

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年6月30日
【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33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートニング部長 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75
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【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75

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。

(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。

本ファンドについて、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の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(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（純資産総額）をそのときの受益権総口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより、日々変動します。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当りに換算した価額で行われます。）。また、委託者および指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）で入手できますので、委託者または指定販売会社（以下「販売会社」といいます。）にお問い合わせください。

委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

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。）

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

継続募集期間

平成26年7月1日から平成26年12月26日まで

継続募集を行う期間は、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って更新されます。

(8)【申込取扱場所】

委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(9)【払込期日】

取得申込者は、取得申込みに係る金額を指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとし、各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」または「委託会社」ということがあります。）の指定する口座を經由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託者」または「受託会社」ということがあります。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込みの指定販売会社とします。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(11)【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、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

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(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したがって取り扱われるものとし、

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(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したがって支払われます。

投資信託振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステムの帳簿（振替口座簿）への記載・記録によって行われますので、やむを得ない事情等がある場合を除き、受益証券は発行されません。

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。

なお、信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

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。

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	東証株価指数(TOPIX) ^{*1}
国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合) ^{*2}
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、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「東証株価指数(TOPIX)」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「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(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。

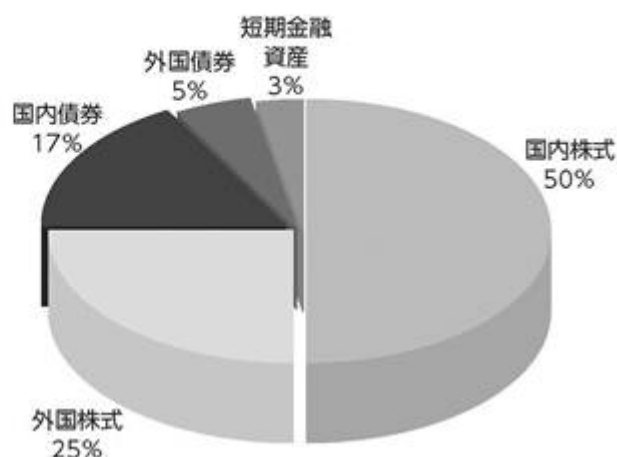
3「MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%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



分配方針

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。

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85%以下とします。

同一銘柄の株式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。

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40%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。

[ファンドの商品分類]

本ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

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)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来 の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産に 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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投 信、その他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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米		
	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり ()
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信		中南米		
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))	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ファン ズ	なし
	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変型		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表に記載している「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。

[区分における定義]

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	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))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを行います。)、実質的に複数資産(本ファンドにおいては、株式、債券、短期金融資産)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行います。 本ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて複数資産(株式、債券、短期金融資産)に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「資産複合」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券)」となっています。
決算頻度	年1回	目論見書また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行います。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書また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(日本を含みます。))の資産を源泉とする旨の記載があるものを行います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書また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きます。))を投資対象として投資する旨の記載があるものを行います。
為替ヘッジ	なし	目論見書また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または為替のヘッジを行う旨の記載がないものを行います。

