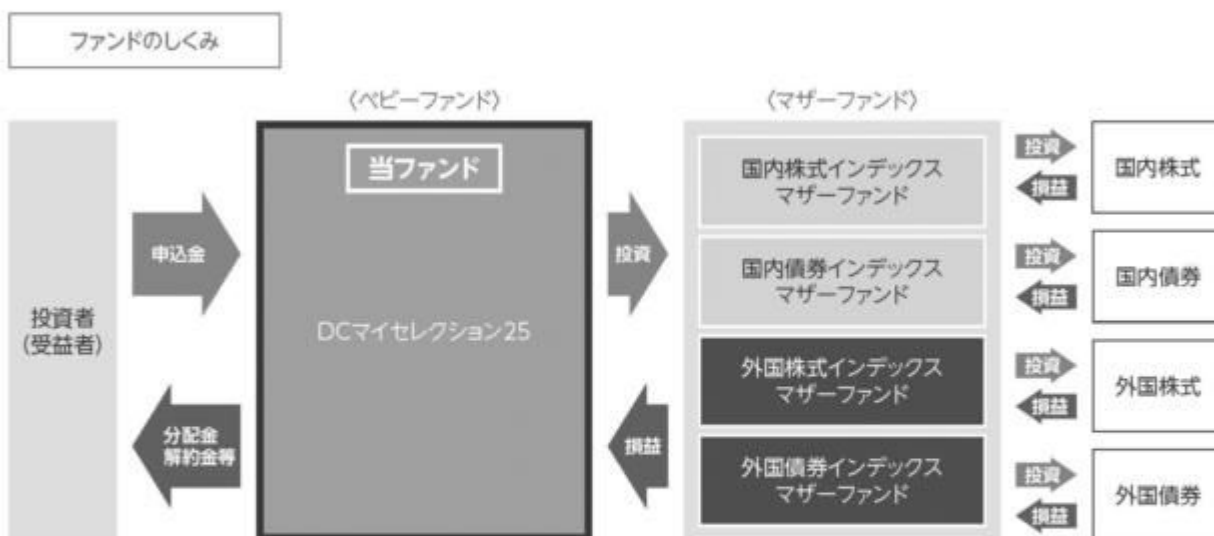
(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

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

<ファンドの特色>

1. 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。



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

? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

| 資産 | インデックス |
|------|----------------------------------------|
| 国内株式 | TOPIX (東証株価指数) ¹ |
| 国内債券 | NOMURA-BPI 総合 ² |
| 外国株式 | MSCI コクサイ・インデックス (円ベース) ³ |
| 外国債券 | シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ⁴ |

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

1 「TOPIX (東証株価指数)」とは、株式会社東京証券取引所 (以下「東証」) が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、

ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

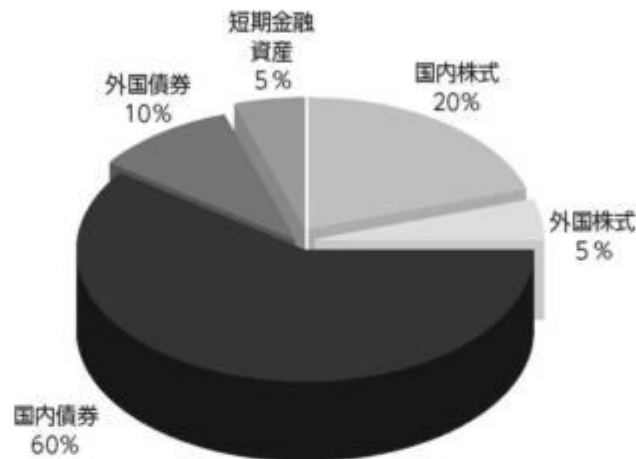
- 2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- 3 「MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有していません。
- 4 「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3.

期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式20%、外国株式5%、国内債券60%、外国債券10%、短期金融資産5%を基準アセットミックスとして運用します。

- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準アセットミックスから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準アセットミックスは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準アセットミックス



ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基準アセットミックスに基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。

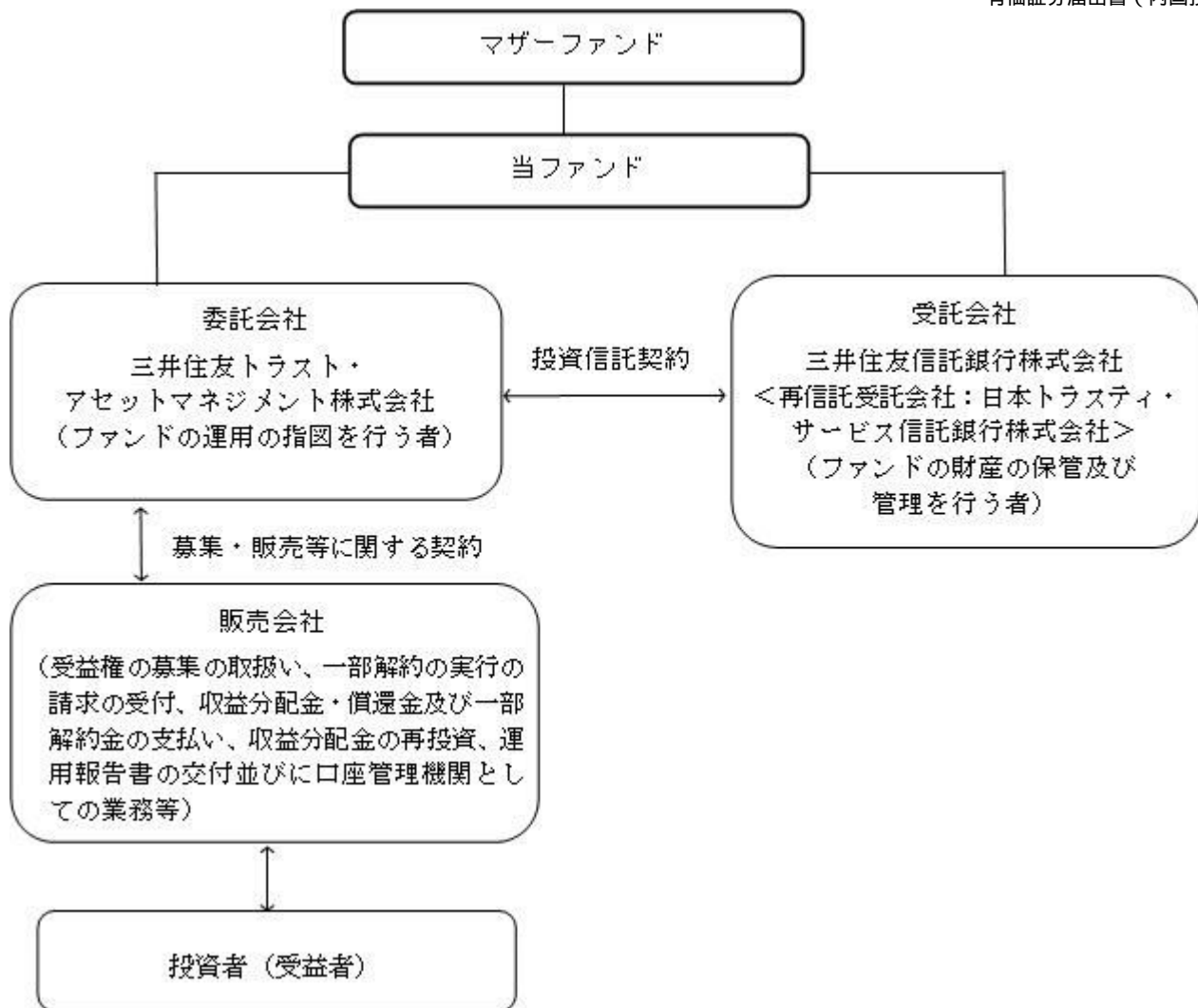
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

| | |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 平成13年10月1日 | 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始 |
| 平成24年4月1日 | 本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクション25」から「DCマイセレクション25」に変更 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更 |

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 4月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

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

（ロ）運用方法

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」および「外国債券インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2)基準ポートフォリオは、国内株式20%、国内債券60%、外国株式5%、外国債券10%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。
- 3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5)投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格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を行うことができます。
- 7)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

二．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託会社は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（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. 国内株式インデックス マザーファンド
2. 国内債券インデックス マザーファンド
3. 外国株式インデックス マザーファンド
4. 外国債券インデックス マザーファンド
5. 株券または新株引受権証書
6. 国債証券
7. 地方債証券
8. 特別の法律により法人の発行する債券
9. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
11. 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。）
12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
13. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
14. コマーシャル・ペーパー
15. 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
16. 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
17. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
18. 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。）
19. 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。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
21. 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。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 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
26. 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5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5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6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

(八) 委託会社は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンド概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対

する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財

産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用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を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

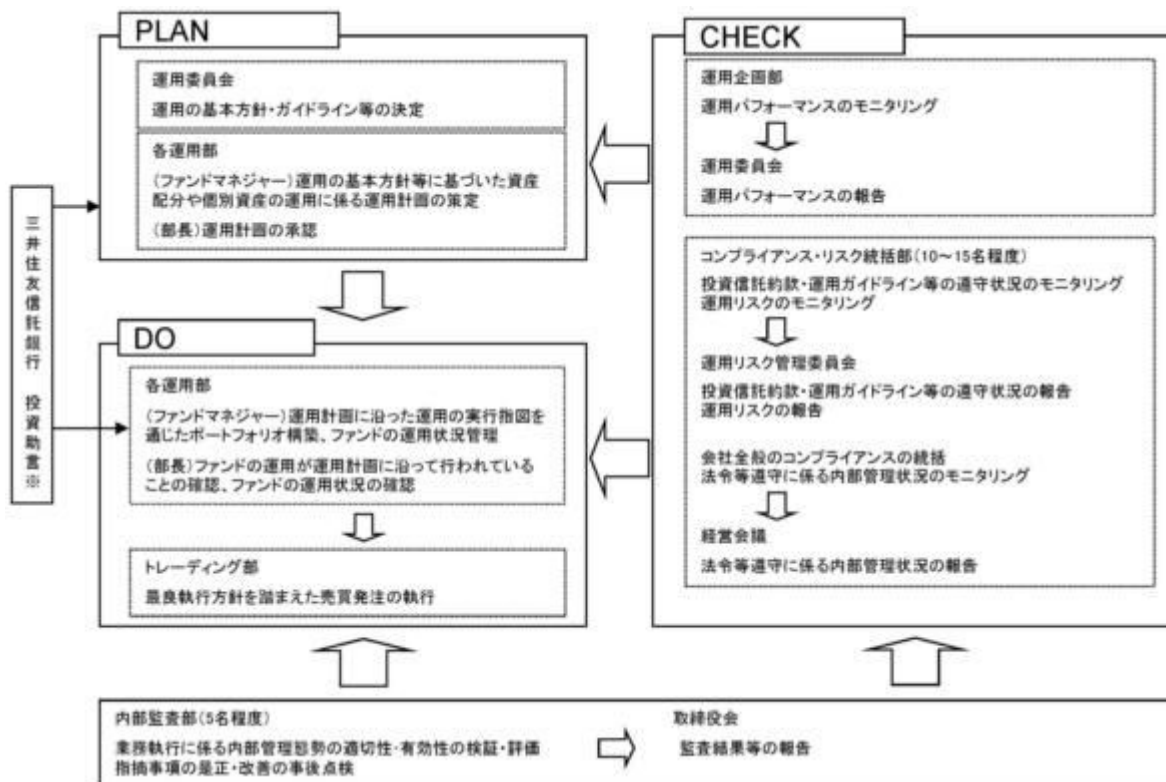
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に

対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

（4）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額と

します。

- ・分配については、委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の25%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託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。（投資信託約款第19条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク

を回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク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。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスク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を指図することができます。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本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）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、売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることがで

き、この指図は、当該借入に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第31条）

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第39条）

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(イ)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

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

(ロ) リスクの管理体制

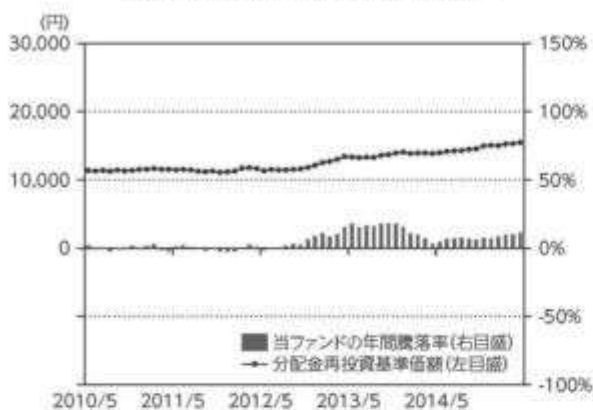
委託会社におけるリスク管理体制

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

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

【参考情報】

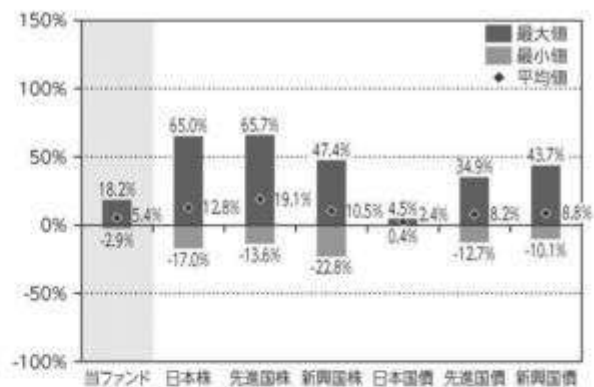
当ファンドの年間騰落率及び 分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



*2010年5月～2015年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX (東証株価指数、配当込み)^{※1}

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

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債… JPモルガン・ガバナメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)^{※6}

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

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

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

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

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.2808%（税抜 0.26%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|------|-----------------------|-----------------------------------------|
| 委託会社 | 年率 0.1404% （税抜 0.13%） | 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 |
| 販売会社 | 年率 0.108% （税抜 0.1%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率 0.0324% （税抜 0.03%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

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

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

5【運用状況】

以下は、平成27年 4月30日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセレクション25】

（１）【投資状況】

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 29,247,055,078 | 96.03 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,209,914,494 | 3.97 |
| 合計(純資産総額) | | 30,456,969,572 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 投資比率(%) |
|------|-----------|--------------------|----------------|-----------|----------------|----------|----------------|---------|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックス マザーファンド | 13,509,757,924 | 1.3033 | 17,607,632,215 | 1.3277 | 17,936,905,595 | 58.89 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス マザーファンド | 4,864,193,584 | 1.1062 | 5,380,770,943 | 1.3425 | 6,530,179,886 | 21.44 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国債券インデックス マザーファンド | 1,067,804,527 | 2.6552 | 2,835,315,229 | 2.8233 | 3,014,732,521 | 9.90 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------|--------------------|-------------|--------|---------------|--------|---------------|------|
| 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 | 839,110,651 | 1.8260 | 1,532,295,565 | 2.1037 | 1,765,237,076 | 5.80 |
|----|-----------|--------------------|-------------|--------|---------------|--------|---------------|------|

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 96.03 |
| 合計 | 96.03 |

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額(円) | | 1万口当たりの純資産額(円) | |
|-------------------------|----------------|----------------|----------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第4期計算期間末 (平成17年 9月30日) | 3,388,829,111 | 3,388,829,111 | 11,588 | 11,588 |
| 第5期計算期間末 (平成18年10月 2日) | 6,601,112,481 | 6,601,112,481 | 12,167 | 12,167 |
| 第6期計算期間末 (平成19年10月 1日) | 9,272,760,350 | 9,272,760,350 | 12,548 | 12,548 |
| 第7期計算期間末 (平成20年 9月30日) | 10,651,165,829 | 10,651,165,829 | 11,551 | 11,551 |
| 第8期計算期間末 (平成21年 9月30日) | 11,547,455,341 | 11,547,455,341 | 11,386 | 11,386 |
| 第9期計算期間末 (平成22年 9月30日) | 12,646,942,774 | 12,646,942,774 | 11,424 | 11,424 |
| 第10期計算期間末 (平成23年 9月30日) | 15,059,779,253 | 15,059,779,253 | 11,199 | 11,199 |
| 第11期計算期間末 (平成24年10月 1日) | 18,760,389,848 | 18,760,389,848 | 11,515 | 11,515 |
| 第12期計算期間末 (平成25年 9月30日) | 22,915,591,315 | 22,915,591,315 | 13,574 | 13,574 |
| 第13期計算期間末 (平成26年 9月30日) | 27,361,873,335 | 27,361,873,335 | 14,469 | 14,469 |
| 平成26年 4月末日 | 25,234,702,949 | | 13,847 | |
| 5月末日 | 25,735,707,976 | | 13,962 | |
| 6月末日 | 26,294,188,370 | | 14,141 | |
| 7月末日 | 26,742,128,807 | | 14,237 | |
| 8月末日 | 26,819,307,169 | | 14,271 | |
| 9月末日 | 27,361,873,335 | | 14,469 | |
| 10月末日 | 27,934,472,182 | | 14,520 | |

| | | | |
|------------|----------------|--|--------|
| 11月末日 | 28,829,923,790 | | 14,964 |
| 12月末日 | 29,216,600,983 | | 15,077 |
| 平成27年 1月末日 | 29,228,707,169 | | 15,007 |
| 2月末日 | 29,648,871,828 | | 15,244 |
| 3月末日 | 30,106,493,759 | | 15,305 |
| 4月末日 | 30,456,969,572 | | 15,445 |

【分配の推移】

| | 期 間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|----------|-------------------------|---------------|
| 第4期計算期間 | 平成16年10月 1日～平成17年 9月30日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 平成17年10月 1日～平成18年10月 2日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 平成18年10月 3日～平成19年10月 1日 | 0 |
| 第7期計算期間 | 平成19年10月 2日～平成20年 9月30日 | 0 |
| 第8期計算期間 | 平成20年10月 1日～平成21年 9月30日 | 0 |
| 第9期計算期間 | 平成21年10月 1日～平成22年 9月30日 | 0 |
| 第10期計算期間 | 平成22年10月 1日～平成23年 9月30日 | 0 |
| 第11期計算期間 | 平成23年10月 1日～平成24年10月 1日 | 0 |
| 第12期計算期間 | 平成24年10月 2日～平成25年 9月30日 | 0 |
| 第13期計算期間 | 平成25年10月 1日～平成26年 9月30日 | 0 |

【収益率の推移】

| | 期 間 | 収益率（％） |
|------------|-------------------------|--------|
| 第4期計算期間 | 平成16年10月 1日～平成17年 9月30日 | 7.7 |
| 第5期計算期間 | 平成17年10月 1日～平成18年10月 2日 | 5.0 |
| 第6期計算期間 | 平成18年10月 3日～平成19年10月 1日 | 3.1 |
| 第7期計算期間 | 平成19年10月 2日～平成20年 9月30日 | 7.9 |
| 第8期計算期間 | 平成20年10月 1日～平成21年 9月30日 | 1.4 |
| 第9期計算期間 | 平成21年10月 1日～平成22年 9月30日 | 0.3 |
| 第10期計算期間 | 平成22年10月 1日～平成23年 9月30日 | 2.0 |
| 第11期計算期間 | 平成23年10月 1日～平成24年10月 1日 | 2.8 |
| 第12期計算期間 | 平成24年10月 2日～平成25年 9月30日 | 17.9 |
| 第13期計算期間 | 平成25年10月 1日～平成26年 9月30日 | 6.6 |
| 第14期中間計算期間 | 平成26年10月 1日～平成27年 3月31日 | 5.8 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|------------|-------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第4期計算期間 | 平成16年10月 1日～平成17年 9月30日 | 1,862,797,963 | 170,144,681 | 2,924,308,393 |
| 第5期計算期間 | 平成17年10月 1日～平成18年10月 2日 | 3,025,489,509 | 524,316,745 | 5,425,481,157 |
| 第6期計算期間 | 平成18年10月 3日～平成19年10月 1日 | 2,860,915,713 | 896,506,692 | 7,389,890,178 |
| 第7期計算期間 | 平成19年10月 2日～平成20年 9月30日 | 2,635,705,553 | 804,657,223 | 9,220,938,508 |
| 第8期計算期間 | 平成20年10月 1日～平成21年 9月30日 | 1,779,813,085 | 858,869,963 | 10,141,881,630 |
| 第9期計算期間 | 平成21年10月 1日～平成22年 9月30日 | 1,735,481,576 | 807,208,250 | 11,070,154,956 |
| 第10期計算期間 | 平成22年10月 1日～平成23年 9月30日 | 3,346,014,906 | 968,606,685 | 13,447,563,177 |
| 第11期計算期間 | 平成23年10月 1日～平成24年10月 1日 | 3,864,486,771 | 1,020,101,320 | 16,291,948,628 |
| 第12期計算期間 | 平成24年10月 2日～平成25年 9月30日 | 2,886,146,198 | 2,295,802,968 | 16,882,291,858 |
| 第13期計算期間 | 平成25年10月 1日～平成26年 9月30日 | 3,563,330,174 | 1,535,389,837 | 18,910,232,195 |
| 第14期中間計算期間 | 平成26年10月 1日～平成27年 3月31日 | 1,835,380,669 | 1,074,299,609 | 19,671,313,255 |

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 150,079,095,630 | 98.45 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 2,363,789,848 | 1.55 |
| 合計(純資産総額) | | 152,442,885,478 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------|---------|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 2,223,900,000 | 1.46 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|----------|----|-------------------|------------|-----------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 888,500 | 5,680.13 | 5,046,795,505 | 8,358.00 | 7,426,083,000 | 4.87 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 5,099,500 | 579.11 | 2,953,171,445 | 855.90 | 4,364,662,050 | 2.86 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 336,100 | 7,264.40 | 2,441,564,840 | 7,505.00 | 2,522,430,500 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 480,700 | 4,103.22 | 1,972,417,854 | 5,242.00 | 2,519,829,400 | 1.65 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 579,500 | 3,533.15 | 2,047,460,425 | 4,041.50 | 2,342,049,250 | 1.54 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 8,856,600 | 197.92 | 1,752,910,110 | 228.70 | 2,025,504,420 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 248,700 | 5,992.23 | 1,490,267,601 | 8,084.00 | 2,010,490,800 | 1.32 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 645,700 | 2,005.67 | 1,295,061,119 | 2,840.00 | 1,833,788,000 | 1.20 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 67,000 | 17,504.18 | 1,172,780,060 | 26,525.00 | 1,777,175,000 | 1.17 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 399,900 | 3,440.23 | 1,375,747,977 | 4,211.00 | 1,683,978,900 | 1.10 |
| 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 373,400 | 3,330.09 | 1,243,455,606 | 4,283.00 | 1,599,272,200 | 1.05 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 252,700 | 4,624.34 | 1,168,570,718 | 6,157.00 | 1,555,873,900 | 1.02 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 420,900 | 1,720.69 | 724,238,421 | 3,644.50 | 1,533,970,050 | 1.01 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 768,100 | 1,300.11 | 998,614,491 | 1,869.50 | 1,435,962,950 | 0.94 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 265,900 | 4,083.93 | 1,085,916,987 | 5,175.00 | 1,376,032,500 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | パナソニック | 電気機器 | 784,800 | 1,108.71 | 870,115,608 | 1,724.00 | 1,352,995,200 | 0.89 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 473,000 | 2,484.39 | 1,175,116,470 | 2,823.00 | 1,335,279,000 | 0.88 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 1,546,000 | 682.78 | 1,055,577,880 | 819.30 | 1,266,637,800 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 487,100 | 2,014.73 | 981,374,983 | 2,590.50 | 1,261,832,550 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 257,300 | 3,173.09 | 816,436,057 | 4,901.00 | 1,261,027,300 | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 118,000 | 7,706.85 | 909,408,300 | 10,595.00 | 1,250,210,000 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 東海旅客鉄道 | 陸運業 | 57,700 | 13,520.22 | 780,116,694 | 21,455.00 | 1,237,953,500 | 0.81 |
| 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 337,000 | 3,201.51 | 1,078,908,870 | 3,561.50 | 1,200,225,500 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 67,600 | 8,651.09 | 584,813,684 | 16,970.00 | 1,147,172,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 903,900 | 928.57 | 839,334,423 | 1,251.00 | 1,130,778,900 | 0.74 |
| 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 211,400 | 3,617.22 | 764,680,308 | 5,021.00 | 1,061,439,400 | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 181,400 | 4,124.54 | 748,191,556 | 5,749.00 | 1,042,868,600 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | NTTドコモ | 情報・通信業 | 489,900 | 1,692.17 | 828,994,083 | 2,125.00 | 1,041,037,500 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 644,000 | 1,191.18 | 767,119,920 | 1,564.00 | 1,007,216,000 | 0.66 |
| 日本 | 株式 | 野村ホールディングス | 証券、商品先物取引業 | 1,300,000 | 679.37 | 883,181,000 | 773.40 | 1,005,420,000 | 0.66 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------|--------|-------------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.07 |

| | | |
|------------|-------|-------|
| 鉱業 | 0.43 | |
| 建設業 | 2.55 | |
| 食料品 | 4.02 | |
| 繊維製品 | 0.74 | |
| パルプ・紙 | 0.24 | |
| 化学 | 5.83 | |
| 医薬品 | 4.74 | |
| 石油・石炭製品 | 0.47 | |
| ゴム製品 | 0.94 | |
| ガラス・土石製品 | 0.90 | |
| 鉄鋼 | 1.44 | |
| 非鉄金属 | 0.90 | |
| 金属製品 | 0.62 | |
| 機械 | 4.83 | |
| 電気機器 | 12.85 | |
| 輸送用機器 | 11.35 | |
| 精密機器 | 1.37 | |
| その他製品 | 1.50 | |
| 電気・ガス業 | 1.97 | |
| 陸運業 | 3.98 | |
| 海運業 | 0.31 | |
| 空運業 | 0.60 | |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.21 | |
| 情報・通信業 | 6.66 | |
| 卸売業 | 4.04 | |
| 小売業 | 4.28 | |
| 銀行業 | 9.36 | |
| 証券、商品先物取引業 | 1.37 | |
| 保険業 | 2.53 | |
| その他金融業 | 1.28 | |
| 不動産業 | 2.97 | |
| サービス業 | 3.10 | |
| | 小計 | 98.45 |
| 合計 | | 98.45 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|---------|---------|------|----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物 | 買建 | 140円 | | 2,217,029,940 | 2,223,900,000 | 1.46 |

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|---------|-----------------|----------|
| 国債証券 | 日本 | 253,699,586,900 | 80.12 |
| | ポーランド | 201,648,000 | 0.06 |
| | メキシコ | 101,040,000 | 0.03 |
| | 小計 | 254,002,274,900 | 80.22 |
| 地方債証券 | 日本 | 19,205,232,466 | 6.07 |
| 特殊債券 | 日本 | 25,688,506,513 | 8.11 |
| | アメリカ | 209,480,000 | 0.07 |
| | 韓国 | 100,481,000 | 0.03 |
| | 小計 | 25,998,467,513 | 8.21 |
| 社債券 | 日本 | 14,886,238,690 | 4.70 |
| | アメリカ | 506,187,000 | 0.16 |
| | オランダ | 305,143,000 | 0.10 |
| | オーストラリア | 302,873,000 | 0.10 |
| | スウェーデン | 302,413,000 | 0.10 |
| | フランス | 100,263,000 | 0.03 |
| | 小計 | 16,403,117,690 | 5.18 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,026,885,489 | 0.32 |
| 合計(純資産総額) | | 316,635,978,058 | 100.00 |

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資比率 (%) |
|--------|------|---------------|---------------|------------|---------------|-----------|---------------|--------|------------|----------|
| 日本 | 国債証券 | 第122回利付国債(5年) | 4,900,000,000 | 100.25 | 4,912,423,800 | 100.13 | 4,906,762,000 | 0.100 | 2019/12/20 | 1.55 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債(5年) | 4,390,000,000 | 100.64 | 4,418,242,000 | 100.90 | 4,429,685,600 | 0.300 | 2018/6/20 | 1.40 |
| 日本 | 国債証券 | 第120回利付国債(5年) | 4,240,000,000 | 100.34 | 4,254,745,100 | 100.61 | 4,265,864,000 | 0.200 | 2019/9/20 | 1.35 |
| 日本 | 国債証券 | 第117回利付国債(5年) | 4,170,000,000 | 100.17 | 4,177,287,400 | 100.65 | 4,197,355,200 | 0.200 | 2019/3/20 | 1.33 |
| 日本 | 国債証券 | 第116回利付国債(5年) | 4,020,000,000 | 100.26 | 4,030,520,000 | 100.66 | 4,046,893,800 | 0.200 | 2018/12/20 | 1.28 |
| 日本 | 国債証券 | 第118回利付国債(5年) | 3,650,000,000 | 100.20 | 3,657,300,000 | 100.65 | 3,674,017,000 | 0.200 | 2019/6/20 | 1.16 |
| 日本 | 国債証券 | 第105回利付国債(5年) | 3,500,000,000 | 100.29 | 3,510,321,500 | 100.42 | 3,514,840,000 | 0.200 | 2017/6/20 | 1.11 |
| 日本 | 国債証券 | 第106回利付国債(5年) | 3,260,000,000 | 100.32 | 3,270,723,400 | 100.47 | 3,275,452,400 | 0.200 | 2017/9/20 | 1.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付国債(10年) | 3,010,000,000 | 103.06 | 3,102,167,300 | 104.70 | 3,151,500,100 | 0.800 | 2022/9/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第334回利付国債(10年) | 2,950,000,000 | 100.68 | 2,970,090,300 | 102.89 | 3,035,284,500 | 0.600 | 2024/6/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第97回利付国債(5年) | 3,000,000,000 | 100.63 | 3,019,155,000 | 100.45 | 3,013,590,000 | 0.400 | 2016/6/20 | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第332回利付国債(10年) | 2,900,000,000 | 100.49 | 2,914,210,000 | 103.04 | 2,988,160,000 | 0.600 | 2023/12/20 | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第335回利付国債(10年) | 2,860,000,000 | 100.38 | 2,870,914,300 | 101.91 | 2,914,797,600 | 0.500 | 2024/9/20 | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第333回利付国債(10年) | 2,750,000,000 | 100.30 | 2,758,288,400 | 102.94 | 2,831,042,500 | 0.600 | 2024/3/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第115回利付国債(5年) | 2,660,000,000 | 100.29 | 2,667,907,200 | 100.64 | 2,677,024,000 | 0.200 | 2018/9/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第99回利付国債(5年) | 2,600,000,000 | 100.70 | 2,618,458,000 | 100.56 | 2,614,612,000 | 0.400 | 2016/9/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債(10年) | 2,490,000,000 | 104.87 | 2,611,263,000 | 103.93 | 2,587,906,800 | 1.500 | 2017/12/20 | 0.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第103回利付国債(5年) | 2,500,000,000 | 100.56 | 2,514,180,500 | 100.57 | 2,514,475,000 | 0.300 | 2017/3/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第321回利付国債(10年) | 2,330,000,000 | 104.87 | 2,443,572,400 | 106.06 | 2,471,361,100 | 1.000 | 2022/3/20 | 0.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第329回利付国債(10年) | 2,300,000,000 | 102.75 | 2,363,345,600 | 104.71 | 2,408,330,000 | 0.800 | 2023/6/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第330回利付国債(10年) | 2,240,000,000 | 102.48 | 2,295,641,600 | 104.72 | 2,345,840,000 | 0.800 | 2023/9/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債(10年) | 2,170,000,000 | 106.08 | 2,302,076,200 | 106.23 | 2,305,364,600 | 1.200 | 2020/12/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第102回利付国債(5年) | 2,280,000,000 | 100.52 | 2,291,878,800 | 100.50 | 2,291,445,600 | 0.300 | 2016/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債(10年) | 2,160,000,000 | 106.03 | 2,290,296,800 | 105.69 | 2,282,904,000 | 1.300 | 2019/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第320回利付国債(10年) | 2,100,000,000 | 104.89 | 2,202,762,600 | 105.88 | 2,223,585,000 | 1.000 | 2021/12/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債(10年) | 2,100,000,000 | 105.76 | 2,221,149,000 | 105.02 | 2,205,483,000 | 1.500 | 2018/9/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第315回利付国債(10年) | 2,050,000,000 | 106.49 | 2,183,130,000 | 106.72 | 2,187,842,000 | 1.200 | 2021/6/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第288回利付国債(10年) | 2,090,000,000 | 105.23 | 2,199,307,000 | 104.03 | 2,174,289,700 | 1.700 | 2017/9/20 | 0.69 |
| 日本 | 国債証券 | 第328回利付国債(10年) | 2,010,000,000 | 100.92 | 2,028,492,000 | 103.13 | 2,073,073,800 | 0.600 | 2023/3/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債(2年) | 2,060,000,000 | 100.16 | 2,063,392,200 | 100.15 | 2,063,254,800 | 0.100 | 2016/10/15 | 0.65 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 80.22 |
| 地方債証券 | 6.07 |
| 特殊債券 | 8.21 |
| 社債券 | 5.18 |
| 合計 | 99.68 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|---------|-----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 142,773,538,347 | 55.47 |
| | イギリス | 20,608,307,350 | 8.01 |
| | カナダ | 10,501,901,014 | 4.08 |
| | スイス | 10,362,048,502 | 4.03 |
| | ドイツ | 9,641,838,295 | 3.75 |
| | フランス | 9,492,320,926 | 3.69 |
| | オーストラリア | 7,000,346,742 | 2.72 |
| | オランダ | 4,260,643,454 | 1.66 |
| | アイルランド | 4,053,795,362 | 1.58 |
| | スペイン | 3,714,860,359 | 1.44 |
| | スウェーデン | 3,185,649,982 | 1.24 |
| | 香港 | 2,776,597,834 | 1.08 |
| | イタリア | 2,226,861,563 | 0.87 |
| | デンマーク | 1,764,198,906 | 0.69 |
| | シンガポール | 1,653,447,588 | 0.64 |
| | ジャージー | 1,445,600,852 | 0.56 |
| | ベルギー | 1,366,181,504 | 0.53 |
| | キュラソー | 956,536,785 | 0.37 |
| | バミューダ | 924,132,965 | 0.36 |
| | フィンランド | 891,276,118 | 0.35 |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | ノルウェー | 650,210,033 | 0.25 |
| | イスラエル | 621,807,745 | 0.24 |
| | ケイマン | 399,752,390 | 0.16 |
| | ルクセンブルク | 388,322,802 | 0.15 |
| | オーストリア | 220,237,613 | 0.09 |
| | ポルトガル | 168,150,673 | 0.07 |
| | ニュージーランド | 153,097,913 | 0.06 |
| | パナマ | 136,850,524 | 0.05 |
| | 英ヴァージン諸島 | 103,530,000 | 0.04 |
| | リベリア | 92,504,805 | 0.04 |
| | マン島 | 39,106,035 | 0.02 |
| | モーリシャス | 15,686,166 | 0.01 |
| | 小計 | 242,589,341,147 | 94.26 |
| 投資信託受益証券 | オーストラリア | 154,446,858 | 0.06 |
| | 香港 | 30,139,725 | 0.01 |
| | シンガポール | 26,426,925 | 0.01 |
| | 小計 | 211,013,508 | 0.08 |
| 投資証券 | アメリカ | 4,129,327,380 | 1.60 |
| | オーストラリア | 568,588,330 | 0.22 |
| | フランス | 368,333,413 | 0.14 |
| | イギリス | 361,398,716 | 0.14 |
| | シンガポール | 107,922,102 | 0.04 |
| | 香港 | 105,467,547 | 0.04 |
| | カナダ | 53,031,035 | 0.02 |
| | 小計 | 5,694,068,523 | 2.21 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 8,873,290,306 | 3.45 |
| 合計(純資産総額) | | 257,367,713,484 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|---------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 5,557,627,250 | 2.16 |
| | 買建 | カナダ | 406,613,218 | 0.16 |
| | 買建 | ドイツ | 1,551,066,828 | 0.60 |
| | 買建 | イギリス | 902,980,911 | 0.35 |
| | 買建 | オーストラリア | 458,758,253 | 0.18 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|---------------|------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 406,017,000 | 0.15 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|------|----|------------------------|------------------------|-----------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 388,827 | 11,076.73 | 4,306,932,999 | 15,308.15 | 5,952,225,928 | 2.31 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 519,102 | 4,869.90 | 2,527,974,868 | 5,838.13 | 3,030,590,150 | 1.18 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 280,380 | 11,814.28 | 3,312,488,048 | 10,456.52 | 2,931,801,881 | 1.14 |
| 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 | 185,353 | 12,010.05 | 2,226,099,219 | 11,946.41 | 2,214,302,933 | 0.86 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 326,298 | 6,042.69 | 1,971,720,587 | 6,599.74 | 2,153,481,963 | 0.84 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO | 資本財 | 665,673 | 3,131.74 | 2,084,716,790 | 3,223.71 | 2,145,936,707 | 0.83 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 213,790 | 8,885.84 | 1,899,704,135 | 9,271.51 | 1,982,156,550 | 0.77 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 247,505 | 6,677.80 | 1,652,789,667 | 7,568.40 | 1,873,216,842 | 0.73 |
| スイス | 株式 | NOVARTIS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 152,516 | 10,482.35 | 1,598,726,974 | 12,248.02 | 1,868,019,323 | 0.73 |
| アメリカ | 株式 | PFIZER | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 417,165 | 3,558.71 | 1,484,570,565 | 4,080.50 | 1,702,245,954 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 178,907 | 9,656.92 | 1,727,692,099 | 9,502.14 | 1,700,001,150 | 0.66 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 125,165 | 14,360.82 | 1,797,472,559 | 13,295.87 | 1,664,177,569 | 0.65 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS | 電気通信サービス | 274,752 | 5,892.78 | 1,619,053,431 | 6,005.92 | 1,650,141,279 | 0.64 |
| スイス | 株式 | ROCHE HOLDING GENUSS | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 46,598 | 33,783.40 | 1,574,239,070 | 33,995.54 | 1,584,124,359 | 0.62 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 銀行 | 1,292,794 | 1,150.68 | 1,487,600,155 | 1,186.98 | 1,534,521,139 | 0.60 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|-----------------------------|------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 343,430 | 4,171.60 | 1,432,655,733 | 4,136.43 | 1,420,577,589 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | THE WALT DISNEY CO | メディア | 106,659 | 10,162.02 | 1,083,871,643 | 13,067.38 | 1,393,754,750 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 188,756 | 6,760.71 | 1,276,126,283 | 7,101.92 | 1,340,530,012 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 小売 | 26,063 | 37,449.26 | 976,040,274 | 51,095.03 | 1,331,689,767 | 0.52 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 696,330 | 1,827.36 | 1,272,449,515 | 1,901.62 | 1,324,155,055 | 0.51 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 各種金融 | 76,483 | 15,535.33 | 1,188,189,062 | 16,946.79 | 1,296,141,340 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | ソフトウェア・サービス | 62,329 | 21,438.82 | 1,336,260,747 | 20,753.59 | 1,293,551,134 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | CITIGROUP | 銀行 | 200,607 | 5,725.36 | 1,148,548,770 | 6,397.43 | 1,283,371,246 | 0.50 |
| アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | ソフトウェア・サービス | 132,684 | 7,977.02 | 1,058,423,892 | 9,575.33 | 1,270,493,749 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 18,881 | 67,417.16 | 1,272,903,462 | 66,805.40 | 1,261,352,946 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO | 食品・飲料・タバコ | 261,028 | 4,856.21 | 1,267,609,278 | 4,818.31 | 1,257,713,823 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | INTEL CORP | 半導体・半導体製造装置 | 320,548 | 3,364.29 | 1,078,416,674 | 3,913.31 | 1,254,405,297 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL C | ソフトウェア・サービス | 19,174 | 66,209.89 | 1,269,508,587 | 65,340.51 | 1,252,839,130 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | ORACLE CORP | ソフトウェア・サービス | 235,003 | 4,924.99 | 1,157,387,620 | 5,322.87 | 1,250,890,419 | 0.49 |
| 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 | 99,903 | 10,306.49 | 1,029,649,457 | 12,176.07 | 1,216,426,920 | 0.47 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------|-------------|-------------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 8.29 |
| | | 素材 | 4.94 |
| | | 資本財 | 6.82 |
| | | 商業・専門サービス | 0.85 |
| | | 運輸 | 1.95 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.73 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.61 |
| | | 消費者サービス | 1.63 |
| | | メディア | 3.11 |
| | | 小売 | 3.34 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 2.07 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 5.91 |

| | | |
|----------|------------------------|-------|
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.64 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 3.38 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.78 |
| | 銀行 | 9.22 |
| | 各種金融 | 3.96 |
| | 保険 | 4.10 |
| | 不動産 | 0.71 |
| | ソフトウェア・サービス | 7.02 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.41 |
| | 電気通信サービス | 3.00 |
| | 公益事業 | 3.09 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 1.69 |
| | 小計 | 94.26 |
| 投資信託受益証券 | | 0.08 |
| 投資証券 | | 2.21 |
| 合計 | | 96.55 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|---------|--------------------|---------------|---------|-----|-----------|----------------|---------------|----------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所 | S&P 500 FUTU | 買建 | 89 | アメリカドル | 46,275,175.5 | 5,506,745,884 | 46,702,750 | 5,557,627,250 | 2.16 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 23 | カナダドル | 4,016,243.5 | 397,728,593 | 4,105,960 | 406,613,218 | 0.16 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 41 | スイスフラン | 3,739,167 | 473,602,892 | 3,721,570 | 471,374,056 | 0.18 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOXX | 買建 | 229 | ユーロ | 8,311,120.5 | 1,099,478,131 | 8,161,560 | 1,079,692,772 | 0.42 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 33 | オーストラリアドル | 4,854,931 | 463,306,065 | 4,807,275 | 458,758,253 | 0.18 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 | 買建 | 71 | イギリスポンド | 4,899,671.25 | 900,559,576 | 4,912,845 | 902,980,911 | 0.35 |

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|-----------|---------------|--------------|-------------|-------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 2,350,000.00 | 279,919,790 | 279,626,500 | 0.10 |
| | カナダドル | 買建 | 230,000.00 | 22,662,935 | 22,774,600 | 0.00 |
| | ユーロ | 買建 | 370,000.00 | 48,288,930 | 48,947,300 | 0.01 |
| | イギリスポンド | 買建 | 160,000.00 | 29,268,790 | 29,403,200 | 0.01 |
| | オーストラリアドル | 買建 | 120,000.00 | 11,243,040 | 11,450,400 | 0.00 |
| | 香港ドル | 買建 | 900,000.00 | 13,841,640 | 13,815,000 | 0.00 |

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|-------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 93,160,362,568 | 40.74 |
| | イタリア | 22,146,061,199 | 9.68 |
| | フランス | 21,786,606,681 | 9.53 |
| | イギリス | 18,533,409,781 | 8.10 |
| | ドイツ | 17,261,374,429 | 7.55 |
| | スペイン | 11,949,580,342 | 5.23 |
| | オランダ | 5,942,186,432 | 2.60 |
| | ベルギー | 5,756,091,605 | 2.52 |
| | カナダ | 5,141,150,213 | 2.25 |
| | オーストラリア | 3,945,142,180 | 1.73 |
| | オーストリア | 3,575,240,956 | 1.56 |
| | メキシコ | 2,375,749,850 | 1.04 |
| | アイルランド | 1,902,931,610 | 0.83 |
| | デンマーク | 1,600,712,133 | 0.70 |
| | フィンランド | 1,439,676,360 | 0.63 |
| | ポーランド | 1,358,354,012 | 0.59 |
| | 南アフリカ | 1,210,441,951 | 0.53 |
| | マレーシア | 1,181,105,243 | 0.52 |
| | スウェーデン | 1,113,743,485 | 0.49 |
| | シンガポール | 911,614,732 | 0.40 |
| スイス | 703,868,701 | 0.31 | |
| ノルウェー | 620,131,294 | 0.27 | |
| | 小計 | 223,615,535,757 | 97.78 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,075,977,766 | 2.22 |

| | | |
|-----------|-----------------|--------|
| 合計(純資産総額) | 228,691,513,523 | 100.00 |
|-----------|-----------------|--------|

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|---------|------|---------------|---------|
| 債券先物取引 | 買建 | アメリカ | 764,182,697 | 0.33 |
| | 買建 | ドイツ | 1,359,828,753 | 0.59 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|---------|------|---------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 2,839,517,400 | 1.24 |

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|-------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|---------|
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 05/31/16 | 18,000,000 | 12,178.57 | 2,192,144,220 | 12,088.26 | 2,175,887,104 | 1.750 | 2016/5/31 | 0.95 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 08/15/16 | 17,300,000 | 11,930.34 | 2,063,949,685 | 11,938.58 | 2,065,374,696 | 0.625 | 2016/8/15 | 0.90 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 07/15/16 | 13,300,000 | 11,954.61 | 1,589,964,339 | 11,940.90 | 1,588,140,531 | 0.625 | 2016/7/15 | 0.69 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 11/15/16 | 13,000,000 | 11,902.85 | 1,547,371,280 | 11,931.14 | 1,551,048,793 | 0.625 | 2016/11/15 | 0.68 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 02/28/21 | 12,000,000 | 12,193.09 | 1,463,171,640 | 12,144.74 | 1,457,368,833 | 2.000 | 2021/2/28 | 0.64 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 01/15/17 | 12,000,000 | 11,943.46 | 1,433,215,541 | 11,949.97 | 1,433,996,486 | 0.750 | 2017/1/15 | 0.63 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/43 | 11,500,000 | 11,146.61 | 1,281,860,652 | 12,165.42 | 1,399,023,967 | 2.875 | 2043/5/15 | 0.61 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 02/15/24 | 10,600,000 | 12,353.36 | 1,309,456,802 | 12,647.23 | 1,340,607,051 | 2.750 | 2024/2/15 | 0.59 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.375% 05/15/44 | 9,900,000 | 11,990.02 | 1,187,012,148 | 13,389.59 | 1,325,569,586 | 3.375 | 2044/5/15 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.5% 05/15/17 | 9,800,000 | 13,209.46 | 1,294,527,551 | 12,843.40 | 1,258,653,234 | 4.500 | 2017/5/15 | 0.55 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.5% 01/31/19 | 10,000,000 | 11,949.04 | 1,194,904,097 | 12,047.12 | 1,204,712,303 | 1.500 | 2019/1/31 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.5% 02/28/19 | 10,000,000 | 11,939.74 | 1,193,974,410 | 12,041.31 | 1,204,131,250 | 1.500 | 2019/2/28 | 0.53 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 01/31/17 | 10,000,000 | 11,977.16 | 1,197,716,412 | 11,975.07 | 1,197,507,222 | 0.875 | 2017/1/31 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 12/15/16 | 10,000,000 | 11,912.50 | 1,191,250,096 | 11,927.65 | 1,192,765,822 | 0.625 | 2016/12/15 | 0.52 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 02/28/17 | 9,500,000 | 12,659.78 | 1,202,679,780 | 12,435.73 | 1,181,394,578 | 3.000 | 2017/2/28 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.25% 11/15/24 | 9,650,000 | 12,227.66 | 1,179,969,728 | 12,120.10 | 1,169,589,983 | 2.250 | 2024/11/15 | 0.51 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 12/31/17 | 9,100,000 | 12,579.37 | 1,144,722,761 | 12,510.80 | 1,138,483,232 | 2.750 | 2017/12/31 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 11/30/18 | 9,400,000 | 11,844.68 | 1,113,400,255 | 11,957.64 | 1,124,018,219 | 1.250 | 2018/11/30 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 08/31/16 | 8,700,000 | 12,583.32 | 1,094,748,871 | 12,316.73 | 1,071,555,719 | 3.000 | 2016/8/31 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1% 06/30/19 | 9,000,000 | 11,585.06 | 1,042,656,157 | 11,771.47 | 1,059,432,365 | 1.000 | 2019/6/30 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 08/15/17 | 8,800,000 | 11,920.46 | 1,049,001,184 | 11,949.73 | 1,051,576,971 | 0.875 | 2017/8/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 08/15/24 | 8,500,000 | 11,850.60 | 1,007,301,561 | 12,260.95 | 1,042,180,848 | 2.375 | 2024/8/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 05/15/24 | 8,400,000 | 11,907.21 | 1,000,205,829 | 12,394.36 | 1,041,126,352 | 2.500 | 2024/5/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 02/15/23 | 8,600,000 | 11,614.40 | 998,838,400 | 12,012.49 | 1,033,074,332 | 2.000 | 2023/2/15 | 0.45 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 4.25% 04/25/19 | 6,600,000 | 15,574.30 | 1,027,904,016 | 15,477.79 | 1,021,534,649 | 4.250 | 2019/4/25 | 0.45 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 4.25% 10/25/23 | 5,800,000 | 16,479.13 | 955,789,892 | 17,519.69 | 1,016,142,244 | 4.250 | 2023/10/25 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 01/31/20 | 8,520,000 | 11,771.24 | 1,002,909,818 | 11,819.81 | 1,007,048,192 | 1.250 | 2020/1/31 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 11/15/20 | 8,000,000 | 12,439.68 | 995,174,685 | 12,565.19 | 1,005,215,315 | 2.625 | 2020/11/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 05/31/17 | 8,000,000 | 12,601.44 | 1,008,115,935 | 12,429.68 | 994,375,157 | 2.750 | 2017/5/31 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 08/31/17 | 7,900,000 | 12,280.70 | 970,175,857 | 12,225.15 | 965,787,498 | 1.875 | 2017/8/31 | 0.42 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 97.78 |
| 合計 | 97.78 |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|------|-------------------|--------------|---------|----|--------|--------------|-------------|--------------|-------------|----------|
| 債券先物取引 | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 5YR NOTE | 買建 | 27 | アメリカドル | 3,244,998.64 | 386,154,838 | 3,246,328.26 | 386,313,063 | 0.17 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 16 | アメリカドル | 2,061,782.77 | 245,352,149 | 2,056,250.08 | 244,693,759 | 0.11 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 7 | アメリカドル | 1,145,278 | 136,288,082 | 1,119,125 | 133,175,875 | 0.06 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 17 | ユーロ | 1,891,103 | 250,174,016 | 1,890,400 | 250,081,016 | 0.11 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 21 | ユーロ | 2,717,284 | 359,469,500 | 2,710,470 | 358,568,076 | 0.16 |

| | | | | | | | | | | |
|-----|-----------------------|-----------|----|----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| ドイツ | ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 36 | ユーロ | 5,713,644 | 755,857,964 | 5,678,280 | 751,179,661 | 0.33 |
|-----|-----------------------|-----------|----|----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|------|

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

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

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|---------|---------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 10,280,000.00 | 1,231,686,490 | 1,223,114,400 | 0.53 |
| | カナダドル | 買建 | 1,140,000.00 | 110,050,270 | 112,848,600 | 0.04 |
| | ユーロ | 買建 | 9,560,000.00 | 1,230,008,800 | 1,264,692,400 | 0.55 |
| | イギリスポンド | 買建 | 1,300,000.00 | 231,238,250 | 238,862,000 | 0.10 |

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

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

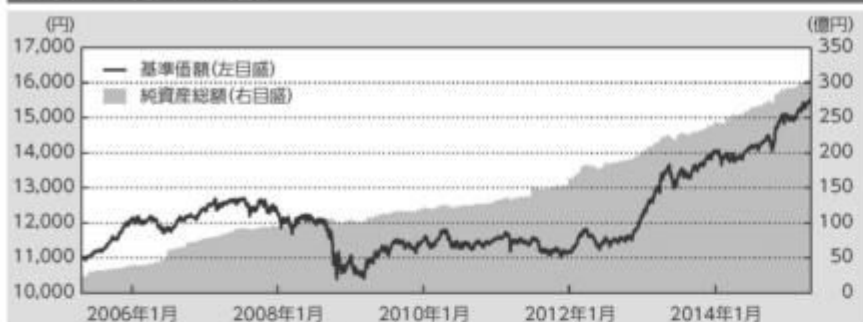
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2001年10月1日

作成基準日：2015年4月30日

基準価額・純資産の推移

| | |
|-------|----------|
| 基準価額 | 15,445円 |
| 純資産総額 | 304.57億円 |

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

分配の推移 (1万口当たり、税引前)

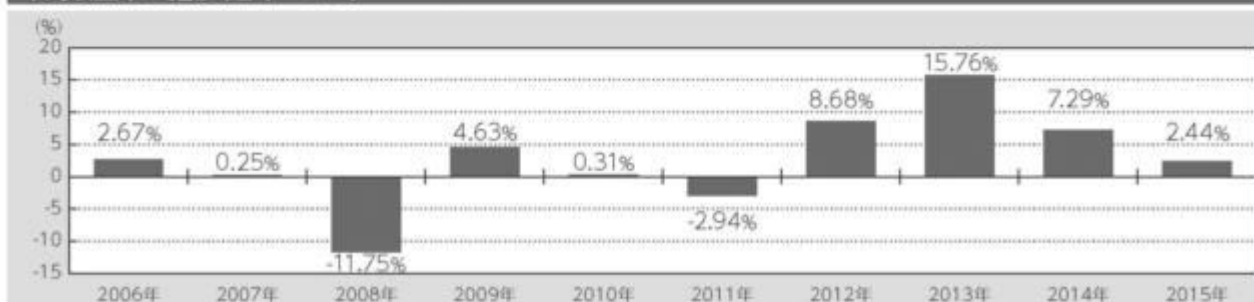
設定来分配金合計額:0円

| 決算期 | 2010年9月 | 2011年9月 | 2012年10月 | 2013年9月 | 2014年9月 |
|-----|---------|---------|----------|---------|---------|
| 分配金 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |

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

主要な資産の状況

| マザーファンド | 投資比率 | 上位組入銘柄 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 利率 | 償還期限 | 実質投資比率 |
|---------------------------|-------|-------------------|------|----|------------------|--------|------------|--------|
| 国内債券 インデックス マザーファンド | 58.9% | 第122回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.1% | 2019/12/20 | 0.9% |
| | | 第113回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.3% | 2018/06/20 | 0.8% |
| | | 第120回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.2% | 2019/09/20 | 0.8% |
| 国内株式 インデックス マザーファンド | 21.4% | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | - | - | 1.0% |
| | | 三菱UFJフィナンシャルグループ | 日本 | 株式 | 銀行業 | - | - | 0.6% |
| | | ソフトバンク | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | - | - | 0.4% |
| 外国債券 インデックス マザーファンド | 9.9% | T 1.75% 05/31/16 | アメリカ | 国債 | - | 1.750% | 2016/05/31 | 0.1% |
| | | T 0.625% 08/15/16 | アメリカ | 国債 | - | 0.625% | 2016/08/15 | 0.1% |
| | | T 0.625% 07/15/16 | アメリカ | 国債 | - | 0.625% | 2016/07/15 | 0.1% |
| 外国株式 インデックス マザーファンド | 5.8% | APPLE INC | アメリカ | 株式 | テクノロジーハードウェア及び機器 | - | - | 0.1% |
| | | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス | - | - | 0.1% |
| | | EXXON MOBIL | アメリカ | 株式 | エネルギー | - | - | 0.1% |

年間収益率の推移 (暦年ベース)

※2015年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法

に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づき、支払を受けることとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があると

きは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

・株式

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

・公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

- a. 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
- b. 価格情報会社の提供する価額
- c. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

外貨建資産の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成13年10月1日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びそ

の内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(平成25年10月1日から平成26年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCマイセレクション25】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第12期 (平成25年 9月30日現在) | 第13期 (平成26年 9月30日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,175,794,863 | 1,244,403,712 |
| 親投資信託受益証券 | 21,788,387,161 | 26,163,428,716 |
| 未収入金 | 100,000 | - |
| 未収利息 | 1,235 | 428 |
| 流動資産合計 | 22,964,283,259 | 27,407,832,856 |
| 資産合計 | 22,964,283,259 | 27,407,832,856 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 17,136,323 | 7,866,421 |
| 未払受託者報酬 | 3,513,125 | 4,241,605 |
| 未払委託者報酬 | 26,933,908 | 32,518,864 |
| その他未払費用 | 1,108,588 | 1,332,631 |
| 流動負債合計 | 48,691,944 | 45,959,521 |
| 負債合計 | 48,691,944 | 45,959,521 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 16,882,291,858 | 18,910,232,195 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 6,033,299,457 | 8,451,641,140 |
| (分配準備積立金) | 3,026,181,268 | 4,331,493,189 |
| 元本等合計 | 22,915,591,315 | 27,361,873,335 |
| 純資産合計 | 22,915,591,315 | 27,361,873,335 |
| 負債純資産合計 | 22,964,283,259 | 27,407,832,856 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第12期 | | 第13期 | |
|-------------------------------------------|------|----------------------------|------|----------------------------|
| | 自 | 平成24年10月2日 至 平成25年9月30日 | 自 | 平成25年10月1日 至 平成26年9月30日 |
| 営業収益 | | | | |
| 受取利息 | | 601,399 | | 607,631 |
| 有価証券売買等損益 | | 3,472,195,807 | | 1,680,101,555 |
| 営業収益合計 | | 3,472,797,206 | | 1,680,709,186 |
| 営業費用 | | | | |
| 受託者報酬 | | 6,652,316 | | 7,996,531 |
| 委託者報酬 | | 51,000,946 | | 61,306,535 |
| その他費用 | | 1,108,588 | | 1,332,631 |
| 営業費用合計 | | 58,761,850 | | 70,635,697 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | | 3,414,035,356 | | 1,610,073,489 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | | 3,414,035,356 | | 1,610,073,489 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | | 3,414,035,356 | | 1,610,073,489 |
| 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（ ） | | 306,589,446 | | 56,185,684 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | | 2,468,441,220 | | 6,033,299,457 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 824,638,065 | | 1,417,893,245 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | | 824,638,065 | | 1,417,893,245 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 367,225,738 | | 553,439,367 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | | 367,225,738 | | 553,439,367 |
| 分配金 | | - | | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | | 6,033,299,457 | | 8,451,641,140 |