(2) 【ファンドの沿革】

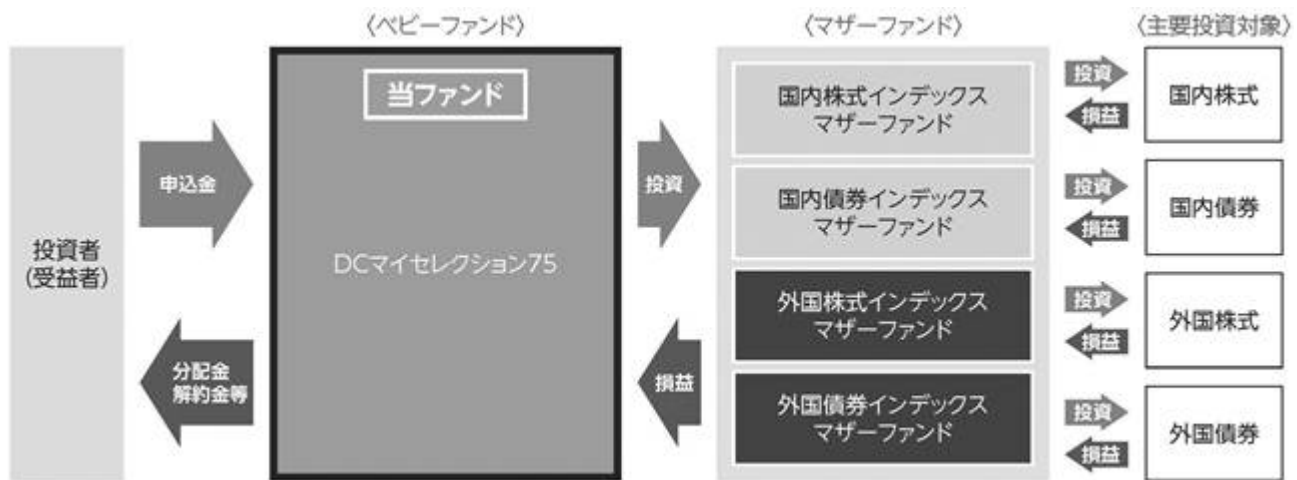
- 平成13年10月1日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
- 平成24年4月 1日 本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクション75」から「DCマイセレクション75」に変更
本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3) 【ファンドの仕組み】