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

（ 貸借対照表に関する注記 ）

| | 第12期 (平成25年 9月30日現在) | 第13期 (平成26年 9月30日現在) |
|----------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 16,882,291,858口 | 18,910,232,195口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3574円 (13,574円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4469円 (14,469円) |

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

| 第12期 自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日 | | | 第13期 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日 | | |
|----------------------------------------|----------------|-----------------|----------------------------------------|----------------|-----------------|
| 分配金の計算過程 | | | 分配金の計算過程 | | |
| 項目 | | | 項目 | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 551,777円 | 費用控除後の配当等収益額 | A | 579,377円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 2,702,539,605円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 1,553,308,428円 |
| 収益調整金額 | C | 3,007,118,189円 | 収益調整金額 | C | 4,120,147,951円 |
| 分配準備積立金額 | D | 323,089,886円 | 分配準備積立金額 | D | 2,777,605,384円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 6,033,299,457円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 8,451,641,140円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 16,882,291,858口 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 18,910,232,195口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 3,573円 | 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 4,469円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | - 円 | 1万口当たり分配金額 | H | - 円 |
| 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | - 円 | 収益分配金金額 | I=F × H/10,000 | - 円 |

（ 金融商品に関する注記 ）

1. 金融商品の状況に関する事項

| | 第13期 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日 |
|------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 第13期 (平成26年 9月30日現在) |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第12期 | 第13期 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日 | 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 16,291,948,628円 | 16,882,291,858円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,886,146,198円 | 3,563,330,174円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,295,802,968円 | 1,535,389,837円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第12期 | 第13期 |
|-----------|---------------------|-----------------|
| | (平成25年 9月30日現在) | (平成26年 9月30日現在) |
| | 計算期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 親投資信託受益証券 | 2,588,761,001 | 1,662,834,913 |
| 合計 | 2,588,761,001 | 1,662,834,913 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

| | | | | |
|-----------|--------------------|----------------|----------------|--|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス マザーファンド | 5,088,305,234 | 5,631,736,232 | |
| | 外国株式インデックス マザーファンド | 863,744,317 | 1,577,024,373 | |
| | 国内債券インデックス マザーファンド | 12,375,574,823 | 16,114,235,977 | |
| | 外国債券インデックス マザーファンド | 1,070,124,754 | 2,840,432,134 | |
| 合計 | | 19,397,749,128 | 26,163,428,716 | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「DCマイセレーション25」は、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成26年 9月30日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| 項目 | 平成26年 9月30日現在 |
|----------|-----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,710,599,934 |
| 株式 | 142,227,723,360 |
| 派生商品評価勘定 | 8,136,000 |
| 未収入金 | 528,466,744 |
| 未収配当金 | 1,051,828,569 |
| 未収利息 | 588 |
| 前払金 | 8,240,000 |
| 差入委託証拠金 | 39,270,000 |
| 流動資産合計 | 145,574,265,195 |
| 資産合計 | 145,574,265,195 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 16,390,580 |
| 未払金 | 41,061,900 |
| 未払解約金 | 230,900,764 |
| 流動負債合計 | 288,353,244 |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債合計 | 288,353,244 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 131,270,959,071 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 14,014,952,880 |
| 元本等合計 | 145,285,911,951 |
| 純資産合計 | 145,285,911,951 |
| 負債純資産合計 | 145,574,265,195 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 131,270,959,071口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.1068円 (1万口当たり純資産額) (11,068円) |

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

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

2．金融商品の時価等に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|---------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|-----------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成25年10月 1日 |
| 期首元本額 | 149,271,308,678円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,335,488,359円 |
| 期中一部解約元本額 | 42,335,837,966円 |
| 期末元本額 | 131,270,959,071円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル・インカム&プラス（毎月決算型） | 1,695,869,189円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 2,115,590,310円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 20,395,355円 |
| SMT TOPIXインデックス・オープン | 6,395,951,226円 |
| 世界経済インデックスファンド | 377,942,137円 |
| マイセクション25 | 62,283,412円 |
| マイセクション50 | 95,442,228円 |
| マイセクション75 | 100,687,705円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 13,469,666,336円 |
| DCマイセクション25 | 5,088,305,234円 |

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|---------------------------------|-----------------|
| DCマイセレクション50 | 16,576,175,174円 |
| DCマイセレクション75 | 15,430,151,293円 |
| DC日本株式インデックス・オープン | 4,045,071,680円 |
| DCマイセレクションS25 | 1,967,947,365円 |
| DCマイセレクションS50 | 5,909,599,198円 |
| DCマイセレクションS75 | 3,784,349,872円 |
| DC日本株式インデックス・オープンS | 2,042,413,390円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2015 | 8,536,273円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 459,385,266円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 479,800,759円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 235,541,811円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 382,771,670円 |
| 日本株式インデックス・オープン(SMA専用) | 398,112,803円 |
| 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用) | 103,922,134円 |
| マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用) | 265,907,134円 |
| マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用) | 130,404,264円 |
| 日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用) | 1,419,287,034円 |
| 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用) | 23,084,984円 |
| バランス30VA1(適格機関投資家専用) | 673,826,119円 |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用) | 2,359,077,803円 |
| バランス25VA2(適格機関投資家専用) | 3,925,607,790円 |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用) | 1,938,257,356円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) | 8,061,633,264円 |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用) | 1,668,807,388円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 9,560,305,993円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 2,030,631,675円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 1,946,642,770円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 1,853,022,165円 |
| グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用) | 3,898,652,728円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 1,023,232,772円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 1,397,090,004円 |
| 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用) | 107,555,643円 |
| FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用) | 3,058,133,228円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 4,085,849,980円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ2 | 507,763,694円 |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 10,440,963円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 23,394,883円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 51,224,201円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 5,213,416円 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 平成26年 9月30日現在 | |
|----|--------------------|--|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | |
| 株式 | 13,368,493,155 | |
| 合計 | 13,368,493,155 | |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成26年 9月30日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 2,608,194,580 | - | 2,599,940,000 | 8,254,580 |
| 合計 | | 2,608,194,580 | - | 2,599,940,000 | 8,254,580 |

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

| 銘柄 | 株式数 (株) | 評価額 | | 備考 |
|----------------|------------|----------|-------------|----|
| | | 単価(円) | 金額(円) | |
| 極洋 | 33,000 | 260.00 | 8,580,000 | |
| 日本水産 | 103,200 | 289.00 | 29,824,800 | |
| マルハニチロ | 16,100 | 1,634.00 | 26,307,400 | |
| サカタのタネ | 12,400 | 1,397.00 | 17,322,800 | |
| ホクト | 9,300 | 1,980.00 | 18,414,000 | |
| 住石ホールディングス | 23,300 | 125.00 | 2,912,500 | |
| 日鉄鉱業 | 21,000 | 448.00 | 9,408,000 | |
| 三井松島産業 | 55,000 | 138.00 | 7,590,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 408,400 | 1,549.50 | 632,815,800 | |
| 日本海洋掘削 | 2,100 | 4,925.00 | 10,342,500 | |
| 石油資源開発 | 12,000 | 4,210.00 | 50,520,000 | |
| K&Oエナジーグループ | 5,600 | 1,432.00 | 8,019,200 | |
| ショーボンドホールディングス | 7,500 | 4,270.00 | 32,025,000 | |

| | | | |
|-----------------|---------|-----------|-------------|
| ミライト・ホールディングス | 23,900 | 1,271.00 | 30,376,900 |
| タマホーム | 6,100 | 692.00 | 4,221,200 |
| サンヨーホームズ | 1,400 | 687.00 | 961,800 |
| ダイセキ環境ソリューション | 900 | 2,062.00 | 1,855,800 |
| 安藤・間 | 57,800 | 702.00 | 40,575,600 |
| 東急建設 | 30,600 | 544.00 | 16,646,400 |
| コムシスホールディングス | 40,800 | 1,891.00 | 77,152,800 |
| ミサワホーム | 10,500 | 1,113.00 | 11,686,500 |
| 高松コンストラクショングループ | 6,500 | 2,054.00 | 13,351,000 |
| 東建コーポレーション | 3,200 | 5,020.00 | 16,064,000 |
| ヤマウラ | 4,800 | 418.00 | 2,006,400 |
| 大成建設 | 425,000 | 619.00 | 263,075,000 |
| 大林組 | 252,000 | 751.00 | 189,252,000 |
| 清水建設 | 257,000 | 865.00 | 222,305,000 |
| 長谷工コーポレーション | 112,500 | 847.00 | 95,287,500 |
| 松井建設 | 10,000 | 531.00 | 5,310,000 |
| 鹿島建設 | 370,000 | 525.00 | 194,250,000 |
| 不動テトラ | 60,800 | 278.00 | 16,902,400 |
| 鉄建建設 | 51,000 | 509.00 | 25,959,000 |
| 日鉄住金テックスエンジ | 16,000 | 588.00 | 9,408,000 |
| 西松建設 | 112,000 | 496.00 | 55,552,000 |
| 三井住友建設 | 225,800 | 132.00 | 29,805,600 |
| 前田建設工業 | 52,000 | 879.00 | 45,708,000 |
| 佐田建設 | 29,000 | 145.00 | 4,205,000 |
| ナカノフドー建設 | 12,900 | 389.00 | 5,018,100 |
| 奥村組 | 75,000 | 640.00 | 48,000,000 |
| 大和小田急建設 | 8,500 | 787.00 | 6,689,500 |
| 東鉄工業 | 10,200 | 2,585.00 | 26,367,000 |
| イチケン | 15,000 | 405.00 | 6,075,000 |
| 戸田建設 | 98,000 | 551.00 | 53,998,000 |
| 熊谷組 | 128,000 | 405.00 | 51,840,000 |
| 青木あすなる建設 | 5,700 | 837.00 | 4,770,900 |
| 北野建設 | 19,000 | 375.00 | 7,125,000 |
| 植木組 | 18,000 | 290.00 | 5,220,000 |
| 三井ホーム | 12,000 | 491.00 | 5,892,000 |
| 矢作建設工業 | 12,100 | 812.00 | 9,825,200 |
| ピーエス三菱 | 7,400 | 508.00 | 3,759,200 |
| 東日本ハウス | 11,600 | 531.00 | 6,159,600 |
| 大東建託 | 31,900 | 12,955.00 | 413,264,500 |
| 新日本建設 | 13,300 | 410.00 | 5,453,000 |
| N I P P O | 19,000 | 2,011.00 | 38,209,000 |
| 東亜道路工業 | 16,000 | 424.00 | 6,784,000 |

| | | | |
|-----------|---------|----------|-------------|
| 前田道路 | 26,000 | 1,706.00 | 44,356,000 |
| 日本道路 | 23,000 | 615.00 | 14,145,000 |
| 東亜建設工業 | 75,000 | 205.00 | 15,375,000 |
| 若築建設 | 48,000 | 209.00 | 10,032,000 |
| 東洋建設 | 27,000 | 501.00 | 13,527,000 |
| 五洋建設 | 100,600 | 369.00 | 37,121,400 |
| 大林道路 | 10,000 | 679.00 | 6,790,000 |
| 福田組 | 15,000 | 1,182.00 | 17,730,000 |
| 住友林業 | 58,200 | 1,180.00 | 68,676,000 |
| 日本基礎技術 | 9,600 | 401.00 | 3,849,600 |
| 日成ビルド工業 | 23,000 | 276.00 | 6,348,000 |
| 巴コーポレーション | 10,400 | 462.00 | 4,804,800 |
| パナホーム | 32,000 | 762.00 | 24,384,000 |
| 大和ハウス工業 | 230,800 | 1,967.50 | 454,099,000 |
| ライト工業 | 17,600 | 1,020.00 | 17,952,000 |
| 積水ハウス | 226,400 | 1,292.00 | 292,508,800 |
| 日特建設 | 10,700 | 545.00 | 5,831,500 |
| 北陸電気工事 | 4,000 | 605.00 | 2,420,000 |
| ユアテック | 13,000 | 536.00 | 6,968,000 |
| 西部電気工業 | 7,000 | 499.00 | 3,493,000 |
| 四電工 | 7,000 | 417.00 | 2,919,000 |
| 中電工 | 12,200 | 1,795.00 | 21,899,000 |
| 関電工 | 38,000 | 554.00 | 21,052,000 |
| きんでん | 56,000 | 1,128.00 | 63,168,000 |
| 東京エネシス | 9,000 | 742.00 | 6,678,000 |
| トーエネック | 12,000 | 598.00 | 7,176,000 |
| 住友電設 | 5,900 | 1,456.00 | 8,590,400 |
| 日本電設工業 | 13,800 | 1,757.00 | 24,246,600 |
| 協和エクシオ | 32,900 | 1,425.00 | 46,882,500 |
| 新日本空調 | 7,500 | 882.00 | 6,615,000 |
| N D S | 13,000 | 309.00 | 4,017,000 |
| 九電工 | 16,000 | 1,296.00 | 20,736,000 |
| 三機工業 | 17,600 | 815.00 | 14,344,000 |
| 日揮 | 85,000 | 2,994.00 | 254,490,000 |
| 中外炉工業 | 24,000 | 229.00 | 5,496,000 |
| ヤマト | 9,000 | 373.00 | 3,357,000 |
| 太平電業 | 13,000 | 873.00 | 11,349,000 |
| 高砂熱学工業 | 23,700 | 1,419.00 | 33,630,300 |
| 三晃金属工業 | 11,000 | 274.00 | 3,014,000 |
| 朝日工業社 | 10,000 | 401.00 | 4,010,000 |
| 明星工業 | 16,000 | 683.00 | 10,928,000 |
| 大気社 | 11,300 | 2,453.00 | 27,718,900 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|--|
| ダイダシ | 12,000 | 624.00 | 7,488,000 | |
| 日比谷総合設備 | 9,500 | 1,586.00 | 15,067,000 | |
| 東芝プラシツシステム | 13,900 | 1,846.00 | 25,659,400 | |
| 東洋エンジニアリング | 46,000 | 470.00 | 21,620,000 | |
| 千代田化工建設 | 67,000 | 1,211.00 | 81,137,000 | |
| 新興プランテック | 17,400 | 841.00 | 14,633,400 | |
| 日本製粉 | 52,000 | 531.00 | 27,612,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 92,100 | 1,084.00 | 99,836,400 | |
| 日東富士製粉 | 7,000 | 315.00 | 2,205,000 | |
| 昭和産業 | 35,000 | 401.00 | 14,035,000 | |
| 鳥越製粉 | 6,700 | 726.00 | 4,864,200 | |
| 協同飼料 | 29,000 | 100.00 | 2,900,000 | |
| 中部飼料 | 8,100 | 683.00 | 5,532,300 | |
| 日本配合飼料 | 26,000 | 114.00 | 2,964,000 | |
| 東洋精糖 | 13,000 | 103.00 | 1,339,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 43,000 | 193.00 | 8,299,000 | |
| 三井製糖 | 33,000 | 367.00 | 12,111,000 | |
| 塩水港精糖 | 6,600 | 330.00 | 2,178,000 | |
| 森永製菓 | 82,000 | 237.00 | 19,434,000 | |
| 中村屋 | 20,000 | 431.00 | 8,620,000 | |
| 江崎グリコ | 14,500 | 3,790.00 | 54,955,000 | |
| 名糖産業 | 3,700 | 1,203.00 | 4,451,100 | |
| 不二家 | 48,000 | 197.00 | 9,456,000 | |
| 山崎製パン | 62,000 | 1,414.00 | 87,668,000 | |
| 第一屋製パン | 11,000 | 137.00 | 1,507,000 | |
| モロゾフ | 13,000 | 359.00 | 4,667,000 | |
| 亀田製菓 | 4,700 | 3,290.00 | 15,463,000 | |
| 寿スピリツツ | 1,800 | 2,205.00 | 3,969,000 | |
| カルビー | 31,100 | 3,590.00 | 111,649,000 | |
| 森永乳業 | 71,000 | 353.00 | 25,063,000 | |
| 六甲バター | 3,800 | 1,106.00 | 4,202,800 | |
| ヤクルト本社 | 49,100 | 5,760.00 | 282,816,000 | |
| 明治ホールディングス | 24,900 | 8,670.00 | 215,883,000 | |
| 雪印メグミルク | 18,100 | 1,435.00 | 25,973,500 | |
| プリマハム | 42,000 | 273.00 | 11,466,000 | |
| 日本ハム | 52,000 | 2,326.00 | 120,952,000 | |
| 伊藤ハム | 46,000 | 526.00 | 24,196,000 | |
| 丸大食品 | 40,000 | 410.00 | 16,400,000 | |
| 米久 | 2,700 | 1,224.00 | 3,304,800 | |
| S Foods | 5,300 | 1,852.00 | 9,815,600 | |
| サッポロホールディングス | 138,000 | 422.00 | 58,236,000 | |
| アサヒグループホールディングス | 168,800 | 3,173.00 | 535,602,400 | |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| キリンホールディングス | 359,400 | 1,456.50 | 523,466,100 |
| 宝ホールディングス | 65,900 | 835.00 | 55,026,500 |
| オエノンホールディングス | 21,000 | 246.00 | 5,166,000 |
| 養命酒製造 | 6,000 | 920.00 | 5,520,000 |
| コカ・コーラウエスト | 28,500 | 1,596.00 | 45,486,000 |
| コカ・コーライーストジャパン | 25,500 | 2,177.00 | 55,513,500 |
| サントリー食品インターナショナル | 50,400 | 3,890.00 | 196,056,000 |
| ダイドードリンコ | 3,900 | 4,330.00 | 16,887,000 |
| 伊藤園 | 22,900 | 2,315.00 | 53,013,500 |
| キーコーヒー | 7,900 | 1,646.00 | 13,003,400 |
| ユニカフェ | 2,300 | 663.00 | 1,524,900 |
| ジャパンフーズ | 1,100 | 1,143.00 | 1,257,300 |
| 日清オイリオグループ | 36,000 | 369.00 | 13,284,000 |
| 不二製油 | 20,400 | 1,619.00 | 33,027,600 |
| かどや製油 | 800 | 2,605.00 | 2,084,000 |
| J - オイルミルズ | 35,000 | 362.00 | 12,670,000 |
| キッコーマン | 69,000 | 2,331.00 | 160,839,000 |
| 味の素 | 194,000 | 1,825.00 | 354,050,000 |
| キューピー | 42,800 | 1,852.00 | 79,265,600 |
| ハウス食品グループ本社 | 28,700 | 1,904.00 | 54,644,800 |
| カゴメ | 32,500 | 1,735.00 | 56,387,500 |
| 焼津水産化学工業 | 3,700 | 993.00 | 3,674,100 |
| アリアケジャパン | 7,600 | 2,458.00 | 18,680,800 |
| ニチレイ | 90,000 | 461.00 | 41,490,000 |
| 東洋水産 | 41,000 | 3,640.00 | 149,240,000 |
| イトアンド | 700 | 1,683.00 | 1,178,100 |
| 日清食品ホールディングス | 32,800 | 5,700.00 | 186,960,000 |
| 永谷園 | 8,000 | 1,076.00 | 8,608,000 |
| フジッコ | 8,000 | 1,420.00 | 11,360,000 |
| ロック・フィールド | 4,400 | 1,941.00 | 8,540,400 |
| 日本たばこ産業 | 465,500 | 3,567.00 | 1,660,438,500 |
| ケンコーマヨネーズ | 2,800 | 1,151.00 | 3,222,800 |
| わらべや日洋 | 4,900 | 1,969.00 | 9,648,100 |
| なとり | 3,900 | 1,137.00 | 4,434,300 |
| ミヨシ油脂 | 29,000 | 138.00 | 4,002,000 |
| 片倉工業 | 9,800 | 1,366.00 | 13,386,800 |
| ゲンゼ | 64,000 | 308.00 | 19,712,000 |
| 東洋紡 | 333,000 | 159.00 | 52,947,000 |
| ユニチカ | 215,000 | 51.00 | 10,965,000 |
| 富士紡ホールディングス | 41,000 | 322.00 | 13,202,000 |
| 日清紡ホールディングス | 50,000 | 921.00 | 46,050,000 |
| 倉敷紡績 | 81,000 | 186.00 | 15,066,000 |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|--|
| シキボウ | 45,000 | 124.00 | 5,580,000 | |
| 日本毛織 | 25,000 | 758.00 | 18,950,000 | |
| トーア紡コーポレーション | 35,000 | 78.00 | 2,730,000 | |
| ダイドーリミテッド | 9,000 | 547.00 | 4,923,000 | |
| 帝国繊維 | 8,200 | 2,318.00 | 19,007,600 | |
| 帝人 | 321,000 | 265.00 | 85,065,000 | |
| 東レ | 570,000 | 725.00 | 413,250,000 | |
| サカイオーベックス | 21,000 | 169.00 | 3,549,000 | |
| 住江織物 | 25,000 | 344.00 | 8,600,000 | |
| 日本フェルト | 4,500 | 481.00 | 2,164,500 | |
| イチカワ | 6,000 | 286.00 | 1,716,000 | |
| 日本バイリーン | 8,000 | 605.00 | 4,840,000 | |
| 芦森工業 | 23,000 | 207.00 | 4,761,000 | |
| アツギ | 66,000 | 113.00 | 7,458,000 | |
| ダイニック | 15,000 | 176.00 | 2,640,000 | |
| セーレン | 21,100 | 980.00 | 20,678,000 | |
| 東海染工 | 11,000 | 122.00 | 1,342,000 | |
| 小松精練 | 13,100 | 571.00 | 7,480,100 | |
| ワコールホールディングス | 47,000 | 1,068.00 | 50,196,000 | |
| ホギメディカル | 4,900 | 5,810.00 | 28,469,000 | |
| レナウン | 18,800 | 119.00 | 2,237,200 | |
| クラウディア | 1,600 | 1,320.00 | 2,112,000 | |
| T S Iホールディングス | 37,700 | 769.00 | 28,991,300 | |
| 三陽商会 | 41,000 | 241.00 | 9,881,000 | |
| オンワードホールディングス | 52,000 | 685.00 | 35,620,000 | |
| ルック | 17,000 | 252.00 | 4,284,000 | |
| ゴールドウイン | 19,000 | 565.00 | 10,735,000 | |
| デサント | 18,000 | 947.00 | 17,046,000 | |
| キング | 3,900 | 441.00 | 1,719,900 | |
| ヤマトインターナショナル | 5,100 | 430.00 | 2,193,000 | |
| 特種東海製紙 | 46,000 | 259.00 | 11,914,000 | |
| 王子ホールディングス | 347,000 | 415.00 | 144,005,000 | |
| 日本製紙 | 40,600 | 1,641.00 | 66,624,600 | |
| 三菱製紙 | 112,000 | 89.00 | 9,968,000 | |
| 北越紀州製紙 | 53,600 | 450.00 | 24,120,000 | |
| 中越パルプ工業 | 30,000 | 183.00 | 5,490,000 | |
| 巴川製紙所 | 12,000 | 192.00 | 2,304,000 | |
| 大王製紙 | 30,000 | 930.00 | 27,900,000 | |
| レンゴー | 63,000 | 493.00 | 31,059,000 | |
| トーモク | 25,000 | 304.00 | 7,600,000 | |
| ザ・バック | 5,600 | 2,296.00 | 12,857,600 | |
| クラレ | 124,800 | 1,286.00 | 160,492,800 | |

| | | | |
|-------------|---------|----------|---------------|
| 旭化成 | 490,000 | 890.40 | 436,296,000 |
| 共和レザー | 5,200 | 784.00 | 4,076,800 |
| コープケミカル | 12,000 | 113.00 | 1,356,000 |
| 昭和電工 | 523,000 | 144.00 | 75,312,000 |
| 住友化学 | 578,000 | 391.00 | 225,998,000 |
| 日本化成 | 15,000 | 145.00 | 2,175,000 |
| 住友精化 | 16,000 | 628.00 | 10,048,000 |
| 日産化学工業 | 52,500 | 1,942.00 | 101,955,000 |
| ラサ工業 | 30,000 | 146.00 | 4,380,000 |
| クレハ | 55,000 | 540.00 | 29,700,000 |
| 多木化学 | 5,000 | 757.00 | 3,785,000 |
| テイカ | 13,000 | 471.00 | 6,123,000 |
| 石原産業 | 141,000 | 90.00 | 12,690,000 |
| 片倉チッカリン | 5,000 | 264.00 | 1,320,000 |
| 日本曹達 | 50,000 | 560.00 | 28,000,000 |
| 東ソー | 210,000 | 444.00 | 93,240,000 |
| トクヤマ | 122,000 | 361.00 | 44,042,000 |
| セントラル硝子 | 75,000 | 388.00 | 29,100,000 |
| 東亜合成 | 98,000 | 452.00 | 44,296,000 |
| ダイソー | 31,000 | 359.00 | 11,129,000 |
| 関東電化工業 | 19,000 | 437.00 | 8,303,000 |
| 電気化学工業 | 152,000 | 359.00 | 54,568,000 |
| 信越化学工業 | 140,800 | 7,168.00 | 1,009,254,400 |
| 日本カーバイド工業 | 23,000 | 245.00 | 5,635,000 |
| 堺化学工業 | 32,000 | 354.00 | 11,328,000 |
| エア・ウォーター | 65,000 | 1,632.00 | 106,080,000 |
| 大陽日酸 | 101,000 | 967.00 | 97,667,000 |
| 日本化学工業 | 29,000 | 158.00 | 4,582,000 |
| 日本パーカラライジング | 18,500 | 2,503.00 | 46,305,500 |
| 高压ガス工業 | 12,000 | 592.00 | 7,104,000 |
| チタン工業 | 9,000 | 259.00 | 2,331,000 |
| 四国化成工業 | 11,000 | 750.00 | 8,250,000 |
| 戸田工業 | 14,000 | 412.00 | 5,768,000 |
| ステラ ケミファ | 4,000 | 1,591.00 | 6,364,000 |
| 保土谷化学工業 | 23,000 | 193.00 | 4,439,000 |
| 日本触媒 | 66,000 | 1,220.00 | 80,520,000 |
| 大日精化工業 | 30,000 | 587.00 | 17,610,000 |
| カネカ | 98,000 | 613.00 | 60,074,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 124,000 | 699.00 | 86,676,000 |
| 三井化学 | 357,000 | 305.00 | 108,885,000 |
| J S R | 72,000 | 1,913.00 | 137,736,000 |
| 東京応化工業 | 15,200 | 2,901.00 | 44,095,200 |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|
| 大阪有機化学工業 | 5,600 | 483.00 | 2,704,800 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 490,900 | 539.60 | 264,889,640 |
| 日本合成化学工業 | 16,000 | 791.00 | 12,656,000 |
| ダイセル | 102,000 | 1,191.00 | 121,482,000 |
| 住友ベークライト | 61,000 | 430.00 | 26,230,000 |
| 積水化学工業 | 161,000 | 1,258.00 | 202,538,000 |
| 日本ゼオン | 62,000 | 1,118.00 | 69,316,000 |
| アイカ工業 | 22,000 | 2,332.00 | 51,304,000 |
| 宇部興産 | 395,000 | 175.00 | 69,125,000 |
| 積水樹脂 | 11,000 | 1,479.00 | 16,269,000 |
| タキロン | 18,000 | 552.00 | 9,936,000 |
| 旭有機材工業 | 28,000 | 267.00 | 7,476,000 |
| 日立化成 | 33,900 | 1,950.00 | 66,105,000 |
| ニチバン | 8,000 | 388.00 | 3,104,000 |
| リケンテクノス | 12,700 | 507.00 | 6,438,900 |
| 大倉工業 | 19,000 | 391.00 | 7,429,000 |
| 積水化成品工業 | 22,000 | 305.00 | 6,710,000 |
| 群栄化学工業 | 21,000 | 368.00 | 7,728,000 |
| タイガースポリマー | 3,900 | 693.00 | 2,702,700 |
| ミライアル | 2,600 | 1,806.00 | 4,695,600 |
| ダイキョーニシカワ | 1,900 | 3,010.00 | 5,719,000 |
| 日本化薬 | 55,000 | 1,337.00 | 73,535,000 |
| カーリットホールディングス | 6,700 | 584.00 | 3,912,800 |
| 日本精化 | 6,500 | 798.00 | 5,187,000 |
| A D E K A | 33,800 | 1,445.00 | 48,841,000 |
| 日油 | 65,000 | 684.00 | 44,460,000 |
| ハリマ化成グループ | 6,900 | 536.00 | 3,698,400 |
| 花王 | 216,200 | 4,276.50 | 924,579,300 |
| 第一工業製薬 | 14,000 | 441.00 | 6,174,000 |
| 三洋化成工業 | 25,000 | 675.00 | 16,875,000 |
| 大日本塗料 | 45,000 | 159.00 | 7,155,000 |
| 日本ペイント | 68,000 | 2,465.00 | 167,620,000 |
| 関西ペイント | 95,000 | 1,638.00 | 155,610,000 |
| 神東塗料 | 7,000 | 210.00 | 1,470,000 |
| 中国塗料 | 23,000 | 823.00 | 18,929,000 |
| 日本特殊塗料 | 6,000 | 700.00 | 4,200,000 |
| 藤倉化成 | 9,900 | 552.00 | 5,464,800 |
| 太陽ホールディングス | 6,400 | 3,495.00 | 22,368,000 |
| D I C | 315,000 | 246.00 | 77,490,000 |
| サカタインクス | 16,000 | 1,094.00 | 17,504,000 |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 71,000 | 512.00 | 36,352,000 |
| T & K T O K A | 2,800 | 2,430.00 | 6,804,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 富士フイルムホールディングス | 179,700 | 3,370.00 | 605,589,000 |
| 資生堂 | 139,700 | 1,809.50 | 252,787,150 |
| ライオン | 91,000 | 590.00 | 53,690,000 |
| 高砂香料工業 | 28,000 | 520.00 | 14,560,000 |
| マンダム | 7,900 | 3,785.00 | 29,901,500 |
| ミルボン | 4,600 | 3,640.00 | 16,744,000 |
| ファンケル | 18,200 | 1,346.00 | 24,497,200 |
| コーセー | 12,700 | 4,660.00 | 59,182,000 |
| コタ | 2,200 | 1,287.00 | 2,831,400 |
| ドクターシーラボ | 5,300 | 3,590.00 | 19,027,000 |
| シーボン | 700 | 2,337.00 | 1,635,900 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 9,300 | 4,295.00 | 39,943,500 |
| ノエビアホールディングス | 5,200 | 2,071.00 | 10,769,200 |
| アジュバンコスメジャパン | 1,400 | 990.00 | 1,386,000 |
| エステー | 4,800 | 999.00 | 4,795,200 |
| コニシ | 5,700 | 1,963.00 | 11,189,100 |
| 長谷川香料 | 9,900 | 1,674.00 | 16,572,600 |
| 星光P M C | 4,300 | 1,020.00 | 4,386,000 |
| 小林製薬 | 12,900 | 6,700.00 | 86,430,000 |
| 荒川化学工業 | 6,600 | 1,235.00 | 8,151,000 |
| メック | 6,100 | 1,205.00 | 7,350,500 |
| 日本高純度化学 | 2,200 | 2,358.00 | 5,187,600 |
| J C U | 2,300 | 5,000.00 | 11,500,000 |
| 新田ゼラチン | 4,900 | 891.00 | 4,365,900 |
| アース製薬 | 5,600 | 3,990.00 | 22,344,000 |
| イハラケミカル工業 | 12,100 | 997.00 | 12,063,700 |
| 北興化学工業 | 8,000 | 394.00 | 3,152,000 |
| 大成ラミック | 2,100 | 2,696.00 | 5,661,600 |
| クミアイ化学工業 | 16,000 | 672.00 | 10,752,000 |
| 日本農薬 | 17,900 | 1,075.00 | 19,242,500 |
| アキレス | 62,000 | 154.00 | 9,548,000 |
| 有沢製作所 | 13,100 | 767.00 | 10,047,700 |
| 日東電工 | 64,700 | 6,015.00 | 389,170,500 |
| レック | 2,600 | 1,127.00 | 2,930,200 |
| きもと | 11,800 | 317.00 | 3,740,600 |
| 藤森工業 | 6,700 | 3,290.00 | 22,043,000 |
| 前澤化成工業 | 5,500 | 1,175.00 | 6,462,500 |
| J S P | 5,100 | 1,905.00 | 9,715,500 |
| エフピコ | 7,700 | 3,070.00 | 23,639,000 |
| 天馬 | 6,300 | 1,596.00 | 10,054,800 |
| 信越ポリマー | 15,400 | 581.00 | 8,947,400 |
| 東リ | 21,000 | 239.00 | 5,019,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|
| ニフコ | 17,500 | 3,380.00 | 59,150,000 |
| 日本バルカー工業 | 33,000 | 316.00 | 10,428,000 |
| ユニ・チャーム | 144,500 | 2,500.50 | 361,322,250 |
| 協和発酵キリン | 94,000 | 1,345.00 | 126,430,000 |
| 武田薬品工業 | 294,100 | 4,768.00 | 1,402,268,800 |
| アステラス製薬 | 894,200 | 1,633.00 | 1,460,228,600 |
| 大日本住友製薬 | 55,600 | 1,397.00 | 77,673,200 |
| 塩野義製薬 | 122,600 | 2,516.00 | 308,461,600 |
| 田辺三菱製薬 | 65,300 | 1,609.00 | 105,067,700 |
| わかもと製薬 | 9,000 | 277.00 | 2,493,000 |
| あすか製薬 | 9,200 | 1,411.00 | 12,981,200 |
| 日本新薬 | 18,000 | 3,320.00 | 59,760,000 |
| バイオフェルミン製薬 | 1,300 | 2,925.00 | 3,802,500 |
| 中外製薬 | 78,200 | 3,175.00 | 248,285,000 |
| 科研製薬 | 27,000 | 2,475.00 | 66,825,000 |
| エーザイ | 96,600 | 4,435.00 | 428,421,000 |
| ロート製薬 | 32,900 | 1,471.00 | 48,395,900 |
| 小野薬品工業 | 35,700 | 9,740.00 | 347,718,000 |
| 久光製薬 | 24,400 | 3,940.00 | 96,136,000 |
| 有機合成薬品工業 | 5,000 | 261.00 | 1,305,000 |
| 持田製薬 | 5,600 | 7,400.00 | 41,440,000 |
| 参天製薬 | 28,800 | 6,140.00 | 176,832,000 |
| 扶桑薬品工業 | 26,000 | 326.00 | 8,476,000 |
| 日本ケミファ | 11,000 | 583.00 | 6,413,000 |
| ツムラ | 23,100 | 2,447.00 | 56,525,700 |
| 日医工 | 18,400 | 1,773.00 | 32,623,200 |
| キッセイ薬品工業 | 14,600 | 2,750.00 | 40,150,000 |
| 生化学工業 | 16,400 | 1,651.00 | 27,076,400 |
| 栄研化学 | 6,100 | 1,876.00 | 11,443,600 |
| 日水製薬 | 3,100 | 1,279.00 | 3,964,900 |
| 鳥居薬品 | 5,400 | 3,040.00 | 16,416,000 |
| JCRファーマ | 6,000 | 2,722.00 | 16,332,000 |
| 東和薬品 | 4,000 | 4,805.00 | 19,220,000 |
| 富士製薬工業 | 2,200 | 2,031.00 | 4,468,200 |
| 沢井製薬 | 12,400 | 6,310.00 | 78,244,000 |
| ゼリア新薬工業 | 12,400 | 2,262.00 | 28,048,800 |
| 第一三共 | 247,500 | 1,721.00 | 425,947,500 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 20,900 | 2,226.00 | 46,523,400 |
| 大幸薬品 | 3,700 | 1,884.00 | 6,970,800 |
| ダイト | 2,900 | 2,034.00 | 5,898,600 |
| 大塚ホールディングス | 155,800 | 3,780.00 | 588,924,000 |
| 大正製薬ホールディングス | 18,900 | 7,510.00 | 141,939,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| 日本コークス工業 | 63,300 | 114.00 | 7,216,200 |
| 昭和シェル石油 | 70,200 | 1,046.00 | 73,429,200 |
| コスモ石油 | 217,000 | 185.00 | 40,145,000 |
| ニチレキ | 10,000 | 922.00 | 9,220,000 |
| 東燃ゼネラル石油 | 118,000 | 959.00 | 113,162,000 |
| ユシロ化学工業 | 4,200 | 1,463.00 | 6,144,600 |
| ピーピー・カストロール | 3,200 | 1,089.00 | 3,484,800 |
| 富士石油 | 20,000 | 388.00 | 7,760,000 |
| MORESCO | 2,500 | 1,854.00 | 4,635,000 |
| 出光興産 | 37,200 | 2,328.00 | 86,601,600 |
| JXホールディングス | 871,200 | 505.50 | 440,391,600 |
| 横浜ゴム | 88,000 | 949.00 | 83,512,000 |
| 東洋ゴム工業 | 35,500 | 1,875.00 | 66,562,500 |
| ブリヂストン | 246,000 | 3,622.00 | 891,012,000 |
| 住友ゴム工業 | 61,200 | 1,559.00 | 95,410,800 |
| 藤倉ゴム工業 | 4,900 | 852.00 | 4,174,800 |
| オカモト | 27,000 | 416.00 | 11,232,000 |
| フコク | 3,300 | 1,161.00 | 3,831,300 |
| ニッタ | 7,800 | 2,663.00 | 20,771,400 |
| 東海ゴム工業 | 14,500 | 968.00 | 14,036,000 |
| 三ツ星ベルト | 20,000 | 719.00 | 14,380,000 |
| バンドー化学 | 29,000 | 431.00 | 12,499,000 |
| 日東紡績 | 58,000 | 422.00 | 24,476,000 |
| 旭硝子 | 387,000 | 594.60 | 230,110,200 |
| 日本板硝子 | 379,000 | 121.00 | 45,859,000 |
| 石塚硝子 | 10,000 | 198.00 | 1,980,000 |
| 日本山村硝子 | 33,000 | 175.00 | 5,775,000 |
| 日本電気硝子 | 162,000 | 534.00 | 86,508,000 |
| オハラ | 3,100 | 611.00 | 1,894,100 |
| 住友大阪セメント | 146,000 | 360.00 | 52,560,000 |
| 太平洋セメント | 461,000 | 414.00 | 190,854,000 |
| デイ・シイ | 8,500 | 552.00 | 4,692,000 |
| 日本ヒューム | 7,700 | 918.00 | 7,068,600 |
| 日本コンクリート工業 | 15,000 | 655.00 | 9,825,000 |
| 三谷セキサン | 3,900 | 2,006.00 | 7,823,400 |
| ジャパンパイル | 9,500 | 945.00 | 8,977,500 |
| 東海カーボン | 68,000 | 304.00 | 20,672,000 |
| 日本カーボン | 41,000 | 190.00 | 7,790,000 |
| 東洋炭素 | 4,400 | 2,268.00 | 9,979,200 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 45,000 | 267.00 | 12,015,000 |
| TOTO | 115,000 | 1,206.00 | 138,690,000 |
| 日本碍子 | 99,000 | 2,612.00 | 258,588,000 |

| | | | |
|--------------------|-----------|----------|-------------|
| 日本特殊陶業 | 67,700 | 3,225.00 | 218,332,500 |
| MARUWA | 2,000 | 3,445.00 | 6,890,000 |
| 品川リフラクトリーズ | 21,000 | 292.00 | 6,132,000 |
| 黒崎播磨 | 18,000 | 249.00 | 4,482,000 |
| ヨータイ | 5,000 | 363.00 | 1,815,000 |
| イソライト工業 | 5,900 | 202.00 | 1,191,800 |
| 東京窯業 | 10,000 | 217.00 | 2,170,000 |
| ニッカトー | 2,900 | 409.00 | 1,186,100 |
| フジミインコーポレーテッド | 7,200 | 1,554.00 | 11,188,800 |
| ニチアス | 38,000 | 725.00 | 27,550,000 |
| ニチハ | 9,600 | 1,093.00 | 10,492,800 |
| 新日鐵住金 | 3,318,000 | 284.60 | 944,302,800 |
| 神戸製鋼所 | 1,252,000 | 178.00 | 222,856,000 |
| 合同製鐵 | 41,000 | 161.00 | 6,601,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 200,300 | 2,188.50 | 438,356,550 |
| 日新製鋼 | 33,600 | 996.00 | 33,465,600 |
| 東京製鐵 | 43,500 | 579.00 | 25,186,500 |
| 共英製鋼 | 7,300 | 2,037.00 | 14,870,100 |
| 大和工業 | 16,200 | 3,660.00 | 59,292,000 |
| 東京鐵鋼 | 16,000 | 561.00 | 8,976,000 |
| 大阪製鐵 | 4,000 | 2,131.00 | 8,524,000 |
| 淀川製鋼所 | 56,000 | 449.00 | 25,144,000 |
| 東洋鋼鋳 | 19,000 | 594.00 | 11,286,000 |
| 丸一鋼管 | 26,300 | 2,693.00 | 70,825,900 |
| モリ工業 | 12,000 | 441.00 | 5,292,000 |
| 大同特殊鋼 | 132,000 | 437.00 | 57,684,000 |
| 日本高周波鋼業 | 33,000 | 111.00 | 3,663,000 |
| 日本冶金工業 | 62,500 | 278.00 | 17,375,000 |
| 山陽特殊製鋼 | 43,000 | 405.00 | 17,415,000 |
| 愛知製鋼 | 42,000 | 403.00 | 16,926,000 |
| 日立金属 | 70,000 | 1,976.00 | 138,320,000 |
| 日本金属 | 20,000 | 161.00 | 3,220,000 |
| 大平洋金属 | 55,000 | 383.00 | 21,065,000 |
| 新日本電工 | 48,300 | 272.00 | 13,137,600 |
| 栗本鐵工所 | 41,000 | 239.00 | 9,799,000 |
| 虹技 | 12,000 | 255.00 | 3,060,000 |
| 日本鑄鉄管 | 9,000 | 253.00 | 2,277,000 |
| 三菱製鋼 | 48,000 | 244.00 | 11,712,000 |
| 日亜鋼業 | 11,000 | 337.00 | 3,707,000 |
| 日本精線 | 6,000 | 706.00 | 4,236,000 |
| シンニッタン | 7,600 | 591.00 | 4,491,600 |
| 新家工業 | 17,000 | 188.00 | 3,196,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 大紀アルミニウム工業所 | 12,000 | 321.00 | 3,852,000 |
| 日本軽金属ホールディングス | 177,700 | 158.00 | 28,076,600 |
| 三井金属鉱業 | 200,000 | 292.00 | 58,400,000 |
| 東邦亜鉛 | 44,000 | 417.00 | 18,348,000 |
| 三菱マテリアル | 490,000 | 355.00 | 173,950,000 |
| 住友金属鉱山 | 203,000 | 1,544.00 | 313,432,000 |
| D O W Aホールディングス | 87,000 | 913.00 | 79,431,000 |
| 古河機械金属 | 132,000 | 227.00 | 29,964,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 8,600 | 2,470.00 | 21,242,000 |
| 東邦チタニウム | 13,300 | 753.00 | 10,014,900 |
| U A C J | 100,000 | 417.00 | 41,700,000 |
| 古河電気工業 | 247,000 | 220.00 | 54,340,000 |
| 住友電気工業 | 295,700 | 1,620.50 | 479,181,850 |
| フジクラ | 126,000 | 528.00 | 66,528,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 100,000 | 109.00 | 10,900,000 |
| 東京特殊電線 | 1,100 | 1,786.00 | 1,964,600 |
| タツタ電線 | 12,300 | 584.00 | 7,183,200 |
| 沖電線 | 10,000 | 338.00 | 3,380,000 |
| カナレ電気 | 1,300 | 1,751.00 | 2,276,300 |
| 平河ヒューテック | 1,800 | 1,145.00 | 2,061,000 |
| リョービ | 48,000 | 320.00 | 15,360,000 |
| アーレスティ | 6,700 | 772.00 | 5,172,400 |
| アサヒホールディングス | 11,800 | 1,962.00 | 23,151,600 |
| 稲葉製作所 | 3,300 | 1,329.00 | 4,385,700 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 26,000 | 225.00 | 5,850,000 |
| トーカロ | 4,900 | 2,282.00 | 11,181,800 |
| アルファC o | 2,900 | 1,151.00 | 3,337,900 |
| S U M C O | 54,600 | 1,324.00 | 72,290,400 |
| 川田テクノロジーズ | 1,800 | 5,030.00 | 9,054,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 55,900 | 1,359.00 | 75,968,100 |
| ホッカンホールディングス | 21,000 | 298.00 | 6,258,000 |
| コロナ | 4,100 | 1,163.00 | 4,768,300 |
| 横河ブリッジホールディングス | 14,900 | 1,535.00 | 22,871,500 |
| O S J Bホールディングス | 10,400 | 286.00 | 2,974,400 |
| 駒井ハルテック | 17,000 | 298.00 | 5,066,000 |
| 高田機工 | 9,000 | 232.00 | 2,088,000 |
| 三和ホールディングス | 64,000 | 780.00 | 49,920,000 |
| 文化シャッター | 19,000 | 977.00 | 18,563,000 |
| 三協立山 | 9,800 | 2,129.00 | 20,864,200 |
| 東洋シャッター | 3,100 | 754.00 | 2,337,400 |
| L I X I Lグループ | 109,300 | 2,343.00 | 256,089,900 |
| 日本ファイルコン | 6,600 | 480.00 | 3,168,000 |

| | | | |
|-------------|---------|----------|-------------|
| ノーリツ | 15,400 | 1,937.00 | 29,829,800 |
| 長府製作所 | 8,400 | 2,985.00 | 25,074,000 |
| リンナイ | 12,200 | 9,110.00 | 111,142,000 |
| ダイニチ工業 | 4,000 | 785.00 | 3,140,000 |
| 日東精工 | 12,000 | 386.00 | 4,632,000 |
| 三洋工業 | 11,000 | 222.00 | 2,442,000 |
| 岡部 | 15,400 | 1,206.00 | 18,572,400 |
| 東プレ | 15,300 | 1,559.00 | 23,852,700 |
| 高周波熱錬 | 11,600 | 813.00 | 9,430,800 |
| サンコール | 5,000 | 703.00 | 3,515,000 |
| モリテック スチール | 4,500 | 337.00 | 1,516,500 |
| パイオラックス | 3,800 | 5,130.00 | 19,494,000 |
| 日本発條 | 62,500 | 1,075.00 | 67,187,500 |
| 中央発條 | 10,000 | 322.00 | 3,220,000 |
| アドバネクス | 21,000 | 165.00 | 3,465,000 |
| 三益半導体工業 | 6,600 | 983.00 | 6,487,800 |
| 日本ドライケミカル | 800 | 2,357.00 | 1,885,600 |
| 日本製鋼所 | 112,000 | 440.00 | 49,280,000 |
| 三浦工業 | 35,000 | 1,290.00 | 45,150,000 |
| タクマ | 25,000 | 696.00 | 17,400,000 |
| ツガミ | 24,000 | 611.00 | 14,664,000 |
| オークマ | 51,000 | 877.00 | 44,727,000 |
| 東芝機械 | 43,000 | 500.00 | 21,500,000 |
| アマダ | 117,000 | 1,045.00 | 122,265,000 |
| アイダエンジニアリング | 17,100 | 1,115.00 | 19,066,500 |
| 滝澤鉄工所 | 28,000 | 235.00 | 6,580,000 |
| 富士機械製造 | 24,000 | 1,054.00 | 25,296,000 |
| 牧野フライス製作所 | 39,000 | 811.00 | 31,629,000 |
| オーエスジー | 35,700 | 1,900.00 | 67,830,000 |
| ダイジェット工業 | 10,000 | 281.00 | 2,810,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 20,200 | 1,588.00 | 32,077,600 |
| D M G 森精機 | 46,400 | 1,406.00 | 65,238,400 |
| ディスコ | 8,700 | 7,450.00 | 64,815,000 |
| 日東工器 | 4,600 | 2,128.00 | 9,788,800 |
| パンチ工業 | 1,900 | 1,608.00 | 3,055,200 |
| 豊和工業 | 4,900 | 787.00 | 3,856,300 |
| 大阪機工 | 30,000 | 163.00 | 4,890,000 |
| 東洋機械金属 | 7,200 | 509.00 | 3,664,800 |
| 津田駒工業 | 22,000 | 156.00 | 3,432,000 |
| 島精機製作所 | 10,200 | 1,806.00 | 18,421,200 |
| 日阪製作所 | 10,000 | 1,032.00 | 10,320,000 |
| やまびこ | 3,300 | 4,445.00 | 14,668,500 |

| | | | | |
|--------------|---------|-----------|-------------|--|
| ペガサスミシン製造 | 8,400 | 700.00 | 5,880,000 | |
| ナブテスコ | 35,800 | 2,629.00 | 94,118,200 | |
| 三井海洋開発 | 7,900 | 2,873.00 | 22,696,700 | |
| レオン自動機 | 9,000 | 496.00 | 4,464,000 | |
| S M C | 22,400 | 30,250.00 | 677,600,000 | |
| 新川 | 6,500 | 542.00 | 3,523,000 | |
| ホソカワミクロン | 14,000 | 651.00 | 9,114,000 | |
| ユニオンツール | 3,900 | 3,015.00 | 11,758,500 | |
| オイレス工業 | 9,000 | 2,110.00 | 18,990,000 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 2,500 | 2,177.00 | 5,442,500 | |
| サトーホールディングス | 9,000 | 3,085.00 | 27,765,000 | |
| 日本エアージェット | 2,300 | 522.00 | 1,200,600 | |
| 日精樹脂工業 | 5,900 | 917.00 | 5,410,300 | |
| ワイエイシイ | 4,300 | 647.00 | 2,782,100 | |
| 小松製作所 | 366,100 | 2,536.50 | 928,612,650 | |
| 住友重機械工業 | 215,000 | 617.00 | 132,655,000 | |
| 日立建機 | 40,100 | 2,208.00 | 88,540,800 | |
| 日工 | 12,000 | 468.00 | 5,616,000 | |
| 巴工業 | 3,000 | 1,933.00 | 5,799,000 | |
| 井関農機 | 81,000 | 269.00 | 21,789,000 | |
| T O W A | 7,100 | 688.00 | 4,884,800 | |
| 丸山製作所 | 20,000 | 257.00 | 5,140,000 | |
| 北川鉄工所 | 39,000 | 187.00 | 7,293,000 | |
| クボタ | 407,000 | 1,732.50 | 705,127,500 | |
| 荏原実業 | 2,500 | 1,441.00 | 3,602,500 | |
| 三菱化工機 | 26,000 | 455.00 | 11,830,000 | |
| 月島機械 | 12,800 | 1,224.00 | 15,667,200 | |
| 帝国電機製作所 | 5,600 | 1,323.00 | 7,408,800 | |
| 新東工業 | 18,600 | 767.00 | 14,266,200 | |
| 澁谷工業 | 6,600 | 2,945.00 | 19,437,000 | |
| アイチ コーポレーション | 11,200 | 522.00 | 5,846,400 | |
| 小森コーポレーション | 19,100 | 1,332.00 | 25,441,200 | |
| 鶴見製作所 | 5,800 | 1,768.00 | 10,254,400 | |
| 住友精密工業 | 13,000 | 432.00 | 5,616,000 | |
| 酒井重工業 | 16,000 | 300.00 | 4,800,000 | |
| 荏原製作所 | 173,000 | 657.00 | 113,661,000 | |
| 石井鐵工所 | 13,000 | 246.00 | 3,198,000 | |
| 西島製作所 | 8,500 | 911.00 | 7,743,500 | |
| 北越工業 | 6,000 | 1,120.00 | 6,720,000 | |
| ダイキン工業 | 102,400 | 6,798.00 | 696,115,200 | |
| オルガノ | 13,000 | 502.00 | 6,526,000 | |
| トーヨーカネツ | 42,000 | 266.00 | 11,172,000 | |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| 栗田工業 | 47,200 | 2,447.00 | 115,498,400 |
| 椿本チエイン | 40,000 | 906.00 | 36,240,000 |
| 大同工業 | 17,000 | 284.00 | 4,828,000 |
| 日本コンベヤ | 24,000 | 268.00 | 6,432,000 |
| 木村化工機 | 8,100 | 497.00 | 4,025,700 |
| アネスト岩田 | 13,400 | 801.00 | 10,733,400 |
| ダイフク | 31,800 | 1,289.00 | 40,990,200 |
| サムコ | 1,000 | 1,042.00 | 1,042,000 |
| 加藤製作所 | 18,000 | 837.00 | 15,066,000 |
| 油研工業 | 17,000 | 255.00 | 4,335,000 |
| タダノ | 33,000 | 2,019.00 | 66,627,000 |
| フジテック | 21,900 | 1,195.00 | 26,170,500 |
| C K D | 21,100 | 996.00 | 21,015,600 |
| キトー | 9,400 | 1,376.00 | 12,934,400 |
| 平和 | 16,700 | 2,169.00 | 36,222,300 |
| 理想科学工業 | 5,800 | 3,550.00 | 20,590,000 |
| S A N K Y O | 22,700 | 3,930.00 | 89,211,000 |
| 日本金銭機械 | 7,200 | 2,173.00 | 15,645,600 |
| マースエンジニアリング | 4,300 | 1,939.00 | 8,337,700 |
| 福島工業 | 4,400 | 2,105.00 | 9,262,000 |
| オーイズミ | 3,200 | 1,151.00 | 3,683,200 |
| ダイコク電機 | 3,300 | 1,931.00 | 6,372,300 |
| アマノ | 21,500 | 1,172.00 | 25,198,000 |
| サンデン | 45,000 | 650.00 | 29,250,000 |
| マックス | 12,000 | 1,261.00 | 15,132,000 |
| グローリー | 22,400 | 3,095.00 | 69,328,000 |
| 新晃工業 | 5,700 | 1,011.00 | 5,762,700 |
| 大和冷機工業 | 11,000 | 829.00 | 9,119,000 |
| セガサミーホールディングス | 80,600 | 1,765.00 | 142,259,000 |
| 日本ピストンリング | 33,000 | 256.00 | 8,448,000 |
| リケン | 30,000 | 464.00 | 13,920,000 |
| T P R | 8,700 | 2,645.00 | 23,011,500 |
| ホシザキ電機 | 16,400 | 5,120.00 | 83,968,000 |
| 大豊工業 | 5,800 | 1,254.00 | 7,273,200 |
| 日本精工 | 167,000 | 1,561.00 | 260,687,000 |
| N T N | 177,000 | 495.00 | 87,615,000 |
| ジェイテクト | 79,900 | 1,834.00 | 146,536,600 |
| 不二越 | 70,000 | 802.00 | 56,140,000 |
| 日本トムソン | 25,000 | 567.00 | 14,175,000 |
| T H K | 46,800 | 2,730.00 | 127,764,000 |
| ユーシン精機 | 3,400 | 2,392.00 | 8,132,800 |
| 前澤給装工業 | 2,900 | 1,334.00 | 3,868,600 |

| | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|
| イーグル工業 | 9,700 | 2,228.00 | 21,611,600 |
| 前澤工業 | 7,900 | 349.00 | 2,757,100 |
| 日本ピラー工業 | 8,200 | 922.00 | 7,560,400 |
| キッツ | 34,600 | 547.00 | 18,926,200 |
| 日立工機 | 20,200 | 954.00 | 19,270,800 |
| マキタ | 48,900 | 6,200.00 | 303,180,000 |
| 日立造船 | 59,500 | 647.00 | 38,496,500 |
| 三菱重工業 | 1,335,000 | 705.60 | 941,976,000 |
| I H I | 540,000 | 568.00 | 306,720,000 |
| イビデン | 45,700 | 2,136.00 | 97,615,200 |
| コニカミノルタ | 190,600 | 1,184.00 | 225,670,400 |
| ブラザー工業 | 96,900 | 2,029.00 | 196,610,100 |
| ミネベア | 102,000 | 1,496.00 | 152,592,000 |
| 日立製作所 | 1,804,000 | 837.50 | 1,510,850,000 |
| 東芝 | 1,479,000 | 508.20 | 751,627,800 |
| 三菱電機 | 750,000 | 1,460.50 | 1,095,375,000 |
| 富士電機 | 208,000 | 531.00 | 110,448,000 |
| 東洋電機製造 | 16,000 | 467.00 | 7,472,000 |
| 安川電機 | 82,200 | 1,485.00 | 122,067,000 |
| シンフォニアテクノロジー | 45,000 | 161.00 | 7,245,000 |
| 明電舎 | 69,000 | 432.00 | 29,808,000 |
| オリジン電気 | 11,000 | 413.00 | 4,543,000 |
| 山洋電気 | 15,000 | 919.00 | 13,785,000 |
| デンヨー | 7,400 | 1,497.00 | 11,077,800 |
| 東芝テック | 47,000 | 710.00 | 33,370,000 |
| 芝浦メカトロニクス | 15,000 | 337.00 | 5,055,000 |
| マブチモーター | 11,500 | 9,560.00 | 109,940,000 |
| 日本電産 | 81,000 | 7,420.00 | 601,020,000 |
| 東光高岳 | 4,400 | 1,543.00 | 6,789,200 |
| ダイヘン | 44,000 | 426.00 | 18,744,000 |
| ヤーマン | 1,000 | 1,338.00 | 1,338,000 |
| J V C ケンウッド | 53,200 | 274.00 | 14,576,800 |
| 第一精工 | 2,800 | 2,083.00 | 5,832,400 |
| 日新電機 | 15,000 | 652.00 | 9,780,000 |
| 大崎電気工業 | 12,000 | 640.00 | 7,680,000 |
| オムロン | 84,600 | 4,980.00 | 421,308,000 |
| 日東工業 | 11,000 | 2,200.00 | 24,200,000 |
| I D E C | 9,800 | 916.00 | 8,976,800 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 144,000 | 639.00 | 92,016,000 |
| サクサホールディングス | 19,000 | 169.00 | 3,211,000 |
| メルコホールディングス | 3,700 | 2,096.00 | 7,755,200 |
| テクノメディカ | 1,700 | 2,211.00 | 3,758,700 |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|
| 日本電気 | 1,031,000 | 379.00 | 390,749,000 |
| 富士通 | 723,000 | 675.00 | 488,025,000 |
| 沖電気工業 | 335,000 | 256.00 | 85,760,000 |
| 岩崎通信機 | 35,000 | 94.00 | 3,290,000 |
| 電気興業 | 21,000 | 627.00 | 13,167,000 |
| サンケン電気 | 41,000 | 921.00 | 37,761,000 |
| ナカヨ | 7,000 | 418.00 | 2,926,000 |
| アイホン | 4,300 | 1,900.00 | 8,170,000 |
| ルネサスエレクトロニクス | 38,800 | 941.00 | 36,510,800 |
| セイコーエプソン | 51,200 | 5,270.00 | 269,824,000 |
| ワコム | 59,400 | 474.00 | 28,155,600 |
| アルバック | 13,800 | 1,379.00 | 19,030,200 |
| アクセル | 3,800 | 1,693.00 | 6,433,400 |
| E I Z O | 6,900 | 2,530.00 | 17,457,000 |
| ジャパンディスプレイ | 126,000 | 529.00 | 66,654,000 |
| 日本信号 | 20,700 | 1,126.00 | 23,308,200 |
| 京三製作所 | 18,000 | 351.00 | 6,318,000 |
| 能美防災 | 10,000 | 1,718.00 | 17,180,000 |
| ホーチキ | 6,000 | 938.00 | 5,628,000 |
| エレコム | 2,800 | 2,472.00 | 6,921,600 |
| 日本無線 | 19,000 | 381.00 | 7,239,000 |
| パナソニック | 856,400 | 1,304.50 | 1,117,173,800 |
| シャープ | 541,000 | 312.00 | 168,792,000 |
| アンリツ | 43,600 | 837.00 | 36,493,200 |
| 富士通ゼネラル | 18,000 | 1,346.00 | 24,228,000 |
| 日立国際電気 | 15,000 | 1,546.00 | 23,190,000 |
| ソニー | 429,700 | 1,991.00 | 855,532,700 |
| T D K | 45,200 | 6,120.00 | 276,624,000 |
| 帝国通信工業 | 18,000 | 189.00 | 3,402,000 |
| ミツミ電機 | 28,700 | 792.00 | 22,730,400 |
| タムラ製作所 | 29,000 | 457.00 | 13,253,000 |
| アルプス電気 | 55,000 | 1,883.00 | 103,565,000 |
| 池上通信機 | 24,000 | 127.00 | 3,048,000 |
| パイオニア | 104,000 | 301.00 | 31,304,000 |
| 日本電波工業 | 7,200 | 888.00 | 6,393,600 |
| 鈴木 | 1,300 | 914.00 | 1,188,200 |
| 日本トリム | 1,700 | 3,010.00 | 5,117,000 |
| ローランド ディー . ジー . | 3,300 | 4,525.00 | 14,932,500 |
| フォスター電機 | 7,700 | 1,578.00 | 12,150,600 |
| クラリオン | 46,000 | 480.00 | 22,080,000 |
| S M K | 22,000 | 533.00 | 11,726,000 |
| ヨコオ | 6,300 | 613.00 | 3,861,900 |

| | | | |
|-----------------|--------|-----------|-------------|
| 東光 | 18,000 | 328.00 | 5,904,000 |
| ホシデン | 22,000 | 594.00 | 13,068,000 |
| ヒロセ電機 | 13,000 | 13,540.00 | 176,020,000 |
| 日本航空電子工業 | 19,000 | 2,500.00 | 47,500,000 |
| TOA | 8,000 | 1,150.00 | 9,200,000 |
| 日立マクセル | 13,000 | 1,731.00 | 22,503,000 |
| 古野電気 | 10,100 | 1,083.00 | 10,938,300 |
| ユニデン | 24,000 | 248.00 | 5,952,000 |
| アルパイン | 16,200 | 1,807.00 | 29,273,400 |
| スミダコーポレーション | 7,200 | 756.00 | 5,443,200 |
| アイコム | 4,100 | 2,748.00 | 11,266,800 |
| リオン | 2,200 | 1,418.00 | 3,119,600 |
| 船井電機 | 7,600 | 1,123.00 | 8,534,800 |
| 横河電機 | 81,300 | 1,442.00 | 117,234,600 |
| 新電元工業 | 24,000 | 749.00 | 17,976,000 |
| アズビル | 22,700 | 2,689.00 | 61,040,300 |
| 東亜ディーケーケー | 3,000 | 608.00 | 1,824,000 |
| 日本光電工業 | 16,000 | 5,760.00 | 92,160,000 |
| チノー | 2,700 | 1,273.00 | 3,437,100 |
| 共和電業 | 9,000 | 503.00 | 4,527,000 |
| 日本電子材料 | 3,200 | 633.00 | 2,025,600 |
| 堀場製作所 | 13,900 | 3,990.00 | 55,461,000 |
| アドバンテスト | 51,100 | 1,414.00 | 72,255,400 |
| 小野測器 | 3,800 | 944.00 | 3,587,200 |
| エスペック | 7,800 | 1,046.00 | 8,158,800 |
| パナソニック デバイスSUNX | 6,600 | 560.00 | 3,696,000 |
| キーエンス | 17,000 | 47,665.00 | 810,305,000 |
| 日置電機 | 4,000 | 1,716.00 | 6,864,000 |
| シスメックス | 62,900 | 4,410.00 | 277,389,000 |
| メガチップス | 6,700 | 1,464.00 | 9,808,800 |
| OBARA GROUP | 4,900 | 4,020.00 | 19,698,000 |
| 日本電産コバル電子 | 7,800 | 979.00 | 7,636,200 |
| 澤藤電機 | 6,000 | 240.00 | 1,440,000 |
| コーセル | 10,900 | 1,300.00 | 14,170,000 |
| 新日本無線 | 5,000 | 451.00 | 2,255,000 |
| オブテックス | 5,200 | 1,981.00 | 10,301,200 |
| 千代田インテグレ | 3,300 | 1,511.00 | 4,986,300 |
| レーザーテック | 7,900 | 1,334.00 | 10,538,600 |
| スタンレー電気 | 54,000 | 2,372.00 | 128,088,000 |
| 岩崎電気 | 29,000 | 236.00 | 6,844,000 |
| ウシオ電機 | 45,500 | 1,158.00 | 52,689,000 |
| 岡谷電機産業 | 4,100 | 390.00 | 1,599,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|
| ヘリオス テクノ ホールディング | 6,800 | 347.00 | 2,359,600 |
| 日本セラミック | 4,300 | 1,637.00 | 7,039,100 |
| 遠藤照明 | 4,200 | 1,279.00 | 5,371,800 |
| 日本デジタル研究所 | 5,500 | 2,028.00 | 11,154,000 |
| 古河電池 | 6,000 | 1,175.00 | 7,050,000 |
| 双信電機 | 3,700 | 392.00 | 1,450,400 |
| 図研 | 5,000 | 1,105.00 | 5,525,000 |
| 日本電子 | 30,000 | 517.00 | 15,510,000 |
| カシオ計算機 | 75,100 | 1,828.00 | 137,282,800 |
| ファナック | 83,600 | 19,810.00 | 1,656,116,000 |
| 日本シイエムケイ | 17,800 | 290.00 | 5,162,000 |
| エンプラス | 2,600 | 5,600.00 | 14,560,000 |
| 大真空 | 14,000 | 394.00 | 5,516,000 |
| ローム | 39,600 | 6,900.00 | 273,240,000 |
| 浜松ホトニクス | 31,200 | 5,210.00 | 162,552,000 |
| 三井ハイテック | 9,900 | 711.00 | 7,038,900 |
| 新光電気工業 | 25,400 | 801.00 | 20,345,400 |
| 京セラ | 131,800 | 5,111.00 | 673,629,800 |
| 太陽誘電 | 36,500 | 1,228.00 | 44,822,000 |
| 村田製作所 | 78,600 | 12,470.00 | 980,142,000 |
| ユーシン | 11,000 | 691.00 | 7,601,000 |
| 双葉電子工業 | 13,900 | 1,648.00 | 22,907,200 |
| 北陸電気工業 | 30,000 | 177.00 | 5,310,000 |
| ニチコン | 23,600 | 788.00 | 18,596,800 |
| 日本ケミコン | 52,000 | 336.00 | 17,472,000 |
| K O A | 9,500 | 1,157.00 | 10,991,500 |
| 市光工業 | 19,000 | 271.00 | 5,149,000 |
| 小糸製作所 | 41,200 | 2,979.00 | 122,734,800 |
| ミツバ | 14,000 | 1,915.00 | 26,810,000 |
| スター精密 | 14,200 | 1,613.00 | 22,904,600 |
| 大日本スクリーン製造 | 71,000 | 558.00 | 39,618,000 |
| キヤノン電子 | 6,900 | 2,024.00 | 13,965,600 |
| キヤノン | 434,600 | 3,570.50 | 1,551,739,300 |
| リコー | 225,400 | 1,178.00 | 265,521,200 |
| M U T O Hホールディングス | 10,000 | 514.00 | 5,140,000 |
| 東京エレクトロン | 67,300 | 7,158.00 | 481,733,400 |
| トヨタ紡織 | 26,200 | 1,150.00 | 30,130,000 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 14,000 | 466.00 | 6,524,000 |
| ユニプレス | 12,200 | 2,149.00 | 26,217,800 |
| 豊田自動織機 | 68,300 | 5,300.00 | 361,990,000 |
| モリタホールディングス | 13,000 | 1,144.00 | 14,872,000 |
| 三櫻工業 | 9,500 | 750.00 | 7,125,000 |

| | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|
| デンソー | 185,200 | 5,055.00 | 936,186,000 |
| 東海理化電機製作所 | 19,700 | 2,318.00 | 45,664,600 |
| 三井造船 | 290,000 | 247.00 | 71,630,000 |
| 佐世保重工業 | 53,000 | 148.00 | 7,844,000 |
| 川崎重工業 | 584,000 | 438.00 | 255,792,000 |
| 名村造船所 | 14,600 | 1,181.00 | 17,242,600 |
| サノヤスホールディングス | 9,100 | 224.00 | 2,038,400 |
| 日本車輛製造 | 27,000 | 394.00 | 10,638,000 |
| ニチュ三菱フォークリフト | 8,600 | 842.00 | 7,241,200 |
| 近畿車輛 | 13,000 | 344.00 | 4,472,000 |
| 日産自動車 | 1,052,200 | 1,069.00 | 1,124,801,800 |
| いすゞ自動車 | 217,200 | 1,550.00 | 336,660,000 |
| トヨタ自動車 | 1,034,200 | 6,463.00 | 6,684,034,600 |
| 日野自動車 | 93,600 | 1,534.00 | 143,582,400 |
| 三菱自動車工業 | 268,200 | 1,331.00 | 356,974,200 |
| エフテック | 3,100 | 1,267.00 | 3,927,700 |
| レシップホールディングス | 2,500 | 871.00 | 2,177,500 |
| G M B | 1,000 | 1,434.00 | 1,434,000 |
| 武蔵精密工業 | 8,000 | 2,174.00 | 17,392,000 |
| 日産車体 | 36,600 | 1,789.00 | 65,477,400 |
| 新明和工業 | 30,000 | 998.00 | 29,940,000 |
| 極東開発工業 | 12,900 | 1,588.00 | 20,485,200 |
| 日信工業 | 15,200 | 1,803.00 | 27,405,600 |
| トピー工業 | 62,000 | 216.00 | 13,392,000 |
| ティラド | 29,000 | 275.00 | 7,975,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 34,800 | 463.00 | 16,112,400 |
| タチエス | 11,000 | 1,586.00 | 17,446,000 |
| N O K | 36,300 | 2,516.00 | 91,330,800 |
| フタバ産業 | 22,800 | 637.00 | 14,523,600 |
| カヤバ工業 | 71,000 | 494.00 | 35,074,000 |
| シロキ工業 | 17,000 | 230.00 | 3,910,000 |
| 大同メタル工業 | 10,000 | 1,426.00 | 14,260,000 |
| プレス工業 | 29,000 | 452.00 | 13,108,000 |
| カルソニックカンセイ | 51,000 | 597.00 | 30,447,000 |
| 太平洋工業 | 15,300 | 831.00 | 12,714,300 |
| ケーヒン | 17,200 | 1,449.00 | 24,922,800 |
| 河西工業 | 10,100 | 1,056.00 | 10,665,600 |
| アイシン精機 | 68,600 | 3,955.00 | 271,313,000 |
| 富士機工 | 9,000 | 573.00 | 5,157,000 |
| マツダ | 223,400 | 2,749.00 | 614,126,600 |
| ダイハツ工業 | 79,500 | 1,741.00 | 138,409,500 |
| 今仙電機製作所 | 5,700 | 2,305.00 | 13,138,500 |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|
| 本田技研工業 | 674,600 | 3,800.00 | 2,563,480,000 |
| スズキ | 156,700 | 3,635.50 | 569,682,850 |
| 富士重工業 | 255,100 | 3,626.00 | 924,992,600 |
| 安永 | 2,500 | 641.00 | 1,602,500 |
| ヤマハ発動機 | 114,000 | 2,145.00 | 244,530,000 |
| ショーワ | 17,700 | 1,201.00 | 21,257,700 |
| T B K | 8,000 | 676.00 | 5,408,000 |
| エクセディ | 9,000 | 2,777.00 | 24,993,000 |
| 豊田合成 | 24,200 | 2,140.00 | 51,788,000 |
| 愛三工業 | 10,000 | 863.00 | 8,630,000 |
| ヨロズ | 5,700 | 1,878.00 | 10,704,600 |
| エフ・シー・シー | 12,300 | 1,783.00 | 21,930,900 |
| シマノ | 32,400 | 13,340.00 | 432,216,000 |
| タカタ | 13,500 | 2,488.00 | 33,588,000 |
| テイ・エス テック | 15,800 | 2,666.00 | 42,122,800 |
| テルモ | 114,900 | 2,629.00 | 302,072,100 |
| クリエートメディック | 2,500 | 1,020.00 | 2,550,000 |
| 日機装 | 24,300 | 1,209.00 | 29,378,700 |
| 島津製作所 | 96,000 | 949.00 | 91,104,000 |
| J M S | 14,000 | 297.00 | 4,158,000 |
| ショットモリテックス | 1,600 | 278.00 | 444,800 |
| 長野計器 | 4,800 | 696.00 | 3,340,800 |
| ブイ・テクノロジー | 1,600 | 3,095.00 | 4,952,000 |
| 東京計器 | 26,000 | 280.00 | 7,280,000 |
| 愛知時計電機 | 10,000 | 309.00 | 3,090,000 |
| オーバル | 5,500 | 352.00 | 1,936,000 |
| 東京精密 | 13,500 | 1,843.00 | 24,880,500 |
| マニー | 2,100 | 6,580.00 | 13,818,000 |
| ニコン | 140,000 | 1,585.00 | 221,900,000 |
| トプコン | 20,100 | 2,496.00 | 50,169,600 |
| オリンパス | 111,700 | 3,935.00 | 439,539,500 |
| 理研計器 | 6,600 | 1,101.00 | 7,266,600 |
| タムロン | 5,800 | 2,107.00 | 12,220,600 |
| H O Y A | 178,400 | 3,684.00 | 657,225,600 |
| ノーリツ鋼機 | 6,800 | 646.00 | 4,392,800 |
| エー・アンド・デイ | 6,800 | 558.00 | 3,794,400 |
| シチズンホールディングス | 92,300 | 719.00 | 66,363,700 |
| リズム時計工業 | 34,000 | 167.00 | 5,678,000 |
| 大研医器 | 2,600 | 2,173.00 | 5,649,800 |
| 松風 | 3,700 | 1,299.00 | 4,806,300 |
| セイコーホールディングス | 48,000 | 480.00 | 23,040,000 |
| ニプロ | 39,900 | 911.00 | 36,348,900 |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------|-------------|
| パラマウントベッドホールディングス | 7,200 | 3,145.00 | 22,644,000 |
| S H O - B I | 2,500 | 414.00 | 1,035,000 |
| 前田工織 | 7,400 | 1,361.00 | 10,071,400 |
| 永大産業 | 10,000 | 482.00 | 4,820,000 |
| アートネイチャー | 2,400 | 2,974.00 | 7,137,600 |
| ダンロップスポーツ | 4,700 | 1,267.00 | 5,954,900 |
| バンダイナムコホールディングス | 82,700 | 2,815.00 | 232,800,500 |
| 共立印刷 | 13,600 | 297.00 | 4,039,200 |
| フランスベッドホールディングス | 47,000 | 189.00 | 8,883,000 |
| パイロットコーポレーション | 6,500 | 6,250.00 | 40,625,000 |
| 萩原工業 | 1,600 | 1,612.00 | 2,579,200 |
| トッパン・フォームズ | 13,400 | 1,132.00 | 15,168,800 |
| フジシールインターナショナル | 9,100 | 3,445.00 | 31,349,500 |
| タカラトミー | 24,700 | 610.00 | 15,067,000 |
| 廣済堂 | 7,000 | 451.00 | 3,157,000 |
| アーク | 22,200 | 155.00 | 3,441,000 |
| タカノ | 3,300 | 615.00 | 2,029,500 |
| プロネクサス | 7,600 | 773.00 | 5,874,800 |
| ホクシン | 5,300 | 140.00 | 742,000 |
| ウッドワン | 13,000 | 294.00 | 3,822,000 |
| 大建工業 | 30,000 | 287.00 | 8,610,000 |
| 凸版印刷 | 212,000 | 788.00 | 167,056,000 |
| 大日本印刷 | 228,000 | 1,099.50 | 250,686,000 |
| 図書印刷 | 12,000 | 498.00 | 5,976,000 |
| 共同印刷 | 23,000 | 392.00 | 9,016,000 |
| 日本写真印刷 | 12,600 | 1,616.00 | 20,361,600 |
| 光村印刷 | 7,000 | 261.00 | 1,827,000 |
| 宝印刷 | 4,200 | 839.00 | 3,523,800 |
| アシックス | 74,500 | 2,471.00 | 184,089,500 |
| ツツミ | 3,700 | 2,672.00 | 9,886,400 |
| 小松ウオール工業 | 2,500 | 2,691.00 | 6,727,500 |
| ヤマハ | 55,100 | 1,433.00 | 78,958,300 |
| 河合楽器製作所 | 2,600 | 2,078.00 | 5,402,800 |
| クリナップ | 7,600 | 949.00 | 7,212,400 |
| ピジョン | 12,300 | 6,210.00 | 76,383,000 |
| 兼松日産農林 | 12,000 | 149.00 | 1,788,000 |
| キングジム | 6,200 | 782.00 | 4,848,400 |
| リンテック | 17,800 | 2,319.00 | 41,278,200 |
| T A S A K I | 1,400 | 1,219.00 | 1,706,600 |
| イトーキ | 15,800 | 671.00 | 10,601,800 |
| 任天堂 | 46,200 | 11,930.00 | 551,166,000 |
| 三菱鉛筆 | 6,200 | 3,530.00 | 21,886,000 |

| | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|
| タカラスタANDARD | 31,000 | 939.00 | 29,109,000 |
| コクヨ | 39,000 | 884.00 | 34,476,000 |
| ナカバヤシ | 16,000 | 208.00 | 3,328,000 |
| グロープライド | 39,000 | 139.00 | 5,421,000 |
| 岡村製作所 | 28,800 | 831.00 | 23,932,800 |
| 美津濃 | 37,000 | 581.00 | 21,497,000 |
| アデランス | 9,400 | 1,366.00 | 12,840,400 |
| 東京電力 | 635,900 | 384.00 | 244,185,600 |
| 中部電力 | 247,000 | 1,259.00 | 310,973,000 |
| 関西電力 | 305,900 | 1,036.50 | 317,065,350 |
| 中国電力 | 103,600 | 1,406.00 | 145,661,600 |
| 北陸電力 | 73,400 | 1,441.00 | 105,769,400 |
| 東北電力 | 187,300 | 1,246.00 | 233,375,800 |
| 四国電力 | 67,500 | 1,406.00 | 94,905,000 |
| 九州電力 | 165,600 | 1,182.00 | 195,739,200 |
| 北海道電力 | 70,200 | 890.00 | 62,478,000 |
| 沖縄電力 | 4,900 | 3,395.00 | 16,635,500 |
| 電源開発 | 46,500 | 3,585.00 | 166,702,500 |
| 東京瓦斯 | 854,000 | 616.50 | 526,491,000 |
| 大阪瓦斯 | 776,000 | 440.70 | 341,983,200 |
| 東邦瓦斯 | 191,000 | 618.00 | 118,038,000 |
| 北海道瓦斯 | 15,000 | 292.00 | 4,380,000 |
| 西部瓦斯 | 84,000 | 261.00 | 21,924,000 |
| 静岡瓦斯 | 21,300 | 730.00 | 15,549,000 |
| SBSホールディングス | 5,500 | 1,094.00 | 6,017,000 |
| 東武鉄道 | 426,000 | 552.00 | 235,152,000 |
| 相鉄ホールディングス | 128,000 | 397.00 | 50,816,000 |
| 東京急行電鉄 | 441,000 | 719.00 | 317,079,000 |
| 京浜急行電鉄 | 193,000 | 916.00 | 176,788,000 |
| 小田急電鉄 | 240,000 | 1,003.00 | 240,720,000 |
| 京王電鉄 | 209,000 | 811.00 | 169,499,000 |
| 京成電鉄 | 112,000 | 1,102.00 | 123,424,000 |
| 富士急行 | 20,000 | 1,246.00 | 24,920,000 |
| 新京成電鉄 | 10,000 | 383.00 | 3,830,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 137,400 | 8,220.00 | 1,129,428,000 |
| 西日本旅客鉄道 | 67,600 | 4,909.50 | 331,882,200 |
| 東海旅客鉄道 | 67,100 | 14,815.00 | 994,086,500 |
| 西武ホールディングス | 59,700 | 2,190.00 | 130,743,000 |
| 鴻池運輸 | 5,300 | 2,010.00 | 10,653,000 |
| 西日本鉄道 | 97,000 | 414.00 | 40,158,000 |
| ハマキョウレックス | 2,100 | 3,795.00 | 7,969,500 |
| サカイ引越センター | 1,300 | 3,825.00 | 4,972,500 |

| | | | |
|--------------|-----------|----------|-------------|
| 近畿日本鉄道 | 754,000 | 369.00 | 278,226,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 503,000 | 639.00 | 321,417,000 |
| 南海電気鉄道 | 156,000 | 504.00 | 78,624,000 |
| 京阪電気鉄道 | 158,000 | 472.00 | 74,576,000 |
| 神戸電鉄 | 18,000 | 362.00 | 6,516,000 |
| 名糖運輸 | 3,100 | 676.00 | 2,095,600 |
| 名古屋鉄道 | 267,000 | 440.00 | 117,480,000 |
| 山陽電気鉄道 | 27,000 | 467.00 | 12,609,000 |
| 日本通運 | 297,000 | 459.00 | 136,323,000 |
| ヤマトホールディングス | 137,600 | 2,041.50 | 280,910,400 |
| 山九 | 91,000 | 586.00 | 53,326,000 |
| 丸運 | 4,700 | 255.00 | 1,198,500 |
| 丸全昭和運輸 | 25,000 | 347.00 | 8,675,000 |
| センコー | 30,000 | 477.00 | 14,310,000 |
| トナミホールディングス | 15,000 | 246.00 | 3,690,000 |
| 日本梱包運輸倉庫 | 22,900 | 1,838.00 | 42,090,200 |
| 日本石油輸送 | 9,000 | 232.00 | 2,088,000 |
| 福山通運 | 45,000 | 547.00 | 24,615,000 |
| セイノーホールディングス | 53,000 | 879.00 | 46,587,000 |
| 神奈川中央交通 | 9,000 | 529.00 | 4,761,000 |
| 日立物流 | 15,600 | 1,416.00 | 22,089,600 |
| 日本郵船 | 638,000 | 289.00 | 184,382,000 |
| 商船三井 | 422,000 | 350.00 | 147,700,000 |
| 川崎汽船 | 330,000 | 233.00 | 76,890,000 |
| NSユナイテッド海運 | 36,000 | 271.00 | 9,756,000 |
| 乾汽船 | 15,200 | 375.00 | 5,700,000 |
| 飯野海運 | 32,800 | 626.00 | 20,532,800 |
| 共栄タンカー | 14,000 | 214.00 | 2,996,000 |
| 日本航空 | 127,200 | 3,000.00 | 381,600,000 |
| ANAホールディングス | 1,474,000 | 255.10 | 376,017,400 |
| パスコ | 12,000 | 423.00 | 5,076,000 |
| トランコム | 2,200 | 4,925.00 | 10,835,000 |
| 日新 | 28,000 | 288.00 | 8,064,000 |
| 三菱倉庫 | 49,000 | 1,574.00 | 77,126,000 |
| 三井倉庫 | 38,000 | 406.00 | 15,428,000 |
| 住友倉庫 | 50,000 | 579.00 | 28,950,000 |
| 澁澤倉庫 | 18,000 | 339.00 | 6,102,000 |
| 東陽倉庫 | 13,000 | 276.00 | 3,588,000 |
| 日本トランスシティ | 16,000 | 375.00 | 6,000,000 |
| ケイヒン | 14,000 | 173.00 | 2,422,000 |
| 中央倉庫 | 4,300 | 886.00 | 3,809,800 |
| 安田倉庫 | 5,800 | 1,044.00 | 6,055,200 |

| | | | |
|------------------------|--------|----------|------------|
| 東洋埠頭 | 22,000 | 223.00 | 4,906,000 |
| 宇徳 | 6,100 | 494.00 | 3,013,400 |
| 上組 | 89,000 | 1,038.00 | 92,382,000 |
| サンリツ | 1,800 | 534.00 | 961,200 |
| キムラユニティー | 1,700 | 975.00 | 1,657,500 |
| キューソー流通システム | 2,100 | 1,392.00 | 2,923,200 |
| 郵船ロジスティクス | 6,900 | 1,156.00 | 7,976,400 |
| 近鉄エクスプレス | 6,700 | 4,180.00 | 28,006,000 |
| 東海運 | 4,000 | 268.00 | 1,072,000 |
| エーアイティー | 2,800 | 796.00 | 2,228,800 |
| N E C ネットズエスアイ | 8,100 | 2,478.00 | 20,071,800 |
| システナ | 7,200 | 836.00 | 6,019,200 |
| デジタルアーツ | 2,600 | 1,105.00 | 2,873,000 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 6,200 | 3,260.00 | 20,212,000 |
| キューブシステム | 3,200 | 567.00 | 1,814,400 |
| コア | 2,800 | 913.00 | 2,556,400 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 2,400 | 982.00 | 2,356,800 |
| I Tホールディングス | 26,600 | 1,919.00 | 51,045,400 |
| ネオス | 1,600 | 822.00 | 1,315,200 |
| 電算システム | 2,600 | 1,592.00 | 4,139,200 |
| グリー | 44,600 | 748.00 | 33,360,800 |
| コーエーテクモホールディングス | 14,600 | 1,770.00 | 25,842,000 |
| 三菱総合研究所 | 2,900 | 2,740.00 | 7,946,000 |
| ボルテージ | 1,300 | 1,541.00 | 2,003,300 |
| 電算 | 700 | 2,147.00 | 1,502,900 |
| A G S | 1,500 | 951.00 | 1,426,500 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 1,000 | 1,840.00 | 1,840,000 |
| ブレインパッド | 800 | 1,364.00 | 1,091,200 |
| K L a b | 7,700 | 1,633.00 | 12,574,100 |
| ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス | 4,400 | 1,010.00 | 4,444,000 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 1,400 | 1,278.00 | 1,789,200 |
| ネクソン | 70,000 | 905.00 | 63,350,000 |
| アイスタイル | 2,400 | 484.00 | 1,161,600 |
| エムアップ | 1,800 | 850.00 | 1,530,000 |
| エイチーム | 900 | 6,030.00 | 5,427,000 |
| e n i s h | 1,900 | 2,508.00 | 4,765,200 |
| コロプラ | 12,900 | 3,605.00 | 46,504,500 |
| モバイルクリエイティブ | 3,200 | 847.00 | 2,710,400 |
| オルトプラス | 1,400 | 1,012.00 | 1,416,800 |
| ブロードリーフ | 6,100 | 1,766.00 | 10,772,600 |
| ハーツユナイテッドグループ | 1,700 | 2,054.00 | 3,491,800 |

| | | | |
|-----------------------|---------|----------|-------------|
| ドワンゴ | 8,600 | 2,259.00 | 19,427,400 |
| ベリサーブ | 800 | 984.00 | 787,200 |
| ティーガイア | 7,400 | 1,050.00 | 7,770,000 |
| 豆蔵ホールディングス | 5,800 | 671.00 | 3,891,800 |
| テクマトリックス | 3,200 | 677.00 | 2,166,400 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 6,400 | 2,480.00 | 15,872,000 |
| ザッパラス | 4,100 | 591.00 | 2,423,100 |
| インターネットイニシアティブ | 10,900 | 2,202.00 | 24,001,800 |
| ビットアイル | 8,300 | 601.00 | 4,988,300 |
| SRAホールディングス | 3,500 | 1,646.00 | 5,761,000 |
| システムインテグレータ | 800 | 668.00 | 534,400 |
| パイブドピッツ | 500 | 1,694.00 | 847,000 |
| 朝日ネット | 6,800 | 514.00 | 3,495,200 |
| コムチュア | 900 | 1,965.00 | 1,768,500 |
| パナソニック インフォメーションシステムズ | 1,500 | 3,015.00 | 4,522,500 |
| フェイス | 2,200 | 1,013.00 | 2,228,600 |
| 野村総合研究所 | 41,900 | 3,545.00 | 148,535,500 |
| サイバネットシステム | 6,000 | 519.00 | 3,114,000 |
| インテージホールディングス | 4,000 | 1,379.00 | 5,516,000 |
| 東邦システムサイエンス | 1,200 | 965.00 | 1,158,000 |
| ソースネクスト | 3,700 | 843.00 | 3,119,100 |
| ティー・ワイ・オー | 7,300 | 172.00 | 1,255,600 |
| クレスコ | 1,700 | 1,437.00 | 2,442,900 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 71,500 | 1,631.00 | 116,616,500 |
| オービック | 25,500 | 3,920.00 | 99,960,000 |
| ジャストシステム | 10,100 | 930.00 | 9,393,000 |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 1,600 | 910.00 | 1,456,000 |
| ヤフー | 530,200 | 417.00 | 221,093,400 |
| トレンドマイクロ | 39,200 | 3,710.00 | 145,432,000 |
| 日本オラクル | 11,800 | 4,280.00 | 50,504,000 |
| アルファシステムズ | 2,400 | 1,603.00 | 3,847,200 |
| フューチャーアーキテクト | 7,800 | 647.00 | 5,046,600 |
| CAC Holdings | 5,000 | 1,316.00 | 6,580,000 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 1,700 | 1,402.00 | 2,383,400 |
| トーセ | 1,800 | 714.00 | 1,285,200 |
| オービックビジネスコンサルタント | 3,800 | 3,135.00 | 11,913,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 8,400 | 4,610.00 | 38,724,000 |
| アイティフォー | 8,200 | 495.00 | 4,059,000 |
| 東計電算 | 1,300 | 1,588.00 | 2,064,400 |
| エクスネット | 700 | 1,425.00 | 997,500 |
| 大塚商会 | 19,900 | 4,360.00 | 86,764,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|---------------|
| サイボウズ | 9,800 | 377.00 | 3,694,600 |
| ソフトブレーン | 10,100 | 230.00 | 2,323,000 |
| アグレックス | 1,700 | 1,135.00 | 1,929,500 |
| 電通国際情報サービス | 4,600 | 1,188.00 | 5,464,800 |
| E Mシステムズ | 1,000 | 1,810.00 | 1,810,000 |
| ウェザーニューズ | 2,200 | 3,110.00 | 6,842,000 |
| C I J | 6,200 | 495.00 | 3,069,000 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 700 | 1,384.00 | 968,800 |
| 日本エンタープライズ | 4,600 | 465.00 | 2,139,000 |
| WOWOW | 2,300 | 4,475.00 | 10,292,500 |
| 日本コロムビア | 3,700 | 536.00 | 1,983,200 |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 3,900 | 488.00 | 1,903,200 |
| ネットワンシステムズ | 28,000 | 633.00 | 17,724,000 |
| アルゴグラフィックス | 2,800 | 1,983.00 | 5,552,400 |
| マーベラス | 11,200 | 1,274.00 | 14,268,800 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 13,600 | 1,663.00 | 22,616,800 |
| 日本ユニシス | 17,900 | 991.00 | 17,738,900 |
| 兼松エレクトロニクス | 4,700 | 1,454.00 | 6,833,800 |
| 東京放送ホールディングス | 39,900 | 1,222.00 | 48,757,800 |
| 日本テレビホールディングス | 73,700 | 1,674.00 | 123,373,800 |
| テレビ朝日ホールディングス | 18,700 | 1,730.00 | 32,351,000 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 56,100 | 645.00 | 36,184,500 |
| テレビ東京ホールディングス | 6,000 | 2,179.00 | 13,074,000 |
| コネクシオ | 6,500 | 1,088.00 | 7,072,000 |
| クロップス | 500 | 551.00 | 275,500 |
| 日本電信電話 | 290,700 | 6,821.00 | 1,982,864,700 |
| K D D I | 229,600 | 6,593.00 | 1,513,752,800 |
| 光通信 | 6,700 | 7,790.00 | 52,193,000 |
| N T T ドコモ | 609,600 | 1,830.50 | 1,115,872,800 |
| G M O インターネット | 24,700 | 954.00 | 23,563,800 |
| 学研ホールディングス | 25,000 | 277.00 | 6,925,000 |
| ゼンリン | 9,800 | 1,300.00 | 12,740,000 |
| 昭文社 | 4,400 | 706.00 | 3,106,400 |
| K A D O K A W A | 7,600 | 2,627.00 | 19,965,200 |
| インプレスホールディングス | 5,200 | 127.00 | 660,400 |
| アイネット | 3,100 | 868.00 | 2,690,800 |
| 松竹 | 49,000 | 1,020.00 | 49,980,000 |
| 東宝 | 52,800 | 2,480.00 | 130,944,000 |
| 東映 | 31,000 | 569.00 | 17,639,000 |
| A O I P r o . | 3,400 | 705.00 | 2,397,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 52,200 | 3,950.00 | 206,190,000 |
| D T S | 7,000 | 2,296.00 | 16,072,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|---------------|
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 26,900 | 2,329.00 | 62,650,100 |
| シーイーシー | 4,400 | 1,077.00 | 4,738,800 |
| カブコン | 18,900 | 1,722.00 | 32,545,800 |
| ジャステック | 4,300 | 894.00 | 3,844,200 |
| S C S K | 17,600 | 2,947.00 | 51,867,200 |
| 日本システムウエア | 2,800 | 661.00 | 1,850,800 |
| アイネス | 10,100 | 927.00 | 9,362,700 |
| T K C | 6,200 | 2,165.00 | 13,423,000 |
| 富士ソフト | 10,200 | 2,672.00 | 27,254,400 |
| N S D | 15,700 | 1,723.00 | 27,051,100 |
| コナミ | 33,400 | 2,286.00 | 76,352,400 |
| 福井コンピュータホールディングス | 2,000 | 825.00 | 1,650,000 |
| J B C Cホールディングス | 6,200 | 811.00 | 5,028,200 |
| ミロク情報サービス | 4,900 | 596.00 | 2,920,400 |
| ソフトバンク | 363,300 | 7,689.00 | 2,793,413,700 |
| ハウスイ | 6,000 | 132.00 | 792,000 |
| 高千穂交易 | 3,100 | 1,054.00 | 3,267,400 |
| 伊藤忠食品 | 1,800 | 3,625.00 | 6,525,000 |
| エレマテック | 3,500 | 2,097.00 | 7,339,500 |
| J A L U X | 2,100 | 1,268.00 | 2,662,800 |
| あらた | 17,000 | 328.00 | 5,576,000 |
| トーメンデバイス | 1,100 | 1,821.00 | 2,003,100 |
| 東京エレクトロン デバイス | 1,500 | 1,530.00 | 2,295,000 |
| 双日 | 495,200 | 172.00 | 85,174,400 |
| アルフレッサ ホールディングス | 87,500 | 1,581.00 | 138,337,500 |
| 横浜冷凍 | 18,400 | 814.00 | 14,977,600 |
| 山下医科器械 | 600 | 1,739.00 | 1,043,400 |
| ラサ商事 | 3,200 | 531.00 | 1,699,200 |
| アルコニックス | 4,500 | 1,502.00 | 6,759,000 |
| 神戸物産 | 1,200 | 4,140.00 | 4,968,000 |
| あい ホールディングス | 11,900 | 2,219.00 | 26,406,100 |
| ダイワボウホールディングス | 67,000 | 212.00 | 14,204,000 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 13,900 | 962.00 | 13,371,800 |
| 八洲電機 | 5,800 | 560.00 | 3,248,000 |
| U K Cホールディングス | 4,800 | 1,791.00 | 8,596,800 |
| T O K A Iホールディングス | 36,200 | 473.00 | 17,122,600 |
| 三洋貿易 | 4,400 | 1,444.00 | 6,353,600 |
| ミタチ産業 | 1,800 | 622.00 | 1,119,600 |
| シップヘルスケアホールディングス | 10,600 | 3,510.00 | 37,206,000 |
| スターティア | 600 | 1,917.00 | 1,150,200 |
| 富士興産 | 2,700 | 660.00 | 1,782,000 |
| 協栄産業 | 9,000 | 232.00 | 2,088,000 |

| | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|
| 小野建 | 6,500 | 1,234.00 | 8,021,000 |
| 佐島電機 | 5,900 | 729.00 | 4,301,100 |
| エコトレーディング | 1,900 | 691.00 | 1,312,900 |
| 伯東 | 4,500 | 1,107.00 | 4,981,500 |
| コンドーテック | 6,100 | 738.00 | 4,501,800 |
| 中山福 | 4,300 | 798.00 | 3,431,400 |
| ナガイレーベン | 10,700 | 2,126.00 | 22,748,200 |
| 三菱食品 | 8,100 | 2,495.00 | 20,209,500 |
| 松田産業 | 5,400 | 1,284.00 | 6,933,600 |
| メディバルホールディングス | 74,000 | 1,333.00 | 98,642,000 |
| アドヴァン | 3,800 | 1,201.00 | 4,563,800 |
| S P K | 1,700 | 1,937.00 | 3,292,900 |
| アズワン | 4,800 | 3,445.00 | 16,536,000 |
| スズデン | 2,700 | 639.00 | 1,725,300 |
| 尾家産業 | 2,400 | 838.00 | 2,011,200 |
| シモジマ | 5,100 | 1,002.00 | 5,110,200 |
| ドウシシャ | 7,900 | 1,883.00 | 14,875,700 |
| 小津産業 | 1,500 | 1,726.00 | 2,589,000 |
| 高速 | 4,400 | 943.00 | 4,149,200 |
| 黒田電気 | 12,100 | 1,607.00 | 19,444,700 |
| 丸文 | 6,600 | 719.00 | 4,745,400 |
| ハピネット | 4,500 | 1,750.00 | 7,875,000 |
| エクセル | 3,400 | 2,255.00 | 7,667,000 |
| マルカキカイ | 2,400 | 1,448.00 | 3,475,200 |
| ガリバーインターナショナル | 24,900 | 933.00 | 23,231,700 |
| 日本エム・ディ・エム | 6,200 | 459.00 | 2,845,800 |
| 進和 | 4,400 | 1,309.00 | 5,759,600 |
| エスケイジャパン | 1,900 | 256.00 | 486,400 |
| ダイトエレクトロン | 3,500 | 519.00 | 1,816,500 |
| シークス | 4,700 | 1,907.00 | 8,962,900 |
| 田中商事 | 2,300 | 703.00 | 1,616,900 |
| オーハシテクニカ | 3,800 | 1,274.00 | 4,841,200 |
| マクニカ | 3,800 | 3,500.00 | 13,300,000 |
| 白銅 | 2,400 | 1,020.00 | 2,448,000 |
| 伊藤忠商事 | 590,200 | 1,340.00 | 790,868,000 |
| 丸紅 | 647,200 | 750.80 | 485,917,760 |
| 高島 | 14,000 | 247.00 | 3,458,000 |
| 長瀬産業 | 41,900 | 1,333.00 | 55,852,700 |
| 蝶理 | 4,700 | 1,430.00 | 6,721,000 |
| 豊田通商 | 82,400 | 2,672.00 | 220,172,800 |
| 三共生興 | 12,700 | 406.00 | 5,156,200 |
| 兼松 | 157,000 | 176.00 | 27,632,000 |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|--|
| ツカモトコーポレーション | 13,000 | 134.00 | 1,742,000 | |
| 三井物産 | 669,000 | 1,729.50 | 1,157,035,500 | |
| 日本紙パルプ商事 | 39,000 | 330.00 | 12,870,000 | |
| 日立ハイテクノロジーズ | 22,500 | 3,150.00 | 70,875,000 | |
| カメイ | 9,700 | 797.00 | 7,730,900 | |
| 東都水産 | 13,000 | 197.00 | 2,561,000 | |
| OUGホールディングス | 11,000 | 229.00 | 2,519,000 | |
| スターゼン | 27,000 | 342.00 | 9,234,000 | |
| 山善 | 28,400 | 859.00 | 24,395,600 | |
| 椿本興業 | 8,000 | 306.00 | 2,448,000 | |
| 住友商事 | 436,600 | 1,210.50 | 528,504,300 | |
| 内田洋行 | 18,000 | 378.00 | 6,804,000 | |
| 三菱商事 | 567,000 | 2,246.00 | 1,273,482,000 | |
| 第一実業 | 17,000 | 614.00 | 10,438,000 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 21,100 | 2,112.00 | 44,563,200 | |
| 西華産業 | 24,000 | 268.00 | 6,432,000 | |
| 佐藤商事 | 6,600 | 725.00 | 4,785,000 | |
| 菱洋エレクトロ | 8,600 | 1,129.00 | 9,709,400 | |
| 東京産業 | 7,400 | 414.00 | 3,063,600 | |
| ユアサ商事 | 7,600 | 2,127.00 | 16,165,200 | |
| 神鋼商事 | 19,000 | 272.00 | 5,168,000 | |
| 小林産業 | 5,500 | 287.00 | 1,578,500 | |
| 阪和興業 | 74,000 | 410.00 | 30,340,000 | |
| カナデン | 7,000 | 801.00 | 5,607,000 | |
| 菱電商事 | 11,000 | 821.00 | 9,031,000 | |
| フルサト工業 | 4,100 | 1,722.00 | 7,060,200 | |
| 岩谷産業 | 82,000 | 760.00 | 62,320,000 | |
| すてきナイスグループ | 32,000 | 217.00 | 6,944,000 | |
| 昭光通商 | 26,000 | 163.00 | 4,238,000 | |
| ニチモウ | 12,000 | 187.00 | 2,244,000 | |
| 極東貿易 | 9,000 | 267.00 | 2,403,000 | |
| イワキ | 11,000 | 254.00 | 2,794,000 | |
| 三愛石油 | 17,000 | 763.00 | 12,971,000 | |
| 稲畑産業 | 17,800 | 1,105.00 | 19,669,000 | |
| G S Iクレオス | 20,000 | 146.00 | 2,920,000 | |
| 明和産業 | 6,900 | 447.00 | 3,084,300 | |
| ワキタ | 14,600 | 1,161.00 | 16,950,600 | |
| 東邦ホールディングス | 23,700 | 2,097.00 | 49,698,900 | |
| サンゲツ | 13,100 | 2,763.00 | 36,195,300 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 12,000 | 546.00 | 6,552,000 | |
| シナネン | 16,000 | 444.00 | 7,104,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 16,400 | 707.00 | 11,594,800 | |

| | | | |
|----------------|--------|----------|-------------|
| サンリオ | 18,700 | 3,180.00 | 59,466,000 |
| サンワテクノス | 4,000 | 1,174.00 | 4,696,000 |
| リョーサン | 11,000 | 2,360.00 | 25,960,000 |
| 新光商事 | 8,100 | 1,076.00 | 8,715,600 |
| トーホー | 15,000 | 407.00 | 6,105,000 |
| 三信電気 | 8,900 | 817.00 | 7,271,300 |
| 東陽テクニカ | 10,900 | 1,135.00 | 12,371,500 |
| モスフードサービス | 9,700 | 2,189.00 | 21,233,300 |
| 加賀電子 | 6,700 | 1,267.00 | 8,488,900 |
| ソーダニッカ | 8,000 | 460.00 | 3,680,000 |
| 立花エレテック | 4,500 | 1,493.00 | 6,718,500 |
| P a l t a c | 10,400 | 1,342.00 | 13,956,800 |
| ヤマタネ | 37,000 | 180.00 | 6,660,000 |
| 丸紅建材リース | 6,000 | 313.00 | 1,878,000 |
| 日鉄住金物産 | 49,000 | 423.00 | 20,727,000 |
| トラスコ中山 | 8,500 | 2,837.00 | 24,114,500 |
| オートバックスセブン | 25,100 | 1,705.00 | 42,795,500 |
| 加藤産業 | 10,700 | 2,301.00 | 24,620,700 |
| イノテック | 6,900 | 553.00 | 3,815,700 |
| イエローハット | 6,400 | 2,410.00 | 15,424,000 |
| 富士エレクトロニクス | 3,800 | 1,380.00 | 5,244,000 |
| J Kホールディングス | 6,700 | 572.00 | 3,832,400 |
| 日伝 | 3,400 | 2,321.00 | 7,891,400 |
| 北沢産業 | 6,300 | 182.00 | 1,146,600 |
| 杉本商事 | 4,000 | 1,100.00 | 4,400,000 |
| 因幡電機産業 | 10,200 | 3,690.00 | 37,638,000 |
| バイテック | 2,600 | 797.00 | 2,072,200 |
| ミスミグループ本社 | 29,700 | 3,310.00 | 98,307,000 |
| 江守グループホールディングス | 3,200 | 1,994.00 | 6,380,800 |
| アルテック | 5,400 | 233.00 | 1,258,200 |
| タキヒヨー | 12,000 | 419.00 | 5,028,000 |
| スズケン | 30,600 | 3,160.00 | 96,696,000 |
| ジェコス | 5,100 | 1,681.00 | 8,573,100 |
| ローソン | 30,400 | 7,670.00 | 233,168,000 |
| サンエー | 5,600 | 3,655.00 | 20,468,000 |
| ダイユーエイト | 1,500 | 694.00 | 1,041,000 |
| カワチ薬品 | 5,200 | 1,878.00 | 9,765,600 |
| エービーシー・マート | 10,500 | 5,600.00 | 58,800,000 |
| ハードオフコーポレーション | 3,600 | 902.00 | 3,247,200 |
| アスクル | 7,700 | 2,300.00 | 17,710,000 |
| ゲオホールディングス | 12,700 | 945.00 | 12,001,500 |
| アダストリアホールディングス | 5,700 | 2,140.00 | 12,198,000 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|--|
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 9,000 | 148.00 | 1,332,000 | |
| くらコーポレーション | 4,300 | 3,065.00 | 13,179,500 | |
| キャンドウ | 3,500 | 1,687.00 | 5,904,500 | |
| パル | 4,300 | 2,980.00 | 12,814,000 | |
| エディオン | 33,900 | 693.00 | 23,492,700 | |
| サーラコーポレーション | 6,400 | 629.00 | 4,025,600 | |
| ワッツ | 2,900 | 902.00 | 2,615,800 | |
| あみやき亭 | 1,300 | 4,030.00 | 5,239,000 | |
| ひらまつ | 9,100 | 637.00 | 5,796,700 | |
| ゲンキー | 700 | 4,985.00 | 3,489,500 | |
| サッポロドラッグストアー | 600 | 1,708.00 | 1,024,800 | |
| 大黒天物産 | 1,800 | 3,275.00 | 5,895,000 | |
| ハニーズ | 5,900 | 1,157.00 | 6,826,300 | |
| アルペン | 6,600 | 1,688.00 | 11,140,800 | |
| クオール | 5,400 | 653.00 | 3,526,200 | |
| ジェイアイエヌ | 5,000 | 2,957.00 | 14,785,000 | |
| ビックカメラ | 32,100 | 1,034.00 | 33,191,400 | |
| D C Mホールディングス | 35,800 | 752.00 | 26,921,600 | |
| M o n o t a R O | 14,400 | 2,747.00 | 39,556,800 | |
| きちり | 1,500 | 738.00 | 1,107,000 | |
| アークランドサービス | 900 | 3,410.00 | 3,069,000 | |
| J . フロント リテイリング | 87,400 | 1,435.00 | 125,419,000 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 13,000 | 1,738.00 | 22,594,000 | |
| マツモトキヨシホールディングス | 15,300 | 3,235.00 | 49,495,500 | |
| ブロンコビリー | 1,200 | 3,125.00 | 3,750,000 | |
| スタートトゥデイ | 23,000 | 2,387.00 | 54,901,000 | |
| 物語コーポレーション | 1,800 | 3,415.00 | 6,147,000 | |
| ココカラファイン | 7,700 | 2,870.00 | 22,099,000 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 147,100 | 1,428.00 | 210,058,800 | |
| ウエルシアホールディングス | 6,700 | 3,270.00 | 21,909,000 | |
| クリエイトSDホールディングス | 3,100 | 3,850.00 | 11,935,000 | |
| 丸善C H Iホールディングス | 6,500 | 370.00 | 2,405,000 | |
| エー・ピーカンパニー | 900 | 2,048.00 | 1,843,200 | |
| チムニー | 1,400 | 2,349.00 | 3,288,600 | |
| ジョイフル本田 | 4,100 | 3,540.00 | 14,514,000 | |
| キリン堂ホールディングス | 2,600 | 706.00 | 1,835,600 | |
| ブックオフコーポレーション | 4,100 | 837.00 | 3,431,700 | |
| あさひ | 4,300 | 1,229.00 | 5,284,700 | |
| 日本調剤 | 900 | 3,000.00 | 2,700,000 | |
| コスモス薬品 | 4,200 | 13,910.00 | 58,422,000 | |
| トーエル | 3,900 | 687.00 | 2,679,300 | |
| 一六堂 | 1,600 | 451.00 | 721,600 | |

| | | | | |
|-----------------------|---------|-----------|---------------|--|
| セブン&アイ・ホールディングス | 309,500 | 4,254.00 | 1,316,613,000 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 3,700 | 1,325.00 | 4,902,500 | |
| ツルハホールディングス | 14,600 | 6,100.00 | 89,060,000 | |
| サンマルクホールディングス | 2,400 | 5,540.00 | 13,296,000 | |
| フェリシモ | 2,100 | 1,178.00 | 2,473,800 | |
| トリドール | 6,400 | 1,300.00 | 8,320,000 | |
| クスリのアオキ | 3,300 | 4,700.00 | 15,510,000 | |
| メディカルシステムネットワーク | 6,100 | 353.00 | 2,153,300 | |
| 総合メディカル | 1,800 | 5,340.00 | 9,612,000 | |
| はるやま商事 | 3,100 | 724.00 | 2,244,400 | |
| カッパ・クリエイトホールディングス | 10,900 | 1,050.00 | 11,445,000 | |
| ライトオン | 5,500 | 714.00 | 3,927,000 | |
| 良品計画 | 7,800 | 13,070.00 | 101,946,000 | |
| 三城ホールディングス | 9,200 | 490.00 | 4,508,000 | |
| コナカ | 8,700 | 660.00 | 5,742,000 | |
| ハウス オブ ローゼ | 800 | 1,386.00 | 1,108,800 | |
| G - 7ホールディングス | 2,200 | 911.00 | 2,004,200 | |
| イオン北海道 | 9,700 | 736.00 | 7,139,200 | |
| コジマ | 10,900 | 307.00 | 3,346,300 | |
| ヒマラヤ | 1,700 | 1,030.00 | 1,751,000 | |
| コーナン商事 | 9,700 | 1,221.00 | 11,843,700 | |
| エコス | 2,500 | 747.00 | 1,867,500 | |
| ワタミ | 8,700 | 1,306.00 | 11,362,200 | |
| マルシェ | 1,800 | 875.00 | 1,575,000 | |
| ドンキホーテホールディングス | 25,600 | 6,290.00 | 161,024,000 | |
| 西松屋チェーン | 14,600 | 856.00 | 12,497,600 | |
| ゼンショーホールディングス | 34,000 | 972.00 | 33,048,000 | |
| 幸楽苑 | 4,600 | 1,399.00 | 6,435,400 | |
| ハークスレイ | 2,100 | 900.00 | 1,890,000 | |
| サイゼリヤ | 11,000 | 1,469.00 | 16,159,000 | |
| ポブラ | 3,100 | 551.00 | 1,708,100 | |
| ユナイテッドアローズ | 9,700 | 4,055.00 | 39,333,500 | |
| ハイデイ日高 | 4,700 | 2,915.00 | 13,700,500 | |
| 京都きもの友禅 | 4,600 | 1,000.00 | 4,600,000 | |
| コロナイド | 24,500 | 1,293.00 | 31,678,500 | |
| 壱番屋 | 3,000 | 5,320.00 | 15,960,000 | |
| トップカルチャー | 3,000 | 550.00 | 1,650,000 | |
| P L A N T | 1,900 | 1,231.00 | 2,338,900 | |
| スギホールディングス | 13,300 | 4,605.00 | 61,246,500 | |
| スクロール | 9,600 | 293.00 | 2,812,800 | |
| ヨンドシーホールディングス | 5,600 | 2,197.00 | 12,303,200 | |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| ファミリーマート | 25,000 | 4,185.00 | 104,625,000 |
| 木曽路 | 9,100 | 1,957.00 | 17,808,700 |
| サトレストランシステムズ | 6,900 | 844.00 | 5,823,600 |
| 千趣会 | 13,300 | 879.00 | 11,690,700 |
| タカキュー | 5,700 | 211.00 | 1,202,700 |
| ケーヨー | 12,500 | 498.00 | 6,225,000 |
| 上新電機 | 16,000 | 981.00 | 15,696,000 |
| 日本瓦斯 | 11,000 | 2,603.00 | 28,633,000 |
| ベスト電器 | 23,800 | 138.00 | 3,284,400 |
| マルエツ | 16,000 | 523.00 | 8,368,000 |
| ロイヤルホールディングス | 12,400 | 1,771.00 | 21,960,400 |
| 東天紅 | 5,000 | 176.00 | 880,000 |
| いなげや | 8,200 | 1,183.00 | 9,700,600 |
| 島忠 | 17,900 | 2,533.00 | 45,340,700 |
| チヨダ | 8,700 | 2,217.00 | 19,287,900 |
| ライフコーポレーション | 5,900 | 1,735.00 | 10,236,500 |
| カスミ | 15,100 | 999.00 | 15,084,900 |
| リンガーハット | 7,200 | 1,683.00 | 12,117,600 |
| MrMax | 7,400 | 325.00 | 2,405,000 |
| テンアライド | 5,600 | 349.00 | 1,954,400 |
| AOKIホールディングス | 12,700 | 1,262.00 | 16,027,400 |
| オークワ | 12,000 | 988.00 | 11,856,000 |
| コメリ | 11,400 | 2,493.00 | 28,420,200 |
| 青山商事 | 18,600 | 2,555.00 | 47,523,000 |
| しまむら | 8,600 | 10,080.00 | 86,688,000 |
| CFSコーポレーション | 4,900 | 620.00 | 3,038,000 |
| はせがわ | 2,600 | 614.00 | 1,596,400 |
| 高島屋 | 101,000 | 917.00 | 92,617,000 |
| 松屋 | 15,400 | 1,363.00 | 20,990,200 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 30,400 | 1,836.00 | 55,814,400 |
| 近鉄百貨店 | 28,000 | 334.00 | 9,352,000 |
| ニッセンホールディングス | 15,500 | 370.00 | 5,735,000 |
| パルコ | 7,100 | 888.00 | 6,304,800 |
| 丸井グループ | 96,500 | 903.00 | 87,139,500 |
| アクシアル リテイリング | 4,100 | 2,091.00 | 8,573,100 |
| ダイエー | 91,300 | 125.00 | 11,412,500 |
| イオン | 295,500 | 1,092.00 | 322,686,000 |
| ユニーグループ・ホールディングス | 71,500 | 583.00 | 41,684,500 |
| イズミ | 16,500 | 3,730.00 | 61,545,000 |
| 東武ストア | 10,000 | 281.00 | 2,810,000 |
| 平和堂 | 15,000 | 1,843.00 | 27,645,000 |
| フジ | 8,400 | 2,174.00 | 18,261,600 |

| | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|
| ヤオコー | 3,800 | 6,520.00 | 24,776,000 |
| ゼビオ | 8,900 | 1,663.00 | 14,800,700 |
| ケーズホールディングス | 15,600 | 3,265.00 | 50,934,000 |
| Olympicグループ | 4,400 | 1,053.00 | 4,633,200 |
| 日産東京販売ホールディングス | 10,900 | 301.00 | 3,280,900 |
| アインファーマシーズ | 8,200 | 2,504.00 | 20,532,800 |
| 元気寿司 | 2,300 | 2,119.00 | 4,873,700 |
| ヤマダ電機 | 292,500 | 320.00 | 93,600,000 |
| アークランドサカモト | 4,800 | 2,571.00 | 12,340,800 |
| ニトリホールディングス | 29,300 | 6,790.00 | 198,947,000 |
| グルメ杵屋 | 5,000 | 867.00 | 4,335,000 |
| 愛眼 | 5,900 | 268.00 | 1,581,200 |
| ケーユーホールディングス | 3,100 | 605.00 | 1,875,500 |
| 吉野家ホールディングス | 19,400 | 1,314.00 | 25,491,600 |
| 松屋フーズ | 3,600 | 2,127.00 | 7,657,200 |
| サガミチェーン | 9,000 | 1,054.00 | 9,486,000 |
| 関西スーパーマーケット | 5,500 | 816.00 | 4,488,000 |
| 王将フードサービス | 4,900 | 4,240.00 | 20,776,000 |
| プレナス | 8,300 | 2,521.00 | 20,924,300 |
| ミニストップ | 5,500 | 1,529.00 | 8,409,500 |
| アークス | 12,600 | 2,294.00 | 28,904,400 |
| バロー | 15,900 | 1,774.00 | 28,206,600 |
| 藤久 | 600 | 1,676.00 | 1,005,600 |
| ベルク | 3,600 | 3,015.00 | 10,854,000 |
| 大庄 | 4,000 | 1,346.00 | 5,384,000 |
| ファーストリテイリング | 14,800 | 36,705.00 | 543,234,000 |
| サンドラッグ | 15,600 | 4,875.00 | 76,050,000 |
| 東京デリカ | 5,550 | 1,691.00 | 9,385,050 |
| ヤマザワ | 1,700 | 1,633.00 | 2,776,100 |
| やまや | 1,500 | 1,668.00 | 2,502,000 |
| ペルーナ | 18,500 | 482.00 | 8,917,000 |
| 島根銀行 | 1,600 | 1,337.00 | 2,139,200 |
| じもとホールディングス | 53,100 | 225.00 | 11,947,500 |
| 足利ホールディングス | 38,800 | 407.00 | 15,791,600 |
| 新生銀行 | 640,000 | 235.00 | 150,400,000 |
| あおぞら銀行 | 384,000 | 371.00 | 142,464,000 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 5,606,200 | 620.20 | 3,476,965,240 |
| りそなホールディングス | 703,200 | 618.40 | 434,858,880 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 1,453,000 | 456.50 | 663,294,500 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 559,500 | 4,471.00 | 2,501,524,500 |
| 第四銀行 | 94,000 | 383.00 | 36,002,000 |
| 北越銀行 | 80,000 | 210.00 | 16,800,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| 西日本シティ銀行 | 260,000 | 293.00 | 76,180,000 |
| 千葉銀行 | 285,000 | 763.00 | 217,455,000 |
| 横浜銀行 | 481,000 | 603.20 | 290,139,200 |
| 常陽銀行 | 269,000 | 540.00 | 145,260,000 |
| 群馬銀行 | 164,000 | 632.00 | 103,648,000 |
| 武蔵野銀行 | 11,800 | 3,640.00 | 42,952,000 |
| 千葉興業銀行 | 15,300 | 789.00 | 12,071,700 |
| 筑波銀行 | 30,700 | 370.00 | 11,359,000 |
| 東京都民銀行 | 13,100 | 1,309.00 | 17,147,900 |
| 七十七銀行 | 116,000 | 578.00 | 67,048,000 |
| 青森銀行 | 54,000 | 333.00 | 17,982,000 |
| 秋田銀行 | 51,000 | 306.00 | 15,606,000 |
| 山形銀行 | 45,000 | 514.00 | 23,130,000 |
| 岩手銀行 | 4,800 | 4,840.00 | 23,232,000 |
| 東邦銀行 | 66,000 | 409.00 | 26,994,000 |
| 東北銀行 | 38,000 | 155.00 | 5,890,000 |
| みちのく銀行 | 40,000 | 213.00 | 8,520,000 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 300,000 | 523.00 | 156,900,000 |
| 静岡銀行 | 217,000 | 1,129.00 | 244,993,000 |
| 十六銀行 | 93,000 | 411.00 | 38,223,000 |
| スルガ銀行 | 72,100 | 2,186.00 | 157,610,600 |
| 八十二銀行 | 134,000 | 659.00 | 88,306,000 |
| 山梨中央銀行 | 47,000 | 481.00 | 22,607,000 |
| 大垣共立銀行 | 93,000 | 297.00 | 27,621,000 |
| 福井銀行 | 63,000 | 263.00 | 16,569,000 |
| 北國銀行 | 82,000 | 373.00 | 30,586,000 |
| 清水銀行 | 2,500 | 2,976.00 | 7,440,000 |
| 滋賀銀行 | 70,000 | 604.00 | 42,280,000 |
| 南都銀行 | 71,000 | 443.00 | 31,453,000 |
| 百五銀行 | 67,000 | 440.00 | 29,480,000 |
| 京都銀行 | 141,000 | 911.00 | 128,451,000 |
| 紀陽銀行 | 29,000 | 1,564.00 | 45,356,000 |
| 三重銀行 | 31,000 | 255.00 | 7,905,000 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 503,000 | 215.00 | 108,145,000 |
| 広島銀行 | 218,000 | 539.00 | 117,502,000 |
| 山陰合同銀行 | 45,000 | 774.00 | 34,830,000 |
| 中国銀行 | 53,200 | 1,611.00 | 85,705,200 |
| 鳥取銀行 | 24,000 | 229.00 | 5,496,000 |
| 伊予銀行 | 79,100 | 1,110.00 | 87,801,000 |
| 百十四銀行 | 81,000 | 351.00 | 28,431,000 |
| 四国銀行 | 53,000 | 236.00 | 12,508,000 |
| 阿波銀行 | 61,000 | 632.00 | 38,552,000 |

| | | | |
|----------------|-----------|----------|---------------|
| 鹿児島銀行 | 51,000 | 697.00 | 35,547,000 |
| 大分銀行 | 45,000 | 413.00 | 18,585,000 |
| 宮崎銀行 | 49,000 | 337.00 | 16,513,000 |
| 肥後銀行 | 60,000 | 603.00 | 36,180,000 |
| 佐賀銀行 | 45,000 | 252.00 | 11,340,000 |
| 十八銀行 | 45,000 | 304.00 | 13,680,000 |
| 沖縄銀行 | 5,500 | 4,820.00 | 26,510,000 |
| 琉球銀行 | 14,300 | 1,733.00 | 24,781,900 |
| 八千代銀行 | 3,500 | 3,435.00 | 12,022,500 |
| セブン銀行 | 277,200 | 447.00 | 123,908,400 |
| みずほフィナンシャルグループ | 9,621,100 | 195.90 | 1,884,773,490 |
| 高知銀行 | 29,000 | 142.00 | 4,118,000 |
| 山口フィナンシャルグループ | 74,000 | 1,036.00 | 76,664,000 |
| 長野銀行 | 24,000 | 190.00 | 4,560,000 |
| 名古屋銀行 | 67,000 | 419.00 | 28,073,000 |
| 北洋銀行 | 111,500 | 432.00 | 48,168,000 |
| 愛知銀行 | 2,700 | 5,480.00 | 14,796,000 |
| 第三銀行 | 42,000 | 183.00 | 7,686,000 |
| 中京銀行 | 30,000 | 197.00 | 5,910,000 |
| 東日本銀行 | 32,000 | 278.00 | 8,896,000 |
| 大光銀行 | 26,000 | 232.00 | 6,032,000 |
| 愛媛銀行 | 43,000 | 245.00 | 10,535,000 |
| トマト銀行 | 29,000 | 180.00 | 5,220,000 |
| みなと銀行 | 67,000 | 216.00 | 14,472,000 |
| 京葉銀行 | 61,000 | 559.00 | 34,099,000 |
| 関西アーバン銀行 | 10,300 | 1,255.00 | 12,926,500 |
| 栃木銀行 | 37,000 | 430.00 | 15,910,000 |
| 北日本銀行 | 2,300 | 2,654.00 | 6,104,200 |
| 東和銀行 | 93,000 | 99.00 | 9,207,000 |
| 福島銀行 | 91,000 | 86.00 | 7,826,000 |
| 大東銀行 | 47,000 | 137.00 | 6,439,000 |
| トモニホールディングス | 56,800 | 461.00 | 26,184,800 |
| フィデアホールディングス | 42,600 | 240.00 | 10,224,000 |
| 池田泉州ホールディングス | 55,500 | 564.00 | 31,302,000 |
| F P G | 6,800 | 1,022.00 | 6,949,600 |
| S B Iホールディングス | 89,200 | 1,228.00 | 109,537,600 |
| ジャフコ | 10,200 | 3,955.00 | 40,341,000 |
| 大和証券グループ本社 | 733,000 | 868.90 | 636,903,700 |
| 野村ホールディングス | 1,513,000 | 653.80 | 989,199,400 |
| 岡三証券グループ | 58,000 | 780.00 | 45,240,000 |
| 丸三証券 | 22,000 | 789.00 | 17,358,000 |
| 東洋証券 | 30,000 | 303.00 | 9,090,000 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|----------|-------------|
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 78,400 | 754.00 | 59,113,600 |
| 光世証券 | 19,000 | 215.00 | 4,085,000 |
| 水戸証券 | 22,200 | 399.00 | 8,857,800 |
| いちよし証券 | 14,600 | 1,314.00 | 19,184,400 |
| 松井証券 | 37,600 | 1,022.00 | 38,427,200 |
| だいこう証券ビジネス | 4,000 | 667.00 | 2,668,000 |
| マネックスグループ | 81,300 | 286.00 | 23,251,800 |
| カブドットコム証券 | 29,000 | 536.00 | 15,544,000 |
| 極東証券 | 9,300 | 1,795.00 | 16,693,500 |
| 岩井コスモホールディングス | 7,100 | 1,093.00 | 7,760,300 |
| マネースクウェア・ジャパン | 2,100 | 1,316.00 | 2,763,600 |
| マネーパートナーズグループ | 8,200 | 390.00 | 3,198,000 |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 164,300 | 2,661.00 | 437,202,300 |
| アニコム ホールディングス | 3,000 | 1,285.00 | 3,855,000 |
| MS & ADインシュアランスグループホールディングス | 221,100 | 2,392.50 | 528,981,750 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 70,900 | 1,774.00 | 125,776,600 |
| 第一生命保険 | 441,300 | 1,628.00 | 718,436,400 |
| 東京海上ホールディングス | 286,600 | 3,402.50 | 975,156,500 |
| T & Dホールディングス | 253,800 | 1,408.50 | 357,477,300 |
| 全国保証 | 17,600 | 3,060.00 | 53,856,000 |
| クレディセゾン | 60,400 | 2,113.00 | 127,625,200 |
| アクリーティブ | 5,100 | 222.00 | 1,132,200 |
| 芙蓉総合リース | 7,800 | 4,285.00 | 33,423,000 |
| 興銀リース | 12,900 | 2,554.00 | 32,946,600 |
| 東京センチュリーリース | 17,400 | 2,915.00 | 50,721,000 |
| 日本証券金融 | 32,500 | 641.00 | 20,832,500 |
| アイフル | 134,900 | 461.00 | 62,188,900 |
| ポケットカード | 7,400 | 662.00 | 4,898,800 |
| リコーリース | 5,100 | 3,055.00 | 15,580,500 |
| イオンフィナンシャルサービス | 43,600 | 2,347.00 | 102,329,200 |
| アコム | 148,600 | 367.00 | 54,536,200 |
| ジャックス | 45,000 | 610.00 | 27,450,000 |
| オリエントコーポレーション | 165,900 | 221.00 | 36,663,900 |
| 日立キャピタル | 14,500 | 2,637.00 | 38,236,500 |
| アプラスフィナンシャル | 35,500 | 143.00 | 5,076,500 |
| オリックス | 462,100 | 1,513.00 | 699,157,300 |
| 三菱UFJリース | 187,700 | 573.00 | 107,552,100 |
| 日本取引所グループ | 108,600 | 2,603.00 | 282,685,800 |
| イー・ギャランティ | 2,100 | 1,907.00 | 4,004,700 |
| アサックス | 1,300 | 1,324.00 | 1,721,200 |
| NECキャピタルソリューション | 2,500 | 2,165.00 | 5,412,500 |

| | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|
| 日本駐車場開発 | 80,600 | 124.00 | 9,994,400 |
| ヒューリック | 124,900 | 1,160.00 | 144,884,000 |
| 東京建物不動産販売 | 3,800 | 392.00 | 1,489,600 |
| 三栄建築設計 | 3,000 | 876.00 | 2,628,000 |
| 野村不動産ホールディングス | 48,900 | 1,884.00 | 92,127,600 |
| プレサンスコーポレーション | 1,800 | 3,060.00 | 5,508,000 |
| 常和ホールディングス | 2,600 | 3,770.00 | 9,802,000 |
| エストラスト | 600 | 667.00 | 400,200 |
| フージャースホールディングス | 11,100 | 501.00 | 5,561,100 |
| オープンハウス | 4,700 | 2,044.00 | 9,606,800 |
| 東急不動産ホールディングス | 164,100 | 752.00 | 123,403,200 |
| 飯田グループホールディングス | 32,400 | 1,342.00 | 43,480,800 |
| パーク24 | 38,900 | 1,750.00 | 68,075,000 |
| バラカ | 2,800 | 820.00 | 2,296,000 |
| 三井不動産 | 388,000 | 3,359.50 | 1,303,486,000 |
| 三菱地所 | 518,000 | 2,468.50 | 1,278,683,000 |
| 平和不動産 | 14,900 | 1,728.00 | 25,747,200 |
| 東京建物 | 161,000 | 887.00 | 142,807,000 |
| ダイビル | 21,800 | 1,259.00 | 27,446,200 |
| 京阪神ビルディング | 12,300 | 596.00 | 7,330,800 |
| 住友不動産 | 177,000 | 3,902.50 | 690,742,500 |
| 大京 | 125,000 | 205.00 | 25,625,000 |
| テーオーシー | 25,500 | 709.00 | 18,079,500 |
| 東京楽天地 | 12,000 | 498.00 | 5,976,000 |
| レオパレス21 | 85,100 | 602.00 | 51,230,200 |
| フジ住宅 | 9,500 | 612.00 | 5,814,000 |
| 空港施設 | 9,000 | 750.00 | 6,750,000 |
| 明和地所 | 3,600 | 515.00 | 1,854,000 |
| 住友不動産販売 | 5,300 | 2,526.00 | 13,387,800 |
| ゴールドクレスト | 5,800 | 2,000.00 | 11,600,000 |
| 日本エスリード | 2,900 | 997.00 | 2,891,300 |
| 日神不動産 | 9,900 | 466.00 | 4,613,400 |
| タカラレーベン | 24,300 | 408.00 | 9,914,400 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 4,200 | 1,246.00 | 5,233,200 |
| イオンモール | 47,800 | 2,093.00 | 100,045,400 |
| ファースト住建 | 2,800 | 1,397.00 | 3,911,600 |
| トーセイ | 10,200 | 697.00 | 7,109,400 |
| 穴吹興産 | 7,000 | 252.00 | 1,764,000 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 46,000 | 1,154.00 | 53,084,000 |
| サンフロンティア不動産 | 7,000 | 1,254.00 | 8,778,000 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 4,000 | 471.00 | 1,884,000 |
| ランドビジネス | 3,700 | 418.00 | 1,546,600 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| グランディハウス | 5,800 | 320.00 | 1,856,000 |
| 日本空港ビルディング | 25,600 | 4,400.00 | 112,640,000 |
| 日本工営 | 26,000 | 448.00 | 11,648,000 |
| ネクスト | 6,600 | 743.00 | 4,903,800 |
| 日本M&Aセンター | 12,100 | 3,185.00 | 38,538,500 |
| ノバレーゼ | 2,100 | 904.00 | 1,898,400 |
| アコーディア・ゴルフ | 31,900 | 1,152.00 | 36,748,800 |
| タケエイ | 5,600 | 1,105.00 | 6,188,000 |
| トラスト・テック | 1,400 | 1,929.00 | 2,700,600 |
| パソナグループ | 6,200 | 599.00 | 3,713,800 |
| CDS | 1,800 | 974.00 | 1,753,200 |
| リンクアンドモチベーション | 11,300 | 169.00 | 1,909,700 |
| GCAサヴィアン | 6,100 | 1,011.00 | 6,167,100 |
| エス・エム・エス | 4,400 | 2,816.00 | 12,390,400 |
| テンプホールディングス | 17,100 | 3,340.00 | 57,114,000 |
| リニカル | 2,200 | 978.00 | 2,151,600 |
| クックパッド | 3,900 | 3,525.00 | 13,747,500 |
| エスクリ | 3,100 | 1,282.00 | 3,974,200 |
| アイ・ケイ・ケイ | 2,100 | 933.00 | 1,959,300 |
| 学情 | 3,300 | 1,112.00 | 3,669,600 |
| スタジオアリス | 3,600 | 1,409.00 | 5,072,400 |
| シミックホールディングス | 3,000 | 1,971.00 | 5,913,000 |
| 総合警備保障 | 28,500 | 2,578.00 | 73,473,000 |
| カカクコム | 46,900 | 1,558.00 | 73,070,200 |
| アイロムホールディングス | 1,700 | 975.00 | 1,657,500 |
| ルネサンス | 3,600 | 951.00 | 3,423,600 |
| ディップ | 1,800 | 4,960.00 | 8,928,000 |
| オプト | 3,500 | 767.00 | 2,684,500 |
| ツクイ | 8,700 | 1,092.00 | 9,500,400 |
| 総合臨床ホールディングス | 3,500 | 484.00 | 1,694,000 |
| キャリアデザインセンター | 2,400 | 1,100.00 | 2,640,000 |
| エムスリー | 52,700 | 1,760.00 | 92,752,000 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 6,000 | 915.00 | 5,490,000 |
| アウトソーシング | 3,200 | 1,697.00 | 5,430,400 |
| ディー・エヌ・エー | 42,100 | 1,395.00 | 58,729,500 |
| 博報堂DYホールディングス | 108,500 | 1,110.00 | 120,435,000 |
| ぐるなび | 10,900 | 1,514.00 | 16,502,600 |
| 一休 | 5,600 | 1,504.00 | 8,422,400 |
| ファンコミュニケーションズ | 13,700 | 1,259.00 | 17,248,300 |
| ジェイコムホールディングス | 1,600 | 776.00 | 1,241,600 |
| PGMホールディングス | 11,300 | 1,050.00 | 11,865,000 |
| WDBホールディングス | 1,000 | 1,628.00 | 1,628,000 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|-------------|
| ティア | 2,600 | 752.00 | 1,955,200 |
| パリュウコマース | 6,500 | 789.00 | 5,128,500 |
| J Pホールディングス | 17,500 | 413.00 | 7,227,500 |
| イーピーエス | 9,300 | 1,417.00 | 13,178,100 |
| プレステージ・インターナショナル | 5,400 | 928.00 | 5,011,200 |
| アミューズ | 2,200 | 3,130.00 | 6,886,000 |
| ドリームインキュベータ | 2,100 | 1,848.00 | 3,880,800 |
| T A C | 6,500 | 273.00 | 1,774,500 |
| ケネディクス | 112,300 | 473.00 | 53,117,900 |
| 電通 | 73,800 | 4,175.00 | 308,115,000 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 3,700 | 1,174.00 | 4,343,800 |
| ぴあ | 2,300 | 1,852.00 | 4,259,600 |
| イオンファンタジー | 2,500 | 1,449.00 | 3,622,500 |
| ネクシィーズ | 3,500 | 667.00 | 2,334,500 |
| みらかホールディングス | 20,600 | 4,535.00 | 93,421,000 |
| アルプス技研 | 3,100 | 1,241.00 | 3,847,100 |
| サニックス | 11,800 | 716.00 | 8,448,800 |
| ダイオーズ | 1,400 | 922.00 | 1,290,800 |
| 日本空調サービス | 3,800 | 828.00 | 3,146,400 |
| オリエンタルランド | 21,200 | 20,735.00 | 439,582,000 |
| ダスキン | 20,700 | 1,793.00 | 37,115,100 |
| 明光ネットワークジャパン | 7,800 | 1,204.00 | 9,391,200 |
| ファルコSDホールディングス | 4,000 | 1,216.00 | 4,864,000 |
| 秀英予備校 | 2,700 | 326.00 | 880,200 |
| 田谷 | 1,200 | 790.00 | 948,000 |
| ラウンドワン | 22,900 | 660.00 | 15,114,000 |
| リゾートトラスト | 26,500 | 2,449.00 | 64,898,500 |
| ビー・エム・エル | 5,100 | 3,460.00 | 17,646,000 |
| ワタベウェディング | 2,600 | 582.00 | 1,513,200 |
| もしもしホットライン | 14,600 | 1,040.00 | 15,184,000 |
| 早稲田アカデミー | 1,200 | 789.00 | 946,800 |
| ユー・エス・エス | 94,800 | 1,680.00 | 159,264,000 |
| 東京個別指導学院 | 4,000 | 363.00 | 1,452,000 |
| 楽天 | 339,900 | 1,263.00 | 429,293,700 |
| テー・オー・ダブリュー | 2,600 | 720.00 | 1,872,000 |
| セントラルスポーツ | 2,400 | 1,750.00 | 4,200,000 |
| フルキャストホールディングス | 8,100 | 576.00 | 4,665,600 |
| リゾートソリューション | 7,000 | 225.00 | 1,575,000 |
| リブセンス | 5,100 | 879.00 | 4,482,900 |
| ジャパンマテリアル | 900 | 4,385.00 | 3,946,500 |
| サクセスホールディングス | 900 | 1,548.00 | 1,393,200 |
| アサンテ | 1,500 | 1,326.00 | 1,989,000 |

| | | | | |
|----------------|-------------|----------|-----------------|--|
| ERIホールディングス | 1,800 | 1,118.00 | 2,012,400 | |
| リロ・ホールディング | 2,900 | 7,570.00 | 21,953,000 | |
| 東祥 | 1,700 | 2,386.00 | 4,056,200 | |
| エイチ・アイ・エス | 12,800 | 2,923.00 | 37,414,400 | |
| 共立メンテナンス | 3,900 | 4,460.00 | 17,394,000 | |
| イチネンホールディングス | 8,800 | 912.00 | 8,025,600 | |
| 建設技術研究所 | 4,800 | 1,865.00 | 8,952,000 | |
| スペース | 4,200 | 1,286.00 | 5,401,200 | |
| 燦ホールディングス | 1,600 | 1,581.00 | 2,529,600 | |
| スバル興業 | 6,000 | 431.00 | 2,586,000 | |
| 東京テアトル | 30,000 | 145.00 | 4,350,000 | |
| よみうりランド | 17,000 | 478.00 | 8,126,000 | |
| 東京都競馬 | 54,000 | 314.00 | 16,956,000 | |
| カナモト | 11,000 | 4,050.00 | 44,550,000 | |
| 東京ドーム | 59,000 | 462.00 | 27,258,000 | |
| 西尾レントオール | 6,300 | 4,235.00 | 26,680,500 | |
| トランス・コスモス | 10,200 | 2,150.00 | 21,930,000 | |
| 乃村工藝社 | 15,400 | 1,017.00 | 15,661,800 | |
| 藤田観光 | 28,000 | 370.00 | 10,360,000 | |
| KNT-CTホールディングス | 38,000 | 177.00 | 6,726,000 | |
| 日本管財 | 3,400 | 2,908.00 | 9,887,200 | |
| トーカイ | 3,500 | 3,370.00 | 11,795,000 | |
| 白洋舎 | 10,000 | 245.00 | 2,450,000 | |
| セコム | 81,400 | 6,533.00 | 531,786,200 | |
| セントラル警備保障 | 3,500 | 1,217.00 | 4,259,500 | |
| 丹青社 | 10,300 | 877.00 | 9,033,100 | |
| メイテック | 10,600 | 3,260.00 | 34,556,000 | |
| アサツー ディ・ケイ | 14,700 | 2,751.00 | 40,439,700 | |
| 応用地質 | 8,200 | 1,866.00 | 15,301,200 | |
| 船井総研ホールディングス | 8,700 | 1,012.00 | 8,804,400 | |
| 進学会 | 3,300 | 388.00 | 1,280,400 | |
| ベネッセホールディングス | 26,200 | 3,600.00 | 94,320,000 | |
| イオンディライト | 7,600 | 2,669.00 | 20,284,400 | |
| ナック | 4,000 | 1,289.00 | 5,156,000 | |
| ニチイ学館 | 17,100 | 869.00 | 14,859,900 | |
| ダイセキ | 11,600 | 2,042.00 | 23,687,200 | |
| ステップ | 2,600 | 834.00 | 2,168,400 | |
| 合 計 | 120,636,250 | | 142,227,723,360 | |

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,432,695,619 |
| 国債証券 | 222,362,104,250 |
| 地方債証券 | 17,576,896,034 |
| 特殊債券 | 23,684,741,423 |
| 社債券 | 15,715,868,890 |
| 未収入金 | 1,710,935,200 |
| 未収利息 | 443,500,017 |
| 前払費用 | 20,940,856 |
| 流動資産合計 | 284,947,682,289 |
| 資産合計 | 284,947,682,289 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 4,906,174,584 |
| 未払解約金 | 119,790,460 |
| 流動負債合計 | 5,025,965,044 |
| 負債合計 | 5,025,965,044 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 214,971,115,502 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 64,950,601,743 |
| 元本等合計 | 279,921,717,245 |
| 純資産合計 | 279,921,717,245 |
| 負債純資産合計 | 284,947,682,289 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成26年 9月30日現在 |
|--------------------|---------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 214,971,115,502口 |
| 2. 担保資産 | <p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 106,042,000円</p> |
| 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | <p>1口当たり純資産額 1.3021円 (1万口当たり純資産額) (13,021円)</p> |

(注) 担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及びそのリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p> |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|------------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成25年10月 1日 |
| 期首元本額 | 201,273,995,644円 |
| 期中追加設定元本額 | 74,494,055,892円 |
| 期中一部解約元本額 | 60,796,936,034円 |
| 期末元本額 | 214,971,115,502円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| エマージング株式オープン | 2,227,240円 |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 1,378,912,206円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 13,329,075円 |
| S M T 国内債券インデックス・オープン | 5,376,081,617円 |
| 世界経済インデックスファンド | 210,086,564円 |
| マイセレクション2 5 | 147,033,170円 |
| マイセレクション5 0 | 87,448,484円 |
| マイセレクション7 5 | 27,215,070円 |
| D Cマイセレクション2 5 | 12,375,574,823円 |
| D Cマイセレクション5 0 | 15,148,608,736円 |
| D Cマイセレクション7 5 | 4,154,385,274円 |
| D C日本債券インデックス・オープン | 406,323,860円 |
| D C日本債券インデックス・オープンS | 51,209,096,620円 |
| D C日本債券インデックス・オープンP | 18,279,387,275円 |
| D CマイセレクションS 2 5 | 4,746,890,380円 |
| D CマイセレクションS 5 0 | 5,446,026,016円 |
| D CマイセレクションS 7 5 | 1,032,039,879円 |
| D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 1 5 | 20,968,928円 |
| D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5 | 1,049,402,715円 |
| D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5 | 552,145,164円 |
| D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5 | 134,284,700円 |
| D C世界経済インデックスファンド | 227,115,769円 |
| 日本債券インデックス・オープン（SMA専用） | 1,090,983,330円 |
| 国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 29,707,641円 |
| マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 239,504,298円 |
| マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用） | 34,574,798円 |
| 国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 6,456,575円 |
| バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 1,130,942,131円 |
| バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 1,585,511,343円 |
| バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用） | 3,074,144,244円 |
| バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 442,854,868円 |

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|------------------------------|-----------------|
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 16,210,495,053円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 1,741,164,835円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 6,209,027,464円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 1,987,202,408円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 3,492,620,218円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 2,406,503,236円 |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用） | 2,227,069,978円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 2,540,370,917円 |
| バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用） | 3,633,477,706円 |
| 国内バランス25VA1（適格機関投資家専用） | 261,980,968円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 4,100,150,415円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ1 | 9,143,092,040円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 4,330,012,134円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,983,324,108円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 964,717,832円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 331,168,441円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 2,758,608円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 59,417,751円 |
| 国内債券SMTBセレクション（SMA専用） | 22,349,243,449円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 312,500,455円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 13,150,773円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 12,403,920円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成26年 9月30日現在 |
|-------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 1,032,231,650 |
| 地方債証券 | 39,788,099 |
| 特殊債券 | 59,086,925 |
| 社債券 | 9,441,360 |
| 合計 | 1,140,548,034 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|---------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第334回利付国債(2年) | 910,000,000 | 910,455,000 | |
| | 第335回利付国債(2年) | 1,190,000,000 | 1,190,571,200 | |
| | 第336回利付国債(2年) | 830,000,000 | 830,423,300 | |
| | 第337回利付国債(2年) | 1,050,000,000 | 1,050,493,500 | |
| | 第338回利付国債(2年) | 1,100,000,000 | 1,100,473,000 | |
| | 第339回利付国債(2年) | 680,000,000 | 680,306,000 | |
| | 第340回利付国債(2年) | 640,000,000 | 640,307,200 | |
| | 第341回利付国債(2年) | 630,000,000 | 630,315,000 | |
| | 第342回利付国債(2年) | 1,170,000,000 | 1,170,620,100 | |
| | 第343回利付国債(2年) | 1,200,000,000 | 1,200,552,000 | |
| | 第344回利付国債(2年) | 1,560,000,000 | 1,560,748,800 | |
| | 第93回利付国債(5年) | 1,820,000,000 | 1,829,609,600 | |
| | 第94回利付国債(5年) | 1,310,000,000 | 1,318,515,000 | |
| | 第95回利付国債(5年) | 840,000,000 | 846,501,600 | |
| | 第96回利付国債(5年) | 1,770,000,000 | 1,781,115,600 | |
| | 第97回利付国債(5年) | 2,700,000,000 | 2,715,255,000 | |
| | 第98回利付国債(5年) | 630,000,000 | 632,475,900 | |
| | 第99回利付国債(5年) | 2,600,000,000 | 2,616,588,000 | |
| | 第100回利付国債(5年) | 490,000,000 | 492,160,900 | |
| | 第101回利付国債(5年) | 950,000,000 | 956,726,000 | |
| | 第102回利付国債(5年) | 2,280,000,000 | 2,291,080,800 | |
| | 第103回利付国債(5年) | 2,500,000,000 | 2,513,500,000 | |
| | 第104回利付国債(5年) | 610,000,000 | 611,793,400 | |
| | 第105回利付国債(5年) | 3,500,000,000 | 3,510,885,000 | |
| | 第106回利付国債(5年) | 2,480,000,000 | 2,488,060,000 | |
| | 第107回利付国債(5年) | 1,120,000,000 | 1,123,584,000 | |
| | 第108回利付国債(5年) | 790,000,000 | 790,000,000 | |
| | 第109回利付国債(5年) | 990,000,000 | 989,821,800 | |
| | 第110回利付国債(5年) | 900,000,000 | 906,048,000 | |
| | 第111回利付国債(5年) | 1,590,000,000 | 1,606,170,300 | |
| 第112回利付国債(5年) | 740,000,000 | 747,932,800 | | |
| 第113回利付国債(5年) | 4,150,000,000 | 4,179,133,000 | | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第114回利付国債(5年) | 1,110,000,000 | 1,117,881,000 | |
| 第115回利付国債(5年) | 1,960,000,000 | 1,966,174,000 | |
| 第116回利付国債(5年) | 3,120,000,000 | 3,129,141,600 | |
| 第117回利付国債(5年) | 3,670,000,000 | 3,678,918,100 | |
| 第118回利付国債(5年) | 3,810,000,000 | 3,818,001,000 | |
| 第119回利付国債(5年) | 400,000,000 | 398,968,000 | |
| 第120回利付国債(5年) | 1,590,000,000 | 1,592,734,800 | |
| 第1回利付国債(40年) | 150,000,000 | 177,897,000 | |
| 第2回利付国債(40年) | 300,000,000 | 340,362,000 | |
| 第3回利付国債(40年) | 340,000,000 | 385,716,400 | |
| 第4回利付国債(40年) | 530,000,000 | 601,152,500 | |
| 第5回利付国債(40年) | 490,000,000 | 528,479,700 | |
| 第6回利付国債(40年) | 690,000,000 | 723,775,500 | |
| 第7回利付国債(40年) | 500,000,000 | 494,740,000 | |
| 第274回利付国債(10年) | 730,000,000 | 742,731,200 | |
| 第275回利付国債(10年) | 280,000,000 | 284,541,600 | |
| 第276回利付国債(10年) | 480,000,000 | 488,952,000 | |
| 第277回利付国債(10年) | 410,000,000 | 419,167,600 | |
| 第278回利付国債(10年) | 720,000,000 | 738,201,600 | |
| 第279回利付国債(10年) | 440,000,000 | 452,408,000 | |
| 第280回利付国債(10年) | 600,000,000 | 618,804,000 | |
| 第281回利付国債(10年) | 700,000,000 | 723,142,000 | |
| 第282回利付国債(10年) | 1,260,000,000 | 1,300,345,200 | |
| 第283回利付国債(10年) | 280,000,000 | 289,486,400 | |
| 第284回利付国債(10年) | 1,210,000,000 | 1,253,366,400 | |
| 第285回利付国債(10年) | 1,990,000,000 | 2,069,241,800 | |
| 第286回利付国債(10年) | 870,000,000 | 910,411,500 | |
| 第287回利付国債(10年) | 540,000,000 | 566,546,400 | |
| 第288回利付国債(10年) | 2,090,000,000 | 2,189,881,100 | |
| 第289回利付国債(10年) | 2,430,000,000 | 2,539,884,600 | |
| 第290回利付国債(10年) | 470,000,000 | 491,084,200 | |
| 第291回利付国債(10年) | 840,000,000 | 874,784,400 | |
| 第292回利付国債(10年) | 860,000,000 | 907,635,400 | |
| 第293回利付国債(10年) | 370,000,000 | 393,206,400 | |
| 第294回利付国債(10年) | 180,000,000 | 190,623,600 | |
| 第295回利付国債(10年) | 100,000,000 | 105,162,000 | |
| 第296回利付国債(10年) | 2,100,000,000 | 2,214,849,000 | |
| 第297回利付国債(10年) | 560,000,000 | 589,820,000 | |
| 第298回利付国債(10年) | 1,660,000,000 | 1,741,439,600 | |
| 第299回利付国債(10年) | 1,310,000,000 | 1,377,085,100 | |
| 第300回利付国債(10年) | 830,000,000 | 879,866,400 | |
| 第301回利付国債(10年) | 1,240,000,000 | 1,318,368,000 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|------------------------|
| 第302回利付国債(10年) | 200,000,000 | 211,704,000 | |
| 第303回利付国債(10年) | 1,390,000,000 | 1,474,929,000 | |
| 第304回利付国債(10年) | 480,000,000 | 506,961,600 | |
| 第305回利付国債(10年) | 2,160,000,000 | 2,286,187,200 | |
| 第306回利付国債(10年) | 1,170,000,000 | 1,247,208,300 | |
| 第307回利付国債(10年) | 700,000,000 | 742,406,000 | |
| 第308回利付国債(10年) | 990,000,000 | 1,052,122,500 | |
| 第309回利付国債(10年) | 1,780,000,000 | 1,871,563,200 | |
| 第310回利付国債(10年) | 1,590,000,000 | 1,664,507,400 | |
| 第311回利付国債(10年) | 610,000,000 | 631,392,700 | |
| 第312回利付国債(10年) | 1,470,000,000 | 1,558,817,400 | 代用有価証券 100,000,000円 |
| 第313回利付国債(10年) | 1,310,000,000 | 1,399,263,400 | |
| 第314回利付国債(10年) | 580,000,000 | 612,132,000 | |
| 第315回利付国債(10年) | 1,300,000,000 | 1,382,017,000 | |
| 第316回利付国債(10年) | 720,000,000 | 760,665,600 | |
| 第317回利付国債(10年) | 480,000,000 | 507,590,400 | |
| 第318回利付国債(10年) | 1,810,000,000 | 1,901,640,300 | |
| 第319回利付国債(10年) | 1,150,000,000 | 1,216,263,000 | |
| 第320回利付国債(10年) | 1,720,000,000 | 1,806,946,000 | |
| 第321回利付国債(10年) | 1,930,000,000 | 2,027,136,900 | |
| 第322回利付国債(10年) | 1,030,000,000 | 1,074,320,900 | |
| 第323回利付国債(10年) | 1,260,000,000 | 1,313,537,400 | |
| 第324回利付国債(10年) | 1,420,000,000 | 1,469,657,400 | |
| 第325回利付国債(10年) | 2,910,000,000 | 3,010,307,700 | |
| 第326回利付国債(10年) | 300,000,000 | 307,770,000 | |
| 第327回利付国債(10年) | 1,540,000,000 | 1,592,159,800 | |
| 第328回利付国債(10年) | 2,210,000,000 | 2,247,083,800 | |
| 第329回利付国債(10年) | 2,040,000,000 | 2,106,932,400 | |
| 第330回利付国債(10年) | 2,240,000,000 | 2,311,545,600 | |
| 第331回利付国債(10年) | 650,000,000 | 659,256,000 | |
| 第332回利付国債(10年) | 3,000,000,000 | 3,038,460,000 | |
| 第333回利付国債(10年) | 2,750,000,000 | 2,781,102,500 | |
| 第334回利付国債(10年) | 2,950,000,000 | 2,978,703,500 | |
| 第335回利付国債(10年) | 660,000,000 | 658,746,000 | |
| 第1回利付国債(30年) | 40,000,000 | 50,457,200 | |
| 第2回利付国債(30年) | 160,000,000 | 192,956,800 | |
| 第3回利付国債(30年) | 120,000,000 | 142,824,000 | |
| 第4回利付国債(30年) | 110,000,000 | 140,597,600 | |
| 第5回利付国債(30年) | 50,000,000 | 58,597,000 | |
| 第6回利付国債(30年) | 190,000,000 | 228,076,000 | |
| 第7回利付国債(30年) | 180,000,000 | 212,837,400 | |

| | | | |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| 第 8 回利付国債(30年) | 50,000,000 | 54,919,000 | |
| 第 9 回利付国債(30年) | 240,000,000 | 247,543,200 | |
| 第 10 回利付国債(30年) | 160,000,000 | 156,633,600 | |
| 第 11 回利付国債(30年) | 90,000,000 | 96,729,300 | |
| 第 12 回利付国債(30年) | 190,000,000 | 216,753,900 | |
| 第 13 回利付国債(30年) | 290,000,000 | 324,956,600 | |
| 第 14 回利付国債(30年) | 300,000,000 | 355,956,000 | |
| 第 15 回利付国債(30年) | 340,000,000 | 408,836,400 | |
| 第 16 回利付国債(30年) | 370,000,000 | 444,610,500 | |
| 第 17 回利付国債(30年) | 370,000,000 | 437,957,900 | |
| 第 18 回利付国債(30年) | 445,000,000 | 518,603,000 | |
| 第 19 回利付国債(30年) | 160,000,000 | 186,264,000 | |
| 第 20 回利付国債(30年) | 230,000,000 | 275,928,700 | |
| 第 21 回利付国債(30年) | 280,000,000 | 325,480,400 | |
| 第 22 回利付国債(30年) | 400,000,000 | 479,740,000 | |
| 第 23 回利付国債(30年) | 350,000,000 | 419,702,500 | |
| 第 24 回利付国債(30年) | 330,000,000 | 395,637,000 | |
| 第 25 回利付国債(30年) | 320,000,000 | 371,318,400 | |
| 第 26 回利付国債(30年) | 580,000,000 | 684,376,800 | |
| 第 27 回利付国債(30年) | 710,000,000 | 851,645,000 | |
| 第 28 回利付国債(30年) | 510,000,000 | 612,321,300 | |
| 第 29 回利付国債(30年) | 840,000,000 | 992,518,800 | |
| 第 30 回利付国債(30年) | 600,000,000 | 697,128,000 | |
| 第 31 回利付国債(30年) | 760,000,000 | 866,863,600 | |
| 第 32 回利付国債(30年) | 810,000,000 | 941,535,900 | |
| 第 33 回利付国債(30年) | 880,000,000 | 966,741,600 | |
| 第 34 回利付国債(30年) | 1,100,000,000 | 1,255,375,000 | |
| 第 35 回利付国債(30年) | 1,070,000,000 | 1,173,843,500 | |
| 第 36 回利付国債(30年) | 1,060,000,000 | 1,161,950,800 | |
| 第 37 回利付国債(30年) | 1,020,000,000 | 1,093,909,200 | |
| 第 38 回利付国債(30年) | 540,000,000 | 566,098,200 | |
| 第 39 回利付国債(30年) | 640,000,000 | 685,190,400 | |
| 第 40 回利付国債(30年) | 720,000,000 | 753,717,600 | |
| 第 41 回利付国債(30年) | 580,000,000 | 593,316,800 | |
| 第 42 回利付国債(30年) | 590,000,000 | 602,413,600 | |
| 第 43 回利付国債(30年) | 890,000,000 | 907,915,700 | |
| 第 44 回利付国債(30年) | 240,000,000 | 244,612,800 | |
| 第 31 回利付国債(20年) | 80,000,000 | 84,017,600 | |
| 第 32 回利付国債(20年) | 50,000,000 | 52,657,500 | |
| 第 33 回利付国債(20年) | 140,000,000 | 150,242,400 | |
| 第 34 回利付国債(20年) | 50,000,000 | 54,210,000 | |
| 第 35 回利付国債(20年) | 10,000,000 | 10,792,800 | |

| | | | |
|---------------|-------------|-------------|--|
| 第36回利付国債(20年) | 70,000,000 | 76,038,900 | |
| 第37回利付国債(20年) | 70,000,000 | 76,246,100 | |
| 第38回利付国債(20年) | 20,000,000 | 21,798,200 | |
| 第39回利付国債(20年) | 500,000,000 | 543,230,000 | |
| 第40回利付国債(20年) | 100,000,000 | 108,628,000 | |
| 第41回利付国債(20年) | 330,000,000 | 349,826,400 | |
| 第42回利付国債(20年) | 80,000,000 | 88,728,000 | |
| 第43回利付国債(20年) | 140,000,000 | 158,942,000 | |
| 第44回利付国債(20年) | 170,000,000 | 191,387,700 | |
| 第45回利付国債(20年) | 290,000,000 | 324,916,000 | |
| 第46回利付国債(20年) | 170,000,000 | 189,390,200 | |
| 第47回利付国債(20年) | 90,000,000 | 100,618,200 | |
| 第48回利付国債(20年) | 130,000,000 | 148,366,400 | |
| 第49回利付国債(20年) | 140,000,000 | 156,786,000 | |
| 第50回利付国債(20年) | 220,000,000 | 243,570,800 | |
| 第51回利付国債(20年) | 100,000,000 | 111,672,000 | |
| 第52回利付国債(20年) | 110,000,000 | 123,855,600 | |
| 第53回利付国債(20年) | 80,000,000 | 90,330,400 | |
| 第54回利付国債(20年) | 200,000,000 | 227,242,000 | |
| 第55回利付国債(20年) | 140,000,000 | 157,378,200 | |
| 第56回利付国債(20年) | 150,000,000 | 168,973,500 | |
| 第57回利付国債(20年) | 240,000,000 | 268,550,400 | |
| 第58回利付国債(20年) | 300,000,000 | 336,300,000 | |
| 第59回利付国債(20年) | 200,000,000 | 221,386,000 | |
| 第60回利付国債(20年) | 350,000,000 | 378,896,000 | |
| 第61回利付国債(20年) | 240,000,000 | 251,992,800 | |
| 第62回利付国債(20年) | 320,000,000 | 330,499,200 | |
| 第63回利付国債(20年) | 200,000,000 | 223,674,000 | |
| 第64回利付国債(20年) | 320,000,000 | 361,238,400 | |
| 第65回利付国債(20年) | 220,000,000 | 248,668,200 | |
| 第66回利付国債(20年) | 330,000,000 | 369,913,500 | |
| 第67回利付国債(20年) | 130,000,000 | 147,041,700 | |
| 第68回利付国債(20年) | 190,000,000 | 220,177,700 | |
| 第69回利付国債(20年) | 390,000,000 | 448,406,400 | |
| 第70回利付国債(20年) | 400,000,000 | 472,160,000 | |
| 第71回利付国債(20年) | 200,000,000 | 232,254,000 | |
| 第72回利付国債(20年) | 630,000,000 | 726,730,200 | |
| 第73回利付国債(20年) | 360,000,000 | 412,286,400 | |
| 第74回利付国債(20年) | 200,000,000 | 230,990,000 | |
| 第75回利付国債(20年) | 130,000,000 | 150,307,300 | |
| 第76回利付国債(20年) | 170,000,000 | 193,087,700 | |
| 第77回利付国債(20年) | 290,000,000 | 332,424,100 | |

| | | | |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第78回利付国債(20年) | 170,000,000 | 193,222,000 | |
| 第79回利付国債(20年) | 270,000,000 | 309,771,000 | |
| 第80回利付国債(20年) | 220,000,000 | 254,632,400 | |
| 第81回利付国債(20年) | 390,000,000 | 447,794,100 | |
| 第82回利付国債(20年) | 400,000,000 | 463,408,000 | |
| 第83回利付国債(20年) | 290,000,000 | 336,420,300 | |
| 第84回利付国債(20年) | 670,000,000 | 769,783,100 | |
| 第85回利付国債(20年) | 290,000,000 | 336,655,200 | |
| 第86回利付国債(20年) | 210,000,000 | 248,421,600 | |
| 第87回利付国債(20年) | 410,000,000 | 480,614,300 | |
| 第88回利付国債(20年) | 550,000,000 | 651,271,500 | |
| 第89回利付国債(20年) | 330,000,000 | 387,156,000 | |
| 第90回利付国債(20年) | 580,000,000 | 680,949,000 | |
| 第91回利付国債(20年) | 320,000,000 | 379,257,600 | |
| 第92回利付国債(20年) | 980,000,000 | 1,140,171,200 | |
| 第93回利付国債(20年) | 370,000,000 | 426,110,500 | |
| 第94回利付国債(20年) | 550,000,000 | 640,464,000 | |
| 第95回利付国債(20年) | 630,000,000 | 749,000,700 | |
| 第96回利付国債(20年) | 420,000,000 | 488,938,800 | |
| 第97回利付国債(20年) | 640,000,000 | 753,228,800 | |
| 第98回利付国債(20年) | 320,000,000 | 372,812,800 | |
| 第99回利付国債(20年) | 900,000,000 | 1,048,617,000 | |
| 第100回利付国債(20年) | 550,000,000 | 647,520,500 | |
| 第101回利付国債(20年) | 325,000,000 | 391,049,750 | |
| 第102回利付国債(20年) | 500,000,000 | 601,845,000 | |
| 第103回利付国債(20年) | 270,000,000 | 321,642,900 | |
| 第104回利付国債(20年) | 360,000,000 | 419,392,800 | |
| 第105回利付国債(20年) | 700,000,000 | 815,346,000 | |
| 第106回利付国債(20年) | 330,000,000 | 388,773,000 | |
| 第107回利付国債(20年) | 370,000,000 | 430,846,500 | |
| 第108回利付国債(20年) | 680,000,000 | 773,500,000 | |
| 第109回利付国債(20年) | 230,000,000 | 261,441,000 | |
| 第110回利付国債(20年) | 850,000,000 | 989,391,500 | |
| 第111回利付国債(20年) | 300,000,000 | 353,199,000 | |
| 第112回利付国債(20年) | 620,000,000 | 721,357,600 | |
| 第113回利付国債(20年) | 1,100,000,000 | 1,279,168,000 | |
| 第114回利付国債(20年) | 490,000,000 | 569,453,500 | |
| 第115回利付国債(20年) | 670,000,000 | 788,147,800 | |
| 第116回利付国債(20年) | 490,000,000 | 576,073,400 | |
| 第117回利付国債(20年) | 910,000,000 | 1,056,792,100 | |
| 第118回利付国債(20年) | 850,000,000 | 974,032,000 | |
| 第119回利付国債(20年) | 380,000,000 | 424,452,400 | |

| | | | |
|-------|------------------|-----------------|-----------------|
| | 第120回利付国債（20年） | 300,000,000 | 326,217,000 |
| | 第121回利付国債（20年） | 940,000,000 | 1,062,331,600 |
| | 第122回利付国債（20年） | 280,000,000 | 312,345,600 |
| | 第123回利付国債（20年） | 700,000,000 | 810,831,000 |
| | 第124回利付国債（20年） | 400,000,000 | 457,408,000 |
| | 第125回利付国債（20年） | 430,000,000 | 504,364,200 |
| | 第126回利付国債（20年） | 390,000,000 | 445,442,400 |
| | 第127回利付国債（20年） | 460,000,000 | 518,521,200 |
| | 第128回利付国債（20年） | 560,000,000 | 630,369,600 |
| | 第129回利付国債（20年） | 620,000,000 | 688,076,000 |
| | 第130回利付国債（20年） | 440,000,000 | 487,524,400 |
| | 第131回利付国債（20年） | 580,000,000 | 633,835,600 |
| | 第132回利付国債（20年） | 530,000,000 | 577,700,000 |
| | 第133回利付国債（20年） | 660,000,000 | 730,039,200 |
| | 第134回利付国債（20年） | 420,000,000 | 463,747,200 |
| | 第135回利付国債（20年） | 380,000,000 | 413,398,200 |
| | 第136回利付国債（20年） | 530,000,000 | 568,398,500 |
| | 第137回利付国債（20年） | 290,000,000 | 314,861,700 |
| | 第138回利付国債（20年） | 630,000,000 | 663,912,900 |
| | 第139回利付国債（20年） | 470,000,000 | 502,603,900 |
| | 第140回利付国債（20年） | 1,170,000,000 | 1,266,759,000 |
| | 第141回利付国債（20年） | 310,000,000 | 334,920,900 |
| | 第142回利付国債（20年） | 780,000,000 | 855,714,600 |
| | 第143回利付国債（20年） | 1,050,000,000 | 1,114,312,500 |
| | 第144回利付国債（20年） | 440,000,000 | 459,949,600 |
| | 第145回利付国債（20年） | 1,480,000,000 | 1,590,659,600 |
| | 第146回利付国債（20年） | 1,340,000,000 | 1,436,855,200 |
| | 第147回利付国債（20年） | 1,470,000,000 | 1,547,322,000 |
| | 第148回利付国債（20年） | 1,180,000,000 | 1,217,594,800 |
| | 第149回利付国債（20年） | 1,300,000,000 | 1,337,648,000 |
| | 第150回利付国債（20年） | 530,000,000 | 534,584,500 |
| | 第18回メキシコ合衆国円貨債券 | 100,000,000 | 99,937,000 |
| | 第14回ポーランド共和国円貨債券 | 200,000,000 | 201,338,000 |
| | 国債証券合計 | 210,020,000,000 | 222,362,104,250 |
| 地方債証券 | 第3回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 116,064,000 |
| | 第6回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 113,901,000 |
| | 第9回東京都公募公債（30年） | 100,000,000 | 113,845,000 |
| | 第11回東京都公募公債（30年） | 100,000,000 | 109,906,000 |
| | 第17回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,295,000 |
| | 第19回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,763,000 |
| | 第23回東京都公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,070,000 |
| | 第27回東京都公募公債（20年） | 200,000,000 | 213,238,000 |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第 6 3 3 回東京都公募公債 | 129,000,000 | 132,532,020 | |
| 第 6 3 9 回東京都公募公債 | 50,000,000 | 51,702,500 | |
| 第 6 4 9 回東京都公募公債 | 102,000,000 | 106,896,000 | |
| 第 6 5 0 回東京都公募公債 | 140,000,000 | 147,217,000 | |
| 第 6 7 4 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 105,860,000 | |
| 第 6 9 5 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 106,013,000 | |
| 第 6 9 6 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 106,070,000 | |
| 第 7 1 6 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 102,863,000 | |
| 第 7 1 7 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,634,000 | |
| 第 7 2 0 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 103,567,000 | |
| 第 7 2 8 回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,411,000 | |
| 平成 1 8 年度第 1 回北海道公募公債 | 100,000,000 | 102,593,000 | |
| 平成 1 8 年度第 1 0 回北海道公募公債 | 100,000,000 | 103,913,000 | |
| 平成 1 9 年度第 9 回北海道公募公債 | 110,000,000 | 115,319,600 | |
| 平成 2 0 年度第 1 4 回北海道公募公債 | 100,000,000 | 106,663,000 | |
| 平成 2 2 年度第 1 1 回北海道公募公債 | 100,000,000 | 106,496,000 | |
| 平成 2 4 年度第 1 4 回北海道公募公債 | 100,000,000 | 102,712,000 | |
| 第 4 回神奈川県公募公債（ 3 0 年 ） | 100,000,000 | 118,616,000 | |
| 第 1 6 回神奈川県公募公債（ 2 0 年 ） | 100,000,000 | 114,408,000 | |
| 第 1 4 4 回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 103,823,000 | |
| 第 1 5 0 回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 104,974,000 | |
| 第 1 6 7 回神奈川県公募公債 | 140,000,000 | 149,133,600 | |
| 第 1 7 2 回神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 212,160,000 | |
| 第 7 回大阪府公募公債（ 2 0 年 ） | 200,000,000 | 218,834,000 | |
| 第 7 2 回大阪府公募公債（ 5 年 ） | 100,000,000 | 100,729,000 | |
| 第 2 9 0 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 103,086,000 | |
| 第 2 9 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 103,239,000 | |
| 第 3 0 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 105,152,000 | |
| 第 3 1 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 105,130,000 | |
| 第 3 4 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 105,940,000 | |
| 第 3 4 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 106,929,000 | |
| 第 3 6 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 103,866,000 | |
| 第 3 7 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 100,864,000 | |
| 第 3 7 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ） | 100,000,000 | 102,858,000 | |
| 平成 1 8 年度第 1 回京都府公募公債 | 100,000,000 | 103,532,000 | |
| 平成 2 2 年度第 2 回京都府公募公債 | 100,000,000 | 105,426,000 | |
| 平成 2 3 年度第 5 回京都府公募公債（ 2 0 年 ） | 100,000,000 | 109,355,000 | |
| 平成 2 5 年度第 7 回京都府公募公債 | 100,000,000 | 102,751,000 | |
| 第 3 回兵庫県公募公債（ 1 2 年 ） | 100,000,000 | 99,207,000 | |
| 平成 1 7 年度第 1 3 回兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 204,612,000 | |
| 平成 1 9 年度第 9 回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 105,129,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 平成22年度第1回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 106,614,000 | |
| 平成25年度第4回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 102,808,000 | |
| 平成19年度第2回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,962,000 | |
| 平成20年度第4回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 105,850,000 | |
| 平成21年度第10回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 106,397,000 | |
| 平成23年度第3回静岡県公募公債 | 103,290,000 | 109,519,419 | |
| 平成23年度第8回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 104,992,000 | |
| 平成24年度第10回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 101,985,000 | |
| 平成20年度第6回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 106,429,000 | |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年） | 100,000,000 | 117,633,000 | |
| 平成21年度第8回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 105,913,000 | |
| 平成22年度第3回愛知県公募公債（10年） | 200,000,000 | 212,724,000 | |
| 平成23年度第1回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 107,208,000 | |
| 平成23年度第3回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 106,126,000 | |
| 平成24年度第19回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 101,628,000 | |
| 平成26年度第3回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 101,323,000 | |
| 平成20年度第1回広島県公募公債（20年） | 100,000,000 | 118,466,000 | |
| 平成22年度第1回広島県公募公債 | 100,000,000 | 106,333,000 | |
| 平成24年度第4回広島県公募公債 | 100,000,000 | 103,077,000 | |
| 平成18年度第2回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 103,155,000 | |
| 平成22年度第10回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 106,260,000 | |
| 平成22年度第11回埼玉県公募公債 | 193,000,000 | 205,406,040 | |
| 平成24年度第1回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 105,162,000 | |
| 平成24年度第9回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 103,373,000 | |
| 平成25年度第11回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 101,266,000 | |
| 平成21年度第3回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 106,585,000 | |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債（20年） | 100,000,000 | 113,012,000 | |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債 | 200,000,000 | 211,912,000 | |
| 平成24年度第1回福岡県公募公債（30年） | 100,000,000 | 108,054,000 | |
| 第13回千葉県公募公債（20年） | 100,000,000 | 106,954,000 | |
| 平成21年度第2回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 106,398,000 | |
| 平成21年度第9回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 105,671,000 | |
| 平成21年度第12回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 106,545,000 | |
| 平成22年度第8回千葉県公募公債 | 120,000,000 | 125,452,800 | |
| 平成25年度第5回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 103,205,000 | |
| 平成17年度第2回新潟県公募公債 | 100,000,000 | 101,718,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 平成22年度第1回長野県公募公債 | 100,000,000 | 100,450,000 | |
| 第35回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,105,000 | |
| 第38回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,128,000 | |
| 第40回共同発行市場公募地方債 | 120,000,000 | 124,351,200 | |
| 第46回共同発行市場公募地方債 | 136,500,000 | 141,838,515 | |
| 第52回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,011,000 | |
| 第55回共同発行市場公募地方債 | 158,400,000 | 166,777,776 | |
| 第56回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,022,000 | |
| 第62回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,825,000 | |
| 第67回共同発行市場公募地方債 | 165,700,000 | 174,709,109 | |
| 第75回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,829,000 | |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 110,000,000 | 117,202,800 | |
| 第78回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,898,000 | |
| 第85回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,705,000 | |
| 第87回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,028,000 | |
| 第89回共同発行市場公募地方債 | 150,300,000 | 157,341,555 | |
| 第91回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,912,000 | |
| 第93回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,139,000 | |
| 第94回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,127,000 | |
| 第95回共同発行市場公募地方債 | 250,000,000 | 266,070,000 | |
| 第97回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 214,386,000 | |
| 第98回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,946,000 | |
| 第102回共同発行市場公募地方債 | 150,000,000 | 157,515,000 | |
| 第108回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,850,000 | |
| 第109回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 105,160,000 | |
| 第110回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,945,000 | |
| 第112回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,531,000 | |
| 第117回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,385,000 | |
| 第119回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 206,000,000 | |
| 第125回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,034,000 | |
| 第127回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,693,000 | |
| 第128回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,488,000 | |
| 第130回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,315,000 | |
| 第132回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 303,930,000 | |
| 平成24年度第2回熊本県公募公債（10年） | 200,000,000 | 206,012,000 | |
| 平成17年度第1回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 101,716,000 | |
| 平成22年度第1回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 104,529,000 | |
| 平成17年度第10回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 101,803,000 | |
| 平成19年度第7回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 104,926,000 | |
| 平成22年度第5回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 105,489,000 | |
| 第5回名古屋市長官公債（30年） | 100,000,000 | 116,267,000 | |