(イ) ファミリーファンド方式での運用

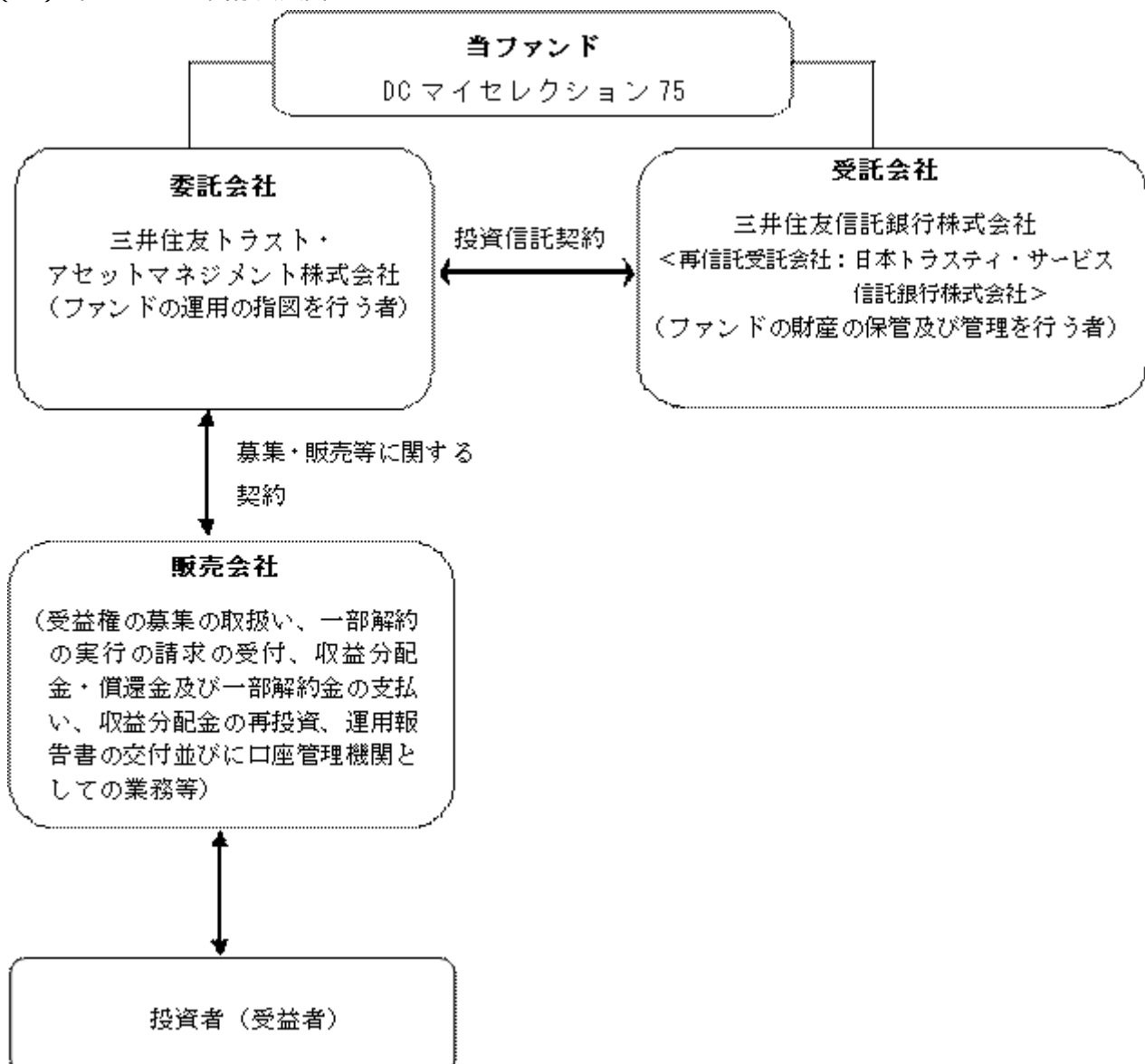
ファミリーファンド方式（ ）で運用します。

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（DCマイセレクト75）とし、その資金をマザーファンド（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 マザーファンド及び外国債券インデックス 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。



※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。

(ロ) 当ファンドの関係法人図



(八) 委託会社等の概況

資本金

平成26年4月30日現在 3億円

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

大株主の状況(平成26年4月30日現在)

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50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%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。

(参考)「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、東証株価指数（TOPIX）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、東証株価指数（TOPIX）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。

（参考）「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。

（参考）「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（除く日本、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（除く日本、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（除く日本、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（除く日本、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、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。

（参考）「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。

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、信託金を主として次に掲げる第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。

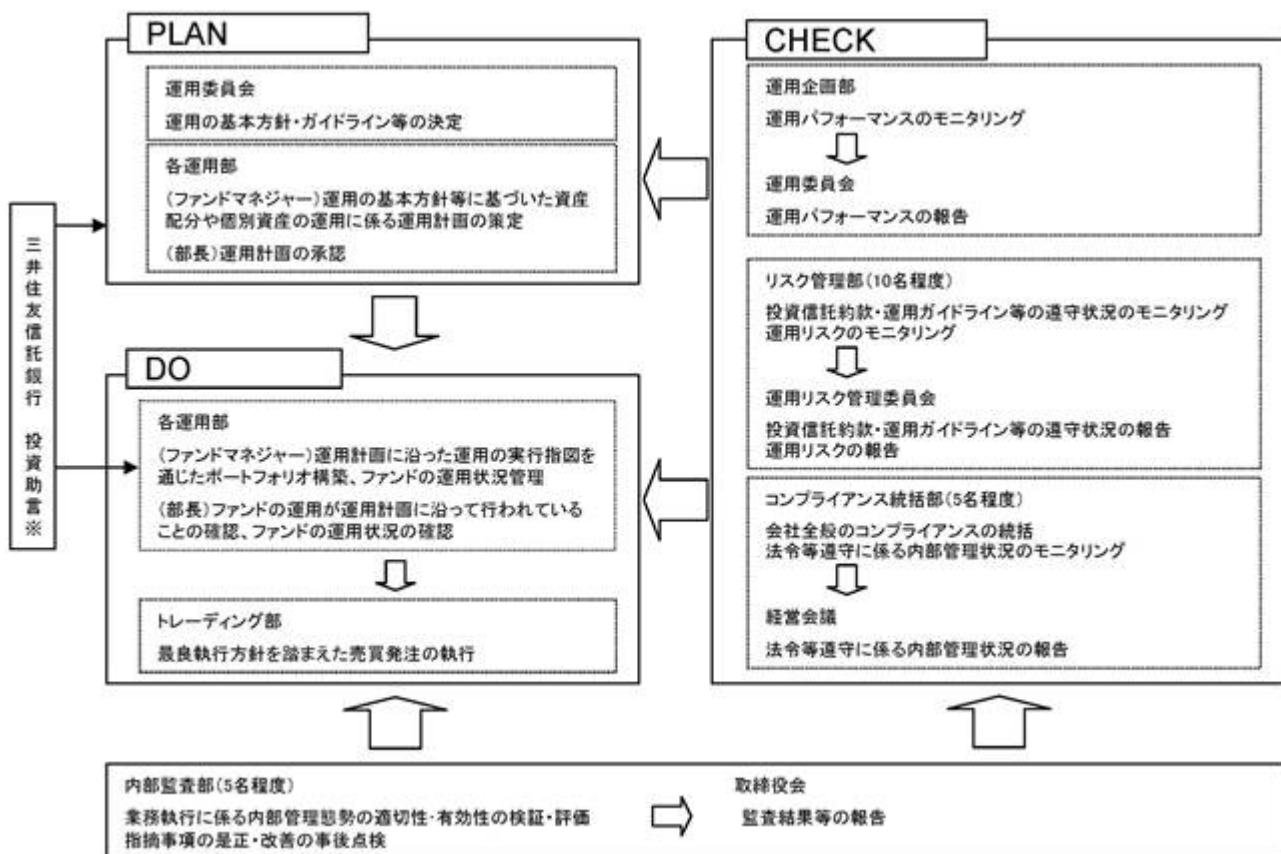
(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

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

(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、平成26年6月30日現在のものであり、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】

(イ) 分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

(ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(5)【投資制限】

(イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%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、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40%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

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

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

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）委託者は、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者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、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者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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）

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

（投資信託約款第25条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の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、
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、

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産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）

委託者は、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ことができ、この指図は、当該借入れ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）

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとし、また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の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）

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。

(ロ) 法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

< 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）

運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

< デリバティブ取引に係る投資制限 >（金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

す。）を行い、または継続することを受託会社に指図してはならない。

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。

(口) 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。

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】

ありません。

(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 0.3456%（税抜（ ） 0.32%）を乗じて得た額とします。その配分は下記のとおりです。

委託会社	年率 0.1836%	（税抜 0.17%）
販売会社	年率 0.1296%	（税抜 0.12%）
受託会社	年率 0.0324%	（税抜 0.03%）

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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】

(イ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ロ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）

(ハ) 投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

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せん。

上記は、平成26年4月30日現在のもので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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】

以下の記載は、平成26年4月30日現在の状況について記載してあります。

(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	29,095,609,540	97.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		723,004,037	2.42
合計(純資産総額)		29,818,613,577	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】

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
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	15,223,586,292	0.9772	14,877,970,798	0.9618	14,642,045,295	49.10
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	4,640,039,768	1.4414	6,688,153,322	1.6827	7,807,794,917	26.18
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	3,986,815,434	1.2736	5,077,620,580	1.2873	5,132,227,508	17.21
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	601,375,485	2.2971	1,381,448,620	2.5168	1,513,541,820	5.08

(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。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.58
合計	97.58