| | | | | |
|------|--------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第9回名古屋市公募公債（20年） | 100,000,000 | 114,897,000 | |
| | 第12回す号名古屋市公募公債 | 100,000,000 | 102,313,000 | |
| | 第481回名古屋市公募公債（10年） | 100,000,000 | 102,534,000 | |
| | 平成22年度第2回京都市公募公債 | 102,000,000 | 107,105,100 | |
| | 平成24年度第4回京都市公募公債 | 100,000,000 | 103,009,000 | |
| | 平成24年度第5回京都市公募公債 | 100,000,000 | 103,370,000 | |
| | 平成17年度第13回神戸市公募公債 | 100,000,000 | 102,054,000 | |
| | 第5回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,579,000 | |
| | 第20回横浜市公募公債（20年） | 100,000,000 | 115,069,000 | |
| | 平成21年度第1回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 212,888,000 | |
| | 平成21年度第5回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 106,896,000 | |
| | 平成23年度第5回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 104,835,000 | |
| | 平成17年度第6回札幌市公募公債 | 100,000,000 | 101,716,000 | |
| | 平成24年度第10回札幌市公募公債（10年） | 100,000,000 | 103,019,000 | |
| | 第11回川崎市公募公債（20年） | 100,000,000 | 110,698,000 | |
| | 第81回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 106,161,000 | |
| | 第82回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 106,497,000 | |
| | 平成23年度第1回北九州市公募公債（5年） | 100,000,000 | 100,467,000 | |
| | 平成22年度第6回広島市公募公債 | 100,000,000 | 105,984,000 | |
| | 平成23年度第2回千葉市公募公債 | 100,000,000 | 105,106,000 | |
| | 平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年） | 100,000,000 | 103,702,000 | |
| | 第113回福岡北九州高速道路債券 | 100,000,000 | 118,193,000 | |
| | 地方債証券合計 | 16,630,190,000 | 17,576,896,034 | |
| 特殊債券 | 第42回韓国産業銀行円貨債券 | 100,000,000 | 100,415,000 | |
| | 第11回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 106,444,000 | |
| | 第13回政府保証日本政策投資銀行債券 | 106,000,000 | 109,831,900 | |
| | 第14回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 112,395,000 | |
| | 第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,660,000 | |
| | 第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 101,983,000 | |
| | 第22回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 114,873,000 | |
| | 第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,740,000 | |
| | 第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 102,123,000 | |
| | 第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 110,373,000 | |
| | 第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 102,230,000 | |
| | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 118,384,000 | |
| | 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 220,922,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第14回道路債券 | 100,000,000 | 111,311,000 | |
| 第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,646,000 | |
| 第21回道路債券 | 100,000,000 | 122,292,000 | |
| 第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,570,000 | |
| 第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,961,000 | |
| 第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 208,408,000 | |
| 第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 118,310,000 | |
| 第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 315,000,000 | 330,293,250 | |
| 第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 117,325,000 | |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 118,778,000 | |
| 第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,523,000 | |
| 第42回道路債券 | 100,000,000 | 115,394,000 | |
| 第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,001,000 | |
| 第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,855,000 | |
| 第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,345,000 | |
| 第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,455,000 | |
| 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 118,593,000 | |
| 第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,522,000 | |
| 第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,549,000 | |
| 第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 30,000,000 | 31,326,300 | |
| 第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 111,000,000 | 115,998,330 | |
| 第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,224,000 | |
| 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 181,000,000 | 191,800,270 | |
| 第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,458,000 | |
| 第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,741,000 | |
| 第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 114,061,000 | |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 230,946,000 | |
| | 100,000,000 | 107,200,000 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | | |
| 第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 317,340,000 | |
| 第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,705,000 | |
| 第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 138,000,000 | 146,371,080 | |
| 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 112,451,000 | |
| 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,129,000 | |
| 第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,464,000 | |
| 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 208,988,000 | |
| 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 207,958,000 | |
| 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 211,680,000 | |
| 第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 114,967,000 | |
| 第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,921,000 | |
| 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,731,000 | |
| 第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,489,000 | |
| 第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,547,000 | |
| 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,083,000 | |
| 第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 208,148,000 | |
| 第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,993,000 | |
| 第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,236,000 | |
| 第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 307,749,000 | |
| 第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,486,000 | |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,376,000 | |
| 第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 309,627,000 | |
| 第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 203,968,000 | |
| 第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,876,000 | |
| 第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 304,131,000 | |
| | 200,000,000 | 204,332,000 | |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | | |
| 第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 202,000,000 | 213,814,980 | |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,181,000 | |
| 第1回地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 106,292,000 | |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,783,000 | |
| 第2回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 108,014,000 | |
| 第3回政府保証公営企業債券（15年） | 300,000,000 | 337,875,000 | |
| 第3回公営企業債券（20年） | 10,000,000 | 10,460,600 | |
| 第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 104,942,000 | |
| 第6回地方公共団体金融機構債券（5年） | 100,000,000 | 100,546,000 | |
| 第7回公営企業債券（20年） | 100,000,000 | 115,065,000 | |
| 第7回公営企業債券（30年） | 100,000,000 | 119,820,000 | |
| 第7回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 115,625,000 | |
| 第8回公営企業債券（20年） | 40,000,000 | 46,206,400 | |
| 第8回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,353,000 | |
| 第10回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,354,000 | |
| 第11回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 213,300,000 | |
| 第15回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 209,512,000 | |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 101,000,000 | 104,995,560 | |
| 第19回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 105,836,000 | |
| 第22回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 101,000,000 | 107,696,300 | |
| 第23回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 101,000,000 | 107,758,920 | |
| 第23回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 107,211,000 | |
| 第24回地方公共団体金融機構債券（20年） | 100,000,000 | 106,327,000 | |
| 第28回公営企業債券 | 100,000,000 | 105,298,000 | |
| 第30回公営企業債券 | 100,000,000 | 106,655,000 | |
| 第32回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 104,111,000 | |
| 第42回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,803,000 | |
| 第47回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,874,000 | |
| 第48回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,371,000 | |
| 第51回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 103,240,000 | |
| 第859回政府保証公営企業債券 | 131,000,000 | 133,435,290 | |
| 第862回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,636,000 | |
| 第867回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 103,351,000 | |
| 第871回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 103,935,000 | |
| 第872回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 208,086,000 | |
| 第874回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 104,044,000 | |
| 第875回政府保証公営企業債券 | 212,000,000 | 220,876,440 | |
| 第876回政府保証公営企業債券 | 122,000,000 | 127,906,020 | |
| 第3回政府保証首都高速道路株式会社債券 | 103,000,000 | 107,075,710 | |
| 第5回政府保証首都高速道路株式会社債券 | 80,000,000 | 83,530,400 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第5回政府保証日本政策金融公庫債券 | 101,000,000 | 106,538,840 | |
| 第18回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 114,359,000 | |
| 第43回都市再生債券 | 100,000,000 | 105,771,000 | |
| 第5回本州四国連絡橋債券 | 100,000,000 | 115,255,000 | |
| 第344回東京交通債券 | 100,000,000 | 109,546,000 | |
| 第346回東京交通債券 | 20,000,000 | 21,026,400 | |
| 第190回政府保証預金保険機構債 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 第191回政府保証預金保険機構債 | 100,000,000 | 100,000,000 | |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 37,561,000 | 40,419,392 | |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 28,903,000 | 31,053,383 | |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 29,705,000 | 32,197,546 | |
| 第3回一般担保住宅金融公庫債券 | 100,000,000 | 108,294,000 | |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,187,000 | 41,378,669 | |
| 第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 31,605,000 | 33,855,592 | |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 25,500,000 | 27,032,295 | |
| 第5回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,337,000 | |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 52,780,000 | 57,107,960 | |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 31,188,000 | 33,209,606 | |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 27,578,000 | 29,728,808 | |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 33,491,000 | 35,677,627 | |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,660,000 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 27,250,000 | 29,430,272 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 35,915,000 | 38,135,624 | |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 42,707,000 | 44,826,975 | |
| 第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 43,031,000 | 45,081,857 | |
| 第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,578,000 | 53,802,541 | |
| 第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,515,000 | 54,999,721 | |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,234,000 | 54,514,941 | |
| 第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 57,046,000 | 61,111,097 | |
| 第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 59,917,000 | 64,129,165 | |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 61,824,000 | 65,923,549 | |
| 第33回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,792,000 | |
| 第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 128,312,000 | 136,588,124 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 38,112,000 | 40,642,255 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,148,000 | 75,615,382 | |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 37,631,000 | 40,039,384 | |
| 第41回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 106,333,000 | |

| | | | |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 36,461,000 | 39,728,634 | |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,830,000 | 86,153,463 | |
| 第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 33,179,000 | 36,040,025 | |
| 第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,783,000 | 86,415,998 | |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,655,000 | 86,450,061 | |
| 第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 37,339,000 | 40,589,733 | |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 162,250,000 | 171,644,275 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 83,833,000 | 88,578,786 | |
| 第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 37,939,000 | 40,906,588 | |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,472,000 | 91,198,307 | |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,796,000 | 90,545,587 | |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,529,000 | 91,432,793 | |
| 第58回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,307,000 | |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 177,050,000 | 183,825,703 | |
| 第60回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 106,187,000 | |
| 第63回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 106,358,000 | |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 183,370,000 | 187,371,133 | |
| 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 92,430,000 | 94,200,034 | |
| 第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 92,931,000 | 95,873,195 | |
| 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 93,165,000 | 96,251,556 | |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 93,048,000 | 95,991,108 | |
| 第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 93,384,000 | 95,107,868 | |
| 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,256,000 | 97,573,811 | |
| 第75回一般担保住宅金融支援機構債券 | 150,000,000 | 169,249,500 | |
| 第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 96,614,000 | 98,236,149 | |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,410,000 | 99,685,393 | |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,911,000 | 100,219,592 | |
| 第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 99,861,000 | 100,517,086 | |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 109,345,000 | |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 201,054,000 | |
| 第114回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 107,086,000 | |
| 第135回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,139,000 | |
| 第12回農林漁業金融公庫債券 | 100,000,000 | 116,516,000 | |
| 第2回政府保証成田国際空港債券 | 147,000,000 | 150,097,290 | |
| い第726号商工債 | 100,000,000 | 100,358,000 | |
| い第729号商工債 | 100,000,000 | 100,772,000 | |
| い第731号商工債 | 100,000,000 | 100,862,000 | |
| い第736号商工債 | 100,000,000 | 100,595,000 | |
| い第738号商工債 | 100,000,000 | 100,633,000 | |
| い第741号商工債 | 100,000,000 | 100,708,000 | |
| い第750号商工債 | 100,000,000 | 100,392,000 | |
| い第752号商工債 | 200,000,000 | 200,798,000 | |

| | | | | |
|-----|--------------------------------|----------------|----------------|--|
| | い第756号商工債 | 100,000,000 | 100,414,000 | |
| | い第761号商工債 | 100,000,000 | 100,383,000 | |
| | い第740号農林債 | 100,000,000 | 100,717,000 | |
| | い第743号農林債 | 100,000,000 | 100,652,000 | |
| | い第746号農林債 | 100,000,000 | 100,420,000 | |
| | い第748号農林債 | 100,000,000 | 100,446,000 | |
| | い第752号農林債 | 100,000,000 | 100,283,000 | |
| | い第761号農林債 | 200,000,000 | 200,482,000 | |
| | い第762号農林債 | 100,000,000 | 100,226,000 | |
| | い第766号農林債 | 100,000,000 | 100,157,000 | |
| | 第258回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,668,000 | |
| | 第259回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,703,000 | |
| | 第265回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,781,000 | |
| | 第267回信金中金債（5年） | 200,000,000 | 201,440,000 | |
| | 第274回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,416,000 | |
| | 第288回信金中金債（5年） | 100,000,000 | 100,391,000 | |
| | 第5回SBA銀行A B (p u b l) 円貨債券 | 100,000,000 | 100,847,000 | |
| | 第1回政府保証東日本高速道路債券 | 100,000,000 | 101,740,000 | |
| | 第19回東日本高速道路株式会社債 | 100,000,000 | 100,400,000 | |
| | 第28回中日本高速道路株式会社債 | 100,000,000 | 101,959,000 | |
| | 第33回中日本高速道路株式会社債 | 100,000,000 | 104,794,000 | |
| | 第43回中日本高速道路株式会社債 | 100,000,000 | 100,508,000 | |
| | 第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 200,000,000 | 205,304,000 | |
| | 特殊債券合計 | 22,500,214,000 | 23,684,741,423 | |
| 社債券 | 第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債 | 100,000,000 | 102,451,000 | |
| | 第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債 | 100,000,000 | 99,961,000 | |
| | 第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債 | 200,000,000 | 200,262,000 | |
| | 第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債 | 100,000,000 | 102,524,000 | |
| | 第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債 | 100,000,000 | 104,016,000 | |
| | 第9回モルガン・スタンレー円貨社債 | 100,000,000 | 100,544,000 | |
| | 第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債 | 100,000,000 | 100,014,000 | |
| | 第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債 | 100,000,000 | 102,346,000 | |
| | 第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100,976,000 | |
| | 第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債 | 200,000,000 | 204,390,000 | |
| | 第17回ラボバンク・ネダーランド円貨社債 | 200,000,000 | 200,764,000 | |
| | 第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債 | 100,000,000 | 100,993,000 | |

| | | | |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,323,000 | |
| 第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,059,000 | |
| 第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,729,000 | |
| 第5回ヒューリック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,142,000 | |
| 第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,184,000 | |
| 第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 106,273,000 | |
| 第8回旭化成株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,967,000 | |
| 第12回日本製紙株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,801,000 | |
| 第48回住友化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,167,000 | |
| 第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 103,073,000 | |
| 第14回武田薬品工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,141,000 | |
| 第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,804,000 | |
| 第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 101,906,000 | |
| 第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,334,000 | |
| 第9回JXホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,809,000 | |
| 第5回東海ゴム工業無担保社債 | 100,000,000 | 100,200,000 | |
| 第13回旭硝子株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,239,000 | |
| 第67回住友金属工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,523,000 | |
| 第22回日新製鋼株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,941,000 | |
| 第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,863,000 | |
| 第16回株式会社豊田自動織機無担保社債 | 100,000,000 | 103,479,000 | |
| 第9回株式会社小松製作所無担保社債 | 100,000,000 | 100,364,000 | |
| 第50回株式会社東芝無担保社債 | 100,000,000 | 100,801,000 | |
| 第59回株式会社東芝無担保社債 | 100,000,000 | 100,650,000 | |
| 第36回富士通株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,568,000 | |
| 第11回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,790,000 | |
| 第27回ソニー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,106,000 | |
| 第24回三菱重工株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,045,000 | |
| 第29回三菱重工株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,739,000 | |
| 第37回川崎重工株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,082,000 | |
| 第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 101,974,000 | |
| 第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 101,546,000 | |
| 第52回日産自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,448,000 | |
| 第57回日産自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,088,000 | |
| 第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,405,000 | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債 | 100,000,000 | 101,724,000 | |
| 第21回株式会社ニコン無担保社債 | 100,000,000 | 101,274,000 | |
| 第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,781,000 | |
| 第89回丸紅株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,615,000 | |
| 第70回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,460,000 | |
| 第69回三菱商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,263,000 | |
| 第74回三菱商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,412,000 | |
| 第50回株式会社クレディセゾン無担保社債 | 100,000,000 | 101,101,000 | |
| 第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,868,000 | |
| 第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 300,000,000 | 301,863,000 | |
| 第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,651,000 | |
| 第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,366,000 | |
| 第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 123,765,000 | |
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 105,370,000 | |
| 第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 107,741,000 | |
| 第151回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,235,000 | |
| 第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約） | 100,000,000 | 100,120,000 | |
| 第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 108,685,000 | |
| 第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 108,046,000 | |
| 第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 108,810,000 | |
| 第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 105,999,000 | |
| 第53回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,829,000 | |
| 第56回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,714,000 | |
| 第10回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付） | 200,000,000 | 211,554,000 | |
| 第36回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,072,000 | |
| 第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債 | 100,000,000 | 100,756,000 | |
| 第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 100,610,000 | |
| 第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,068,000 | |
| 第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,754,000 | |
| 第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,669,000 | |
| 第67回アコム株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,280,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第55回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,962,000 | |
| 第138回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,090,000 | |
| 第167回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,676,000 | |
| 第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,697,000 | |
| 第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,057,000 | |
| 第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,195,000 | |
| 第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,912,000 | |
| 第24回三井不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,772,000 | |
| 第31回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,710,000 | |
| 第103回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,598,000 | |
| 第84回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,334,000 | |
| 第97回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,654,000 | |
| 第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債 | 100,000,000 | 103,395,000 | |
| 第105回東武鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,046,000 | |
| 第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,840,000 | |
| 第63回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,536,000 | |
| 第30回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,771,000 | |
| 第17回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 112,393,000 | |
| 第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 114,138,000 | |
| 第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 106,190,000 | |
| 第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 200,000,000 | 202,650,000 | |
| 第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 19,000,000 | 21,594,830 | |
| 第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 118,613,000 | |
| 第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 20,000,000 | 22,633,000 | |
| 第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 107,926,000 | |
| 第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 102,247,000 | |
| 第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 112,605,000 | |
| 第9回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 106,197,000 | |
| 第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,338,000 | |
| 第9回三井倉庫株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 102,522,000 | |
| 第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債 | 100,000,000 | 100,797,000 | |
| 第63回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 101,502,000 | |
| 第20回KDDI株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,688,000 | |
| 第455回東京電力株式会社社債 | 120,000,000 | 122,104,800 | |
| 第459回東京電力株式会社社債 | 10,000,000 | 10,418,100 | |

| | | | |
|-------------------------------|----------------|-----------------|--|
| 第518回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,171,000 | |
| 第521回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,848,000 | |
| 第528回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,894,000 | |
| 第536回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,405,000 | |
| 第542回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,153,000 | |
| 第544回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,505,000 | |
| 第554回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,794,000 | |
| 第408回中部電力株式会社社債 | 50,000,000 | 52,147,500 | |
| 第499回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,364,000 | |
| 第451回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,938,000 | |
| 第473回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,000,000 | |
| 第474回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,234,000 | |
| 第489回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,704,000 | |
| 第491回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,345,000 | |
| 第358回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,634,000 | |
| 第362回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,992,000 | |
| 第371回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,839,000 | |
| 第286回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,713,000 | |
| 第307回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,622,000 | |
| 第380回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,045,000 | |
| 第382回東北電力株式会社社債 | 20,000,000 | 21,444,800 | |
| 第466回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,764,000 | |
| 第471回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,521,000 | |
| 第276回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,953,000 | |
| 第279回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,977,000 | |
| 第387回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,110,000 | |
| 第408回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,985,000 | |
| 第417回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,922,000 | |
| 第420回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 101,685,000 | |
| 第423回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,681,000 | |
| 第261回北海道電力株式会社社債 | 31,000,000 | 33,295,860 | |
| 第285回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,359,000 | |
| 第17回電源開発株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 206,238,000 | |
| 第30回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,423,000 | |
| 第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 109,018,000 | |
| 第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債 | 100,000,000 | 103,084,000 | |
| 社債券合計 | 15,270,000,000 | 15,715,868,890 | |
| 合計 | | 279,339,610,597 | |

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,632,572,046 |
| コール・ローン | 1,311,626,656 |
| 株式 | 178,154,446,402 |
| 投資信託受益証券 | 138,912,312 |
| 投資証券 | 3,827,612,195 |
| 派生商品評価勘定 | 4,434,129 |
| 未収入金 | 1,684,673 |
| 未収配当金 | 276,539,243 |
| 未収利息 | 451 |
| 前払金 | 96,306,656 |
| 差入保証金 | 1,427,850 |
| 差入委託証拠金 | 1,465,407,788 |
| 流動資産合計 | 189,910,970,401 |
| 資産合計 | 189,910,970,401 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 98,000,532 |
| 未払解約金 | 150,081,547 |
| 流動負債合計 | 248,082,079 |
| 負債合計 | 248,082,079 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 103,878,614,653 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 85,784,273,669 |
| 元本等合計 | 189,662,888,322 |
| 純資産合計 | 189,662,888,322 |
| 負債純資産合計 | 189,910,970,401 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成26年 9月30日現在 |
|--------------------|---------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1) 株式 |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4.収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> |

| | 平成26年 9月30日現在 |
|--|--------------------------------------|
| | (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |
| | (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 103,878,614,653口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.8258円 (1万口当たり純資産額) (18,258円) |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------|---------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|-------------------------------|------------------|
| 期首 | 平成25年10月 1日 |
| 期首元本額 | 110,876,572,872円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,240,504,649円 |
| 期中一部解約元本額 | 31,238,462,868円 |
| 期末元本額 | 103,878,614,653円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 1,338,058,371円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 12,865,987円 |
| S M T グローバル株式インデックス・オープン | 21,533,711,392円 |
| 世界経済インデックスファンド | 1,227,365,784円 |
| マイセレクション25 | 10,601,300円 |
| マイセレクション50 | 24,919,934円 |
| マイセレクション75 | 30,641,049円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 1,011,229,001円 |
| D C マイセレクション25 | 863,744,317円 |
| D C マイセレクション50 | 4,421,398,074円 |
| D C マイセレクション75 | 4,731,893,905円 |
| D C 外国株式インデックス・オープン | 5,906,263,822円 |
| D C マイセレクションS25 | 336,531,293円 |
| D C マイセレクションS50 | 1,548,577,802円 |
| D C マイセレクションS75 | 1,150,153,903円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド2015 | 2,556,147円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド2025 | 138,052,043円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド2035 | 144,209,597円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド2045 | 70,805,094円 |
| D C 世界経済インデックスファンド | 1,278,937,696円 |
| 外国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 17,131,635,861円 |
| マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用） | 71,001,589円 |
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用） | 40,321,175円 |
| 外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用） | 223,303,347円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 415,767,277円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 1,437,919,851円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 2,339,263,007円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 1,154,751,795円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 3,209,474,267円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 899,460,679円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 5,689,760,995円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 6,041,104,188円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 3,474,305,570円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 829,875,175円 |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用） | 920,523,942円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 281,562,152円 |

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|------------------------------------|----------------|
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 1,652,325,529円 |
| F O F s用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 4,463,952,735円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ1 | 617,603,863円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,436,021,987円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 4,210,453,253円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 316,779,868円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 475,724,493円 |
| D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 34,700,024円 |
| D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 79,116,637円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 455,555,981円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 176,057,549円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 17,775,353円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 平成26年 9月30日現在 |
|----------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 2,428,759,879 |
| 投資信託受益証券 | 3,965,987 |
| 投資証券 | 49,369,298 |
| 合計 | 2,383,356,568 |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成26年 9月30日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 8,417,457,794 | - | 8,321,151,138 | 96,306,656 |
| 合計 | | 8,417,457,794 | - | 8,321,151,138 | 96,306,656 |

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成26年 9月30日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,903,429,147 | - | 1,906,169,400 | 2,740,253 |
| | アメリカドル | 1,157,735,138 | - | 1,160,064,000 | 2,328,862 |
| | カナダドル | 91,088,343 | - | 91,167,900 | 79,557 |
| | ユーロ | 253,854,053 | - | 254,113,800 | 259,747 |
| | イギリスポンド | 166,947,092 | - | 167,062,200 | 115,108 |
| | スイスフラン | 67,837,290 | - | 67,885,400 | 48,110 |
| | スウェーデンクローナ | 25,490,862 | - | 25,552,800 | 61,938 |
| | ノルウェークローネ | 9,479,064 | - | 9,503,200 | 24,136 |
| | デンマーククローネ | 19,751,044 | - | 19,769,000 | 17,956 |
| | オーストラリアドル | 71,574,552 | - | 71,376,900 | 197,652 |
| | 香港ドル | 19,598,861 | - | 19,585,100 | 13,761 |
| | シンガポールドル | 11,154,208 | - | 11,176,100 | 21,892 |
| | イスラエルシェケル | 8,918,640 | - | 8,913,000 | 5,640 |
| | 合計 | | 1,903,429,147 | - | 1,906,169,400 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 (株) | 評価額 | | 備考 |
|--------|-------------------------|------------|--------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | ANADARKO PETROLEUM CORP | 27,739 | 104.25 | 2,891,790.75 | |
| | ANTERO RESOURCES CORP | 2,745 | 55.39 | 152,045.55 | |
| | APACHE CORP | 21,447 | 94.68 | 2,030,601.96 | |
| | BAKER HUGHES | 24,272 | 66.16 | 1,605,835.52 | |
| | CABOT OIL & GAS CORP | 23,375 | 33.01 | 771,608.75 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| CAMERON INTERNATIONAL CORP | 11,374 | 67.28 | 765,242.72 |
| CHENIERE ENERGY INC | 12,632 | 81.59 | 1,030,644.88 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 29,852 | 23.64 | 705,701.28 |
| CHEVRON CORP | 105,487 | 120.55 | 12,716,457.85 |
| CIMAREX ENERGY CO | 4,885 | 129.23 | 631,288.55 |
| COBALT INTERNATIONAL ENERGY | 14,569 | 14.15 | 206,151.35 |
| CONCHO RESOURCES INC | 6,318 | 130.07 | 821,782.26 |
| CONOCOPHILLIPS | 68,096 | 77.84 | 5,300,592.64 |
| CONSOL ENERGY INC | 12,950 | 37.46 | 485,107.00 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 5,154 | 68.68 | 353,976.72 |
| CORE LABORATORIES N.V. | 2,348 | 148.23 | 348,044.04 |
| DENBURY RESOURCES INC | 18,996 | 15.33 | 291,208.68 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 21,414 | 69.58 | 1,489,986.12 |
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING | 3,474 | 35.17 | 122,180.58 |
| ENERGEN CORP | 3,649 | 75.00 | 273,675.00 |
| ENSCO PLC-CL A | 13,115 | 42.06 | 551,616.90 |
| EOG RESOURCES INC | 30,346 | 101.87 | 3,091,347.02 |
| EQT CORPORATION | 8,496 | 92.84 | 788,768.64 |
| EXXON MOBIL | 237,897 | 94.43 | 22,464,613.71 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 12,792 | 54.21 | 693,454.32 |
| HALLIBURTON CO | 46,399 | 65.61 | 3,044,238.39 |
| HELMERICH & PAYNE | 6,077 | 98.80 | 600,407.60 |
| HESS CORP | 15,749 | 96.21 | 1,515,211.29 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 9,792 | 44.16 | 432,414.72 |
| KINDER MORGAN INC | 37,531 | 38.53 | 1,446,069.43 |
| KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC | 5,453 | 94.50 | 515,308.50 |
| MARATHON OIL CORP | 37,186 | 38.60 | 1,435,379.60 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 16,081 | 84.39 | 1,357,075.59 |
| MURPHY OIL CORP | 8,962 | 57.00 | 510,834.00 |
| NABORS INDUSTRIES LTD | 13,930 | 23.11 | 321,922.30 |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 23,438 | 78.10 | 1,830,507.80 |
| NOBLE CORP PLC | 14,396 | 22.54 | 324,485.84 |
| NOBLE ENERGY INC | 19,969 | 69.89 | 1,395,633.41 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 43,590 | 97.23 | 4,238,255.70 |
| OCEANEERING INTL INC | 6,110 | 65.40 | 399,594.00 |
| ONEOK INC | 11,950 | 66.07 | 789,536.50 |
| PEABODY ENERGY CORP | 14,207 | 12.03 | 170,910.21 |
| PHILLIPS 66 | 31,437 | 81.77 | 2,570,603.49 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES | 7,941 | 201.96 | 1,603,764.36 |
| QEP RESOURCES INC | 9,981 | 31.30 | 312,405.30 |
| RANGE RESOURCES CORP | 8,831 | 68.67 | 606,424.77 |
| SCHLUMBERGER | 72,100 | 103.28 | 7,446,488.00 |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 19,018 | 35.79 | 680,654.22 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 36,995 | 39.23 | 1,451,313.85 |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 7,710 | 33.47 | 258,053.70 |
| TESORO CORP | 7,212 | 61.05 | 440,292.60 |
| VALERO ENERGY CORP | 29,714 | 46.77 | 1,389,723.78 |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PL | 43,490 | 21.23 | 923,292.70 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 6,687 | 80.42 | 537,768.54 |
| WILLIAMS COS | 38,568 | 55.99 | 2,159,422.32 |
| AIR PRODUCTS&CHEMICALS | 11,549 | 133.13 | 1,537,518.37 |
| AIRGAS INC | 3,795 | 112.55 | 427,127.25 |
| ALBEMARLE CORP | 4,304 | 60.03 | 258,369.12 |
| ALCOA | 65,671 | 15.93 | 1,046,139.03 |
| ASHLAND INC | 3,915 | 105.71 | 413,854.65 |
| AVERY DENNISON CORP | 4,954 | 45.45 | 225,159.30 |
| BALL CORP | 7,358 | 64.19 | 472,310.02 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 8,241 | 59.79 | 492,729.39 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 2,922 | 278.62 | 814,127.64 |
| CROWN HOLDINGS INC | 7,486 | 44.91 | 336,196.26 |
| DOW CHEMICAL CO | 67,068 | 53.42 | 3,582,772.56 |
| DU PONT (E.I) DE NEMOURS | 51,160 | 72.05 | 3,686,078.00 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 8,354 | 82.38 | 688,202.52 |
| ECOLAB INC | 15,090 | 116.32 | 1,755,268.80 |
| FMC CORP | 7,358 | 57.45 | 422,717.10 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 57,515 | 32.40 | 1,863,486.00 |
| INT'L PAPER CO | 23,331 | 47.88 | 1,117,088.28 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 4,194 | 96.76 | 405,811.44 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 24,982 | 113.30 | 2,830,460.60 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 3,206 | 129.69 | 415,786.14 |
| MEADWESTVACO CORP | 8,828 | 41.22 | 363,890.16 |
| MONSANTO CO | 29,200 | 112.93 | 3,297,556.00 |
| MOSAIC CO/THE | 18,134 | 45.42 | 823,646.28 |
| NEWMONT MINING CORP | 27,014 | 23.48 | 634,288.72 |
| NUCOR CORP | 18,288 | 54.56 | 997,793.28 |
| OWENS-ILLINOIS INC | 8,238 | 26.76 | 220,448.88 |
| PPG INDUSTRIES INC | 7,725 | 199.46 | 1,540,828.50 |
| PRAXAIR INC | 16,157 | 130.88 | 2,114,628.16 |
| ROCK-TENN COMPANY -CL A | 7,374 | 48.34 | 356,459.16 |
| SEALED AIR CORP | 11,641 | 35.38 | 411,858.58 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 4,747 | 221.44 | 1,051,175.68 |
| SIGMA-ALDRICH | 6,492 | 136.28 | 884,729.76 |
| VULCAN MATERIALS CO | 7,408 | 60.62 | 449,072.96 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 2,454 | 90.24 | 221,448.96 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| 3 M COMPANY | 34,229 | 142.19 | 4,867,021.51 |
| AGCO CORP | 4,746 | 45.98 | 218,221.08 |
| AMETEK INC | 13,197 | 50.98 | 672,783.06 |
| B/E AEROSPACE INC | 5,493 | 84.90 | 466,355.70 |
| BOEING CO | 38,398 | 128.77 | 4,944,510.46 |
| CATERPILLAR | 32,922 | 99.83 | 3,286,603.26 |
| CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV | 5,158 | 58.35 | 300,969.30 |
| CUMMINS INC | 9,734 | 132.85 | 1,293,161.90 |
| DANAHER CORP | 34,978 | 75.79 | 2,650,982.62 |
| DEERE&CO | 19,242 | 82.34 | 1,584,386.28 |
| DOVER CORP | 9,268 | 81.32 | 753,673.76 |
| EATON CORP | 26,291 | 64.69 | 1,700,764.79 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 38,996 | 62.67 | 2,443,879.32 |
| FASTENAL CO | 15,805 | 45.20 | 714,386.00 |
| FLOWSERVE CORP | 7,263 | 70.80 | 514,220.40 |
| FLUOR CORP | 8,820 | 67.37 | 594,203.40 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 16,210 | 127.49 | 2,066,612.90 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 555,640 | 25.42 | 14,124,368.80 |
| GRAINGER (WW) INC | 3,446 | 252.02 | 868,460.92 |
| HONEYWELL INTL INC | 41,290 | 93.53 | 3,861,853.70 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 21,805 | 85.28 | 1,859,530.40 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 14,843 | 57.26 | 849,910.18 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 6,748 | 49.32 | 332,811.36 |
| JOY GLOBAL INC | 5,239 | 55.84 | 292,545.76 |
| KBR INC | 8,182 | 19.11 | 156,358.02 |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS | 4,812 | 115.26 | 554,631.12 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 14,856 | 181.36 | 2,694,284.16 |
| MASCO CORP | 19,054 | 23.32 | 444,339.28 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 11,527 | 131.98 | 1,521,333.46 |
| PACCAR INC | 19,916 | 57.19 | 1,139,095.62 |
| PALL CORP | 5,994 | 83.58 | 500,978.52 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 8,323 | 114.03 | 949,071.69 |
| PENTAIR PLC | 10,793 | 66.17 | 714,172.81 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 7,973 | 237.25 | 1,891,594.25 |
| QUANTA SERVICES INC | 12,064 | 36.34 | 438,405.76 |
| RAYTHEON COMPANY | 17,416 | 100.89 | 1,757,100.24 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 7,791 | 111.48 | 868,540.68 |
| ROCKWELL COLLIN | 6,615 | 78.93 | 522,121.95 |
| ROPER INDUSTRIES INC | 5,733 | 147.02 | 842,865.66 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 8,385 | 45.96 | 385,374.60 |
| SPX CORP | 1,919 | 95.20 | 182,688.80 |
| STANLEY BLACK&DECKER | 8,431 | 89.98 | 758,621.38 |

| | | | |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|
| TEXTRON | 15,684 | 36.36 | 570,270.24 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 2,832 | 184.89 | 523,608.48 |
| UNITED RENTALS INC | 5,462 | 112.52 | 614,584.24 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 48,308 | 105.08 | 5,076,204.64 |
| XYLEM INC | 10,093 | 36.25 | 365,871.25 |
| ADT CORPORATION | 9,887 | 35.57 | 351,680.59 |
| CINTAS CORP | 5,599 | 65.95 | 369,254.05 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 2,027 | 117.49 | 238,152.23 |
| EQUIFAX INC | 6,491 | 74.31 | 482,346.21 |
| IHS INC-CLASS A | 3,569 | 125.46 | 447,766.74 |
| MANPOWER GROUP | 4,455 | 71.08 | 316,661.40 |
| NIELSEN NV | 16,267 | 44.70 | 727,134.90 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 15,596 | 38.80 | 605,124.80 |
| ROBERT HALF INTL INC | 7,318 | 49.27 | 360,557.86 |
| STERICYCLE INC | 4,626 | 116.19 | 537,494.94 |
| TOWERS WATSON & CO-CL A | 3,973 | 100.00 | 397,300.00 |
| TYCO INTERNATIONAL LTD | 25,672 | 44.30 | 1,137,269.60 |
| VERISK ANALYTICS INC-CLASS A | 8,126 | 60.93 | 495,117.18 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 24,662 | 47.40 | 1,168,978.80 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 9,442 | 35.03 | 330,753.26 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 8,348 | 66.45 | 554,724.60 |
| CSX CORP | 56,117 | 32.26 | 1,810,334.42 |
| DELTA AIR LINES INC | 11,957 | 36.00 | 430,452.00 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 11,078 | 40.90 | 453,090.20 |
| FEDEX CORP | 15,605 | 162.18 | 2,530,818.90 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 24,316 | 26.08 | 634,161.28 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 4,793 | 74.00 | 354,682.00 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 6,187 | 121.69 | 752,896.03 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 17,154 | 111.42 | 1,911,298.68 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 9,854 | 33.67 | 331,784.18 |
| UNION PACIFIC CORP | 50,281 | 108.53 | 5,456,996.93 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 5,391 | 46.75 | 252,029.25 |
| UNITED PARCEL SERVICE B | 39,196 | 97.34 | 3,815,338.64 |
| AUTOLIV INC | 4,931 | 93.51 | 461,097.81 |
| BORGWARNER INC | 12,370 | 54.31 | 671,814.70 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 16,953 | 62.80 | 1,064,648.40 |
| FORD MOTOR COMPANY | 204,963 | 15.11 | 3,096,990.93 |
| GENERAL MOTORS CO | 71,356 | 32.22 | 2,299,090.32 |
| HARLEY-DAVIDSON | 11,611 | 59.34 | 688,996.74 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 36,673 | 44.39 | 1,627,914.47 |
| TESLA MOTORS INC | 4,780 | 245.26 | 1,172,342.80 |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 6,284 | 101.59 | 638,391.56 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| COACH INC | 14,691 | 36.16 | 531,226.56 |
| DR HORTON INC | 16,578 | 20.73 | 343,661.94 |
| FOSSIL GROUP INC | 2,424 | 95.94 | 232,558.56 |
| GARMIN LTD | 6,629 | 51.87 | 343,846.23 |
| HASBRO INC | 5,948 | 55.05 | 327,437.40 |
| LEGGETT & PLATT INC | 7,102 | 35.44 | 251,694.88 |
| LENNAR CORP-CL A | 9,818 | 39.41 | 386,927.38 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 6,262 | 42.27 | 264,694.74 |
| MATTEL INC | 17,952 | 30.48 | 547,176.96 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 10,936 | 71.17 | 778,315.12 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 3,306 | 135.97 | 449,516.82 |
| NEWELL RUBBERMAID | 14,823 | 34.51 | 511,541.73 |
| NIKE B | 38,483 | 89.12 | 3,429,604.96 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 3,368 | 151.21 | 509,275.28 |
| PULTE GROUP INC | 17,827 | 17.74 | 316,250.98 |
| PVH CORP | 4,634 | 122.28 | 566,645.52 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 3,265 | 165.03 | 538,822.95 |
| TOLL BROTHERS INC | 9,602 | 31.63 | 303,711.26 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 9,283 | 70.12 | 650,923.96 |
| VF CORP | 19,416 | 66.13 | 1,283,980.08 |
| WHIRLPOOL CORP | 4,283 | 148.88 | 637,653.04 |
| BLOCK H & R INC | 15,457 | 31.04 | 479,785.28 |
| CARNIVAL CORPORATION | 21,579 | 40.40 | 871,791.60 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 1,751 | 662.94 | 1,160,807.94 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 6,661 | 52.00 | 346,372.00 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 16,713 | 24.55 | 410,304.15 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 22,754 | 60.15 | 1,368,653.10 |
| MARRIOTT INTL A | 12,563 | 70.44 | 884,937.72 |
| MCDONALD'S CORP | 54,869 | 96.22 | 5,279,495.18 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 22,102 | 22.16 | 489,780.32 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 8,710 | 66.93 | 582,960.30 |
| STARBUCKS CORP | 41,832 | 75.27 | 3,148,694.64 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 10,745 | 83.35 | 895,595.75 |
| WYMDHAM WORLDWIDE CORP | 7,142 | 81.36 | 581,073.12 |
| WYNN RESORTS LTD | 4,624 | 178.99 | 827,649.76 |
| YUM BRANDS INC | 24,582 | 72.66 | 1,786,128.12 |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 10,601 | 17.65 | 187,107.65 |
| CBS CORP-CL B | 27,126 | 54.32 | 1,473,484.32 |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 4,250 | 155.58 | 661,215.00 |
| COMCAST CORP-CL A | 119,104 | 54.16 | 6,450,672.64 |
| COMCAST CORP-SPECIAL A | 24,133 | 53.92 | 1,301,251.36 |
| DIRECTV | 26,784 | 86.66 | 2,321,101.44 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|--------------|
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A | 7,963 | 37.70 | 300,244.91 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 16,488 | 37.21 | 613,518.48 |
| DISH NETWORK CORPORATION-A | 12,597 | 65.01 | 818,930.97 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS | 23,921 | 18.39 | 439,907.19 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 12,095 | 43.24 | 522,987.80 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 29,160 | 41.87 | 1,220,929.20 |
| LIBERTY MEDIA CORP | 4,935 | 47.06 | 232,241.10 |
| LIBERTY MEDIA CORP-C | 11,585 | 46.70 | 541,019.50 |
| NEWS CORP-CLASS A | 20,142 | 16.80 | 338,385.60 |
| OMNICOM GROUP | 14,483 | 69.14 | 1,001,354.62 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 4,261 | 78.04 | 332,528.44 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 167,674 | 3.50 | 586,859.00 |
| THE WALT DISNEY CO | 91,273 | 88.83 | 8,107,780.59 |
| TIME WARNER CABLE-A | 15,500 | 144.97 | 2,247,035.00 |
| TIME WARNER INC | 48,576 | 75.64 | 3,674,288.64 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A | 79,740 | 34.15 | 2,723,121.00 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 24,592 | 33.25 | 817,684.00 |
| VIACOM INC-CLASS B | 21,349 | 76.82 | 1,640,030.18 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 4,108 | 130.64 | 536,669.12 |
| AMAZON.COM | 21,703 | 321.82 | 6,984,459.46 |
| AUTONATION INC | 4,068 | 50.74 | 206,410.32 |
| AUTOZONE INC | 1,835 | 507.84 | 931,886.40 |
| BED BATH & BEYOND INC | 11,443 | 66.20 | 757,526.60 |
| BEST BUY COMPANY INC | 16,694 | 33.65 | 561,753.10 |
| CARMAX INC | 12,059 | 47.11 | 568,099.49 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 5,316 | 44.33 | 235,658.28 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 16,820 | 61.33 | 1,031,570.60 |
| DOLLAR TREE INC | 11,299 | 56.06 | 633,421.94 |
| EXPEDIA INC | 5,770 | 86.58 | 499,566.60 |
| FAMILY DOLLAR STORES | 5,520 | 77.50 | 427,800.00 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A | 5,678 | 42.06 | 238,816.68 |
| GAP | 13,415 | 42.03 | 563,832.45 |
| GENUINE PARTS CO | 8,612 | 88.07 | 758,458.84 |
| HOME DEPOT | 75,886 | 92.88 | 7,048,291.68 |
| KOHL'S CORP | 11,706 | 61.26 | 717,109.56 |
| L BRANDS INC | 13,846 | 67.77 | 938,343.42 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION | 25,897 | 28.29 | 732,626.13 |
| LKQ CORP | 15,504 | 26.58 | 412,173.84 |
| LOWES COMPANIES | 55,878 | 53.35 | 2,981,091.30 |
| MACY'S INC | 20,388 | 58.92 | 1,201,260.96 |
| NETFLIX INC | 3,173 | 449.56 | 1,426,453.88 |
| NORDSTROM INC | 7,529 | 68.66 | 516,941.14 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|----------|--------------|
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 5,935 | 151.81 | 900,992.35 |
| PETSMART INC | 5,053 | 70.19 | 354,670.07 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 2,913 | 1,161.05 | 3,382,138.65 |
| ROSS STORES INC | 11,890 | 75.46 | 897,219.40 |
| STAPLES INC | 34,140 | 12.15 | 414,801.00 |
| TARGET (DAYTON HUDSON) | 32,903 | 63.04 | 2,074,205.12 |
| TIFFANY & CO | 6,895 | 97.36 | 671,297.20 |
| TJX COMPANIES INC | 39,218 | 59.80 | 2,345,236.40 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 7,518 | 61.43 | 461,830.74 |
| TRIPADVISOR INC | 6,310 | 90.80 | 572,948.00 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 3,108 | 118.32 | 367,738.56 |
| URBAN OUTFITTERS INC | 6,170 | 36.96 | 228,043.20 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 24,431 | 125.32 | 3,061,692.92 |
| CVS HEALTH CORP | 64,859 | 80.03 | 5,190,665.77 |
| KROGER CO | 27,073 | 51.97 | 1,406,983.81 |
| SAFEWAY INC | 12,078 | 34.38 | 415,241.64 |
| SYSCO CORP | 32,086 | 37.94 | 1,217,342.84 |
| WAL-MART STORES | 89,470 | 76.08 | 6,806,877.60 |
| WALGREEN CO | 50,349 | 59.60 | 3,000,800.40 |
| WHOLE FOODS MKT INC | 19,517 | 37.56 | 733,058.52 |
| ALTRIA GROUP INC | 110,210 | 46.04 | 5,074,068.40 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 36,314 | 51.30 | 1,862,908.20 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 6,872 | 90.17 | 619,648.24 |
| BUNGE LIMITED | 7,957 | 84.12 | 669,342.84 |
| CAMPBELL SOUP CO (US) | 11,493 | 42.85 | 492,475.05 |
| COCA-COLA CO | 219,265 | 42.25 | 9,263,946.25 |
| COCA-COLA ENTERPRISES | 13,141 | 45.11 | 592,790.51 |
| CONAGRA | 22,867 | 32.98 | 754,153.66 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 9,425 | 86.35 | 813,848.75 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 10,510 | 64.09 | 673,585.90 |
| GENERAL MILLS INC | 34,365 | 50.63 | 1,739,899.95 |
| HERSHEY FOODS CORPORATION | 8,622 | 94.50 | 814,779.00 |
| HORMEL FOODS CORP | 8,128 | 50.80 | 412,902.40 |
| JM SMUCKER CO | 5,676 | 98.44 | 558,745.44 |
| KELLOGG CO | 15,049 | 61.81 | 930,178.69 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 6,597 | 130.40 | 860,248.80 |
| KRAFT FOODS GROUP INC | 32,659 | 56.29 | 1,838,375.11 |
| LORILLARD INC | 20,269 | 60.34 | 1,223,031.46 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 6,679 | 66.78 | 446,023.62 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 11,461 | 96.81 | 1,109,539.41 |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 8,559 | 74.22 | 635,248.98 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 93,913 | 34.20 | 3,211,824.60 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| MONSTER BEVERAGE CORP | 7,966 | 91.33 | 727,534.78 |
| PEPSICO INC | 84,050 | 93.15 | 7,829,257.50 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 87,205 | 82.66 | 7,208,365.30 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 18,014 | 58.65 | 1,056,521.10 |
| TYSON FOODS INC | 17,158 | 38.85 | 666,588.30 |
| AVON PRODUCTS INC | 24,395 | 12.59 | 307,133.05 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 7,656 | 70.72 | 541,432.32 |
| CLOROX COMPANY | 7,049 | 96.27 | 678,607.23 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 50,827 | 65.63 | 3,335,776.01 |
| ENERGIZER HOLDINGS INC | 3,469 | 124.24 | 430,988.56 |
| ESTEE LAUDER CO-CL A | 13,077 | 74.71 | 976,982.67 |
| HERBALIFE LTD | 4,464 | 42.99 | 191,907.36 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 20,873 | 107.91 | 2,252,405.43 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 149,952 | 84.44 | 12,661,946.88 |
| ABBOTT LABORATORIES | 83,898 | 41.90 | 3,515,326.20 |
| AETNA INC | 19,495 | 81.34 | 1,585,723.30 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 12,621 | 77.63 | 979,768.23 |
| BARD C R INC | 4,050 | 143.37 | 580,648.50 |
| BAXTER INTERNATIONAL | 29,615 | 71.88 | 2,128,726.20 |
| BECTON DICKINSON & CO | 10,774 | 114.35 | 1,232,006.90 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 73,950 | 11.92 | 881,484.00 |
| CARDINAL HEALTH | 18,944 | 75.63 | 1,432,734.72 |
| CAREFUSION CORP | 11,482 | 45.80 | 525,875.60 |
| CERNER CORP | 17,685 | 59.69 | 1,055,617.65 |
| CIGNA CORP | 15,084 | 91.24 | 1,376,264.16 |
| COVIDIEN PLC | 24,626 | 87.81 | 2,162,409.06 |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 9,609 | 73.48 | 706,069.32 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 7,997 | 45.89 | 367,022.31 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 5,625 | 103.17 | 580,331.25 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING | 43,062 | 71.40 | 3,074,626.80 |
| HCA HOLDINGS INC | 16,922 | 71.77 | 1,214,491.94 |
| HENRY SCHEIN INC | 4,467 | 117.22 | 523,621.74 |
| HOLOGIC INC | 11,506 | 24.49 | 281,781.94 |
| HUMANA INC | 8,643 | 131.90 | 1,140,011.70 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 2,067 | 464.72 | 960,576.24 |
| LABORATORY CRP OF AMER | 4,843 | 103.14 | 499,507.02 |
| MCKESSON CORP | 12,814 | 196.52 | 2,518,207.28 |
| MEDTRONIC | 55,459 | 62.54 | 3,468,405.86 |
| OMNICARE INC | 5,836 | 62.59 | 365,275.24 |
| PATTERSON COMPANIES INC | 4,632 | 41.48 | 192,135.36 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 8,142 | 61.47 | 500,488.74 |
| RESMED INC | 7,971 | 49.97 | 398,310.87 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ST JUDE MEDICAL INC | 16,136 | 61.14 | 986,555.04 |
| STRYKER CORP | 18,871 | 81.52 | 1,538,363.92 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 54,366 | 86.51 | 4,703,202.66 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 5,000 | 109.55 | 547,750.00 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 5,539 | 81.20 | 449,766.80 |
| WELLPOINT INC | 15,575 | 121.31 | 1,889,403.25 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 9,382 | 101.46 | 951,897.72 |
| ABBVIE INC | 88,212 | 58.52 | 5,162,166.24 |
| ACTAVIS PLC | 14,671 | 244.39 | 3,585,445.69 |
| AGILENT TECHNOLOGIES | 18,566 | 57.15 | 1,061,046.90 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 11,006 | 167.95 | 1,848,457.70 |
| ALLERGAN INC | 16,531 | 179.70 | 2,970,620.70 |
| AMGEN | 41,988 | 140.07 | 5,881,259.16 |
| BIOGEN IDEC INC | 13,161 | 330.16 | 4,345,235.76 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 8,206 | 73.00 | 599,038.00 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 91,944 | 51.71 | 4,754,424.24 |
| CELGENE CORP | 44,088 | 95.64 | 4,216,576.32 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 8,148 | 69.52 | 566,448.96 |
| GILEAD SCIENCES INC | 85,125 | 107.51 | 9,151,788.75 |
| HOSPIRA INC | 9,252 | 52.75 | 488,043.00 |
| ILLUMINA INC | 7,161 | 165.22 | 1,183,140.42 |
| JOHNSON & JOHNSON | 156,751 | 106.54 | 16,700,251.54 |
| LILLY (ELI) & CO | 55,933 | 65.34 | 3,654,662.22 |
| MALLINCKRODT PLC | 6,000 | 89.92 | 539,520.00 |
| MERCK & CO | 161,980 | 59.41 | 9,623,231.80 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,700 | 257.36 | 437,512.00 |
| MYLAN INC | 20,878 | 45.79 | 956,003.62 |
| PERRIGO CO PLC | 7,468 | 149.73 | 1,118,183.64 |
| PFIZER | 353,108 | 29.77 | 10,512,025.16 |
| PHARMACYCLICS INC | 3,500 | 120.54 | 421,890.00 |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD | 3,064 | 57.20 | 175,260.80 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 4,406 | 354.96 | 1,563,953.76 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 22,164 | 122.00 | 2,704,008.00 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 13,104 | 113.90 | 1,492,545.60 |
| WATERS CORP | 4,781 | 100.05 | 478,339.05 |
| ZOETIS INC | 28,624 | 36.79 | 1,053,076.96 |
| BANK OF AMERICA CORP | 582,867 | 17.01 | 9,914,567.67 |
| BB&T CORP | 39,902 | 37.31 | 1,488,743.62 |
| CIT GROUP INC | 10,896 | 46.09 | 502,196.64 |
| CITIGROUP | 168,395 | 52.05 | 8,764,959.75 |
| COMERICA INC | 9,514 | 50.17 | 477,317.38 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 46,284 | 20.11 | 931,002.66 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 6,616 | 49.58 | 328,021.28 |
| HUDSON CITY BANCORP INC | 27,687 | 9.83 | 272,163.21 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 209,735 | 60.33 | 12,653,312.55 |
| KEY CORP | 47,236 | 13.43 | 634,379.48 |
| M & T BANK CORP | 6,337 | 124.33 | 787,879.21 |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 24,669 | 15.91 | 392,483.79 |
| OCWEN FINANCIAL CORP | 6,111 | 26.59 | 162,491.49 |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 18,290 | 14.59 | 266,851.10 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 29,612 | 85.69 | 2,537,452.28 |
| REGIONS FINL CORP | 77,236 | 10.06 | 776,994.16 |
| SUNTRUST BANKS | 30,303 | 38.34 | 1,161,817.02 |
| US BANCORP | 100,220 | 41.73 | 4,182,180.60 |
| WELLS FARGO & CO | 277,261 | 51.69 | 14,331,621.09 |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 3,105 | 200.82 | 623,546.10 |
| ALLY FINANCIAL INC | 17,625 | 23.43 | 412,953.75 |
| AMERICAN EXPRESS | 52,859 | 87.95 | 4,648,949.05 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 10,348 | 123.58 | 1,278,805.84 |
| BANK NEW YORK CO | 63,000 | 38.61 | 2,432,430.00 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 62,240 | 138.33 | 8,609,659.20 |
| BLACKROCK INC | 7,437 | 330.65 | 2,459,044.05 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 31,341 | 81.83 | 2,564,634.03 |
| CME GROUP INC | 17,825 | 79.50 | 1,417,087.50 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 25,348 | 64.45 | 1,633,678.60 |
| EATON VANCE CORP | 6,650 | 38.09 | 253,298.50 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 23,156 | 54.80 | 1,268,948.80 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 23,667 | 183.83 | 4,350,704.61 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 6,433 | 195.20 | 1,255,721.60 |
| INVESCO LTD | 24,180 | 39.60 | 957,528.00 |
| LEGG MASON INC | 6,202 | 51.64 | 320,271.28 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 16,616 | 24.12 | 400,777.92 |
| MCGRAW-HILL FINANCIAL | 15,240 | 84.81 | 1,292,504.40 |
| MOODY'S CORP | 10,896 | 94.11 | 1,025,422.56 |
| MORGAN STANLEY | 82,068 | 34.50 | 2,831,346.00 |
| NASDAQ OMX GROUP | 6,376 | 42.35 | 270,023.60 |
| NAVIENT CORP | 22,604 | 17.65 | 398,960.60 |
| NORTHERN TRUST CORP | 12,570 | 68.23 | 857,651.10 |
| PRICE T ROWE GROUP INC | 14,865 | 78.52 | 1,167,199.80 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 6,405 | 54.20 | 347,151.00 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 65,336 | 29.74 | 1,943,092.64 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 8,203 | 36.35 | 298,179.05 |
| STATE STREET CORP | 24,181 | 73.61 | 1,779,963.41 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 14,439 | 33.43 | 482,695.77 |