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	1,360,963,665	1,360,963,665	10,924	10,924
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	3,832,378,778	3,832,378,778	13,072	13,072
第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	9,683,741,259	9,683,741,259	14,861	14,861
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	14,820,213,543	14,820,213,543	15,717	15,717
第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	13,376,901,179	13,376,901,179	11,770	11,770
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	14,737,407,779	14,737,407,779	10,647	10,647
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	16,131,827,028	16,131,827,028	10,338	10,338
第10期計算期間末 (平成23年 9月30日)	17,023,679,540	17,023,679,540	9,740	9,740
第11期計算期間末 (平成24年10月 1日)	19,440,154,386	19,440,154,386	10,260	10,260
第12期計算期間末 (平成25年 9月30日)	28,620,541,787	28,620,541,787	14,959	14,959
平成25年 4月末日	28,129,835,109		14,487	
5月末日	28,071,407,777		14,498	
6月末日	27,398,693,893		14,228	
7月末日	27,753,602,174		14,388	
8月末日	27,262,241,674		14,187	
9月末日	28,620,541,787		14,959	
10月末日	29,141,628,711		15,177	
11月末日	30,221,713,219		15,826	
12月末日	31,269,602,378		16,305	
平成26年 1月末日	30,037,548,437		15,580	
2月末日	30,214,830,063		15,672	
3月末日	30,279,590,597		15,737	
4月末日	29,818,613,577		15,530	

【分配の推移】

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	0
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

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	9.4
第4期計算期間(平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	19.7
第5期計算期間(平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	13.7
第6期計算期間(平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	5.8
第7期計算期間(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	25.1
第8期計算期間(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	9.5
第9期計算期間(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	2.9
第10期計算期間(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	5.8
第11期計算期間(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	5.3
第12期計算期間(平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	45.8
第13期中間計算期間(平成25年10月 1日～平成26年 3月31日)	5.2

(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3期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	1,155,730,146	22,767,738	1,245,800,945
第4期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	1,885,857,059	199,872,844	2,931,785,160
第5期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	4,169,238,791	584,702,097	6,516,321,854
第6期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	4,003,156,930	1,089,928,632	9,429,550,152
第7期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	3,302,454,022	1,366,571,750	11,365,432,424
第8期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	3,420,020,723	943,488,620	13,841,964,527
第9期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	2,824,764,190	1,062,037,170	15,604,691,547
第10期計算期間 (平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	3,149,786,275	1,276,681,816	17,477,796,006
第11期計算期間 (平成23年10月 1日～平成24年10月 1日)	2,819,375,711	1,350,257,742	18,946,913,975
第12期計算期間 (平成24年10月 2日～平成25年 9月30日)	3,425,315,153	3,238,964,390	19,133,264,738
第13期中間計算期間 (平成25年10月 1日～平成26年 3月31日)	1,468,786,642	1,360,592,855	19,241,458,525

(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。

(参考情報)

国内株式インデックス マザーファンド

(1)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	134,634,644,360	98.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,151,181,180	1.57
合計(純資産総額)		136,785,825,540	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。

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,131,000	6,184.28	6,994,431,746	5,516.00	6,238,596,000	4.56
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,075,700	611.70	3,716,536,448	542.00	3,293,029,400	2.41
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	393,900	5,422.91	2,136,086,343	7,590.00	2,989,701,000	2.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	731,300	3,982.47	2,912,382,882	3,380.00	2,471,794,000	1.81
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	606,600	4,205.04	2,550,778,132	4,033.00	2,446,417,800	1.79
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,403,100	201.04	2,091,523,040	200.00	2,080,620,000	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	315,200	5,208.57	1,641,742,710	5,661.00	1,784,347,200	1.30
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	504,700	3,594.11	1,813,947,960	3,356.00	1,693,773,200	1.24
日本	株式	ファナック	電気機器	90,700	15,340.08	1,391,345,550	18,400.00	1,668,880,000	1.22
日本	株式	キヤノン	電気機器	471,200	3,634.40	1,712,530,642	3,215.00	1,514,908,000	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	318,800	4,682.98	1,492,935,690	4,588.00	1,462,654,400	1.07
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,956,000	702.43	1,373,957,600	727.00	1,422,012,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	249,000	4,884.76	1,216,306,615	5,442.00	1,355,058,000	0.99
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	335,500	3,682.50	1,235,480,370	4,031.00	1,352,400,500	0.99
日本	株式	三菱地所	不動産業	561,000	2,641.65	1,481,967,950	2,314.00	1,298,154,000	0.95
日本	株式	三菱商事	卸売業	625,800	1,850.13	1,157,814,305	1,828.00	1,143,962,400	0.84
日本	株式	三井不動産	不動産業	378,000	2,984.62	1,128,187,820	3,021.00	1,141,938,000	0.83
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	980,000	1,089.11	1,067,332,975	1,137.00	1,114,260,000	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	149,500	7,699.02	1,151,003,924	7,453.00	1,114,223,500	0.81
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	660,900	1,522.40	1,006,154,905	1,622.00	1,071,979,800	0.78