| | | | |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| VOYA FINANCIAL INC | 7,335 | 39.03 | 286,285.05 |
| ACE LTD | 18,785 | 104.84 | 1,969,419.40 |
| AFLAC | 25,294 | 58.47 | 1,478,940.18 |
| ALLEGHANY CORP | 856 | 419.57 | 359,151.92 |
| ALLSTATE CORP | 24,177 | 61.29 | 1,481,808.33 |
| AMERICAN INT'L GROUP | 76,337 | 54.17 | 4,135,175.29 |
| AON PLC | 15,294 | 87.51 | 1,338,377.94 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 6,848 | 54.72 | 374,722.56 |
| ASSURANT INC | 4,030 | 64.63 | 260,458.90 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 5,941 | 47.33 | 281,187.53 |
| CHUBB CORPORATION | 13,785 | 90.97 | 1,254,021.45 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 8,700 | 47.32 | 411,727.50 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 2,493 | 160.09 | 399,104.37 |
| FNF GROUP | 12,973 | 27.86 | 361,427.78 |
| GENWORTH FINANCIAL INC-CL A | 26,026 | 13.26 | 345,104.76 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS | 25,638 | 37.48 | 960,912.24 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 14,770 | 53.89 | 795,955.30 |
| LOEWS CORP | 19,467 | 41.98 | 817,224.66 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 30,418 | 52.48 | 1,596,336.64 |
| METLIFE INC | 52,795 | 53.91 | 2,846,178.45 |
| PARTNERRE LTD | 2,555 | 110.32 | 281,867.60 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 16,460 | 53.00 | 872,380.00 |
| PROGRESSIVE CORP | 29,765 | 25.49 | 758,709.85 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 25,605 | 89.10 | 2,281,405.50 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 2,183 | 100.22 | 218,780.26 |
| TORCHMARK CORP | 7,314 | 52.64 | 385,008.96 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 19,336 | 93.77 | 1,813,136.72 |
| UNUM GROUP | 14,141 | 34.77 | 491,682.57 |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 8,583 | 41.40 | 355,336.20 |
| WR BERKLEY CORP | 5,726 | 47.93 | 274,447.18 |
| XL GROUP PLC | 14,744 | 33.24 | 490,090.56 |
| CBRE GROUP INC-A | 16,827 | 30.01 | 504,978.27 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 7,466 | 37.64 | 281,020.24 |
| WEYERHAEUSER CO | 29,747 | 32.25 | 959,340.75 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 35,214 | 79.92 | 2,814,302.88 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 28,134 | 20.91 | 588,281.94 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 26,198 | 69.22 | 1,813,425.56 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES, INC | 10,430 | 59.74 | 623,088.20 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 3,073 | 250.96 | 771,200.08 |
| ANSYS INC | 5,240 | 75.72 | 396,772.80 |
| AUTODESK INC | 13,027 | 55.04 | 717,006.08 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 26,442 | 82.81 | 2,189,662.02 |

| | | | |
|----------------------------------------|---------|--------|---------------|
| CA INC | 18,733 | 27.64 | 517,780.12 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 9,212 | 71.01 | 654,144.12 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 33,561 | 44.37 | 1,489,101.57 |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 7,907 | 59.62 | 471,415.34 |
| EBAY | 63,407 | 52.66 | 3,339,012.62 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 17,764 | 35.78 | 635,595.92 |
| EQUINIX INC | 2,777 | 212.07 | 588,918.39 |
| FACEBOOK INC-A | 110,674 | 79.00 | 8,743,246.00 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 16,113 | 56.49 | 910,223.37 |
| FIREEYE INC | 3,393 | 31.45 | 106,709.85 |
| FISERV INC | 13,957 | 64.52 | 900,575.42 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 4,198 | 141.86 | 595,528.28 |
| GOOGLE INC-CL A | 15,634 | 587.81 | 9,189,821.54 |
| GOOGLE INC-CL C | 15,911 | 576.36 | 9,170,463.96 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 53,367 | 189.64 | 10,120,517.88 |
| INTUIT INC | 14,917 | 87.78 | 1,309,414.26 |
| LINKEDIN CORP - A | 5,865 | 210.38 | 1,233,878.70 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 55,768 | 74.52 | 4,155,831.36 |
| MICROSOFT CORP | 435,346 | 46.44 | 20,217,468.24 |
| NETSUITE INC | 1,707 | 89.49 | 152,759.43 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 14,585 | 15.12 | 220,598.12 |
| ORACLE CORP | 198,013 | 38.44 | 7,611,619.72 |
| PAYCHEX INC | 18,363 | 44.23 | 812,195.49 |
| RACKSPACE HOSTING INC | 6,900 | 32.38 | 223,422.00 |
| RED HAT INC | 10,641 | 55.49 | 590,469.09 |
| SALESFORCE.COM INC | 32,063 | 57.23 | 1,834,965.49 |
| SERVICENOW INC | 7,337 | 59.79 | 438,679.23 |
| SYMANTEC CORP | 39,120 | 23.41 | 915,994.80 |
| SYNOPSYS INC | 8,164 | 39.93 | 326,029.34 |
| TERADATA CORP | 8,368 | 41.90 | 350,619.20 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 9,333 | 30.63 | 285,869.79 |
| TWITTER INC | 18,184 | 51.74 | 940,840.16 |
| VANTIV INC - CL A | 8,373 | 31.08 | 260,232.84 |
| VERISIGN INC | 6,665 | 55.21 | 367,974.65 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 27,733 | 210.93 | 5,849,721.69 |
| VMWARE INC-CLASS A | 4,666 | 94.10 | 439,070.60 |
| WESTERN UNION CO | 28,486 | 16.17 | 460,618.62 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 5,373 | 82.77 | 444,723.21 |
| XEROX CORP | 59,126 | 13.24 | 782,828.24 |
| YAHOO | 53,456 | 40.52 | 2,166,037.12 |
| AMPHENOL CORPORATION | 8,935 | 101.84 | 909,940.40 |
| APPLE INC | 334,442 | 100.11 | 33,480,988.62 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| ARROW ELECTRONICS INC | 5,800 | 56.76 | 329,208.00 |
| AVNET INC | 7,613 | 41.97 | 319,517.61 |
| CISCO SYSTEMS | 284,419 | 25.12 | 7,144,605.28 |
| CORNING | 72,985 | 19.55 | 1,426,856.75 |
| EMC CORP | 113,823 | 28.83 | 3,281,517.09 |
| F5 NETWORKS INC | 4,271 | 119.16 | 508,932.36 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 33,519 | 10.35 | 346,921.65 |
| FLIR SYSTEMS INC | 6,867 | 31.67 | 217,477.89 |
| HARRIS CORP | 6,029 | 67.16 | 404,907.64 |
| HEWLETT-PACKARD CO | 105,326 | 34.97 | 3,683,250.22 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 24,010 | 22.18 | 532,541.80 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 12,591 | 63.18 | 795,499.38 |
| NETAPP INC | 18,444 | 42.44 | 782,763.36 |
| QUALCOMM | 93,710 | 74.82 | 7,011,382.20 |
| SANDISK CORP | 12,200 | 99.68 | 1,216,096.00 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 18,254 | 57.25 | 1,045,041.50 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 22,806 | 57.87 | 1,319,783.22 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 14,724 | 30.45 | 448,345.80 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 12,470 | 96.25 | 1,200,237.50 |
| AT&T INC | 287,688 | 35.23 | 10,135,248.24 |
| CENTURYLINK INC | 31,932 | 40.40 | 1,290,052.80 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 53,046 | 6.48 | 343,738.08 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 10,063 | 45.97 | 462,596.11 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 7,214 | 110.74 | 798,878.36 |
| SPRINT CORP | 41,934 | 6.35 | 266,280.90 |
| T-MOBILE US INC | 12,775 | 28.98 | 370,219.50 |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 229,504 | 49.75 | 11,417,824.00 |
| WINDSTREAM HOLDINGS INC | 33,150 | 10.64 | 352,716.00 |
| AES CORP | 37,287 | 14.21 | 529,848.27 |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 6,173 | 55.39 | 341,922.47 |
| AMEREN CORPORATION | 13,296 | 38.24 | 508,439.04 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 27,027 | 52.18 | 1,410,268.86 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 9,509 | 48.29 | 459,189.61 |
| CALPINE CORP | 21,395 | 21.83 | 467,052.85 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 22,554 | 24.46 | 551,670.84 |
| CMS ENERGY CORP | 14,951 | 29.52 | 441,353.52 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 16,373 | 56.53 | 925,565.69 |
| DOMINION RESOURCES | 32,334 | 68.48 | 2,214,232.32 |
| DTE ENERGY COMPANY | 9,457 | 75.96 | 718,353.72 |
| DUKE ENERGY CORP | 39,285 | 74.19 | 2,914,554.15 |
| EDISON INTL | 17,291 | 55.75 | 963,973.25 |
| ENTERGY CORP | 9,623 | 76.74 | 738,469.02 |

| | | | | |
|---------------------------|------------|--------|-------------------------------------|--|
| EXELON CORP | 47,825 | 34.11 | 1,631,310.75 | |
| FIRSTENERGY CORP | 23,517 | 33.97 | 798,872.49 | |
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC | 3,984 | 64.81 | 258,203.04 | |
| MDU RESOURCES GROUP INC | 10,361 | 27.76 | 287,621.36 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 24,241 | 93.60 | 2,268,957.60 | |
| NISOURCE INC | 16,828 | 40.84 | 687,255.52 | |
| NORTHEAST UTILITIES | 17,693 | 44.31 | 783,976.83 | |
| NRG ENERGY INC | 18,972 | 30.41 | 576,938.52 | |
| OGE ENERGY CORP | 11,103 | 37.10 | 411,921.30 | |
| PEPCO HOLDINGS INC | 14,374 | 26.91 | 386,804.34 | |
| PG&E CORP | 25,006 | 44.85 | 1,121,519.10 | |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 6,136 | 54.87 | 336,682.32 | |
| PPL CORPORATION | 35,241 | 32.94 | 1,160,838.54 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 28,258 | 37.65 | 1,063,913.70 | |
| SCANA CORP | 7,621 | 49.47 | 377,010.87 | |
| SEMPRA ENERGY | 12,741 | 104.83 | 1,335,639.03 | |
| SOUTHERN CO | 49,531 | 43.63 | 2,161,037.53 | |
| WISCONSIN ENERGY CORP | 12,243 | 42.87 | 524,857.41 | |
| XCEL ENERGY INC | 26,973 | 30.30 | 817,281.90 | |
| ALTERA CORPORATION | 17,227 | 35.93 | 618,966.11 | |
| ANALOG DEVICES | 17,466 | 49.81 | 869,981.46 | |
| APPLIED MATERIALS | 67,454 | 21.75 | 1,467,124.50 | |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD | 13,969 | 87.11 | 1,216,839.59 | |
| BROADCOM CORP-CL A | 30,085 | 40.65 | 1,222,955.25 | |
| CREE INC | 6,609 | 41.41 | 273,711.73 | |
| INTEL CORP | 276,290 | 34.90 | 9,642,521.00 | |
| KLA-TENCOR CORP | 8,938 | 79.84 | 713,654.61 | |
| LAM RESEARCH CORP | 8,750 | 75.23 | 658,262.50 | |
| LINER TECHNOLOGY CORP | 13,311 | 44.73 | 595,401.03 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP | 19,411 | 13.58 | 263,601.38 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 14,649 | 30.51 | 446,940.99 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 11,695 | 47.52 | 555,746.40 | |
| MICRON TECHNOLOGY | 59,619 | 34.50 | 2,056,855.50 | |
| NVIDIA CORP | 29,853 | 18.51 | 552,728.29 | |
| TEXAS INSTRUMENTS | 60,035 | 48.26 | 2,897,289.10 | |
| XILINX INC | 15,113 | 42.99 | 649,707.87 | |
| アメリカドル 小計 | 17,133,353 | | 999,799,514.47 (109,428,056,858) | |
| カナダドル | | | | |
| ALTAGAS INCOME LTD | 6,922 | 46.91 | 324,711.02 | |
| ARC RESOURCES LTD | 16,744 | 29.50 | 493,948.00 | |
| ATHABASCA OIL CORPORATION | 20,054 | 5.86 | 117,516.44 | |
| BAYTEX ENERGY CORP | 9,931 | 42.78 | 424,848.18 | |

| | | | |
|------------------------------|--------|-------|--------------|
| CAMECO CORP | 21,148 | 19.99 | 422,748.52 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 61,287 | 44.05 | 2,699,692.35 |
| CANADIAN OIL SANDS LTD | 26,085 | 21.00 | 547,785.00 |
| CENOVUS ENERGY INC | 41,890 | 30.31 | 1,269,685.90 |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 23,123 | 40.34 | 932,781.82 |
| ENBRIDGE | 46,889 | 53.81 | 2,523,097.09 |
| ENCANA CORP | 39,999 | 24.06 | 962,375.94 |
| ENERPLUS CORP | 10,454 | 21.34 | 223,088.36 |
| HUSKY ENERGY INC | 18,542 | 31.08 | 576,285.36 |
| IMPERIAL OIL | 15,870 | 53.55 | 849,838.50 |
| INTER PIPELINE LTD | 19,069 | 35.54 | 677,712.26 |
| KEYERA CORP | 4,917 | 88.71 | 436,187.07 |
| MEG ENERGY CORP | 8,375 | 35.00 | 293,125.00 |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP | 19,513 | 19.10 | 372,698.30 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 17,218 | 46.64 | 803,047.52 |
| PENGROWTH ENERGY CORP | 31,475 | 5.93 | 186,646.75 |
| PENN WEST PETROLEUM LTD | 23,074 | 7.65 | 176,516.10 |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 9,172 | 35.88 | 329,091.36 |
| SUNCOR ENERGY | 81,684 | 40.23 | 3,286,147.32 |
| TALISMAN ENERGY INC | 55,994 | 9.75 | 545,941.50 |
| TOURMALINE OIL CORP | 8,740 | 50.11 | 437,961.40 |
| TRANSCANADA CORP | 39,588 | 57.89 | 2,291,749.32 |
| VERMILION ENERGY INC | 5,975 | 67.69 | 404,447.75 |
| AGNICO EAGLE MINES | 12,166 | 33.11 | 402,816.26 |
| AGRIUM INC | 8,211 | 99.75 | 819,047.25 |
| BARRICK GOLD CORP | 64,321 | 16.71 | 1,074,803.91 |
| ELDORADO GOLD CORP | 45,613 | 7.62 | 347,571.06 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 33,888 | 21.72 | 736,047.36 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 9,259 | 54.82 | 507,578.38 |
| GOLDCORP INC | 44,754 | 26.03 | 1,164,946.62 |
| KINROSS GOLD CORP | 55,654 | 3.75 | 208,702.50 |
| METHANEX CORP | 5,075 | 76.71 | 389,303.25 |
| NEW GOLD INC | 29,614 | 6.02 | 178,276.28 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 47,586 | 38.96 | 1,853,950.56 |
| SILVER WHEATON CORP | 18,897 | 22.56 | 426,316.32 |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 32,900 | 21.08 | 693,532.00 |
| YAMANA GOLD INC | 47,555 | 6.79 | 322,898.45 |
| BOMBARDIER B | 71,394 | 3.74 | 267,013.56 |
| CAE INC | 12,079 | 13.36 | 161,375.44 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 8,970 | 32.11 | 288,026.70 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 8,077 | 51.72 | 417,742.44 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 45,214 | 79.42 | 3,590,895.88 |

| | | | |
|------------------------------------------|---------|--------|--------------|
| CP RAILWAY LIMITED | 9,769 | 228.58 | 2,232,998.02 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 11,784 | 110.14 | 1,297,889.76 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 7,067 | 60.92 | 430,521.64 |
| TIM HORTONS INC | 7,360 | 88.28 | 649,740.80 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 20,777 | 27.40 | 569,289.80 |
| THOMSON REUTERS CORP | 20,240 | 40.45 | 818,708.00 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 4,119 | 113.10 | 465,858.90 |
| DOLLARAMA INC | 3,609 | 95.00 | 342,855.00 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 24,251 | 35.36 | 857,515.36 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 2,863 | 76.77 | 219,792.51 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 13,323 | 55.75 | 742,757.25 |
| METRO INC | 4,535 | 73.94 | 335,317.90 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 2,658 | 87.76 | 233,266.08 |
| SAPUTO INC | 7,625 | 62.11 | 473,588.75 |
| CATAMARAN CORPORATION | 11,095 | 47.57 | 527,789.15 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 17,566 | 144.67 | 2,541,273.22 |
| BANK MONTREAL | 35,718 | 82.31 | 2,939,948.58 |
| BANK NOVA SCOTIA | 67,945 | 69.18 | 4,700,435.10 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK | 22,008 | 100.40 | 2,209,603.20 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 17,624 | 51.06 | 899,881.44 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 80,212 | 79.57 | 6,382,468.84 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 102,685 | 54.91 | 5,638,433.35 |
| CI FINANCIAL CORP | 12,608 | 33.96 | 428,167.68 |
| IGM FINANCIAL INC | 5,864 | 48.45 | 284,110.80 |
| ONEX CORP | 4,342 | 61.86 | 268,596.12 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,098 | 496.86 | 545,552.28 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 17,649 | 32.20 | 568,297.80 |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 5,185 | 46.23 | 239,702.55 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 7,059 | 72.41 | 511,142.19 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 102,884 | 21.63 | 2,225,380.92 |
| POWER CORP OF CANADA | 21,844 | 30.99 | 676,945.56 |
| POWER FINANCIAL CORP | 13,355 | 34.45 | 460,079.75 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 34,248 | 40.94 | 1,402,113.12 |
| BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A | 30,566 | 50.59 | 1,546,333.94 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 5,534 | 17.44 | 96,512.96 |
| CGI GROUP INC - CL A | 12,163 | 37.58 | 457,085.54 |
| OPEN TEXT CORP | 6,226 | 61.50 | 382,899.00 |
| BCE INC | 16,476 | 48.43 | 797,932.68 |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 19,886 | 41.85 | 832,229.10 |
| TELUS CORP | 16,454 | 38.18 | 628,213.72 |
| ATCO LTD -CLASS I | 4,000 | 45.37 | 181,480.00 |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 7,267 | 39.12 | 284,285.04 |

| | | | | |
|-----|-----------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| | FORTIS INC | 11,903 | 34.56 | 411,367.68 |
| | TRANSALTA CORP | 15,621 | 11.73 | 183,234.33 |
| | カナダドル 小計 | 2,152,024 | | 85,382,113.76 (8,370,862,433) |
| ユーロ | ENI | 140,108 | 18.47 | 2,587,794.76 |
| | FUGRO NV-CVA | 3,638 | 23.14 | 84,201.51 |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 21,031 | 12.92 | 271,720.52 |
| | NESTE OIL OYJ | 6,385 | 16.21 | 103,500.85 |
| | OMV AG | 8,150 | 26.82 | 218,583.00 |
| | REPSOL SA | 58,473 | 18.59 | 1,087,013.07 |
| | SAIPEM | 15,941 | 16.39 | 261,272.99 |
| | TECHNIP S.A. | 5,427 | 65.12 | 353,406.24 |
| | TENARIS SA | 25,624 | 17.95 | 459,950.80 |
| | TOTAL SA | 118,837 | 50.31 | 5,978,689.47 |
| | VOPAK | 3,622 | 42.32 | 153,283.04 |
| | AIR LIQUIDE | 19,229 | 95.26 | 1,831,754.54 |
| | AKZO NOBEL | 13,736 | 53.75 | 738,310.00 |
| | ARCELORMITTAL | 57,628 | 10.89 | 627,857.06 |
| | ARKEMA | 3,184 | 53.31 | 169,739.04 |
| | BASF SE | 50,963 | 72.41 | 3,690,230.83 |
| | CRH | 43,255 | 17.83 | 771,236.65 |
| | FUCHS PETROLUB SE -PREF | 4,228 | 29.81 | 126,036.68 |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 7,624 | 52.32 | 398,887.68 |
| | IMERYS SA | 1,975 | 57.71 | 113,977.25 |
| | K+S AG | 9,866 | 22.37 | 220,702.42 |
| | KONINKLIJKE DSM NV | 9,909 | 48.70 | 482,617.84 |
| | LAFARGE (FRANCE) | 10,743 | 56.72 | 609,342.96 |
| | LANXESS | 4,818 | 43.94 | 211,727.01 |
| | LINDE AG | 10,142 | 150.90 | 1,530,427.80 |
| | SOLVAY SA | 3,155 | 119.45 | 376,864.75 |
| | STORA ENSO OYJ R | 31,297 | 6.43 | 201,239.71 |
| | THYSSEN KRUPP | 24,299 | 20.73 | 503,718.27 |
| | UMICORE | 5,353 | 35.30 | 188,960.90 |
| | UPM KYMMENE CORP | 27,512 | 11.12 | 305,933.44 |
| | VOESTALPINE AG | 5,461 | 31.40 | 171,475.40 |
| | ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 10,407 | 30.21 | 314,395.47 |
| | AIRBUS GROUP NV | 32,370 | 48.55 | 1,571,725.35 |
| | ALSTOM RGPT | 11,643 | 27.00 | 314,361.00 |
| | ANDRITZ AG | 3,496 | 42.25 | 147,706.00 |
| | BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 4,427 | 44.75 | 198,108.25 |
| | BOUYGUES ORD | 9,712 | 25.24 | 245,130.88 |
| | BRENNTAG AG | 8,349 | 38.16 | 318,639.58 |

| | | | |
|------------------------------------|--------|--------|--------------|
| CNH INDUSTRIAL NV | 50,975 | 6.16 | 314,260.87 |
| FERROVIAL SA | 22,078 | 15.17 | 335,033.65 |
| FINMECCANICA SPA | 21,154 | 7.53 | 159,395.39 |
| GEA GROUP AG | 9,866 | 34.50 | 340,377.00 |
| HOCHTIEF AG | 1,223 | 54.39 | 66,518.97 |
| KONE OYJ-B | 16,796 | 31.40 | 527,394.40 |
| KONINKLIJKE PHILIPS | 54,323 | 24.88 | 1,351,827.85 |
| LEGRAND SA | 14,256 | 40.80 | 581,716.08 |
| MAN SE | 1,667 | 89.07 | 148,479.69 |
| METSO OYJ | 6,575 | 28.19 | 185,349.25 |
| OCI NV | 5,400 | 24.70 | 133,380.00 |
| OSRAM LICHT AG | 4,722 | 29.64 | 139,983.69 |
| PRYSMIAN SPA | 10,872 | 14.38 | 156,339.36 |
| REXEL SA | 14,819 | 14.85 | 220,136.24 |
| SAFRAN SA | 15,330 | 50.25 | 770,332.50 |
| SAINT-GOBAIN | 25,021 | 35.83 | 896,627.53 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 28,878 | 59.90 | 1,729,792.20 |
| SIEMENS | 43,991 | 93.42 | 4,109,639.22 |
| THALES SA | 4,601 | 40.95 | 188,433.95 |
| VALLOUREC | 5,583 | 35.98 | 200,904.25 |
| VINCI S.A. | 26,958 | 45.39 | 1,223,623.62 |
| WARTSILA OYJ | 9,741 | 35.13 | 342,201.33 |
| ZARDOYA OTIS SA | 10,201 | 9.76 | 99,561.76 |
| ZODIAC AEROSPACE | 10,962 | 24.76 | 271,419.12 |
| BUREAU VERITAS SA | 11,149 | 17.37 | 193,658.13 |
| EDENRED | 11,350 | 19.52 | 221,552.00 |
| RANDSTAD HOLDING NV | 6,762 | 36.86 | 249,281.13 |
| SOCIETE BIC SA | 1,437 | 104.30 | 149,879.10 |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS | 22,413 | 15.52 | 347,849.76 |
| ADP | 1,728 | 94.91 | 164,004.48 |
| ATLANTIA SPA | 23,265 | 19.24 | 447,618.60 |
| BOLLORE | 311 | 449.45 | 139,778.95 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 12,159 | 12.51 | 152,109.09 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 53,908 | 25.22 | 1,359,829.30 |
| FRAPORT AG | 2,319 | 51.80 | 120,124.20 |
| GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR | 25,823 | 9.59 | 247,874.97 |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE | 56,869 | 4.71 | 268,137.33 |
| TNT EXPRESS | 22,191 | 4.96 | 110,111.74 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 18,383 | 85.21 | 1,566,415.43 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 2,666 | 65.04 | 173,396.64 |
| CONTINENTAL AG | 6,136 | 152.65 | 936,660.40 |
| DAIMLER AG | 53,446 | 60.54 | 3,235,620.84 |

| | | | |
|----------------------------------------|--------|--------|--------------|
| FIAT ORD | 47,091 | 7.91 | 372,489.81 |
| MICHELIN | 10,471 | 74.73 | 782,497.83 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 6,178 | 24.04 | 148,519.12 |
| PEUGEOT SA | 20,500 | 10.26 | 210,432.50 |
| PIRELLI & CO | 16,123 | 10.87 | 175,257.01 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 8,590 | 64.03 | 550,017.70 |
| RENAULT SA | 10,938 | 58.91 | 644,357.58 |
| VALEO SA | 3,978 | 89.66 | 356,667.48 |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 8,885 | 164.90 | 1,465,136.50 |
| VOLKSWAGEN STAMM | 1,589 | 164.25 | 260,993.25 |
| ADIDAS AG | 11,778 | 59.41 | 699,730.98 |
| CHRISTIAN DIOR | 3,139 | 132.55 | 416,074.45 |
| HUGO BOSS AG | 1,699 | 99.55 | 169,135.45 |
| KERING | 4,084 | 160.05 | 653,644.20 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 9,028 | 40.08 | 361,842.24 |
| LVMH | 15,605 | 128.85 | 2,010,704.25 |
| ACCOR | 9,315 | 34.90 | 325,093.50 |
| SODEXO | 5,007 | 76.88 | 384,938.16 |
| ALTICE SA | 4,516 | 42.07 | 189,988.12 |
| AXEL SPRINGER SE | 2,489 | 43.54 | 108,371.06 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 9,179 | 25.29 | 232,182.80 |
| JC DECAUX SA | 3,121 | 24.89 | 77,697.29 |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 1,323 | 105.35 | 139,378.05 |
| LAGADERE S.C.A | 5,564 | 20.73 | 115,369.54 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED | 11,754 | 31.95 | 375,540.30 |
| PUBLICIS GROUPE | 10,377 | 54.01 | 560,461.77 |
| REED ELSEVIER NV | 37,555 | 18.04 | 677,679.97 |
| RTL GROUP | 2,054 | 68.43 | 140,571.65 |
| SES | 17,418 | 27.52 | 479,430.45 |
| SKY DEUTSCHLAND AG | 23,240 | 6.73 | 156,405.20 |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 3,220 | 45.80 | 147,492.10 |
| WOLTERS KLUWER | 17,586 | 21.11 | 371,240.46 |
| INDITEX | 61,900 | 21.53 | 1,332,707.00 |
| CARREFOUR | 34,573 | 24.32 | 840,815.36 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 2,860 | 86.04 | 246,074.40 |
| COLRUYT SA | 4,415 | 34.32 | 151,544.87 |
| DELHAIZE GROUP | 5,268 | 54.76 | 288,475.68 |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT | 33,359 | 5.75 | 191,814.25 |
| JERONIMO MARTINS | 15,262 | 8.79 | 134,290.33 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 53,287 | 12.77 | 680,474.99 |
| METRO STAMM | 8,530 | 26.15 | 223,059.50 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV | 44,861 | 87.28 | 3,915,468.08 |

| | | | |
|-------------------------------------|-----------|--------|--------------|
| DANONE (GROUPE) | 32,350 | 52.20 | 1,688,670.00 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 5,452 | 52.09 | 283,994.68 |
| HEINEKEN NV | 13,208 | 58.44 | 771,875.52 |
| KERRY GROUP PLC-A | 9,660 | 55.63 | 537,385.80 |
| PERNOD-RICARD | 11,807 | 88.23 | 1,041,731.61 |
| REMY COINTREAU | 1,575 | 56.73 | 89,349.75 |
| UNILEVER NV-CVA | 89,688 | 31.10 | 2,789,296.80 |
| BEIERSDORF AG | 5,460 | 66.23 | 361,615.80 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 6,146 | 73.94 | 454,435.24 |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD | 9,997 | 78.87 | 788,463.39 |
| LOREAL | 14,049 | 124.40 | 1,747,695.60 |
| CELESIO AG | 2,526 | 26.55 | 67,065.30 |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 11,413 | 85.40 | 974,670.20 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | 12,131 | 54.23 | 657,864.13 |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 21,138 | 38.88 | 821,845.44 |
| BAYER | 45,872 | 109.00 | 5,000,048.00 |
| GRIFOLS SA | 8,679 | 32.13 | 278,899.66 |
| MERCK KGAA | 7,010 | 72.30 | 506,823.00 |
| ORION OYJ-CLASS B | 5,839 | 30.95 | 180,717.05 |
| QIAGEN N.V. | 13,359 | 18.20 | 243,200.59 |
| SANOFI | 65,890 | 87.61 | 5,772,622.90 |
| UCB (GROUPE) | 7,379 | 71.95 | 530,919.05 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA | 336,042 | 9.40 | 3,158,794.80 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA-RTS | 336,042 | 0.07 | 26,211.27 |
| BANCO DE SABADELL SA | 187,781 | 2.29 | 431,332.95 |
| BANCO SANTANDER SA | 684,053 | 7.52 | 5,144,762.61 |
| BCP BANCO COMERCIAL NOM | 1,846,500 | 0.10 | 189,266.25 |
| BNP PARIBAS | 60,227 | 52.08 | 3,136,622.16 |
| CAIXABANK | 104,851 | 4.75 | 498,147.10 |
| COMMERZBANK AG | 55,471 | 11.72 | 650,397.47 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 58,121 | 11.76 | 683,502.96 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 17,314 | 18.00 | 311,652.00 |
| ING GROEP NV-CVA | 219,975 | 11.18 | 2,460,420.37 |
| INTESA SANPAOLO | 673,394 | 2.38 | 1,602,677.72 |
| INTESA SANPAOLO-RNC | 65,000 | 2.09 | 135,850.00 |
| KBC GROEP NV | 14,819 | 42.15 | 624,694.94 |
| NATIXIS | 55,840 | 5.33 | 297,906.40 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 5,746 | 17.33 | 99,606.91 |
| SOCIETE GENERALE | 41,178 | 40.00 | 1,647,120.00 |
| UNICREDIT SPA | 256,128 | 6.09 | 1,559,819.52 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC | 45,851 | 6.37 | 292,300.12 |
| DEUTSCHE BANK NAMEN | 78,373 | 27.49 | 2,154,473.77 |

| | | | |
|------------------------------------------|---------|--------|--------------|
| DEUTSCHE BOERSE | 11,065 | 53.43 | 591,202.95 |
| EURAZEO | 2,073 | 56.50 | 117,124.50 |
| EXOR SPA | 5,807 | 30.37 | 176,358.59 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 4,236 | 71.86 | 304,398.96 |
| MEDIOBANCA | 30,462 | 6.59 | 200,896.89 |
| WENDEL | 1,898 | 89.58 | 170,022.84 |
| AEGON | 98,534 | 6.58 | 648,649.32 |
| AGEAS | 11,969 | 26.18 | 313,348.42 |
| ALLIANZ SE-REG | 25,896 | 128.50 | 3,327,636.00 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 68,275 | 16.28 | 1,111,517.00 |
| AXA | 103,648 | 19.42 | 2,013,362.40 |
| CNP ASSURANCES | 8,550 | 14.77 | 126,326.25 |
| DELTA LLOYD NV | 11,075 | 18.85 | 208,763.75 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 3,252 | 63.81 | 207,510.12 |
| MAPFRE SA | 65,064 | 2.78 | 181,268.30 |
| MUENCHENER RUECKVERSICH. | 9,958 | 155.55 | 1,548,966.90 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 25,265 | 38.50 | 972,702.50 |
| SCOR SE | 7,779 | 24.51 | 190,702.18 |
| UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA | 47,000 | 2.26 | 106,220.00 |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH | 2,264 | 35.85 | 81,164.40 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 16,145 | 16.92 | 273,254.12 |
| IMMOFINANZ AG | 55,175 | 2.26 | 124,861.02 |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 20,889 | 29.29 | 611,838.81 |
| ATOS | 4,325 | 57.04 | 246,698.00 |
| CAP GEMINI SA | 7,599 | 56.27 | 427,595.73 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 7,319 | 51.74 | 378,685.06 |
| GEMALTO | 4,231 | 72.60 | 307,170.60 |
| SAP SE | 51,156 | 57.09 | 2,920,496.04 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 6,685 | 33.48 | 223,813.80 |
| ALCATEL-LUCENT | 148,862 | 2.49 | 370,964.10 |
| NOKIA CORP | 208,267 | 6.75 | 1,406,843.58 |
| BELGACOM | 7,760 | 27.53 | 213,632.80 |
| DEUTSCHE TELEKOM | 172,139 | 11.91 | 2,050,175.49 |
| ELISA A | 7,061 | 20.94 | 147,857.34 |
| ILIAD SA | 1,349 | 164.70 | 222,180.30 |
| KPN (KON.) | 171,949 | 2.52 | 433,483.42 |
| ORANGE | 103,983 | 11.58 | 1,204,643.05 |
| TELECOM ITALIA ORD | 544,541 | 0.90 | 495,260.03 |
| TELECOM ITALIA RNC | 319,440 | 0.70 | 225,684.36 |
| TELEFONICA | 226,971 | 12.12 | 2,750,888.52 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 16,719 | 4.18 | 70,019.17 |
| TELEKOM AUSTRIA AG | 10,225 | 7.13 | 72,975.82 |

| | | | | |
|---------|------------------------------|------------|-------|------------------------------------|
| | VIVENDI | 67,109 | 19.04 | 1,277,755.36 |
| | ZIGGO NV | 8,822 | 37.20 | 328,178.40 |
| | E.ON SE | 111,232 | 14.25 | 1,585,056.00 |
| | ELECTRICITE DE FRANCE | 12,365 | 25.72 | 318,027.80 |
| | ENAGAS | 12,914 | 25.49 | 329,177.86 |
| | ENEL | 366,443 | 4.12 | 1,511,943.81 |
| | ENEL GREEN POWER SPA | 92,686 | 1.99 | 185,001.25 |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 128,233 | 3.42 | 439,710.95 |
| | FORTUM OYJ | 23,610 | 19.26 | 454,728.60 |
| | GAS NATURAL SDG SA | 19,183 | 23.15 | 444,182.36 |
| | GDF SUEZ | 79,995 | 19.44 | 1,555,502.77 |
| | IBERDROLA SA | 289,911 | 5.57 | 1,616,253.82 |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 5,917 | 66.98 | 396,320.66 |
| | RWE STAMM | 27,778 | 30.30 | 841,812.29 |
| | SNAM SPA | 110,056 | 4.36 | 480,284.38 |
| | SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 14,532 | 13.15 | 191,168.46 |
| | TERNA SPA | 83,672 | 3.93 | 328,998.30 |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 25,206 | 13.62 | 343,431.75 |
| | ASML HOLDING NV | 19,998 | 78.56 | 1,571,042.88 |
| | INFINEON TECHNOLOGIES | 63,332 | 8.47 | 536,422.04 |
| | STMICROELECTRONICS | 32,158 | 5.99 | 192,915.84 |
| | ユーロ 小計 | 11,983,379 | | 167,681,046.09 (23,285,866,870) |
| イギリスポンド | AMEC PLC | 15,243 | 11.08 | 168,892.44 |
| | BG GROUP | 189,615 | 11.45 | 2,172,039.82 |
| | BP PLC | 1,022,848 | 4.56 | 4,667,766.84 |
| | PETROFAC LTD | 12,770 | 10.39 | 132,680.30 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 218,123 | 23.60 | 5,147,702.80 |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 135,505 | 24.49 | 3,318,517.45 |
| | TULLOW OIL PLC | 47,460 | 6.56 | 311,337.60 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 77,180 | 13.84 | 1,068,171.20 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 19,350 | 7.18 | 139,029.75 |
| | BHP BILLITON PLC | 115,779 | 17.20 | 1,991,977.69 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 6,661 | 20.58 | 137,083.38 |
| | FRESNILLO PLC | 9,483 | 7.60 | 72,118.21 |
| | GLENCORE PLC | 590,774 | 3.39 | 2,005,677.73 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 10,991 | 29.34 | 322,475.94 |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 4,501 | 42.49 | 191,247.49 |
| | REXAM PLC | 36,243 | 4.96 | 179,946.49 |
| | RIO TINTO PLC REG | 69,842 | 30.51 | 2,130,879.42 |
| | BAE SYSTEMS PLC | 169,479 | 4.70 | 796,890.25 |
| | BUNZL PLC | 17,199 | 16.10 | 276,903.90 |

| | | | |
|------------------------------|---------|-------|--------------|
| COBHAM PLC | 56,036 | 2.89 | 162,280.25 |
| IMI PLC | 14,701 | 12.53 | 184,203.53 |
| MEGGITT PLC | 40,649 | 4.55 | 184,952.95 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 56,502 | 2.37 | 134,135.74 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 104,281 | 9.67 | 1,008,918.67 |
| SMITHS GROUP PLC | 21,067 | 12.50 | 263,337.50 |
| TRAVIS PERKINS PLC | 15,233 | 16.87 | 256,980.71 |
| WEIR GROUP PLC/THE | 11,331 | 25.41 | 287,920.71 |
| WOLSELEY LTD | 15,365 | 32.57 | 500,438.05 |
| AGGREKO PLC | 15,329 | 15.76 | 241,585.04 |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 26,521 | 10.81 | 286,692.01 |
| CAPITA GROUP PLC | 35,312 | 11.69 | 412,797.28 |
| EXPERIAN PLC | 56,829 | 9.86 | 560,333.94 |
| G4S PLC | 76,673 | 2.50 | 191,682.50 |
| INTERTEK GROUP PLC | 8,601 | 25.67 | 220,787.67 |
| EASYJET PLC | 7,667 | 13.81 | 105,881.27 |
| ROYAL MAIL PLC | 36,948 | 3.98 | 147,200.83 |
| NEW GKN | 87,889 | 3.26 | 286,606.02 |
| BURBERRY GROUP PLC | 23,806 | 15.13 | 360,184.78 |
| PERSIMMON PLC | 15,599 | 13.43 | 209,494.57 |
| CARNIVAL PLC | 9,460 | 24.77 | 234,324.20 |
| COMPASS GROUP PLC | 93,947 | 9.84 | 924,438.48 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 12,916 | 23.62 | 305,075.92 |
| TUI TRAVEL PLC | 20,444 | 3.88 | 79,363.60 |
| WHITBREAD PLC | 9,667 | 41.79 | 403,983.93 |
| WILLIAM HILL | 44,403 | 3.72 | 165,267.96 |
| BRITISH SKY BROADCASTING | 58,230 | 8.84 | 514,753.20 |
| ITV PLC | 200,934 | 2.11 | 424,171.67 |
| PEARSON | 46,597 | 12.25 | 570,813.25 |
| REED ELSEVIER PLC | 61,631 | 9.94 | 612,920.29 |
| WPP PLC | 75,482 | 12.59 | 950,318.38 |
| ASOS PLC | 3,098 | 21.55 | 66,761.90 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 49,500 | 3.66 | 181,170.00 |
| KINGFISHER PLC | 123,985 | 3.20 | 397,619.89 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 87,223 | 4.15 | 362,324.34 |
| NEXT PLC | 8,675 | 68.65 | 595,538.75 |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 14,452 | 6.34 | 91,625.68 |
| MORRISON SUPERMARKETS | 118,741 | 1.69 | 201,503.47 |
| SAINSBURY (J) PLC | 63,963 | 2.47 | 158,180.49 |
| TESCO | 447,464 | 1.87 | 840,337.39 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 20,051 | 25.63 | 513,907.13 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 103,990 | 35.02 | 3,641,729.80 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|-------|--------------|
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 11,262 | 13.42 | 151,136.04 |
| DIAGEO | 139,613 | 17.62 | 2,460,679.12 |
| IMPERIAL-TOBACCO GROUP | 52,877 | 26.40 | 1,395,952.80 |
| SABMILLER PLC | 53,676 | 34.22 | 1,836,792.72 |
| TATE & LYLE | 23,966 | 5.97 | 143,196.85 |
| UNILEVER PLC | 71,420 | 25.61 | 1,829,066.20 |
| RECKITT BENCKISER PLC | 36,191 | 53.65 | 1,941,647.15 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 48,397 | 10.33 | 499,941.01 |
| ASTRAZENECA | 70,116 | 44.46 | 3,117,357.36 |
| GLAXOSMITHKLINE | 269,576 | 14.20 | 3,829,327.08 |
| SHIRE PLC | 32,198 | 53.65 | 1,727,422.70 |
| BARCLAYS | 932,153 | 2.26 | 2,106,665.78 |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 1,080,679 | 6.35 | 6,862,311.65 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 3,243,407 | 0.76 | 2,481,206.35 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND | 144,608 | 3.61 | 522,613.31 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 140,414 | 11.55 | 1,622,483.77 |
| 3I GROUP PLC | 49,028 | 3.83 | 188,169.46 |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 50,274 | 3.99 | 200,593.26 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 14,209 | 9.37 | 133,209.37 |
| ICAP PLC | 32,393 | 3.95 | 128,179.10 |
| INVESTEC PLC | 30,876 | 5.20 | 160,709.58 |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 9,458 | 18.92 | 178,945.36 |
| SCHRODERS PLC | 7,932 | 24.03 | 190,605.96 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 11,529 | 12.81 | 147,686.49 |
| AVIVA PIC | 168,565 | 5.33 | 898,451.45 |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 90,720 | 2.99 | 271,343.52 |
| FRIENDS LIFE GROUP LTD | 74,378 | 3.11 | 231,836.22 |
| LEGAL & GENERAL GROUP | 338,689 | 2.33 | 792,193.57 |
| OLD MUTUAL PLC | 281,850 | 1.82 | 514,376.25 |
| PRUDENTIAL | 145,747 | 14.14 | 2,061,591.31 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 54,813 | 4.84 | 265,678.61 |
| STANDARD LIFE PLC | 137,712 | 4.15 | 572,606.49 |
| SAGE GROUP PLC | 58,315 | 3.69 | 215,648.87 |
| BT GROUP PLC | 437,434 | 3.82 | 1,670,997.88 |
| INMARSAT PLC | 23,362 | 7.09 | 165,753.39 |
| VODAFONE GROUP PLC | 1,450,335 | 2.06 | 2,998,567.61 |
| CENTRICA PLC | 282,265 | 3.06 | 865,989.02 |
| NATIONAL GRID PLC | 204,486 | 8.86 | 1,812,768.39 |
| SEVERN TRENT PLC | 12,322 | 18.77 | 231,283.94 |
| SSE PLC | 54,596 | 15.39 | 840,232.44 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 36,246 | 8.11 | 293,955.06 |
| ARM HOLDINGS PLC | 80,006 | 9.24 | 739,655.47 |

| | | | | |
|---------------------------|-----------------------------------|------------|--------------|-----------------------------------|
| | イギリスポンド 小計 | 15,658,331 | | 92,772,710.40 (16,489,421,546) |
| スイスフラン | TRANSOCEAN LTD | 20,383 | 30.95 | 630,853.85 |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 477 | 396.50 | 189,130.50 |
| | GIVAUDAN-REG | 496 | 1,517.00 | 752,432.00 |
| | HOLCIM LTD | 13,020 | 68.85 | 896,427.00 |
| | SIKA AG-BR | 122 | 3,299.00 | 402,478.00 |
| | SYNGENTA AG | 5,198 | 304.60 | 1,583,310.80 |
| | ABB LTD | 121,692 | 21.43 | 2,607,859.56 |
| | GEBERIT AG-REG | 2,055 | 307.40 | 631,707.00 |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1,042 | 127.10 | 132,438.20 |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2,485 | 129.10 | 320,813.50 |
| | SULZER AG-REG | 1,193 | 118.50 | 141,370.50 |
| | ADECCO | 9,605 | 64.50 | 619,522.50 |
| | SGS SA | 296 | 1,971.00 | 583,416.00 |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 2,767 | 118.90 | 328,996.30 |
| | CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 28,798 | 79.00 | 2,275,042.00 |
| | SWATCH GROUP AG(BEARER) | 1,731 | 453.80 | 785,527.80 |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 2,872 | 84.15 | 241,678.80 |
| | ARYZTA AG | 4,970 | 81.00 | 402,570.00 |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 132 | 1,053.00 | 138,996.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 49 | 4,700.00 | 230,300.00 |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-REG | 6 | 56,115.00 | 336,690.00 |
| | NESTLE SA - REGISTERED | 178,746 | 69.60 | 12,440,721.60 |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 3,056 | 151.70 | 463,595.20 |
| | ACTELION LTD-REG | 5,535 | 111.10 | 614,938.50 |
| | LONZA GROUP AG-REG | 2,757 | 114.60 | 315,952.20 |
| | NOVARTIS | 127,525 | 89.10 | 11,362,477.50 |
| | ROCHE HOLDING GENUSS | 38,950 | 280.70 | 10,933,265.00 |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG | 86,270 | 26.25 | 2,264,587.50 |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 12,321 | 42.65 | 525,490.65 |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 1,896 | 75.05 | 142,294.80 |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 936 | 252.25 | 236,106.00 |
| UBS AG-REG | 207,372 | 16.73 | 3,469,333.56 | |
| BALOISE HOLDING AG | 2,556 | 122.60 | 313,365.60 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 1,866 | 228.20 | 425,821.20 | |
| SWISS RE LTD | 19,716 | 76.20 | 1,502,359.20 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 8,493 | 284.20 | 2,413,710.60 | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 2,934 | 70.45 | 206,700.30 | |
| SWISSCOM | 1,313 | 540.00 | 709,020.00 | |
| | スイスフラン 小計 | 921,631 | | 62,571,299.72 (7,200,079,458) |

| | | | | | |
|----------------------------|---------------------------------|-----------|---------------|-----------------------------------|--|
| スウェーデンクローナ | LUNDIN PETROLEUM AB | 11,307 | 122.00 | 1,379,454.00 | |
| | BOLIDEN AB | 13,292 | 115.30 | 1,532,567.60 | |
| | ALFA LAVAL AB | 16,494 | 150.60 | 2,483,996.40 | |
| | ASSA ABLOY B | 18,561 | 371.60 | 6,897,267.60 | |
| | ATLAS COPCO A | 37,674 | 205.10 | 7,726,937.40 | |
| | ATLAS COPCO B | 20,730 | 185.70 | 3,849,561.00 | |
| | SANDVIK AB | 61,350 | 81.75 | 5,015,362.50 | |
| | SKANSKA B | 19,200 | 144.90 | 2,782,080.00 | |
| | SKF AB-B | 21,056 | 151.10 | 3,181,561.60 | |
| | VOLVO B | 85,885 | 78.10 | 6,707,618.50 | |
| | SECURITAS B | 15,190 | 78.70 | 1,195,453.00 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 13,627 | 195.40 | 2,662,715.80 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 19,855 | 49.90 | 990,764.50 | |
| | HENNES & MAURITZ B | 53,975 | 297.50 | 16,057,562.50 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 10,523 | 234.20 | 2,464,486.60 | |
| | SCA SV CELLULOSA B | 34,934 | 171.10 | 5,977,207.40 | |
| | ELEKTA AB-B SHS | 21,103 | 71.50 | 1,508,864.50 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 10,818 | 180.00 | 1,947,240.00 | |
| | NORDEA BANK AB | 175,639 | 92.45 | 16,237,825.55 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 86,262 | 94.80 | 8,177,637.60 | |
| | SVENSKA HANDELSBK A | 28,176 | 336.90 | 9,492,494.40 | |
| | SWEDBANK AB-A | 51,153 | 180.70 | 9,243,347.10 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 7,453 | 125.20 | 933,115.60 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 25,163 | 254.80 | 6,411,532.40 | |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 12,549 | 248.00 | 3,112,152.00 | | |
| ERICSSON (LM) B | 167,687 | 90.35 | 15,150,520.45 | | |
| HEXAGON AB-B SHS | 13,502 | 229.00 | 3,091,958.00 | | |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 3,309 | 584.50 | 1,934,110.50 | | |
| TELE2 AB-B SHS | 15,978 | 87.35 | 1,395,678.30 | | |
| TELIASONERA AB | 135,081 | 50.15 | 6,774,312.15 | | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 1,207,526 | | 156,315,384.95 (2,363,488,620) | |
| ノルウェークローネ | AKASTOR ASA | 8,029 | 25.71 | 206,425.59 | |
| | AKER SOLUTIONS HOLDING ASA | 8,029 | 65.35 | 524,695.15 | |
| | SEADRILL LTD | 20,267 | 173.00 | 3,506,191.00 | |
| | STATOIL ASA | 61,271 | 174.60 | 10,697,916.60 | |
| | SUBSEA 7 SA | 18,360 | 89.20 | 1,637,712.00 | |
| | NORSK HYDRO | 69,507 | 35.54 | 2,470,278.78 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 9,529 | 318.70 | 3,036,892.30 | |
| | ORKLA | 48,294 | 57.80 | 2,791,393.20 | |
| | DNB ASA | 57,856 | 120.40 | 6,965,862.40 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 10,106 | 136.50 | 1,379,469.00 | |

| | | | | |
|------------------------|-----------------------------|---------|------------|----------------------------------|
| | TELENOR ASA | 41,786 | 141.20 | 5,900,183.20 |
| | ノルウェークローネ 小計 | 353,034 | | 39,117,019.22 (664,206,986) |
| デンマーククローネ | NOVOZYMES A/S | 12,663 | 256.60 | 3,249,325.80 |
| | VESTAS WIND SYSEMS | 11,858 | 230.80 | 2,736,826.40 |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 218 | 13,750.00 | 2,997,500.00 |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 400 | 14,110.00 | 5,644,000.00 |
| | DSV A/S | 9,332 | 167.50 | 1,563,110.00 |
| | PANDORA A/S | 6,120 | 458.70 | 2,807,244.00 |
| | CARLSBERG AS-B | 6,289 | 522.00 | 3,282,858.00 |
| | COLOPLAST-B | 6,299 | 482.90 | 3,041,787.10 |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 1,484 | 451.00 | 669,284.00 |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 111,405 | 284.00 | 31,639,020.00 |
| | DANSKE BANK A/S | 37,532 | 159.50 | 5,986,354.00 |
| | TRYG A/S | 1,289 | 611.50 | 788,223.50 |
| | TDC A/S | 41,126 | 44.99 | 1,850,258.74 |
| | デンマーククローネ 小計 | 246,015 | | 66,255,791.54 (1,236,333,070) |
| オーストラリアドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 8,489 | 28.01 | 237,776.89 |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 62,386 | 14.75 | 920,193.50 |
| | SANTOS | 52,200 | 13.68 | 714,096.00 |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 41,493 | 40.53 | 1,681,711.29 |
| | WORLEYPARSONS LTD | 10,573 | 15.50 | 163,881.50 |
| | ALUMINA LIMITED | 119,523 | 1.75 | 209,165.25 |
| | AMCOR | 65,010 | 11.34 | 737,213.40 |
| | BHP BILLITON LTD | 178,351 | 33.72 | 6,013,995.72 |
| | BORAL LIMITED | 46,867 | 5.01 | 234,803.67 |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 90,478 | 3.41 | 308,529.98 |
| | ILUKA RESOURCES LTD | 21,335 | 8.07 | 172,173.45 |
| | INCITEC PIVOT LTD | 83,630 | 2.75 | 229,982.50 |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 22,623 | 11.96 | 270,571.08 |
| | NEWCREST MINING LIMITED | 40,479 | 10.38 | 420,172.02 |
| | ORICA LTD | 19,603 | 18.95 | 371,476.85 |
| | RIO TINTO LTD | 24,419 | 59.21 | 1,445,848.99 |
| | LEIGHTON HOLDINGS LIMITED | 5,336 | 19.89 | 106,133.04 |
| | ALS LTD | 21,808 | 5.36 | 116,890.88 |
| | BRAMBLES LTD | 88,563 | 9.61 | 851,090.43 |
| | SEEK LTD | 15,860 | 16.28 | 258,200.80 |
| ASCIANO GROUP | 51,076 | 6.03 | 307,988.28 | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 116,448 | 4.50 | 524,016.00 | |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 77,149 | 1.42 | 109,551.58 | |
| TOLL HOLDINGS LIMITED | 41,707 | 5.67 | 236,478.69 | |

| | | | | |
|------------|--------------------------------|-----------|-------|----------------------------------|
| | TRANSURBAN GROUP | 102,119 | 7.66 | 782,231.54 |
| | CROWN RESORTS LTD | 21,269 | 13.86 | 294,788.34 |
| | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 3,263 | 42.60 | 139,003.80 |
| | TABCORP HOLDINGS | 45,765 | 3.59 | 164,296.35 |
| | TATTS GROUP LTD | 77,050 | 3.12 | 240,396.00 |
| | REA GROUP LTD | 2,513 | 42.55 | 106,928.15 |
| | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 30,812 | 3.57 | 109,998.84 |
| | METCASH LTD | 55,380 | 2.62 | 145,095.60 |
| | WESFARMERS LIMITED | 63,732 | 42.21 | 2,690,127.72 |
| | WOOLWORTHS LTD | 70,142 | 34.10 | 2,391,842.20 |
| | COCA-COLA AMATIL LIMITED | 28,004 | 8.83 | 247,275.32 |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 38,552 | 4.50 | 173,484.00 |
| | COCHLEAR LIMITED | 2,709 | 68.11 | 184,509.99 |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 7,646 | 49.57 | 379,012.22 |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 21,648 | 17.50 | 378,840.00 |
| | CSL LIMITED | 26,484 | 73.44 | 1,944,984.96 |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 152,524 | 30.53 | 4,656,557.72 |
| | BANK OF QUEENSLAND LTD | 18,181 | 11.61 | 211,081.41 |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 23,591 | 11.90 | 280,732.90 |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 90,017 | 74.43 | 6,699,965.31 |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 129,486 | 32.07 | 4,152,616.02 |
| | WESTPAC BANKING | 172,708 | 31.65 | 5,466,208.20 |
| | ASX LTD | 10,432 | 35.91 | 374,613.12 |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 16,600 | 57.35 | 952,010.00 |
| | AMP LTD | 158,697 | 5.55 | 880,768.35 |
| | INSURANCE AUSTRALIA GRP. | 132,628 | 6.11 | 810,357.08 |
| | QBE INSURANCE GROUP | 72,184 | 11.67 | 842,387.28 |
| | SUNCORP GROUP LIMITED | 72,433 | 13.99 | 1,013,337.67 |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 25,705 | 12.10 | 311,030.50 |
| | TELSTRA CORP | 240,715 | 5.27 | 1,268,568.05 |
| | TPG TELECOM LTD | 20,000 | 7.00 | 140,000.00 |
| | AGL ENERGY LTD | 29,447 | 13.49 | 397,240.03 |
| | AUSNET SERVICES | 87,439 | 1.35 | 118,479.84 |
| | オーストラリアドル 小計 | 3,355,281 | | 55,590,710.30 (5,291,679,713) |
| ニュージーランドドル | FLETCHER BUILDING LTD | 35,168 | 8.78 | 308,775.04 |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 47,782 | 3.84 | 183,482.88 |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 22,016 | 7.91 | 174,146.56 |
| | XERO LTD | 3,006 | 21.00 | 63,126.00 |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 108,032 | 2.96 | 319,774.72 |
| | CONTACT ENERGY LTD | 25,503 | 5.92 | 150,977.76 |
| | | 241,507 | | 1,200,282.96 |

| ニュージーランドドル 小計 | | | | (101,892,020) |
|-------------------------------|------------------------------|-----------|--------------|-----------------------------------|
| 香港ドル | HUTCHISON WHAMPOA | 118,000 | 94.95 | 11,204,100.00 |
| | NWS HOLDINGS LTD | 78,000 | 14.32 | 1,116,960.00 |
| | CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 57,000 | 14.38 | 819,660.00 |
| | MTR CORP | 84,000 | 30.85 | 2,591,400.00 |
| | LI & FUNG | 314,800 | 8.88 | 2,795,424.00 |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 72,000 | 21.65 | 1,558,800.00 |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 46,500 | 24.50 | 1,139,250.00 |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 131,000 | 46.35 | 6,071,850.00 |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 43,600 | 23.00 | 1,002,800.00 |
| | SANDS CHINA LTD | 135,600 | 41.50 | 5,627,400.00 |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 98,000 | 11.48 | 1,125,040.00 |
| | SJM HOLDINGS LTD | 95,000 | 15.34 | 1,457,300.00 |
| | WYNN MACAU LTD | 82,800 | 25.35 | 2,098,980.00 |
| | BANK EAST ASIA | 65,960 | 31.40 | 2,071,144.00 |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS -R | 200,500 | 24.75 | 4,962,375.00 |
| | HANG SENG BANK | 41,400 | 125.20 | 5,183,280.00 |
| | FIRST PACIFIC CO | 128,000 | 8.46 | 1,082,880.00 |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 62,100 | 169.70 | 10,538,370.00 |
| | AIA GROUP LTD | 669,600 | 40.15 | 26,884,440.00 |
| | CHEUNG KONG HOLDINGS | 77,000 | 129.70 | 9,986,900.00 |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 120,000 | 22.55 | 2,706,000.00 |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMEN | 61,600 | 51.25 | 3,157,000.00 |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 40,000 | 35.00 | 1,400,000.00 |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 38,500 | 26.10 | 1,004,850.00 |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 270,500 | 9.19 | 2,485,895.00 |
| | SINO LAND CO | 175,400 | 11.92 | 2,090,768.00 |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 92,000 | 112.10 | 10,313,200.00 |
| | SWIRE PACIFIC A | 36,500 | 100.70 | 3,675,550.00 |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 69,200 | 24.20 | 1,674,640.00 |
| | WHARF HOLDINGS | 86,000 | 55.20 | 4,747,200.00 |
| | WHEELLOCK & CO LTD | 53,000 | 38.00 | 2,014,000.00 |
| | PCCW LTD | 232,000 | 4.93 | 1,143,760.00 |
| | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 31,000 | 54.25 | 1,681,750.00 |
| CLP HOLDINGS | 104,500 | 62.75 | 6,557,375.00 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 356,163 | 17.02 | 6,061,894.26 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 75,000 | 69.10 | 5,182,500.00 | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 13,800 | 76.85 | 1,060,530.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 4,456,023 | | 156,275,265.26 (2,203,481,240) |
| シンガポールド ル | KEPPEL CORP LTD | 81,300 | 10.53 | 856,089.00 |
| | NOBLE GROUP LTD | 227,363 | 1.39 | 317,171.38 |

| | | | | | |
|-----------|------------------------------------|------------|----------|--------------------------------------|--|
| | SEBFCORP INDUSTRIES LTD | 57,000 | 5.20 | 296,400.00 | |
| | SEBFCORP MARINE LTD | 41,000 | 3.76 | 154,160.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 76,000 | 3.70 | 281,200.00 | |
| | YANGZIJANG SHIPBUILDING | 133,000 | 1.16 | 154,280.00 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 99,000 | 2.50 | 247,500.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES | 31,533 | 9.95 | 313,753.35 | |
| | GENTING SINGAPORE PLC | 313,000 | 1.14 | 356,820.00 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 93,000 | 4.19 | 389,670.00 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 6,000 | 43.37 | 260,220.00 | |
| | OLAM INTERNATIONAL LTD | 26,000 | 2.44 | 63,440.00 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 419,000 | 0.51 | 213,690.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 111,000 | 3.11 | 345,210.00 | |
| | DBS GROUP | 96,000 | 18.52 | 1,777,920.00 | |
| | OCBC BANK | 147,000 | 9.75 | 1,433,250.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 72,000 | 22.56 | 1,624,320.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 42,000 | 7.27 | 305,340.00 | |
| | CAPITALAND LTD | 130,500 | 3.23 | 421,515.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 24,000 | 9.70 | 232,800.00 | |
| | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 158,000 | 2.77 | 437,660.00 | |
| | KEPPEL LAND LTD | 40,000 | 3.43 | 137,200.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 22,300 | 6.56 | 146,288.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 445,243 | 3.81 | 1,696,375.83 | |
| | STARHUB LTD | 38,000 | 4.12 | 156,560.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | 2,929,239 | | 12,618,832.56 (1,084,967,223) | |
| イスラエルシェケル | DELEK GROUP LTD | 201 | 1,360.00 | 273,360.00 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LTD | 20,596 | 26.20 | 539,615.20 | |
| | ISRAEL CORP LIMITED/THE | 161 | 2,061.00 | 331,821.00 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 48,196 | 199.50 | 9,615,102.00 | |
| | BANK HAPAOALIM BM | 58,582 | 20.80 | 1,218,505.60 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 70,820 | 14.93 | 1,057,342.60 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 8,200 | 43.54 | 357,028.00 | |
| | NICE SYSTEMS LTD | 3,358 | 149.50 | 502,021.00 | |
| | BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP | 111,633 | 6.42 | 716,795.49 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | 321,747 | | 14,611,590.89 (434,110,365) | |
| | 合 計 | 60,959,090 | | 178,154,446,402 (178,154,446,402) | |

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----------------------|--------------|-------------------------------|------------------------------|------------------------------|----|
| 投資信託受益証券 | アメリカドル | HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U | 329,000 | 225,365.00 | |
| | アメリカドル 小計 | | 329,000 | 225,365.00 (24,666,199) | |
| | オーストラリアドル | APA GROUP | 48,718 | 359,051.66 | |
| | | LEND LEASE GROUP | 28,820 | 415,008.00 | |
| | | SYDNEY AIRPORT | 58,361 | 245,699.81 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 135,899 | 1,019,759.47 (97,070,903) | |
| | 香港ドル | HKT TRUST AND HKT LTD | 130,000 | 1,218,100.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 130,000 | 1,218,100.00 (17,175,210) | | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 594,899 | 138,912,312 (138,912,312) | |
| 投資証券 | アメリカドル | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 18,579 | 398,519.55 | |
| | | AMERICAN REALTY CAPITAL PRO | 46,690 | 577,555.30 | |
| | | AMERICAN TOWER CORPORATION | 21,641 | 2,024,515.55 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 50,991 | 553,762.26 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 7,235 | 1,019,628.55 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 8,631 | 1,000,073.97 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 4,483 | 306,368.22 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 18,302 | 1,460,682.62 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 7,628 | 477,283.96 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 18,853 | 327,288.08 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 19,132 | 1,177,383.28 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST | 3,300 | 593,406.00 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 3,796 | 450,167.64 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 29,726 | 703,317.16 | |
| | | HCP INC | 25,582 | 1,023,280.00 | |
| | | HEALTH CARE REIT INC | 17,144 | 1,075,443.12 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 40,654 | 878,532.94 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 8,532 | 289,234.80 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 24,134 | 529,982.64 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 8,318 | 281,231.58 | |
| | | MACERICH CO/THE | 7,524 | 479,278.80 | |
| | | PLUM CREEK TIMBER COMMON | 9,142 | 358,823.50 | |
| | | PROLOGIS INC | 28,126 | 1,073,850.68 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 8,138 | 1,350,256.96 | |
| | | RAYONIER INC | 7,016 | 219,109.68 | |
| REALTY INCOME CORP | 11,520 | 473,472.00 | | | |
| REGENCY CENTERS CORP | 5,269 | 286,317.46 | | | |

| | | | | |
|-----------|---------------------------------------|-----------|----------------------------------|--|
| | SIMON PROPERTY GROUP | 17,255 | 2,837,067.10 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 5,458 | 559,390.42 | |
| | UDR INC | 13,985 | 382,210.05 | |
| | VENTAS INC | 16,433 | 1,020,489.30 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 9,542 | 958,493.90 | |
| | アメリカドル 小計 | 522,759 | 25,146,417.07 (2,752,275,348) | |
| カナダドル | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 7,535 | 163,283.45 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7,604 | 194,282.20 | |
| | カナダドル 小計 | 15,139 | 357,565.65 (35,055,736) | |
| ユーロ | CORIO NV | 3,438 | 132,706.80 | |
| | FONCIERE DES REGIONS | 1,649 | 116,386.42 | |
| | GECINA SA | 1,389 | 143,344.80 | |
| | ICADE | 2,102 | 139,993.20 | |
| | KLEPIERRE | 5,171 | 178,554.63 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 5,466 | 1,098,392.70 | |
| | ユーロ 小計 | 19,215 | 1,809,378.55 (251,268,399) | |
| イギリスポンド | BRITISH LAND CO PLC | 55,670 | 390,803.40 | |
| | HAMMERSON PLC | 38,982 | 223,951.59 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 56,999 | 188,096.70 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 42,914 | 449,309.58 | |
| | SEGRO PLC | 38,146 | 139,728.79 | |
| | イギリスポンド 小計 | 232,711 | 1,391,890.06 (247,394,539) | |
| オーストラリアドル | CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP | 126,802 | 251,067.96 | |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 290,814 | 327,165.75 | |
| | FEDERATION CENTRES | 67,999 | 172,037.47 | |
| | GOODMAN GROUP | 91,399 | 473,446.82 | |
| | GPT GROUP | 90,744 | 351,179.28 | |
| | MIRVAC GROUP | 214,622 | 365,930.51 | |
| | SCENTRE GROUP | 300,129 | 993,426.99 | |
| | STOCKLAND | 133,303 | 526,546.85 | |
| | WESTFIELD CORP | 104,929 | 790,115.37 | |
| | オーストラリアドル 小計 | 1,420,741 | 4,250,917.00 (404,644,789) | |
| 香港ドル | LINK REIT | 125,000 | 5,462,500.00 | |
| | 香港ドル 小計 | 125,000 | 5,462,500.00 (77,021,250) | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 111,000 | 251,970.00 | |

| | | | | |
|--------------|------------------------|-----------|---------------|-----------------|
| シンガポールドドル | CAPITACOMMERCIAL TRUST | 110,000 | 176,000.00 | |
| | CAPITAMALL TRUST | 141,000 | 269,310.00 | |
| シンガポールドドル 小計 | | 362,000 | 697,280.00 | (59,952,134) |
| 投資証券合計 | | 2,697,565 | 3,827,612,195 | (3,827,612,195) |
| 合計 | | | 3,966,524,507 | (3,966,524,507) |

(注1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(注4)外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 | 組入投資信託 受益証券 時価比率 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|------------|--------------|--------------|------------------------|----------------|----------------|
| アメリカドル | 株式 587銘柄 | 97.5% | | | 60.1% |
| | 投資信託受益証券 1銘柄 | | 0.0% | | 0.0% |
| | 投資証券 32銘柄 | | | 2.5% | 1.5% |
| カナダドル | 株式 90銘柄 | 99.6% | | | 4.6% |
| | 投資証券 2銘柄 | | | 0.4% | 0.0% |
| ユーロ | 株式 227銘柄 | 98.9% | | | 12.8% |
| | 投資証券 6銘柄 | | | 1.1% | 0.1% |
| イギリスポンド | 株式 103銘柄 | 98.5% | | | 9.1% |
| | 投資証券 5銘柄 | | | 1.5% | 0.1% |
| スイスフラン | 株式 38銘柄 | 100.0% | | | 4.0% |
| スウェーデンクローナ | 株式 30銘柄 | 100.0% | | | 1.3% |
| ノルウェークローネ | 株式 11銘柄 | 100.0% | | | 0.4% |
| デンマーククローネ | 株式 13銘柄 | 100.0% | | | 0.7% |
| オーストラリアドル | 株式 57銘柄 | 91.3% | | | 2.9% |
| | 投資信託受益証券 3銘柄 | | 1.7% | | 0.1% |
| | 投資証券 9銘柄 | | | 7.0% | 0.2% |
| ニュージーランドドル | 株式 6銘柄 | 100.0% | | | 0.1% |
| 香港ドル | 株式 37銘柄 | 95.9% | | | 1.2% |
| | 投資信託受益証券 1銘柄 | | 0.7% | | 0.0% |
| | 投資証券 1銘柄 | | | 3.4% | 0.0% |
| シンガポールドドル | 株式 25銘柄 | 94.8% | | | 0.6% |
| | 投資証券 3銘柄 | | | 5.2% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式 9銘柄 | 100.0% | | | 0.2% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| 項目 | 平成26年 9月30日現在 |
|-----------------|-----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 366,436,153 |
| コール・ローン | 5,794,699,666 |
| 国債証券 | 244,680,234,637 |
| 派生商品評価勘定 | 50,323,173 |
| 未収入金 | 803,340 |
| 未収利息 | 2,255,975,222 |
| 前払費用 | 132,131,055 |
| 差入委託証拠金 | 125,306,890 |
| 流動資産合計 | 253,405,910,136 |
| 資産合計 | |
| 253,405,910,136 | |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 8,132,643 |
| 前受金 | 9,714,040 |
| 未払金 | 38,970 |
| 未払解約金 | 239,613,590 |
| 流動負債合計 | 257,499,243 |
| 負債合計 | |
| 257,499,243 | |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 95,373,091,380 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 157,775,319,513 |
| 元本等合計 | 253,148,410,893 |
| 純資産合計 | |
| 253,148,410,893 | |
| 負債純資産合計 | |
| 253,405,910,136 | |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 平成26年 9月30日現在 | |
|--------------------|------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |

| | |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p> | <p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| <p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p> | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| <p>4. 収益及び費用の計上基準</p> | <p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | | 平成26年 9月30日現在 |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 95,373,091,380口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2.6543円 (26,543円) |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| | | 平成26年 9月30日現在 |
|--|--|---------------|
| | | |

| | |
|------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2.金融商品の内容及びそのリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。 |

2.金融商品の時価等に関する事項

| | 平成26年 9月30日現在 |
|---------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 平成26年 9月30日現在 |
|--------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成25年10月 1日 |
| 期首元本額 | 99,697,021,945円 |
| 期中追加設定元本額 | 32,548,678,297円 |
| 期中一部解約元本額 | 36,872,608,862円 |
| 期末元本額 | 95,373,091,380円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 3,828,606,306円 |
| 外国債券オープン（3ヶ月決算型） | 183,062,871円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 1,566,788,801円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 1,095,660,412円 |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 838,298,184円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 8,225,239円 |
| S M T グローバル債券インデックス・オープン | 4,234,377,824円 |
| 世界経済インデックスファンド | 796,034,680円 |
| マイセレクション25 | 12,562,721円 |
| マイセレクション50 | 6,057,715円 |
| マイセレクション75 | 4,081,340円 |
| D Cマイセレクション25 | 1,070,124,754円 |
| D Cマイセレクション50 | 959,452,612円 |
| D Cマイセレクション75 | 626,241,859円 |
| D C外国債券インデックス・オープン | 1,286,595,931円 |
| D CマイセレクションS25 | 409,671,443円 |
| D CマイセレクションS50 | 338,881,074円 |
| D CマイセレクションS75 | 152,773,904円 |
| D Cターゲット・イヤーフアンド2015 | 879,821円 |
| D Cターゲット・イヤーフアンド2025 | 45,200,936円 |
| D Cターゲット・イヤーフアンド2035 | 31,992,436円 |
| D Cターゲット・イヤーフアンド2045 | 11,873,961円 |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| D C世界経済インデックスファンド | 835,925,430円 |
| 外国債券インデックス・オープン(SMA専用) | 15,950,909,015円 |
| 外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用) | 335,499,343円 |
| マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用) | 16,552,556円 |
| マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用) | 5,333,347円 |
| 外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用) | 204,521,854円 |
| バランス30VA1(適格機関投資家専用) | 653,528,798円 |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用) | 973,948,945円 |
| バランス25VA2(適格機関投資家専用) | 7,747,738,070円 |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用) | 1,274,948,762円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) | 7,844,306,436円 |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用) | 1,118,247,593円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 3,819,280,234円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 2,087,059,575円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 2,801,030,848円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 1,159,129,892円 |
| グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用) | 2,864,393,241円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 429,146,744円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 582,091,688円 |
| FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用) | 2,495,795,641円 |
| グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用) | 1,065,446,215円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 569,647,057円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ1 | 151,559,641円 |
| コア投資戦略ファンド(安定型) | 1,660,994,051円 |
| コア投資戦略ファンド(成長型) | 3,699,875,859円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 370,199,082円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 417,299,345円 |
| D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 7,671,972円 |
| D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 163,760,519円 |
| コア投資戦略ファンド(切替型) | 394,770,782円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 38,651,701円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 35,367,447円 |
| SMTグローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり) | 122,383,308円 |
| FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) | 15,968,631,565円 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 平成26年 9月30日現在 |
|------|--------------------|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 2,744,178,973 |
| 合計 | 2,744,178,973 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成26年 9月30日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 4,706,429,305 | - | 4,716,143,345 | 9,714,040 |
| | 合計 | 4,706,429,305 | - | 4,716,143,345 | 9,714,040 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成26年 9月30日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | 6,512,226,510 | - | 6,544,703,000 | 32,476,490 |
| | アメリカドル | 2,686,467,310 | - | 2,713,864,000 | 27,396,690 |
| | カナダドル | 257,508,050 | - | 257,713,700 | 205,650 |
| | ユーロ | 3,011,449,030 | - | 3,011,656,500 | 207,470 |
| | イギリスポンド | 556,802,120 | - | 561,468,800 | 4,666,680 |

| | | | | |
|----|---------------|---|---------------|------------|
| 合計 | 6,512,226,510 | - | 6,544,703,000 | 32,476,490 |
|----|---------------|---|---------------|------------|

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|--------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | アメリカドル | T 0.25% 04/15/16 | 18,000,000.00 | 17,968,007.88 | |
| | | T 0.25% 10/15/15 | 15,900,000.00 | 15,921,117.26 | |
| | | T 0.25% 12/31/15 | 25,000,000.00 | 25,012,207.00 | |
| | | T 0.375% 02/15/16 | 3,000,000.00 | 3,004,394.52 | |
| | | T 0.375% 03/15/16 | 11,000,000.00 | 11,008,808.58 | |
| | | T 0.375% 05/31/16 | 1,500,000.00 | 1,498,798.83 | |
| | | T 0.5% 07/31/17 | 12,000,000.00 | 11,823,281.28 | |
| | | T 0.625% 07/15/16 | 13,300,000.00 | 13,333,509.74 | |
| | | T 0.625% 08/15/16 | 17,300,000.00 | 17,328,044.85 | |
| | | T 0.625% 09/30/17 | 1,000,000.00 | 985,781.25 | |
| | | T 0.625% 11/30/17 | 5,000,000.00 | 4,912,402.35 | |
| | | T 0.625% 12/15/16 | 10,000,000.00 | 9,980,859.40 | |
| | | T 0.75% 01/15/17 | 12,000,000.00 | 11,997,421.92 | |
| | | T 0.75% 02/28/18 | 10,100,000.00 | 9,912,597.63 | |
| | | T 0.75% 03/31/18 | 10,000,000.00 | 9,798,828.09 | |
| | | T 0.75% 06/30/17 | 6,000,000.00 | 5,962,968.78 | |
| | | T 0.75% 12/31/17 | 10,000,000.00 | 9,846,679.70 | |
| | | T 0.875% 01/31/17 | 10,000,000.00 | 10,023,632.80 | |
| | | T 0.875% 01/31/18 | 5,500,000.00 | 5,429,638.66 | |
| | | T 0.875% 04/15/17 | 16,000,000.00 | 16,006,562.56 | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| T 0.875% 06/15/17 | 5,000,000.00 | 4,990,332.05 | |
| T 0.875% 09/15/16 | 5,200,000.00 | 5,229,351.55 | |
| T 1.125% 04/30/20 | 2,000,000.00 | 1,914,687.50 | |
| T 1.125% 12/31/19 | 10,000,000.00 | 9,635,742.20 | |
| T 1.25% 01/31/19 | 900,000.00 | 885,357.42 | |
| T 1.25% 02/29/20 | 11,000,000.00 | 10,637,558.58 | |
| T 1.25% 10/31/18 | 15,600,000.00 | 15,412,312.50 | |
| T 1.25% 10/31/19 | 5,500,000.00 | 5,353,691.42 | |
| T 1.25% 11/30/18 | 9,400,000.00 | 9,274,789.08 | |
| T 1.375% 02/28/19 | 2,100,000.00 | 2,074,488.27 | |
| T 1.375% 05/31/20 | 3,800,000.00 | 3,683,476.57 | |
| T 1.375% 06/30/18 | 2,200,000.00 | 2,194,542.96 | |
| T 1.375% 09/30/18 | 3,900,000.00 | 3,877,605.45 | |
| T 1.375% 11/30/15 | 27,800,000.00 | 28,183,878.80 | |
| T 1.375% 12/31/18 | 3,000,000.00 | 2,971,640.64 | |
| T 1.5% 01/31/19 | 10,000,000.00 | 9,943,359.40 | |
| T 1.5% 02/28/19 | 10,000,000.00 | 9,934,960.90 | |
| T 1.5% 03/31/19 | 4,400,000.00 | 4,367,773.43 | |
| T 1.5% 07/31/16 | 4,300,000.00 | 4,377,433.58 | |
| T 1.5% 08/31/18 | 5,800,000.00 | 5,800,226.54 | |
| T 1.625% 08/15/22 | 4,500,000.00 | 4,279,218.75 | |
| T 1.625% 11/15/22 | 8,500,000.00 | 8,045,283.23 | |
| T 1.75% 05/15/22 | 3,800,000.00 | 3,658,539.07 | |
| T 1.75% 05/15/23 | 10,200,000.00 | 9,682,828.17 | |
| T 1.75% 05/31/16 | 18,000,000.00 | 18,395,156.34 | |
| T 1.75% 10/31/20 | 1,500,000.00 | 1,473,251.95 | |
| T 1.875% 06/30/20 | 5,200,000.00 | 5,176,640.61 | |
| T 1.875% 08/31/17 | 7,900,000.00 | 8,088,550.80 | |
| T 1.875% 09/30/17 | 3,000,000.00 | 3,068,847.66 | |
| T 1.875% 10/31/17 | 2,500,000.00 | 2,556,054.70 | |
| T 1% 03/31/17 | 1,400,000.00 | 1,404,730.47 | |
| T 1% 06/30/19 | 9,000,000.00 | 8,694,843.75 | |
| T 1% 09/30/16 | 7,900,000.00 | 7,961,564.46 | |
| T 1% 09/30/19 | 4,000,000.00 | 3,848,046.88 | |
| T 1% 11/30/19 | 6,300,000.00 | 6,040,617.21 | |
| T 2.125% 01/31/21 | 3,000,000.00 | 3,002,695.32 | |
| T 2.125% 06/30/21 | 10,000,000.00 | 9,968,359.40 | |
| T 2.125% 08/15/21 | 6,100,000.00 | 6,078,435.52 | |
| T 2.125% 08/31/20 | 6,500,000.00 | 6,539,736.32 | |
| T 2.25% 03/31/21 | 6,600,000.00 | 6,645,632.79 | |
| T 2.25% 04/30/21 | 3,500,000.00 | 3,521,601.58 | |
| T 2.25% 07/31/18 | 5,750,000.00 | 5,918,232.40 | |

| | | | |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| T 2.25% 11/30/17 | 2,000,000.00 | 2,066,367.18 | |
| T 2.375% 03/31/16 | 5,200,000.00 | 5,357,929.66 | |
| T 2.375% 05/31/18 | 4,000,000.00 | 4,139,609.36 | |
| T 2.375% 06/30/18 | 9,050,000.00 | 9,361,093.75 | |
| T 2.375% 08/15/24 | 4,400,000.00 | 4,357,031.27 | |
| T 2.5% 05/15/24 | 8,400,000.00 | 8,420,835.93 | |
| T 2.625% 02/29/16 | 1,000,000.00 | 1,033,046.88 | |
| T 2.625% 04/30/16 | 5,100,000.00 | 5,280,292.95 | |
| T 2.625% 04/30/18 | 5,000,000.00 | 5,222,460.95 | |
| T 2.625% 08/15/20 | 5,500,000.00 | 5,691,318.38 | |
| T 2.625% 11/15/20 | 8,000,000.00 | 8,259,062.48 | |
| T 2.75% 02/15/19 | 600,000.00 | 628,300.78 | |
| T 2.75% 02/15/24 | 8,100,000.00 | 8,305,347.63 | |
| T 2.75% 02/28/18 | 3,800,000.00 | 3,985,101.57 | |
| T 2.75% 05/31/17 | 8,000,000.00 | 8,381,250.00 | |
| T 2.75% 11/15/23 | 5,200,000.00 | 5,339,242.16 | |
| T 2.75% 11/15/42 | 8,400,000.00 | 7,734,398.44 | |
| T 2.75% 11/30/16 | 6,250,000.00 | 6,527,954.12 | |
| T 2.875% 03/31/18 | 3,900,000.00 | 4,106,958.99 | |
| T 2.875% 05/15/43 | 9,100,000.00 | 8,579,949.19 | |
| T 2% 01/31/16 | 10,300,000.00 | 10,538,992.23 | |
| T 2% 02/15/22 | 2,500,000.00 | 2,458,496.10 | |
| T 2% 02/15/23 | 12,500,000.00 | 12,147,949.25 | |
| T 2% 05/31/21 | 3,800,000.00 | 3,760,664.07 | |
| T 2% 07/31/20 | 5,200,000.00 | 5,206,601.55 | |
| T 2% 11/15/21 | 2,400,000.00 | 2,366,015.61 | |
| T 2% 11/30/20 | 5,500,000.00 | 5,475,615.25 | |
| T 3.125% 01/31/17 | 3,500,000.00 | 3,690,791.02 | |
| T 3.125% 02/15/43 | 1,000,000.00 | 991,718.75 | |
| T 3.125% 04/30/17 | 6,500,000.00 | 6,870,449.23 | |
| T 3.125% 05/15/19 | 5,000,000.00 | 5,316,894.55 | |
| T 3.125% 05/15/21 | 5,300,000.00 | 5,622,968.75 | |
| T 3.125% 08/15/44 | 4,000,000.00 | 3,961,796.88 | |
| T 3.125% 10/31/16 | 6,500,000.00 | 6,833,886.73 | |
| T 3.125% 11/15/41 | 2,800,000.00 | 2,794,476.55 | |
| T 3.25% 06/30/16 | 5,400,000.00 | 5,660,613.28 | |
| T 3.25% 07/31/16 | 2,500,000.00 | 2,624,951.17 | |
| T 3.25% 12/31/16 | 3,500,000.00 | 3,696,601.58 | |
| T 3.375% 05/15/44 | 9,900,000.00 | 10,286,332.05 | |
| T 3.5% 02/15/18 | 5,700,000.00 | 6,118,371.10 | |
| T 3.5% 02/15/39 | 2,000,000.00 | 2,140,078.12 | |
| T 3.625% 02/15/20 | 5,150,000.00 | 5,619,333.97 | |

| | | | |
|-------------------|----------------|----------------|------------------|
| T 3.625% 02/15/21 | 7,000,000.00 | 7,643,945.33 | |
| T 3.625% 02/15/44 | 4,200,000.00 | 4,567,910.17 | |
| T 3.625% 08/15/19 | 2,700,000.00 | 2,937,199.21 | |
| T 3.75% 08/15/41 | 6,100,000.00 | 6,813,056.63 | |
| T 3.75% 11/15/18 | 5,000,000.00 | 5,441,015.65 | |
| T 3.75% 11/15/43 | 900,000.00 | 1,000,933.59 | |
| T 3.875% 08/15/40 | 4,200,000.00 | 4,782,175.77 | |
| T 3% 02/28/17 | 9,500,000.00 | 9,999,121.07 | |
| T 3% 05/15/42 | 5,500,000.00 | 5,344,667.95 | |
| T 3% 08/31/16 | 8,700,000.00 | 9,105,773.48 | |
| T 4.0% 08/15/18 | 3,300,000.00 | 3,618,849.59 | |
| T 4.25% 05/15/39 | 600,000.00 | 721,746.09 | |
| T 4.25% 11/15/17 | 4,600,000.00 | 5,037,179.67 | |
| T 4.25% 11/15/40 | 5,000,000.00 | 6,040,136.70 | |
| T 4.375% 02/15/38 | 1,400,000.00 | 1,708,382.81 | |
| T 4.375% 05/15/40 | 4,900,000.00 | 6,025,181.65 | |
| T 4.375% 05/15/41 | 2,000,000.00 | 2,467,343.76 | |
| T 4.375% 11/15/39 | 4,000,000.00 | 4,907,656.24 | |
| T 4.5% 02/15/36 | 2,500,000.00 | 3,101,220.70 | |
| T 4.5% 05/15/17 | 9,800,000.00 | 10,710,902.35 | |
| T 4.5% 05/15/38 | 1,000,000.00 | 1,242,910.16 | |
| T 4.5% 08/15/39 | 2,900,000.00 | 3,618,939.46 | |
| T 4.5% 11/15/15 | 3,100,000.00 | 3,250,822.25 | |
| T 4.625% 02/15/17 | 5,000,000.00 | 5,450,683.60 | |
| T 4.625% 02/15/40 | 1,150,000.00 | 1,464,520.50 | |
| T 4.75% 08/15/17 | 1,300,000.00 | 1,436,779.29 | |
| T 5.0% 05/15/37 | 500,000.00 | 663,134.76 | |
| T 5.125% 05/15/16 | 4,800,000.00 | 5,166,187.48 | |
| T 5.25% 02/15/29 | 1,400,000.00 | 1,808,625.00 | |
| T 5.25% 11/15/28 | 1,300,000.00 | 1,677,863.27 | |
| T 5.375% 02/15/31 | 2,400,000.00 | 3,188,390.61 | |
| T 5.5% 08/15/28 | 1,200,000.00 | 1,579,828.12 | |
| T 6.0% 02/15/26 | 1,700,000.00 | 2,274,214.84 | |
| T 6.125% 11/15/27 | 1,650,000.00 | 2,273,487.29 | |
| T 6.25% 05/15/30 | 1,100,000.00 | 1,576,544.92 | |
| T 6.25% 08/15/23 | 2,700,000.00 | 3,540,322.26 | |
| T 7.25% 05/15/16 | 6,350,000.00 | 7,050,980.50 | |
| T 7.5% 11/15/16 | 3,000,000.00 | 3,433,242.18 | |
| T 8.0% 11/15/21 | 1,700,000.00 | 2,356,292.97 | |
| T 8.125% 08/15/19 | 2,100,000.00 | 2,731,886.72 | |
| アメリカドル 合計 | 849,850,000.00 | 871,268,823.35 | (95,360,372,715) |

| | | | |
|--------------------|----------------------|---------------|----------------------------------|
| カナダドル | CAN 1.25% 02/01/16 | 3,850,000.00 | 3,860,529.75 |
| | CAN 1.25% 03/01/18 | 1,800,000.00 | 1,794,645.00 |
| | CAN 1.25% 09/01/18 | 1,400,000.00 | 1,389,059.00 |
| | CAN 1.5% 02/01/17 | 2,300,000.00 | 2,318,549.50 |
| | CAN 1.5% 06/01/23 | 1,900,000.00 | 1,820,247.50 |
| | CAN 1.5% 09/01/17 | 1,650,000.00 | 1,660,502.25 |
| | CAN 1.75% 03/01/19 | 1,000,000.00 | 1,009,355.00 |
| | CAN 1.75% 09/01/19 | 350,000.00 | 352,206.75 |
| | CAN 1% 05/01/16 | 3,300,000.00 | 3,295,743.00 |
| | CAN 1% 11/01/15 | 300,000.00 | 299,965.50 |
| | CAN 2.25% 06/01/25 | 900,000.00 | 901,651.50 |
| | CAN 2.5% 06/01/24 | 2,100,000.00 | 2,167,756.50 |
| | CAN 2.75% 06/01/22 | 1,800,000.00 | 1,906,317.00 |
| | CAN 2.75% 09/01/16 | 2,400,000.00 | 2,474,724.00 |
| | CAN 2.75% 12/01/64 | 350,000.00 | 361,156.25 |
| | CAN 2% 06/01/16 | 1,800,000.00 | 1,826,928.00 |
| | CAN 3.25% 06/01/21 | 1,600,000.00 | 1,748,808.00 |
| | CAN 3.5% 06/01/20 | 2,550,000.00 | 2,803,100.25 |
| | CAN 3.5% 12/01/45 | 2,400,000.00 | 2,829,000.00 |
| | CAN 3.75% 06/01/19 | 2,700,000.00 | 2,967,988.50 |
| | CAN 3% 12/01/15 | 1,700,000.00 | 1,739,117.00 |
| | CAN 4.0% 06/01/41 | 2,400,000.00 | 3,014,964.00 |
| | CAN 4.25% 06/01/18 | 1,750,000.00 | 1,928,237.50 |
| | CAN 4% 06/01/16 | 2,050,000.00 | 2,148,246.25 |
| | CAN 4% 06/01/17 | 1,400,000.00 | 1,504,020.00 |
| | CAN 5.75% 06/01/29 | 1,750,000.00 | 2,472,155.00 |
| CAN 5.75% 06/01/33 | 1,950,000.00 | 2,880,393.75 | |
| CAN 5% 06/01/37 | 2,100,000.00 | 2,953,219.50 | |
| CAN 8.0% 06/01/27 | 550,000.00 | 894,093.75 | |
| カナダドル 合計 | | 52,100,000.00 | 57,322,680.00 (5,619,915,547) |
| メキシコペ ソ | MBONO 10% 11/20/36 | 8,500,000.00 | 11,446,525.00 |
| | MBONO 4.75% 06/14/18 | 38,700,000.00 | 38,367,180.00 |
| | MBONO 5% 06/15/17 | 21,800,000.00 | 22,112,612.00 |
| | MBONO 6.25% 06/16/16 | 40,000,000.00 | 41,735,400.00 |
| | MBONO 6.5% 06/10/21 | 18,400,000.00 | 19,147,132.00 |
| | MBONO 7.25% 12/15/16 | 24,400,000.00 | 26,024,430.00 |
| | MBONO 7.5% 06/03/27 | 16,000,000.00 | 17,421,920.00 |
| | MBONO 7.75% 05/29/31 | 3,700,000.00 | 4,079,953.00 |
| | MBONO 7.75% 12/14/17 | 6,100,000.00 | 6,644,150.50 |
| | MBONO 8.5% 05/31/29 | 47,800,000.00 | 56,178,623.00 |
| | MBONO 8.5% 11/18/38 | 28,400,000.00 | 33,370,426.00 |

| | | | |
|-----|---------------------|----------------|-----------------------------------|
| | MBONO 8% 06/11/20 | 18,700,000.00 | 20,986,355.50 |
| | MBONO 8% 12/07/23 | 29,500,000.00 | 33,396,507.50 |
| | メキシコペソ 合計 | 302,000,000.00 | 330,911,214.50 (2,686,999,061) |
| ユーロ | BGB 1.25% 06/22/18 | 1,100,000.00 | 1,146,541.00 |
| | BGB 2.25% 06/22/23 | 1,050,000.00 | 1,154,259.75 |
| | BGB 2.6% 06/22/24 | 1,750,000.00 | 1,966,405.00 |
| | BGB 3.25% 09/28/16 | 3,400,000.00 | 3,621,323.00 |
| | BGB 3.5% 06/28/17 | 350,000.00 | 383,589.50 |
| | BGB 3.75% 06/22/45 | 900,000.00 | 1,170,976.50 |
| | BGB 3.75% 09/28/15 | 800,000.00 | 830,020.00 |
| | BGB 3.75% 09/28/20 | 2,500,000.00 | 2,984,212.50 |
| | BGB 3% 06/22/34 | 700,000.00 | 801,069.50 |
| | BGB 3% 09/28/19 | 1,550,000.00 | 1,756,785.50 |
| | BGB 4.0% 03/28/17 | 2,800,000.00 | 3,079,566.00 |
| | BGB 4.0% 03/28/19 | 1,700,000.00 | 1,988,031.00 |
| | BGB 4.25% 03/28/41 | 1,850,000.00 | 2,581,018.25 |
| | BGB 4.25% 09/28/21 | 1,200,000.00 | 1,491,684.00 |
| | BGB 4.25% 09/28/22 | 3,100,000.00 | 3,899,908.50 |
| | BGB 4.5% 03/28/26 | 1,200,000.00 | 1,579,968.00 |
| | BGB 4% 03/28/18 | 3,050,000.00 | 3,466,630.00 |
| | BGB 4% 03/28/22 | 2,950,000.00 | 3,637,984.25 |
| | BGB 4% 03/28/32 | 1,150,000.00 | 1,494,045.50 |
| | BGB 5.5% 03/28/28 | 2,800,000.00 | 4,092,494.00 |
| | BGB 5.5% 09/28/17 | 1,900,000.00 | 2,211,258.00 |
| | BGB 5% 03/28/35 | 2,750,000.00 | 4,069,903.75 |
| | BKO 0.25% 03/11/16 | 4,100,000.00 | 4,118,532.00 |
| | BTNS 1.75% 02/25/17 | 2,500,000.00 | 2,605,125.00 |
| | BTNS 1% 07/25/17 | 3,600,000.00 | 3,700,242.00 |
| | BTNS 2.25% 02/25/16 | 8,000,000.00 | 8,255,840.00 |
| | BTNS 2.5% 07/25/16 | 4,000,000.00 | 4,182,780.00 |
| | BTPS 1.15% 05/15/17 | 2,000,000.00 | 2,029,790.00 |
| | BTPS 1.5% 08/01/19 | 1,500,000.00 | 1,530,157.50 |
| | BTPS 1.5% 12/15/16 | 1,200,000.00 | 1,226,172.00 |
| | BTPS 2.75% 12/01/15 | 2,700,000.00 | 2,775,964.50 |
| | BTPS 3.5% 11/01/17 | 3,000,000.00 | 3,258,615.00 |
| | BTPS 3.5% 12/01/18 | 3,500,000.00 | 3,872,802.50 |
| | BTPS 3.75% 03/01/21 | 5,050,000.00 | 5,733,871.00 |
| | BTPS 3.75% 04/15/16 | 3,700,000.00 | 3,891,475.00 |
| | BTPS 3.75% 08/01/16 | 6,300,000.00 | 6,682,756.50 |
| | BTPS 3.75% 08/01/21 | 4,000,000.00 | 4,533,040.00 |
| | BTPS 3.75% 09/01/24 | 1,100,000.00 | 1,231,472.00 |

| | | | |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| BTPS 3% 11/01/15 | 2,800,000.00 | 2,881,158.00 | |
| BTPS 4.25% 02/01/19 | 3,800,000.00 | 4,334,945.00 | |
| BTPS 4.25% 03/01/20 | 5,350,000.00 | 6,203,619.25 | |
| BTPS 4.25% 09/01/19 | 2,650,000.00 | 3,054,125.00 | |
| BTPS 4.5% 02/01/18 | 2,800,000.00 | 3,145,212.00 | |
| BTPS 4.5% 02/01/20 | 3,750,000.00 | 4,391,062.50 | |
| BTPS 4.5% 03/01/19 | 4,350,000.00 | 5,022,401.25 | |
| BTPS 4.5% 03/01/24 | 3,950,000.00 | 4,691,237.25 | |
| BTPS 4.5% 03/01/26 | 2,700,000.00 | 3,197,785.50 | |
| BTPS 4.5% 05/01/23 | 3,150,000.00 | 3,731,505.75 | |
| BTPS 4.5% 08/01/18 | 7,500,000.00 | 8,530,275.00 | |
| BTPS 4.75% 06/01/17 | 3,800,000.00 | 4,216,252.00 | |
| BTPS 4.75% 08/01/23 | 3,700,000.00 | 4,468,767.50 | |
| BTPS 4.75% 09/01/21 | 4,800,000.00 | 5,751,216.00 | |
| BTPS 4.75% 09/01/28 | 1,850,000.00 | 2,233,024.00 | |
| BTPS 4.75% 09/01/44 | 2,100,000.00 | 2,517,511.50 | |
| BTPS 4.75% 09/15/16 | 2,400,000.00 | 2,600,280.00 | |
| BTPS 4% 02/01/17 | 5,500,000.00 | 5,942,365.00 | |
| BTPS 4% 02/01/37 | 3,900,000.00 | 4,272,333.00 | |
| BTPS 4% 09/01/20 | 4,000,000.00 | 4,599,760.00 | |
| BTPS 5.0% 08/01/39 | 2,800,000.00 | 3,483,704.00 | |
| BTPS 5.25% 08/01/17 | 3,050,000.00 | 3,445,691.75 | |
| BTPS 5.25% 11/01/29 | 5,000,000.00 | 6,359,300.00 | |
| BTPS 5.5% 09/01/22 | 2,100,000.00 | 2,636,214.00 | |
| BTPS 5.5% 11/01/22 | 4,100,000.00 | 5,149,169.50 | |
| BTPS 5.75% 02/01/33 | 2,950,000.00 | 4,005,111.75 | |
| BTPS 5% 03/01/22 | 2,800,000.00 | 3,404,660.00 | |
| BTPS 5% 03/01/25 | 3,750,000.00 | 4,611,318.75 | |
| BTPS 5% 08/01/34 | 3,300,000.00 | 4,130,329.50 | |
| BTPS 5% 09/01/40 | 3,100,000.00 | 3,829,197.50 | |
| BTPS 6.5% 11/01/27 | 5,100,000.00 | 7,163,460.00 | |
| BTPS 6% 05/01/31 | 4,000,000.00 | 5,524,920.00 | |
| BTPS 7.25% 11/01/26 | 1,900,000.00 | 2,807,696.50 | |
| BTPS 9% 11/01/23 | 800,000.00 | 1,256,036.00 | |
| DBR 1.5% 02/15/23 | 3,600,000.00 | 3,831,120.00 | |
| DBR 1.5% 05/15/23 | 3,950,000.00 | 4,199,106.75 | |
| DBR 1.5% 05/15/24 | 3,850,000.00 | 4,056,514.00 | |
| DBR 1.5% 09/04/22 | 2,900,000.00 | 3,094,894.50 | |
| DBR 1.75% 02/15/24 | 1,950,000.00 | 2,103,211.50 | |
| DBR 1.75% 07/04/22 | 3,100,000.00 | 3,372,490.00 | |
| DBR 2.25% 09/04/20 | 2,500,000.00 | 2,789,787.50 | |
| DBR 2.25% 09/04/21 | 2,800,000.00 | 3,145,800.00 | |

| | | |
|---------------------|--------------|--------------|
| DBR 2.5% 01/04/21 | 2,700,000.00 | 3,063,595.50 |
| DBR 2.5% 07/04/44 | 2,200,000.00 | 2,527,613.00 |
| DBR 2.5% 08/15/46 | 900,000.00 | 1,034,167.50 |
| DBR 2% 01/04/22 | 2,600,000.00 | 2,877,446.00 |
| DBR 3.25% 01/04/20 | 3,300,000.00 | 3,829,567.50 |
| DBR 3.25% 07/04/21 | 2,800,000.00 | 3,331,328.00 |
| DBR 3.25% 07/04/42 | 2,100,000.00 | 2,753,730.00 |
| DBR 3.5% 01/04/16 | 5,800,000.00 | 6,060,565.00 |
| DBR 3.5% 07/04/19 | 3,500,000.00 | 4,062,222.50 |
| DBR 3.75% 01/04/17 | 3,600,000.00 | 3,909,906.00 |
| DBR 3.75% 01/04/19 | 3,150,000.00 | 3,645,542.25 |
| DBR 3% 07/04/20 | 3,300,000.00 | 3,817,704.00 |
| DBR 4.0% 01/04/18 | 3,300,000.00 | 3,734,808.00 |
| DBR 4.0% 01/04/37 | 3,500,000.00 | 4,936,785.00 |
| DBR 4.25% 07/04/17 | 3,200,000.00 | 3,579,728.00 |
| DBR 4.25% 07/04/18 | 4,150,000.00 | 4,812,277.75 |
| DBR 4.25% 07/04/39 | 2,000,000.00 | 2,972,630.00 |
| DBR 4.75% 07/04/28 | 2,000,000.00 | 2,853,540.00 |
| DBR 4.75% 07/04/34 | 2,950,000.00 | 4,460,547.50 |
| DBR 4.75% 07/04/40 | 2,550,000.00 | 4,089,167.25 |
| DBR 4% 07/04/16 | 3,600,000.00 | 3,856,428.00 |
| DBR 5.5% 01/04/31 | 2,450,000.00 | 3,840,301.50 |
| DBR 5.625% 01/04/28 | 1,800,000.00 | 2,748,060.00 |
| DBR 6.25% 01/04/24 | 1,600,000.00 | 2,381,640.00 |
| DBR 6.25% 01/04/30 | 1,250,000.00 | 2,072,425.00 |
| DBR 6.5% 07/04/27 | 1,450,000.00 | 2,356,047.00 |
| DBR 6% 06/20/16 | 560,000.00 | 618,282.00 |
| FRTR 0.25% 11/25/15 | 2,300,000.00 | 2,307,406.00 |
| FRTR 0.5% 11/25/19 | 1,000,000.00 | 1,007,865.00 |
| FRTR 1.75% 05/25/23 | 4,050,000.00 | 4,298,447.25 |
| FRTR 1.75% 11/25/24 | 2,200,000.00 | 2,292,675.00 |
| FRTR 1% 05/25/18 | 4,100,000.00 | 4,232,553.00 |
| FRTR 1% 05/25/19 | 2,300,000.00 | 2,379,108.50 |
| FRTR 1% 11/25/18 | 2,500,000.00 | 2,584,612.50 |
| FRTR 2.25% 05/25/24 | 4,400,000.00 | 4,820,288.00 |
| FRTR 2.25% 10/25/22 | 4,200,000.00 | 4,636,590.00 |
| FRTR 2.5% 05/25/30 | 1,000,000.00 | 1,079,135.00 |
| FRTR 2.5% 10/25/20 | 5,200,000.00 | 5,821,712.00 |
| FRTR 2.75% 10/25/27 | 3,950,000.00 | 4,448,351.75 |
| FRTR 3.25% 04/25/16 | 4,400,000.00 | 4,625,170.00 |
| FRTR 3.25% 05/25/45 | 1,700,000.00 | 2,028,440.00 |
| FRTR 3.25% 10/25/21 | 5,800,000.00 | 6,819,089.00 |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| FRTR 3.5% 04/25/20 | 7,150,000.00 | 8,366,965.75 |
| FRTR 3.5% 04/25/26 | 4,500,000.00 | 5,449,207.50 |
| FRTR 3.75% 04/25/17 | 6,100,000.00 | 6,685,539.00 |
| FRTR 3.75% 04/25/21 | 5,800,000.00 | 6,974,645.00 |
| FRTR 3.75% 10/25/19 | 2,300,000.00 | 2,698,843.00 |
| FRTR 3% 04/25/22 | 4,150,000.00 | 4,818,461.25 |
| FRTR 3% 10/25/15 | 3,000,000.00 | 3,096,840.00 |
| FRTR 4.25% 04/25/19 | 6,600,000.00 | 7,805,985.00 |
| FRTR 4.25% 10/25/17 | 4,000,000.00 | 4,517,560.00 |
| FRTR 4.25% 10/25/18 | 3,900,000.00 | 4,548,589.50 |
| FRTR 4.25% 10/25/23 | 5,100,000.00 | 6,501,301.50 |
| FRTR 4.5% 04/25/41 | 3,450,000.00 | 4,991,943.00 |
| FRTR 4.75% 04/25/35 | 3,200,000.00 | 4,623,200.00 |
| FRTR 4% 04/25/18 | 3,800,000.00 | 4,329,397.00 |
| FRTR 4% 04/25/55 | 2,200,000.00 | 3,095,796.00 |
| FRTR 4% 04/25/60 | 1,650,000.00 | 2,342,694.75 |
| FRTR 4% 10/25/38 | 3,350,000.00 | 4,462,149.75 |
| FRTR 5.5% 04/25/29 | 3,700,000.00 | 5,467,693.50 |
| FRTR 5.75% 10/25/32 | 4,200,000.00 | 6,612,627.00 |
| FRTR 5% 10/25/16 | 5,000,000.00 | 5,518,900.00 |
| FRTR 6.0% 10/25/25 | 2,400,000.00 | 3,527,808.00 |
| FRTR 8.5% 04/25/23 | 1,000,000.00 | 1,621,595.00 |
| FRTR 8.5% 10/25/19 | 1,120,000.00 | 1,583,086.40 |
| IRISH 3.4% 03/18/24 | 900,000.00 | 1,033,191.00 |
| IRISH 3.9% 03/20/23 | 1,000,000.00 | 1,188,755.00 |
| IRISH 4.4% 06/18/19 | 1,100,000.00 | 1,301,844.50 |
| IRISH 4.5% 04/18/20 | 3,550,000.00 | 4,274,856.75 |
| IRISH 4.5% 10/18/18 | 800,000.00 | 933,956.00 |
| IRISH 4.6% 04/18/16 | 1,500,000.00 | 1,606,455.00 |
| IRISH 5.4% 03/13/25 | 1,850,000.00 | 2,456,430.00 |
| IRISH 5.5% 10/18/17 | 950,000.00 | 1,103,957.00 |
| IRISH 5.9% 10/18/19 | 750,000.00 | 950,531.25 |
| NETHER 1.25% 01/15/18 | 1,900,000.00 | 1,975,962.00 |
| NETHER 1.25% 01/15/19 | 2,200,000.00 | 2,301,629.00 |
| NETHER 1.75% 07/15/23 | 2,000,000.00 | 2,134,360.00 |
| NETHER 2.25% 07/15/22 | 2,400,000.00 | 2,666,544.00 |
| NETHER 2.5% 01/15/17 | 3,250,000.00 | 3,436,631.25 |
| NETHER 2.5% 01/15/33 | 1,400,000.00 | 1,576,190.00 |
| NETHER 2.75% 01/15/47 | 550,000.00 | 660,173.25 |
| NETHER 2% 07/15/24 | 1,600,000.00 | 1,732,000.00 |
| NETHER 3.25% 07/15/21 | 2,300,000.00 | 2,705,329.00 |
| NETHER 3.5% 07/15/20 | 2,250,000.00 | 2,647,192.50 |

| | | |
|-----------------------|--------------|--------------|
| NETHER 3.75% 01/15/23 | 1,700,000.00 | 2,093,125.00 |
| NETHER 3.75% 01/15/42 | 2,250,000.00 | 3,169,608.75 |
| NETHER 4.0% 07/15/18 | 2,950,000.00 | 3,387,057.25 |
| NETHER 4.5% 07/15/17 | 2,450,000.00 | 2,756,703.25 |
| NETHER 4% 01/15/37 | 2,000,000.00 | 2,812,410.00 |
| NETHER 4% 07/15/16 | 4,450,000.00 | 4,770,155.25 |
| NETHER 4% 07/15/19 | 1,900,000.00 | 2,239,995.50 |
| NETHER 5.5% 01/15/28 | 2,150,000.00 | 3,215,669.00 |
| NETHER 7.5% 01/15/23 | 550,000.00 | 843,939.25 |
| OBL 0.25% 04/13/18 | 2,100,000.00 | 2,118,753.00 |
| OBL 0.5% 02/23/18 | 4,000,000.00 | 4,070,280.00 |
| OBL 0.5% 04/07/17 | 2,400,000.00 | 2,432,844.00 |
| OBL 0.5% 04/12/19 | 3,850,000.00 | 3,917,375.00 |
| OBL 0.5% 10/13/17 | 450,000.00 | 457,429.50 |
| OBL 0.75% 02/24/17 | 3,000,000.00 | 3,057,705.00 |
| OBL 1.25% 10/14/16 | 1,050,000.00 | 1,078,087.50 |
| OBL 1.75% 10/09/15 | 3,800,000.00 | 3,870,186.00 |
| OBL 1% 10/12/18 | 2,750,000.00 | 2,856,232.50 |
| OBL 2.75% 04/08/16 | 5,500,000.00 | 5,734,575.00 |
| RAGB 1.65% 10/21/24 | 750,000.00 | 784,492.50 |
| RAGB 1.75% 10/20/23 | 1,350,000.00 | 1,438,094.25 |
| RAGB 1.95% 06/18/19 | 400,000.00 | 432,180.00 |
| RAGB 2.4% 05/23/34 | 500,000.00 | 551,455.00 |
| RAGB 3.15% 06/20/44 | 900,000.00 | 1,138,180.50 |
| RAGB 3.2% 02/20/17 | 1,050,000.00 | 1,130,204.25 |
| RAGB 3.4% 11/22/22 | 1,250,000.00 | 1,499,775.00 |
| RAGB 3.5% 09/15/21 | 2,200,000.00 | 2,630,199.00 |
| RAGB 3.65% 04/20/22 | 1,100,000.00 | 1,334,943.50 |
| RAGB 3.8% 01/26/62 | 500,000.00 | 770,582.50 |
| RAGB 3.9% 07/15/20 | 1,950,000.00 | 2,338,098.75 |
| RAGB 4.15% 03/15/37 | 1,800,000.00 | 2,550,321.00 |
| RAGB 4.3% 09/15/17 | 900,000.00 | 1,013,859.00 |
| RAGB 4.35% 03/15/19 | 2,300,000.00 | 2,724,603.00 |
| RAGB 4.65% 01/15/18 | 2,900,000.00 | 3,338,320.50 |
| RAGB 4.85% 03/15/26 | 1,050,000.00 | 1,447,971.00 |
| RAGB 4% 09/15/16 | 2,050,000.00 | 2,210,730.25 |
| RAGB 6.25% 07/15/27 | 1,200,000.00 | 1,884,510.00 |
| RFGB 1.5% 04/15/23 | 650,000.00 | 681,326.75 |
| RFGB 1.625% 09/15/22 | 900,000.00 | 956,686.50 |
| RFGB 1.75% 04/15/16 | 600,000.00 | 616,458.00 |
| RFGB 1.875% 04/15/17 | 350,000.00 | 366,728.25 |
| RFGB 2.625% 07/04/42 | 450,000.00 | 522,213.75 |

| | | | |
|-------------|----------------------|----------------|-------------------------------------|
| | RFGB 2.75% 07/04/28 | 550,000.00 | 636,790.00 |
| | RFGB 2% 04/15/24 | 950,000.00 | 1,029,144.50 |
| | RFGB 3.375% 04/15/20 | 700,000.00 | 814,565.50 |
| | RFGB 3.5% 04/15/21 | 1,150,000.00 | 1,367,045.25 |
| | RFGB 3.875% 09/15/17 | 1,900,000.00 | 2,116,552.50 |
| | RFGB 4.375% 07/04/19 | 900,000.00 | 1,075,257.00 |
| | RFGB 4% 07/04/25 | 850,000.00 | 1,088,153.00 |
| | SPGB 2.1% 04/30/17 | 3,000,000.00 | 3,123,945.00 |
| | SPGB 2.75% 04/30/19 | 2,800,000.00 | 3,034,024.00 |
| | SPGB 2.75% 10/31/24 | 1,400,000.00 | 1,466,381.00 |
| | SPGB 3.15% 01/31/16 | 5,600,000.00 | 5,815,348.00 |
| | SPGB 3.25% 04/30/16 | 1,100,000.00 | 1,151,430.50 |
| | SPGB 3.3% 07/30/16 | 2,950,000.00 | 3,109,683.50 |
| | SPGB 3.75% 10/31/15 | 1,400,000.00 | 1,452,955.00 |
| | SPGB 3.75% 10/31/18 | 950,000.00 | 1,063,344.50 |
| | SPGB 3.8% 01/31/17 | 3,700,000.00 | 3,992,966.00 |
| | SPGB 3.8% 04/30/24 | 3,550,000.00 | 4,067,519.00 |
| | SPGB 4.1% 07/30/18 | 5,900,000.00 | 6,651,601.00 |
| | SPGB 4.2% 01/31/37 | 2,400,000.00 | 2,752,044.00 |
| | SPGB 4.25% 10/31/16 | 2,550,000.00 | 2,755,071.00 |
| | SPGB 4.3% 10/31/19 | 2,950,000.00 | 3,434,626.00 |
| | SPGB 4.5% 01/31/18 | 2,100,000.00 | 2,365,786.50 |
| | SPGB 4.6% 07/30/19 | 3,100,000.00 | 3,636,408.50 |
| | SPGB 4.65% 07/30/25 | 2,400,000.00 | 2,930,664.00 |
| | SPGB 4.7% 07/30/41 | 1,850,000.00 | 2,262,189.25 |
| | SPGB 4.8% 01/31/24 | 2,200,000.00 | 2,712,160.00 |
| | SPGB 4.85% 10/31/20 | 2,950,000.00 | 3,571,329.00 |
| | SPGB 4.9% 07/30/40 | 2,000,000.00 | 2,527,530.00 |
| | SPGB 4% 04/30/20 | 3,400,000.00 | 3,925,572.00 |
| | SPGB 5.15% 10/31/28 | 2,000,000.00 | 2,536,870.00 |
| | SPGB 5.15% 10/31/44 | 800,000.00 | 1,039,404.00 |
| | SPGB 5.4% 01/31/23 | 5,050,000.00 | 6,432,387.00 |
| | SPGB 5.5% 04/30/21 | 3,600,000.00 | 4,537,980.00 |
| | SPGB 5.5% 07/30/17 | 3,200,000.00 | 3,644,784.00 |
| | SPGB 5.75% 07/30/32 | 2,400,000.00 | 3,309,420.00 |
| | SPGB 5.85% 01/31/22 | 2,500,000.00 | 3,242,062.50 |
| | SPGB 5.9% 07/30/26 | 2,150,000.00 | 2,886,729.75 |
| | SPGB 6.0% 01/31/29 | 2,250,000.00 | 3,085,886.25 |
| | ユーロ 合計 | 649,980,000.00 | 763,044,863.15 (105,964,040,145) |
| イギリスポ ンド | UKT 1.25% 07/22/18 | 6,550,000.00 | 6,474,052.75 |
| | UKT 1.75% 01/22/17 | 2,600,000.00 | 2,643,368.00 |