日本	株式	三井物産	卸売業	738,500	1,373.11	1,014,044,485	1,449.00	1,070,086,500	0.78
日本	株式	パナソニック	電気機器	928,500	849.45	788,719,251	1,119.00	1,038,991,500	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,140,700	1,112.96	1,269,559,715	877.00	1,000,393,900	0.73
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	266,700	3,471.88	925,953,041	3,660.00	976,122,000	0.71
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品 先物取引業	1,640,600	833.09	1,366,774,761	588.00	964,672,800	0.71
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,597,000	274.88	988,750,000	268.00	963,996,000	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	813,000	1,049.22	853,018,020	1,163.00	945,519,000	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	310,700	3,143.64	976,728,971	3,011.00	935,517,700	0.68
日本	株式	デンソー	輸送用機器	200,800	4,490.39	901,670,652	4,652.00	934,121,600	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	152,600	6,479.18	988,724,364	5,998.00	915,294,800	0.67

(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。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.43
合計	98.43

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.54
		建設業	2.61
		食料品	4.11
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.42
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.64
		ゴム製品	0.94
		ガラス・土石製品	1.01
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	1.04
		金属製品	0.68
		機械	5.10
		電気機器	12.43
		輸送用機器	11.39
		精密機器	1.37
		その他製品	1.39
		電気・ガス業	2.02
陸運業	3.84		
海運業	0.33		

	空運業	0.53
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	7.16
	卸売業	4.57
	小売業	4.22
	銀行業	9.09
	証券、商品先物取引業	1.47
	保険業	2.17
	その他金融業	1.29
	不動産業	3.21
	サービス業	2.55
合計		98.43

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	TOPIX先物	大阪取引所	買建	円	186	2,153,002,760	2,149,230,000	2,149,230,000	1.57

(注)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。

国内債券インデックス マザーファンド

(1)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	199,836,052,050	79.00
	ポーランド	200,268,000	0.08
	小計	200,036,320,050	79.08
地方債証券	日本	15,752,818,808	6.23
特殊債券	日本	21,572,440,613	8.53
	アメリカ	208,894,000	0.08
	スウェーデン	101,004,000	0.04
	韓国	100,174,000	0.04
	小計	21,982,512,613	8.69
社債券	日本	13,158,925,060	5.20
	オーストラリア	406,070,000	0.16
	オランダ	405,512,000	0.16
	アメリカ	207,319,000	0.08
	スウェーデン	102,583,000	0.04