| | | | |
|--------------------|----------------------|----------------|------------------|
| UKT 1.75% 07/22/19 | 4,300,000.00 | 4,292,410.50 | |
| UKT 1.75% 09/07/22 | 4,000,000.00 | 3,866,420.00 | |
| UKT 1% 09/07/17 | 3,000,000.00 | 2,975,640.00 | |
| UKT 2.25% 09/07/23 | 3,950,000.00 | 3,927,327.00 | |
| UKT 2.75% 09/07/24 | 3,200,000.00 | 3,287,184.00 | |
| UKT 2% 01/22/16 | 3,100,000.00 | 3,153,382.00 | |
| UKT 3.25% 01/22/44 | 3,900,000.00 | 4,038,177.00 | |
| UKT 3.5% 01/22/45 | 1,000,000.00 | 1,083,780.00 | |
| UKT 3.5% 07/22/68 | 1,400,000.00 | 1,569,309.00 | |
| UKT 3.75% 07/22/52 | 2,750,000.00 | 3,184,073.75 | |
| UKT 3.75% 09/07/19 | 2,050,000.00 | 2,242,054.25 | |
| UKT 3.75% 09/07/20 | 2,650,000.00 | 2,918,710.00 | |
| UKT 3.75% 09/07/21 | 2,900,000.00 | 3,216,317.50 | |
| UKT 4.25% 03/07/36 | 2,900,000.00 | 3,489,352.50 | |
| UKT 4.25% 06/07/32 | 2,900,000.00 | 3,463,919.50 | |
| UKT 4.25% 09/07/39 | 1,900,000.00 | 2,313,069.50 | |
| UKT 4.25% 12/07/27 | 1,800,000.00 | 2,121,660.00 | |
| UKT 4.25% 12/07/40 | 2,700,000.00 | 3,297,847.50 | |
| UKT 4.25% 12/07/46 | 2,150,000.00 | 2,681,759.50 | |
| UKT 4.25% 12/07/49 | 1,900,000.00 | 2,401,011.00 | |
| UKT 4.25% 12/07/55 | 2,100,000.00 | 2,712,024.00 | |
| UKT 4.5% 03/07/19 | 1,950,000.00 | 2,186,837.25 | |
| UKT 4.5% 09/07/34 | 3,150,000.00 | 3,898,156.50 | |
| UKT 4.5% 12/07/42 | 2,650,000.00 | 3,388,767.00 | |
| UKT 4.75% 03/07/20 | 3,600,000.00 | 4,137,336.00 | |
| UKT 4.75% 09/07/15 | 2,500,000.00 | 2,598,425.00 | |
| UKT 4.75% 12/07/30 | 3,100,000.00 | 3,890,732.50 | |
| UKT 4.75% 12/07/38 | 2,350,000.00 | 3,064,905.25 | |
| UKT 4% 01/22/60 | 2,000,000.00 | 2,483,180.00 | |
| UKT 4% 03/07/22 | 2,100,000.00 | 2,372,496.00 | |
| UKT 4% 09/07/16 | 3,350,000.00 | 3,553,378.50 | |
| UKT 5% 03/07/18 | 3,300,000.00 | 3,697,369.50 | |
| UKT 5% 03/07/25 | 2,400,000.00 | 2,965,500.00 | |
| UKT 6.0% 12/07/28 | 1,500,000.00 | 2,091,037.50 | |
| UKT 8.75% 08/25/17 | 1,500,000.00 | 1,822,230.00 | |
| UKT 8% 06/07/21 | 2,000,000.00 | 2,746,900.00 | |
| UKT 8% 12/07/15 | 1,600,000.00 | 1,741,992.00 | |
| イギリスポンド 合計 | 104,750,000.00 | 117,992,092.25 | (20,971,914,476) |
| スイスフラン | SWISS 2.25% 07/06/20 | 550,000.00 | 616,671.00 |
| | SWISS 2.5% 03/12/16 | 350,000.00 | 362,995.50 |
| | SWISS 3% 01/08/18 | 3,100,000.00 | 3,403,784.50 |

| | | | |
|----------------|----------------------|---------------|-----------------------------------|
| | SWISS 4% 02/11/23 | 1,850,000.00 | 2,407,386.50 |
| | SWISS 4% 04/08/28 | 400,000.00 | 562,904.00 |
| スイスフラン 合計 | | 6,250,000.00 | 7,353,741.50 (846,195,034) |
| スウェーデン クローナ | SGB 1.5% 11/13/23 | 10,950,000.00 | 11,085,670.50 |
| | SGB 2.5% 05/12/25 | 5,650,000.00 | 6,204,406.25 |
| | SGB 3.5% 03/30/39 | 6,450,000.00 | 8,179,922.25 |
| | SGB 3.5% 06/01/22 | 8,400,000.00 | 9,835,098.00 |
| | SGB 3.75% 08/12/17 | 8,950,000.00 | 9,826,249.75 |
| | SGB 3% 07/12/16 | 8,200,000.00 | 8,614,592.00 |
| | SGB 4.25% 03/12/19 | 13,700,000.00 | 15,907,070.00 |
| | SGB 5% 12/01/20 | 9,200,000.00 | 11,446,088.00 |
| スウェーデンクローナ 合計 | | 71,500,000.00 | 81,099,096.75 (1,226,218,342) |
| ノルウェー クローネ | NGB 2% 05/24/23 | 7,300,000.00 | 7,213,714.00 |
| | NGB 3.75% 05/25/21 | 9,300,000.00 | 10,320,861.00 |
| | NGB 3% 03/14/24 | 4,800,000.00 | 5,098,320.00 |
| | NGB 4.25% 05/19/17 | 9,600,000.00 | 10,270,992.00 |
| | NGB 4.5% 05/22/19 | 8,750,000.00 | 9,818,987.50 |
| ノルウェークローネ 合計 | | 39,750,000.00 | 42,722,874.50 (725,434,409) |
| デンマーク クローネ | DGB 1.5% 11/15/23 | 10,050,000.00 | 10,558,379.25 |
| | DGB 1.75% 11/15/25 | 3,400,000.00 | 3,585,283.00 |
| | DGB 2.5% 11/15/16 | 6,750,000.00 | 7,114,128.75 |
| | DGB 3% 11/15/21 | 13,650,000.00 | 15,963,606.75 |
| | DGB 4.5% 11/15/39 | 17,700,000.00 | 27,037,635.00 |
| | DGB 4% 11/15/15 | 12,600,000.00 | 13,176,135.00 |
| | DGB 4% 11/15/17 | 7,850,000.00 | 8,826,736.25 |
| | DGB 4% 11/15/19 | 14,900,000.00 | 17,741,430.00 |
| | DGB 7% 11/10/24 | 3,500,000.00 | 5,565,962.50 |
| デンマーククローネ 合計 | | 90,400,000.00 | 109,569,296.50 (2,044,563,072) |
| ポーランド ズロチ | POLGB 2.5% 07/25/18 | 3,100,000.00 | 3,132,410.50 |
| | POLGB 3.25% 07/25/19 | 1,900,000.00 | 1,979,610.00 |
| | POLGB 3.75% 04/25/18 | 3,100,000.00 | 3,268,066.50 |
| | POLGB 4.75% 04/25/17 | 2,400,000.00 | 2,562,060.00 |
| | POLGB 4.75% 10/25/16 | 5,000,000.00 | 5,280,775.00 |
| | POLGB 4% 10/25/23 | 4,100,000.00 | 4,434,949.50 |
| | POLGB 5.25% 10/25/17 | 3,500,000.00 | 3,827,337.50 |
| | POLGB 5.25% 10/25/20 | 2,900,000.00 | 3,340,582.50 |
| | POLGB 5.5% 10/25/19 | 2,600,000.00 | 2,987,582.00 |
| | POLGB 5.75% 04/25/29 | 1,200,000.00 | 1,545,516.00 |

| | | | | |
|------------------|----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | POLGB 5.75% 09/23/22 | 3,500,000.00 | 4,220,020.00 | |
| | POLGB 5.75% 10/25/21 | 2,250,000.00 | 2,685,442.50 | |
| | POLGB 5% 04/25/16 | 2,900,000.00 | 3,034,821.00 | |
| | POLGB 6.25% 10/24/15 | 7,000,000.00 | 7,313,565.00 | |
| ポーランドズロチ 合計 | | 45,450,000.00 | 49,612,738.00 | (1,647,639,028) |
| オーストラリアドル | ACGB 2.75% 04/21/24 | 2,250,000.00 | 2,117,857.50 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/25 | 1,850,000.00 | 1,801,557.75 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/29 | 1,150,000.00 | 1,076,267.75 | |
| | ACGB 3.25% 10/21/18 | 550,000.00 | 557,562.50 | |
| | ACGB 4.25% 04/21/26 | 1,500,000.00 | 1,591,935.00 | |
| | ACGB 4.25% 07/21/17 | 2,450,000.00 | 2,550,119.25 | |
| | ACGB 4.5% 04/15/20 | 3,350,000.00 | 3,593,327.25 | |
| | ACGB 4.5% 04/21/33 | 1,150,000.00 | 1,228,004.50 | |
| | ACGB 4.75% 04/21/27 | 1,850,000.00 | 2,049,809.25 | |
| | ACGB 4.75% 06/15/16 | 2,800,000.00 | 2,900,142.00 | |
| | ACGB 4.75% 10/21/15 | 2,050,000.00 | 2,095,909.75 | |
| | ACGB 5.25% 03/15/19 | 3,550,000.00 | 3,893,941.75 | |
| | ACGB 5.5% 01/21/18 | 3,350,000.00 | 3,634,029.75 | |
| | ACGB 5.5% 04/21/23 | 3,300,000.00 | 3,814,932.00 | |
| | ACGB 5.75% 05/15/21 | 3,000,000.00 | 3,456,600.00 | |
| | ACGB 5.75% 07/15/22 | 2,600,000.00 | 3,031,080.00 | |
| ACGB 6% 02/15/17 | 3,550,000.00 | 3,820,865.00 | | |
| オーストラリアドル 合計 | | 40,300,000.00 | 43,213,941.00 | (4,113,535,043) |
| シンガポールドドル | SIGB 0.5% 04/01/18 | 400,000.00 | 391,920.00 | |
| | SIGB 1.125% 04/01/16 | 950,000.00 | 958,630.75 | |
| | SIGB 2.25% 06/01/21 | 800,000.00 | 809,452.00 | |
| | SIGB 2.375% 04/01/17 | 550,000.00 | 573,575.75 | |
| | SIGB 2.5% 06/01/19 | 900,000.00 | 938,317.50 | |
| | SIGB 2.75% 04/01/42 | 450,000.00 | 423,693.00 | |
| | SIGB 2.75% 07/01/23 | 100,000.00 | 103,223.00 | |
| | SIGB 2.875% 07/01/29 | 200,000.00 | 200,730.00 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/30 | 400,000.00 | 399,744.00 | |
| | SIGB 3.125% 09/01/22 | 1,150,000.00 | 1,225,635.50 | |
| | SIGB 3.25% 09/01/20 | 700,000.00 | 753,200.00 | |
| | SIGB 3.375% 09/01/33 | 400,000.00 | 424,734.00 | |
| | SIGB 3.5% 03/01/27 | 800,000.00 | 867,752.00 | |
| | SIGB 3.75% 09/01/16 | 800,000.00 | 848,616.00 | |
| | SIGB 3% 09/01/24 | 950,000.00 | 993,652.50 | |
| | SIGB 4% 09/01/18 | 650,000.00 | 718,409.25 | |
| シンガポールドドル 合計 | | 10,200,000.00 | 10,631,285.25 | |

| | | | | |
|---------------------|---------------------|----------------|--------------------------------------|--|
| | | | (914,077,905) | |
| マレーシア リンギット | MGS 3.172% 07/15/16 | 2,600,000.00 | 2,593,747.00 | |
| | MGS 3.197% 10/15/15 | 500,000.00 | 499,462.50 | |
| | MGS 3.26% 03/01/18 | 1,450,000.00 | 1,436,507.75 | |
| | MGS 3.314% 10/31/17 | 2,900,000.00 | 2,881,440.00 | |
| | MGS 3.418% 08/15/22 | 2,400,000.00 | 2,326,884.00 | |
| | MGS 3.48% 03/15/23 | 1,450,000.00 | 1,407,783.25 | |
| | MGS 3.492% 03/31/20 | 1,550,000.00 | 1,529,912.00 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 1,900,000.00 | 1,776,300.50 | |
| | MGS 3.58% 09/28/18 | 2,400,000.00 | 2,399,292.00 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 100,000.00 | 94,997.50 | |
| | MGS 3.814% 02/15/17 | 2,000,000.00 | 2,015,210.00 | |
| | MGS 3.889% 07/31/20 | 1,500,000.00 | 1,506,300.00 | |
| | MGS 3.892% 03/15/27 | 350,000.00 | 341,395.25 | |
| | MGS 4.048% 09/30/21 | 350,000.00 | 355,117.00 | |
| | MGS 4.127% 04/15/32 | 2,050,000.00 | 2,003,700.75 | |
| | MGS 4.16% 07/15/21 | 2,300,000.00 | 2,344,206.00 | |
| | MGS 4.181% 07/15/24 | 950,000.00 | 970,786.00 | |
| | MGS 4.24% 02/07/18 | 2,650,000.00 | 2,706,007.75 | |
| | MGS 4.262% 09/15/16 | 4,300,000.00 | 4,376,454.00 | |
| | MGS 4.378% 11/29/19 | 4,100,000.00 | 4,227,920.00 | |
| MGS 4.392% 04/15/26 | 1,100,000.00 | 1,131,042.00 | | |
| MGS 4.72% 09/30/15 | 150,000.00 | 152,088.00 | | |
| MGS 5.248% 09/15/28 | 1,000,000.00 | 1,105,985.00 | | |
| マレーシアリンギット 合計 | | 40,050,000.00 | 40,182,538.25 (1,342,096,777) | |
| 南アフリカ ランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 20,800,000.00 | 24,264,344.00 | |
| | SAGB 6.25% 03/31/36 | 14,900,000.00 | 11,213,665.50 | |
| | SAGB 6.5% 02/28/41 | 12,400,000.00 | 9,354,436.00 | |
| | SAGB 6.75% 03/31/21 | 13,400,000.00 | 12,675,998.00 | |
| | SAGB 7.25% 01/15/20 | 12,200,000.00 | 11,975,276.00 | |
| | SAGB 7.75% 02/28/23 | 8,700,000.00 | 8,534,482.50 | |
| | SAGB 7% 02/28/31 | 16,450,000.00 | 14,014,413.00 | |
| | SAGB 8.25% 09/15/17 | 12,750,000.00 | 13,128,802.50 | |
| | SAGB 8.5% 01/31/37 | 1,700,000.00 | 1,627,333.50 | |
| | SAGB 8.75% 02/28/48 | 6,500,000.00 | 6,332,300.00 | |
| | SAGB 8% 12/21/18 | 12,000,000.00 | 12,237,660.00 | |
| 南アフリカランド 合計 | | 131,800,000.00 | 125,358,711.00 (1,217,233,083) | |
| 合計 | | | 244,680,234,637 (244,680,234,637) | |

(注1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(注4)外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|------------|------------|--------------|----------------|
| アメリカドル | 国債証券 144銘柄 | 100.0% | 39.0% |
| カナダドル | 国債証券 29銘柄 | 100.0% | 2.3% |
| メキシコペソ | 国債証券 13銘柄 | 100.0% | 1.1% |
| ユーロ | 国債証券 244銘柄 | 100.0% | 43.3% |
| イギリスポンド | 国債証券 39銘柄 | 100.0% | 8.6% |
| スイスフラン | 国債証券 5銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 8銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 5銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| デンマーククローネ | 国債証券 9銘柄 | 100.0% | 0.8% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 14銘柄 | 100.0% | 0.7% |
| オーストラリアドル | 国債証券 17銘柄 | 100.0% | 1.7% |
| シンガポールドル | 国債証券 16銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリンギット | 国債証券 23銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| 南アフリカランド | 国債証券 11銘柄 | 100.0% | 0.5% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(平成26年10月1日から平成27年3月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCマイセレクション25】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第13期 (平成26年 9月30日現在) | 第14期中間計算期間 (平成27年 3月31日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,244,403,712 | 1,271,962,159 |
| 親投資信託受益証券 | 26,163,428,716 | 28,892,888,420 |
| 未収利息 | 428 | 110 |
| 流動資産合計 | 27,407,832,856 | 30,164,850,689 |
| 資産合計 | 27,407,832,856 | 30,164,850,689 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 7,866,421 | 17,261,283 |
| 未払受託者報酬 | 4,241,605 | 4,652,356 |
| 未払委託者報酬 | 32,518,864 | 35,668,054 |
| その他未払費用 | 1,332,631 | 775,237 |
| 流動負債合計 | 45,959,521 | 58,356,930 |
| 負債合計 | 45,959,521 | 58,356,930 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 18,910,232,195 | 19,671,313,255 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 8,451,641,140 | 10,435,180,504 |
| (分配準備積立金) | 4,331,493,189 | 4,097,185,491 |
| 元本等合計 | 27,361,873,335 | 30,106,493,759 |
| 純資産合計 | 27,361,873,335 | 30,106,493,759 |
| 負債純資産合計 | 27,407,832,856 | 30,164,850,689 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第13期中間計算期間 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 3月31日 | 第14期中間計算期間 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 3月31日 |
|-------------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 300,357 | 313,170 |
| 有価証券売買等損益 | 607,545,617 | 1,656,699,704 |
| 営業収益合計 | 607,845,974 | 1,657,012,874 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 3,754,926 | 4,652,356 |
| 委託者報酬 | 28,787,671 | 35,668,054 |
| その他費用 | 625,762 | 775,237 |
| 営業費用合計 | 33,168,359 | 41,095,647 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 574,677,615 | 1,615,917,227 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 574,677,615 | 1,615,917,227 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 574,677,615 | 1,615,917,227 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） | 17,141,756 | 48,524,246 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 6,033,299,457 | 8,451,641,140 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 801,200,878 | 897,398,819 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 801,200,878 | 897,398,819 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 251,618,291 | 481,252,436 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 251,618,291 | 481,252,436 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 7,140,417,903 | 10,435,180,504 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第13期 (平成26年 9月30日現在) | 第14期中間計算期間 (平成27年 3月31日現在) |
|----------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 18,910,232,195口 | 19,671,313,255口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4469円 (14,469円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5305円 (15,305円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | 第14期中間計算期間 (平成27年 3月31日現在) |
|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |

| | 第14期中間計算期間 (平成27年 3月31日現在) |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第13期 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日 | 第14期中間計算期間 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 3月31日 |
|----------------|----------------------------------------|----------------------------------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 16,882,291,858円 | 18,910,232,195円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,563,330,174円 | 1,835,380,669円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,535,389,837円 | 1,074,299,609円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

「DCマイセレクション25」は、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成27年 3月31日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成27年 3月31日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,737,218,739 |
| 株式 | 148,003,049,280 |
| 派生商品評価勘定 | 9,672,000 |
| 未収入金 | 36,794,700 |
| 未収配当金 | 1,230,948,403 |
| 未収利息 | 151 |
| 前払金 | 4,768,000 |
| 差入委託証拠金 | 57,196,000 |
| 流動資産合計 | 151,079,647,273 |
| 資産合計 | 151,079,647,273 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 14,448,100 |
| 未払金 | 5,334,920 |
| 未払解約金 | 106,074,413 |
| 流動負債合計 | 125,857,433 |
| 負債合計 | 125,857,433 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 116,097,587,312 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 34,856,202,528 |
| 元本等合計 | 150,953,789,840 |
| 純資産合計 | 150,953,789,840 |
| 負債純資産合計 | 151,079,647,273 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成27年 3月31日現在 |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 |
| 3.収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

| | |
|--|---------------------------------|
| | (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |
|--|---------------------------------|

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成27年 3月31日現在 | |
|--------------------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 116,097,587,312口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.3002円 (13,002円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | 平成27年 3月31日現在 |
|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|-------------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成26年10月 1日 |
| 期首元本額 | 131,270,959,071円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,809,022,452円 |
| 期中一部解約元本額 | 24,982,394,211円 |
| 期末元本額 | 116,097,587,312円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル・インカム&プラス（毎月決算型） | 1,339,536,935円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 2,613,509,928円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 24,105,303円 |
| SMT TOPIXインデックス・オープン | 6,756,014,197円 |
| 世界経済インデックスファンド | 526,188,395円 |
| マイセクション25 | 30,146,386円 |
| マイセクション50 | 82,863,233円 |
| マイセクション75 | 79,604,995円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 10,898,072,906円 |
| DCマイセクション25 | 4,915,235,631円 |
| DCマイセクション50 | 15,085,042,645円 |
| DCマイセクション75 | 14,813,411,511円 |
| DC日本株式インデックス・オープン | 4,108,354,659円 |
| DCマイセクションS25 | 1,912,585,727円 |
| DCマイセクションS50 | 5,485,378,711円 |
| DCマイセクションS75 | 3,716,806,629円 |
| DC日本株式インデックス・オープンS | 2,360,352,569円 |
| DCターゲット・イヤーフンド2015 | 3,705,945円 |
| DCターゲット・イヤーフンド2025 | 426,408,078円 |
| DCターゲット・イヤーフンド2035 | 466,273,140円 |
| DCターゲット・イヤーフンド2045 | 238,652,775円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 458,014,388円 |
| 日本株式インデックス・オープン（SMA専用） | 446,435,905円 |
| 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用） | 81,890,675円 |
| マイセクション50VA1（適格機関投資家専用） | 212,771,945円 |
| マイセクション75VA1（適格機関投資家専用） | 109,018,711円 |
| 日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用） | 1,124,164,675円 |
| 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用） | 2,951,623円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 467,387,318円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 1,566,373,498円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 1,936,294,741円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 1,387,513,208円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 6,479,395,956円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 1,400,141,629円 |

| | |
|---------------------------------|----------------|
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 8,047,617,397円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 1,438,795,819円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 1,314,929,499円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 1,621,912,630円 |
| グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用) | 2,941,005,421円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 865,661,743円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 1,214,803,655円 |
| 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用) | 87,764,771円 |
| FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用) | 2,306,889,404円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 4,001,746,570円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ2 | 507,094,201円 |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 18,470,614円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 34,142,377円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 101,284,113円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 8,862,922円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 32,001,606円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成27年 3月31日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,520,681,100 | - | 2,515,905,000 | 4,776,100 |
| 合計 | | 2,520,681,100 | - | 2,515,905,000 | 4,776,100 |

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成27年 3月31日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,333,697,578 |
| 国債証券 | 249,448,962,250 |
| 地方債証券 | 18,903,023,939 |
| 特殊債券 | 25,987,030,689 |
| 社債券 | 16,272,805,400 |
| 未収入金 | 1,337,080,800 |
| 未収利息 | 475,147,921 |
| 前払費用 | 15,387,698 |
| 流動資産合計 | 314,773,136,275 |
| 資産合計 | 314,773,136,275 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 3,134,332,636 |
| 未払解約金 | 121,489,803 |
| 流動負債合計 | 3,255,822,439 |
| 負債合計 | 3,255,822,439 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 235,403,556,445 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 76,113,757,391 |
| 元本等合計 | 311,517,313,836 |
| 純資産合計 | 311,517,313,836 |
| 負債純資産合計 | 314,773,136,275 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成27年 3月31日現在 |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> |
| 3.収益及び費用の計上基準 | <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | 平成27年 3月31日現在 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 235,403,556,445口 |
| 2. 担保資産 | 先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 106,012,000円 |
| 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.3233円 (1万口当たり純資産額) (13,233円) |

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| | 平成27年 3月31日現在 |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|----------------|---------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|---------------------------|------------------|
| 期首 | 平成26年10月 1日 |
| 期首元本額 | 214,971,115,502円 |
| 期中追加設定元本額 | 32,056,771,251円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,624,330,308円 |
| 期末元本額 | 235,403,556,445円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| エマージング株式オープン | 2,227,240円 |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 1,873,670,877円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 17,512,630円 |
| S M T 国内債券インデックス・オープン | 6,606,418,070円 |
| 世界経済インデックスファンド | 336,013,868円 |
| マイセレクション25 | 81,466,773円 |
| マイセレクション50 | 89,352,053円 |
| マイセレクション75 | 25,758,753円 |
| D Cマイセレクション25 | 13,405,662,125円 |
| D Cマイセレクション50 | 17,213,143,820円 |
| D Cマイセレクション75 | 4,850,974,929円 |
| D C日本債券インデックス・オープン | 404,158,777円 |
| D C日本債券インデックス・オープンS | 54,063,813,010円 |
| D C日本債券インデックス・オープンP | 19,890,736,320円 |
| D CマイセレクションS25 | 5,264,013,923円 |
| D CマイセレクションS50 | 6,238,818,983円 |
| D CマイセレクションS75 | 1,238,089,528円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2015 | 10,582,936円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2025 | 1,172,878,350円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2035 | 643,747,135円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2045 | 164,040,057円 |
| D C世界経済インデックスファンド | 280,746,882円 |
| 日本債券インデックス・オープン（SMA専用） | 1,186,365,556円 |
| 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用） | 27,032,991円 |
| マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用） | 223,092,474円 |
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用） | 34,960,011円 |
| 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用） | 975,740円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 888,390,055円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 1,229,276,616円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 1,788,003,154円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 373,739,049円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 14,461,449,723円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 1,688,139,109円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 6,247,162,796円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 1,661,033,899円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 2,782,820,764円 |

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|------------------------------|-----------------|
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 2,328,502,755円 |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用） | 2,107,830,488円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 2,451,864,221円 |
| バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用） | 3,467,905,038円 |
| 国内バランス25VA1（適格機関投資家専用） | 234,402,628円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 4,832,427,712円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ1 | 9,024,474,907円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 7,379,151,309円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 5,772,940,227円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,139,391,606円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 510,572,277円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 5,047,200円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 87,696,779円 |
| 国内債券SMTBセレクション（SMA専用） | 28,916,500,339円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 601,100,604円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 26,731,287円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 21,855,731円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 28,801,300円 |
| 債券コア戦略ファンド | 91,061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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成27年 3月31日現在 |
|----------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 12,180,873,933 |
| コール・ローン | 740,388,172 |
| 株式 | 240,635,813,193 |
| 投資信託受益証券 | 201,386,836 |
| 投資証券 | 5,899,362,044 |
| 派生商品評価勘定 | 32,027,903 |
| 未収入金 | 2,113,766 |
| 未収配当金 | 497,608,374 |
| 未収利息 | 64 |
| 前払金 | 5,871,930 |
| 差入委託証拠金 | 899,322,716 |
| 流動資産合計 | 261,094,768,931 |
| 資産合計 | 261,094,768,931 |

| | 平成27年 3月31日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 33,769,996 |
| 未払金 | 8,155,107,330 |
| 未払解約金 | 112,193,151 |
| 流動負債合計 | 8,301,070,477 |
| 負債合計 | 8,301,070,477 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 121,312,124,998 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 131,481,573,456 |
| 元本等合計 | 252,793,698,454 |
| 純資産合計 | 252,793,698,454 |
| 負債純資産合計 | 261,094,768,931 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 平成27年 3月31日現在 |
|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> |

| 平成27年 3月31日現在 | |
|------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成27年 3月31日現在 | |
|----------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 121,312,124,998口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.0838円 (1万口当たり純資産額) (20,838円) |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 平成27年 3月31日現在 | |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|-----------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成26年10月 1日 |
| 期首元本額 | 103,878,614,653円 |
| 期中追加設定元本額 | 29,432,619,502円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,999,109,157円 |
| 期末元本額 | 121,312,124,998円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 1,633,044,190円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 14,978,494円 |

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|---------------------------------|-----------------|
| SMT グローバル株式インデックス・オープン | 22,914,478,884円 |
| 世界経済インデックスファンド | 1,683,257,941円 |
| マイセレクション25 | 4,464,949円 |
| マイセレクション50 | 21,564,155円 |
| マイセレクション75 | 24,191,908円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 1,003,611,444円 |
| DCマイセレクション25 | 838,759,893円 |
| DCマイセレクション50 | 4,122,880,413円 |
| DCマイセレクション75 | 4,515,676,079円 |
| DC外国株式インデックス・オープン | 6,208,488,784円 |
| DCマイセレクションS25 | 288,237,664円 |
| DCマイセレクションS50 | 1,482,426,353円 |
| DCマイセレクションS75 | 1,172,194,971円 |
| DCターゲット・イヤール ファンド2015 | 1,131,229円 |
| DCターゲット・イヤール ファンド2025 | 129,341,232円 |
| DCターゲット・イヤール ファンド2035 | 141,426,917円 |
| DCターゲット・イヤール ファンド2045 | 72,396,087円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 1,471,045,716円 |
| 外国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 29,208,212,922円 |
| マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用） | 55,036,132円 |
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用） | 32,599,479円 |
| 外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用） | 181,352,991円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 287,429,755円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 990,735,601円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 1,178,999,319円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 844,818,718円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 2,735,472,885円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 780,316,599円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 5,093,690,880円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 4,366,058,197円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 2,393,985,846円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 776,652,499円 |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用） | 741,720,108円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 232,540,245円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 1,682,031,648円 |
| FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 4,080,840,943円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ1 | 616,523,829円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 3,962,861,217円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 10,007,219,789円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 621,863,420円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 938,915,424円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 60,458,051円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 113,498,226円 |

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|------------------------|----------------|
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,116,702,844円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 331,975,139円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 29,645,365円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 106,369,624円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 3月31日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 6,727,021,549 | - | 6,721,149,619 | 5,871,930 |
| 合計 | | 6,727,021,549 | - | 6,721,149,619 | 5,871,930 |

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 3月31日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,295,579,563 | - | 1,299,709,400 | 4,129,837 |
| | アメリカドル | 807,873,700 | - | 811,080,000 | 3,206,300 |
| | カナダドル | 50,168,858 | - | 50,228,100 | 59,242 |
| | ユーロ | 188,433,450 | - | 188,949,500 | 516,050 |
| | イギリスポンド | 129,761,255 | - | 129,978,800 | 217,545 |
| | スイスフラン | 49,675,340 | - | 49,776,000 | 100,660 |
| | デンマーククローネ | 7,815,960 | - | 7,848,000 | 32,040 |
| | オーストラリアドル | 43,264,920 | - | 43,261,000 | 3,920 |
| | 香港ドル | 18,586,080 | - | 18,588,000 | 1,920 |
| 合計 | | 1,295,579,563 | - | 1,299,709,400 | 4,129,837 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 平成27年 3月31日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 326,363,043 |
| コール・ローン | 5,175,808,738 |
| 国債証券 | 220,228,632,835 |
| 派生商品評価勘定 | 41,350,231 |
| 未収入金 | 427,070 |
| 未収利息 | 1,929,030,181 |
| 前払費用 | 96,087,796 |
| 差入委託証拠金 | 94,369,398 |
| 流動資産合計 | 227,892,069,292 |
| 資産合計 | 227,892,069,292 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 21,498,947 |
| 前受金 | 13,869,419 |
| 未払金 | 371,500 |
| 未払解約金 | 212,993,930 |
| 流動負債合計 | 248,733,796 |
| 負債合計 | 248,733,796 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 80,594,796,541 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 147,048,538,955 |
| 元本等合計 | 227,643,335,496 |
| 純資産合計 | 227,643,335,496 |
| 負債純資産合計 | 227,892,069,292 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 平成27年 3月31日現在 |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p> |

| | |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4.収益及び費用の計上基準 | <p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | | 平成27年 3月31日現在 | |
|----------------------------|---------------------------|---------------|----------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | | 80,594,796,541口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | | 2.8245円 (28,245円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | | 平成27年 3月31日現在 | |
|----------------------|---------------------------------------------------------|---------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | | |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 | | |

| | |
|----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> | <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
|----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 平成27年 3月31日現在 |
|------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 平成26年10月 1日 |
| 期首元本額 | 95,373,091,380円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,786,578,255円 |
| 期中一部解約元本額 | 29,564,873,094円 |
| 期末元本額 | 80,594,796,541円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 3,458,668,640円 |
| 外国債券オープン（3ヶ月決算型） | 175,268,636円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 1,357,425,552円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 970,412,044円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 1,071,344,432円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 10,105,119円 |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン | 4,721,412,372円 |
| 世界経済インデックスファンド | 1,162,929,935円 |
| マイセレクション25 | 6,249,150円 |
| マイセレクション50 | 5,083,526円 |
| マイセレクション75 | 3,523,768円 |
| DCマイセレクション25 | 1,067,296,335円 |

| | |
|-----------------------------------|-----------------|
| D Cマイセレクション5 0 | 1,014,476,127円 |
| D Cマイセレクション7 5 | 662,230,822円 |
| D C外国債券インデックス・オープン | 1,347,281,833円 |
| D CマイセレクションS 2 5 | 404,313,797円 |
| D CマイセレクションS 5 0 | 366,058,871円 |
| D CマイセレクションS 7 5 | 170,992,462円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 1 5 | 412,919円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5 | 46,166,580円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5 | 33,924,092円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5 | 13,077,346円 |
| D C世界経済インデックスファンド | 1,008,855,115円 |
| 外国債券インデックス・オープン(SMA専用) | 19,050,725,558円 |
| 外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用) | 205,489,533円 |
| マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用) | 12,804,739円 |
| マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用) | 4,731,038円 |
| 外国債券インデックス・オープンV A 1(適格機関投資家専用) | 167,414,774円 |
| バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用) | 471,571,613円 |
| バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用) | 688,955,871円 |
| バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用) | 4,147,436,532円 |
| バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用) | 990,934,943円 |
| バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用) | 6,617,186,825円 |
| バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用) | 1,000,551,520円 |
| バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用) | 3,531,734,840円 |
| 世界バランスV A 1(適格機関投資家専用) | 1,605,769,631円 |
| 世界バランスV A 2(適格機関投資家専用) | 2,054,225,621円 |
| バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用) | 1,074,723,387円 |
| グローバルバランスファンドV A 3 5(適格機関投資家専用) | 2,473,113,504円 |
| バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用) | 374,930,654円 |
| バランスF(2 5)V A 1(適格機関投資家専用) | 512,824,246円 |
| F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用) | 2,184,223,655円 |
| グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用) | 1,565,875,968円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 613,318,249円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ1 | 151,351,634円 |
| コア投資戦略ファンド(安定型) | 2,687,082,688円 |
| コア投資戦略ファンド(成長型) | 6,771,269,011円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 412,737,414円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 632,089,938円 |
| D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 13,496,738円 |
| D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 235,707,722円 |
| コア投資戦略ファンド(切替型) | 721,984,951円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 75,591,759円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 60,326,466円 |
| S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり) | 332,040,794円 |
| S M T インデックスバランス・オープン | 75,065,252円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

（平成27年 3月31日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 3,864,362,295 | - | 3,878,231,714 | 13,869,419 |
| | 合計 | 3,864,362,295 | - | 3,878,231,714 | 13,869,419 |

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 3月31日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | 5,291,884,035 | - | 5,297,865,900 | 5,981,865 |
| | アメリカドル | 2,337,480,810 | - | 2,328,545,100 | 8,935,710 |
| | カナダドル | 212,351,840 | - | 211,181,000 | 1,170,840 |
| | ユーロ | 2,298,506,075 | - | 2,318,628,000 | 20,121,925 |
| | イギリスポンド | 443,545,310 | - | 439,511,800 | 4,033,510 |
| | 合計 | 5,291,884,035 | - | 5,297,865,900 | 5,981,865 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DCマイセレクション25】

【純資産額計算書】

(平成27年 4月30日現在)

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 30,475,302,840円 |
| 負債総額 | 18,333,268円 |
| 純資産総額(-) | 30,456,969,572円 |
| 発行済口数 | 19,719,951,617口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.5445円 |
| (1万口当たり純資産額) | (15,445円) |

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 153,216,501,171円 |
| 負債総額 | 773,615,693円 |
| 純資産総額(-) | 152,442,885,478円 |
| 発行済口数 | 113,555,128,626口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.3425円 |
| (1万口当たり純資産額) | (13,425円) |

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 320,807,951,265円 |
| 負債総額 | 4,171,973,207円 |
| 純資産総額(-) | 316,635,978,058円 |
| 発行済口数 | 238,485,288,568口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.3277円 |
| (1万口当たり純資産額) | (13,277円) |

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 257,608,849,167円 |
| 負債総額 | 241,135,683円 |
| 純資産総額（ - ） | 257,367,713,484円 |
| 発行済口数 | 122,338,732,110口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.1037円 |
| （1万口当たり純資産額） | （21,037円） |

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 228,938,868,622円 |
| 負債総額 | 247,355,099円 |
| 純資産総額（ - ） | 228,691,513,523円 |
| 発行済口数 | 81,000,999,715口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.8233円 |
| （1万口当たり純資産額） | （28,233円） |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成27年 4月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成27年 6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 408 | 6,829,641 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 13 | 73,091 |
| 単位型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 合計 | 421 | 6,902,731 |

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（自平成25年4月1日至平成26年3月31日）の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第29期事業年度の中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) | |
|------------|-------------------------|------------|-------------------------|------------|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | | 8,192,444 | | 10,457,599 |
| 前払費用 | | 81,751 | | 114,325 |
| 未収委託者報酬 | | 2,210,605 | | 2,735,763 |
| 未収運用受託報酬 | | 31,051 | | 15,268 |
| 未収入金 | | 676 | | - |
| 繰延税金資産 | | 61,743 | | 144,183 |
| その他 | | 19,263 | | 3,448 |
| 流動資産合計 | | 10,597,535 | | 13,470,589 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | 1 | 79,281 | 1 | 67,359 |
| 器具備品 | 1 | 103,209 | 1 | 87,378 |
| 有形固定資産合計 | | 182,491 | | 154,737 |
| 無形固定資産 | | | | |
| ソフトウェア | | 168,561 | | 203,360 |
| その他 | | 1,770 | | 4,686 |
| 無形固定資産合計 | | 170,332 | | 208,046 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 47,112 | | 69,583 |
| 長期前払費用 | | - | | 34,773 |
| 長期貸付金 | | 31,838 | | 28,838 |
| 会員権 | | 25,000 | | 25,000 |
| 繰延税金資産 | | - | | 117,743 |
| その他 | | 633 | | 553 |
| 貸倒引当金 | | 31,838 | | 28,838 |
| 投資その他の資産合計 | | 72,746 | | 247,653 |
| 固定資産合計 | | 425,570 | | 610,437 |
| 資産合計 | | 11,023,105 | | 14,081,027 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日現在) | | 当事業年度 (平成26年3月31日現在) | |
|------|-------------------------|--|-------------------------|--|
| 負債の部 | | | | |
| 流動負債 | | | | |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| 預り金 | 19,992 | 13,353 |
| 未払金 | 1,459,757 | 1,723,999 |
| 未払手数料 | 942,503 | 1,169,997 |
| その他未払金 | 517,254 | 554,001 |
| 未払費用 | 82,209 | 44,167 |
| 未払法人税等 | 204,363 | 1,467,469 |
| 未払消費税等 | 11,940 | 129,007 |
| 賞与引当金 | 92,832 | 94,659 |
| その他 | 21,231 | 14,376 |
| 流動負債合計 | 1,892,326 | 3,487,033 |
| 固定負債 | | |
| 資産除去債務 | 12,281 | 12,492 |
| 退職給付引当金 | 268,531 | 313,992 |
| 繰延税金負債 | 303,555 | - |
| 固定負債合計 | 584,368 | 326,485 |
| 負債合計 | 2,476,694 | 3,813,518 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 300,000 | 300,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 350,000 | 350,000 |
| 資本剰余金合計 | 350,000 | 350,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 59,500 | 62,500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 2,100,000 | 2,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | 5,731,912 | 7,452,293 |
| 利益剰余金合計 | 7,891,412 | 9,614,793 |
| 株主資本合計 | 8,541,412 | 10,264,793 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 4,998 | 2,715 |
| 評価・換算差額等合計 | 4,998 | 2,715 |
| 純資産合計 | 8,546,410 | 10,267,508 |
| 負債・純資産合計 | 11,023,105 | 14,081,027 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 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) |
|--------|------------------------------------------|------------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 19,128,296 | 22,773,831 |
| 運用受託報酬 | 94,659 | 55,511 |
| 営業収益合計 | 19,222,955 | 22,829,342 |

| | | | |
|----------|------------|---------|------------|
| 営業費用 | | | |
| 支払手数料 | 9,030,246 | | 10,451,296 |
| 広告宣伝費 | 73,287 | | 76,961 |
| 公告費 | 2,244 | | - |
| 調査費 | 4,132,154 | | 5,091,105 |
| 調査費 | 207,030 | | 259,236 |
| 委託調査費 | 3,922,394 | | 4,830,390 |
| 図書費 | 2,729 | | 1,479 |
| 営業雑経費 | 1,294,879 | | 1,264,334 |
| 通信費 | 21,905 | | 17,246 |
| 印刷費 | 330,735 | | 327,214 |
| 協会費 | 21,939 | | 22,524 |
| 諸会費 | 757 | | 773 |
| 情報機器関連費 | 874,151 | | 837,859 |
| その他営業雑経費 | 45,391 | | 58,716 |
| 営業費用合計 | 14,532,812 | | 16,883,698 |
| 一般管理費 | | | |
| 給料 | 2,259,238 | | 2,201,964 |
| 役員報酬 | 78,205 | | 102,330 |
| 給料・手当 | 1,967,177 | | 1,846,450 |
| 賞与 | 213,855 | | 253,183 |
| 退職給付費用 | 64,787 | | 72,029 |
| 役員退職慰労金 | - | | 1,070 |
| 福利費 | 190,716 | | 207,122 |
| 交際費 | 879 | | 2,758 |
| 旅費交通費 | 45,160 | | 45,973 |
| 租税公課 | 25,420 | | 42,862 |
| 不動産賃借料 | 129,096 | | 130,938 |
| 寄付金 | - | | 3,385 |
| 減価償却費 | 129,966 | | 119,445 |
| 諸経費 | 1 | 257,947 | 1 |
| 一般管理費合計 | 3,103,213 | | 3,047,165 |
| 営業利益 | 1,586,929 | | 2,898,479 |

(単位：千円)

| | 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) |
|-----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 1,919 | - |
| 受取利息 | 6,475 | 7,464 |
| 収益分配金 | - | 3,234 |
| 投資有価証券売却益 | 924 | 553 |
| 貸倒引当金戻入 | 3,000 | 3,000 |
| その他 | 2,552 | 1,775 |
| 営業外収益合計 | 14,873 | 16,027 |
| 営業外費用 | | |
| 長期前払費用償却 | - | 1 |
| | | 23,222 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 支払補償費 | - | 14,648 |
| 投資有価証券売却損 | 14,182 | 284 |
| その他 | 361 | 2,112 |
| 営業外費用合計 | 14,544 | 40,268 |
| 経常利益 | 1,587,257 | 2,874,238 |
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 30,000 | - |
| 特別利益合計 | 30,000 | - |
| 特別損失 | | |
| 統合関連損失 | 484,725 | - |
| 特別損失合計 | 484,725 | - |
| 税引前当期純利益 | 1,132,532 | 2,874,238 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 369,828 | 1,623,332 |
| 法人税等調整額 | 56,358 | 502,474 |
| 法人税等合計 | 426,187 | 1,120,857 |
| 当期純利益 | 706,344 | 1,753,381 |

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

| | 株主資本 | | | | |
|-----------------------------|--------|-----------|-------------|-------------|-----------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 56,500 | 2,100,000 | 2,516,273 | 4,672,773 | 4,972,773 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,000 | | 33,000 | 30,000 | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 706,344 | 706,344 | 706,344 |
| 合併による増加 | | | 2,542,294 | 2,542,294 | 2,892,294 |
| 株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額） | | | | | |

| | | | | | |
|---------|--------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 当期変動額合計 | 3,000 | - | 3,215,638 | 3,218,638 | 3,568,638 |
| 当期末残高 | 59,500 | 2,100,000 | 5,731,912 | 7,891,412 | 8,541,412 |

| | 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 | 9,859 | 9,859 | 4,962,913 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 706,344 |
| 合併による増加 | | | 2,892,294 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 14,857 | 14,857 | 14,857 |
| 当期変動額合計 | 14,857 | 14,857 | 3,583,496 |
| 当期末残高 | 4,998 | 4,998 | 8,546,410 |

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

| | 株主資本 | | | | 株主資本合計 |
|-----------------------------|--------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 59,500 | 2,100,000 | 5,731,912 | 7,891,412 | 8,541,412 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,000 | | 33,000 | 30,000 | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 1,753,381 | 1,753,381 | 1,753,381 |
| 株主資本以外の項目 の 当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | 3,000 | - | 1,720,381 | 1,723,381 | 1,723,381 |
| 当期末残高 | 62,500 | 2,100,000 | 7,452,293 | 9,614,793 | 10,264,793 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-------|--------------|------------|-----------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 4,998 | 4,998 | 8,546,410 |

| | | | |
|-------------------------|-------|-------|------------|
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 当期純利益 | | | 1,753,381 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 2,283 | 2,283 | 2,283 |
| 当期変動額合計 | 2,283 | 2,283 | 1,721,098 |
| 当期末残高 | 2,715 | 2,715 | 10,267,508 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

| | 前事業年度 (平成25年3月31日) | | 当事業年度 (平成26年3月31日) | |
|------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 建 物 | 23,594 | 千円 | 35,517 | 千円 |
| 器具備品 | 235,212 | 〃 | 188,630 | 〃 |
| 計 | 258,807 | 〃 | 224,147 | 〃 |

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成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) | |
|----------|----------------------------------------|----|----------------------------------------|----|
| | | | | |
| 諸経費 | 97,199 | 千円 | 73,276 | 千円 |
| 長期前払費用償却 | - | " | 23,222 | " |

(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. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

| 決議 | 株式の種 類 | 配当金の 総額(千 円) | 配当金の 原資 | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-----------|--------------------|------------|---------------------|------------|------------|
| 平成25年6月28日 定時株主総会 | 普通株式 | 30,000 | 利益剰余金 | 10,000 | 平成25年3月31日 | 平成25年6月28日 |

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成26年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額（*） | 時価（*） | 差額 |
|-------------|-------------|-----------|----|
| (1) 現金及び預金 | 8,192,444 | 8,192,444 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,210,605 | 2,210,605 | - |

| | | | |
|----------------------|-------------|-------------|---|
| (3) 投資有価証券 其他有価証券 | 47,112 | 47,112 | - |
| (4) 未払金 | (1,459,757) | (1,459,757) | - |

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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 | 10,457,599 | 10,457,599 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,735,763 | 2,735,763 | - |
| (3) 投資有価証券 其他有価証券 | 69,583 | 69,583 | - |
| (4) 未払金 | (1,723,999) | (1,723,999) | - |
| (5) 未払法人税等 | (1,467,469) | (1,467,469) | - |

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 金銭債権等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）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-------------------------|--------------|------|----|
| 貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの | | | |

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位：千円）

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

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 |
|--------|---------|---------|
| 23,757 | 553 | 284 |

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

| | 前事業年度 （平成25年3月31日） | 当事業年度 （平成26年3月31日） |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| （1）退職給付債務 | 268,531 | 313,992 |

| | | |
|-------------|---------|---------|
| (2) 退職給付引当金 | 268,531 | 313,992 |
|-------------|---------|---------|

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成25年3月31日) | 当事業年度 (平成26年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付費用 | 64,787 | 72,029 |

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

| | 前事業年度 (平成25年3月31日) | | 当事業年度 (平成26年3月31日) | |
|------------------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 繰延税金資産 | | | | |
| 未払事業税 | 16,142 | 千円 | 102,368 | 千円 |
| 貸倒引当金繰入限度超過額 | 11,347 | " | 10,277 | " |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 35,285 | " | 33,736 | " |
| 退職給付引当金損金算入限度超過額 | 95,704 | " | 111,906 | " |
| 減価償却超過額 | 1,067 | " | - | " |
| その他 | 11,680 | " | 13,094 | " |
| 繰延税金資産 小計 | 171,228 | " | 271,384 | " |
| 評価性引当額 | 11,347 | " | - | " |
| 繰延税金資産 合計 | 159,881 | " | 271,384 | " |
| 繰延税金負債 | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 2,767 | " | 1,503 | " |
| 投資有価証券売却益益金不算入額 | 398,925 | " | 7,953 | " |
| 繰延税金負債 合計 | 401,693 | " | 9,457 | " |
| 繰延税金資産(負債)の純額 | 241,812 | " | 261,926 | " |

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成26年法律第10号)の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」(平成26年政令第151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課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、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従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金 （百万円） | 事業の内容 又は職業 | 議決権等の所有 （被所有） 割合（%） | 関連 当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 （千円） | 科目 | 期末残高 （千円） |
|----|----------------|-----|-------------------|---------------|---------------------------|-------------------|-------|--------------|----|--------------|
|----|----------------|-----|-------------------|---------------|---------------------------|-------------------|-------|--------------|----|--------------|

| | | | | | | | | | | |
|-----|----------------------|---------|---------|------|----------|-------|----------|--------|---|---|
| 親会社 | 三井住友トラスト・ホールディングス(株) | 東京都千代田区 | 261,608 | 持株会社 | (直接)100% | 役員の兼任 | 経営指導料の支払 | 97,199 | - | - |
|-----|----------------------|---------|---------|------|----------|-------|----------|--------|---|---|

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 事業の内容 又は職業 | 議決権等の所有 (被所有) 割合(%) | 関連 当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-----|----------------------|---------|-------------------|---------------|---------------------------|-------------------|----------|--------------|----|--------------|
| 親会社 | 三井住友トラスト・ホールディングス(株) | 東京都千代田区 | 261,608 | 持株会社 | (直接)100% | 役員の兼任 | 経営指導料の支払 | 73,276 | - | - |

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成25年3月31日）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

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

(企業結合等関係)

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| | 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株当たり純資産額 | 2,848,803円51銭 | 3,422,502円93銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 235,448円31銭 | 584,460円49銭 |

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 前事業年度 (自 平成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) |
|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 当期純利益 | 706,344千円 | 1,753,381千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 706,344千円 | 1,753,381千円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 | 3,000株 |

中間貸借対照表

(単位：千円)

第29期中間会計期間末
(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産

| | |
|---------|------------|
| 現金及び預金 | 10,736,816 |
| 未収委託者報酬 | 3,496,458 |
| 繰延税金資産 | 85,943 |
| その他流動資産 | 131,122 |
| 流動資産合計 | 14,450,340 |

固定資産

| | | |
|------------|---|------------|
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 | 62,410 |
| 器具備品 | 1 | 116,552 |
| 有形固定資産合計 | | 178,963 |
| 無形固定資産 | | 193,575 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 58,781 |
| 長期貸付金 | | 27,338 |
| 会員権 | | 25,000 |
| その他の投資 | | 20,550 |
| 繰延税金資産 | | 122,025 |
| 貸倒引当金 | | 27,338 |
| 投資その他の資産合計 | | 226,357 |
| 固定資産合計 | | 598,896 |
| 資産合計 | | 15,049,237 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | | 2,137,961 |
| 未払費用 | | 69,372 |
| 未払法人税等 | | 681,263 |
| 賞与引当金 | | 93,828 |
| その他流動負債 | 2 | 185,306 |
| 流動負債合計 | | 3,167,732 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | | 328,845 |
| 資産除去債務 | | 12,599 |
| 固定負債合計 | | 341,445 |
| 負債合計 | | 3,509,177 |

(単位：千円)

第29期中間会計期間末

(平成26年9月30日)

| | | |
|----------|--|-----------|
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 300,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | | 350,000 |
| 資本剰余金合計 | | 350,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | 65,500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | 2,100,000 |
| 繰越利益剰余金 | | 8,721,600 |

| | |
|--------------|------------|
| 利益剰余金合計 | 10,887,100 |
| 株主資本合計 | 11,537,100 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 2,959 |
| 評価・換算差額等合計 | 2,959 |
| 純資産合計 | 11,540,060 |
| 負債・純資産合計 | 15,049,237 |

中間損益計算書

(単位：千円)

| | | 第29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 | | 13,096,655 |
| 運用受託報酬 | | 8,732 |
| 営業収益合計 | | 13,105,387 |
| 営業費用 | | 9,550,999 |
| 一般管理費 | 1 | 1,514,728 |
| 営業利益 | | 2,039,658 |
| 営業外収益 | 2 | 9,123 |
| 営業外費用 | | 24,340 |
| 経常利益 | | 2,024,441 |
| 税引前中間純利益 | | 2,024,441 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 668,312 |
| 法人税等調整額 | | 53,822 |
| 法人税等合計 | | 722,134 |
| 中間純利益 | | 1,302,307 |

中間株主資本等変動計算書

第29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 | | |
|---------------------------|---------|----------|---------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | |
| | | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 300,000 | 350,000 | 350,000 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | |
| 中間純利益 | | | |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | - |
| 当中間期末残高 | 300,000 | 350,000 | 350,000 |

| | 株主資本 | | | | |
|-----------------------|--------|-----------|-------------|-------------|------------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| | | | | | |
| 当期首残高 | 62,500 | 2,100,000 | 7,452,293 | 9,614,793 | 10,264,793 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,000 | | 33,000 | 30,000 | 30,000 |
| 中間純利益 | | | 1,302,307 | 1,302,307 | 1,302,307 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | 3,000 | - | 1,269,307 | 1,272,307 | 1,272,307 |
| 当中間期末残高 | 65,500 | 2,100,000 | 8,721,600 | 10,887,100 | 11,537,100 |

| | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|-----------------------|--------------|------------|------------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 2,715 | 2,715 | 10,267,508 |
| 当中間期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 30,000 |
| 中間純利益 | | | 1,302,307 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 244 | 244 | 244 |
| 当中間期変動額合計 | 244 | 244 | 1,272,551 |
| 当中間期末残高 | 2,959 | 2,959 | 11,540,060 |

重要な会計方針

| 第29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. 資産の評価基準及び評価方法 | |
| 有価証券 | |
| その他有価証券 | |
| 時価のあるもの | 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。) |
| 時価のないもの | 移動平均法による原価法によっております。 |
| 2. 固定資産の減価償却の方法 | |
| (1) 有形固定資産 | 定率法によっております。 |

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 第29期中間会計期間末 (平成26年9月30日) | |
|-----------------------------|--------------------------------------------------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 |
| | 建 物 40,466千円 |
| | 器具備品 187,949千円 |
| | 計 228,416千円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。 |

(中間損益計算書関係)

| 第29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 22,111千円 |
| | 無形固定資産 36,655千円 |
| 2 | 営業外収益の主要項目 |

| | |
|------|---------|
| 受取利息 | 3,339千円 |
|------|---------|

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29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. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(リ-ス取引関係)

第29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)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

第29期中間会計期間末(平成26年9月30日)

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

(単位:千円)

| | 貸借対照表計上額(*) | 時価(*) | 差額 |
|----------------------|-------------|-------------|----|
| (1)現金及び預金 | 10,736,816 | 10,736,816 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 3,496,458 | 3,496,458 | - |
| (3)投資有価証券 その他有価証券 | 58,778 | 58,778 | - |
| (4)未払金 | (2,137,961) | (2,137,961) | - |

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（平成26年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

| 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|--------------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| その他 | 56,226 | 51,514 | 4,711 |
| 小計 | 56,226 | 51,514 | 4,711 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 2,552 | 2,665 | 113 |
| 小計 | 2,552 | 2,665 | 113 |
| 合計 | 58,778 | 54,180 | 4,598 |

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

（デリバティブ取引関係）

第29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）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第29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）

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

（関連情報）

第29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．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|---------------------------------------------|-------------|
| PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース) | 1,703,639千円 |
| J-REIT・リサーチ・オープン(毎月決算型) | 1,456,865千円 |

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

第29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)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第29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)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第29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)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| 第29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 | 3,846,686円70銭 |
| 1株当たり中間純利益 | 434,102円38銭 |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。 | |

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第29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) |
|--------------|---------------------------------------------|
| 中間純利益 | 1,302,307千円 |
| 普通株式に係る中間純利益 | 1,302,307千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】**(1)定款の変更**

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 6月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1)受託会社**

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成26年9月末日現在）

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

(2)販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） （平成26年9月末日現在） | 事業の内容 |
|----------------|-----------------------------|-------------------------------------------------------|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。 |
| 株式会社愛媛銀行 | 19,078 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 岡三証券株式会社 | 5,000 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社紀陽銀行 | 80,096 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 139,595 | 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。 |
| 第一生命保険株式会社 | 343,104 | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。 |
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成26年9月末日現在）

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

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

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成26年 6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成26年11月28日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション25の平成25年10月1日から平成26年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCマイセレクション25の平成26年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（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、三井住友トラスト・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

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年5月29日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員業
務執行社員

公認会計士

山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション25の平成26年10月1日から平成27年3月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCマイセレクション25の平成27年3月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成26年10月1日から平成27年3月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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