	イギリス	101,148,000	0.04
	小計	14,381,557,060	5.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		814,860,727	0.32
合計(純資産総額)		252,968,069,258	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第113回利付国債 (5年)	3,880,000,000	100.37	3,894,591,100	100.61	3,903,900,800	0.3	2018/06/20	1.54
日本	国債証券	第332回利付国債 (10年)	3,000,000,000	99.69	2,990,821,100	100.04	3,001,350,000	0.6	2023/12/20	1.19
日本	国債証券	第116回利付国債 (5年)	2,920,000,000	100.00	2,920,164,600	100.09	2,922,657,200	0.2	2018/12/20	1.16
日本	国債証券	第105回利付国債 (5年)	2,910,000,000	99.97	2,909,327,800	100.28	2,918,177,100	0.2	2017/06/20	1.15
日本	国債証券	第97回利付国債(5 年)	2,700,000,000	100.71	2,719,289,900	100.66	2,717,820,000	0.4	2016/06/20	1.07
日本	国債証券	第328回利付国債 (10年)	2,640,000,000	97.67	2,578,603,100	100.55	2,654,546,400	0.6	2023/03/20	1.05
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	2,430,000,000	105.16	2,555,462,700	104.99	2,551,378,500	1.5	2017/12/20	1.01
日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	2,360,000,000	99.70	2,353,154,300	102.49	2,418,929,200	0.8	2022/09/20	0.96
日本	国債証券	第329回利付国債 (10年)	2,340,000,000	100.64	2,355,179,000	102.17	2,390,871,600	0.8	2023/06/20	0.95
日本	国債証券	第102回利付国債 (5年)	2,280,000,000	100.18	2,284,289,000	100.52	2,291,970,000	0.3	2016/12/20	0.91
日本	国債証券	第106回利付国債 (5年)	2,280,000,000	99.44	2,267,341,000	100.26	2,286,133,200	0.2	2017/09/20	0.90
日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	2,240,000,000	101.59	2,275,648,700	102.04	2,285,897,600	0.8	2023/09/20	0.90
日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	105.81	2,222,073,000	1.5	2018/09/20	0.88
日本	国債証券	第99回利付国債(5 年)	2,200,000,000	100.54	2,211,931,000	100.72	2,215,972,000	0.4	2016/09/20	0.88
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	105.36	2,202,107,600	1.7	2017/09/20	0.87
日本	国債証券	第103回利付国債 (5年)	2,090,000,000	100.28	2,095,882,500	100.56	2,101,704,000	0.3	2017/03/20	0.83
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	1,990,000,000	105.26	2,094,674,000	104.59	2,081,500,200	1.7	2017/03/20	0.82
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	1,960,000,000	105.25	2,062,980,300	106.04	2,078,403,600	1.3	2019/12/20	0.82

日本	国債証券	第270回利付国債 (10年)	2,000,000,000	102.26	2,045,245,400	101.38	2,027,760,000	1.3	2015/06/20	0.80
日本	国債証券	第318回利付国債 (10年)	1,910,000,000	101.76	1,943,684,700	104.34	1,992,932,200	1.0	2021/09/20	0.79
日本	国債証券	第327回利付国債 (10年)	1,940,000,000	98.94	1,919,436,000	102.39	1,986,521,200	0.8	2022/12/20	0.79
日本	国債証券	第115回利付国債 (5年)	1,960,000,000	100.03	1,960,664,700	100.15	1,962,979,200	0.2	2018/09/20	0.78
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.14	1,745,456,800	1.3	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第320回利付国債 (10年)	1,620,000,000	101.90	1,650,849,600	104.29	1,689,514,200	1.0	2021/12/20	0.67
日本	国債証券	第117回利付国債 (5年)	1,680,000,000	100.01	1,680,304,200	100.04	1,680,806,400	0.2	2019/03/20	0.66
日本	国債証券	第333回利付国債 (10年)	1,680,000,000	99.72	1,675,361,900	99.86	1,677,648,000	0.6	2024/03/20	0.66
日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	1,590,000,000	102.61	1,631,499,000	104.51	1,661,820,300	1.0	2020/09/20	0.66
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,530,000,000	106.37	1,627,497,500	106.39	1,627,828,200	1.4	2019/09/20	0.64
日本	国債証券	第321回利付国債 (10年)	1,520,000,000	102.35	1,555,868,000	104.22	1,584,235,200	1.0	2022/03/20	0.63
日本	国債証券	第315回利付国債 (10年)	1,460,000,000	104.19	1,521,241,500	105.80	1,544,753,000	1.2	2021/06/20	0.61

(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。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.08
地方債証券	6.23
特殊債券	8.69
社債券	5.69
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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

(1) 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	87,917,763,178	52.99
	イギリス	14,807,373,839	8.92
	スイス	7,213,525,466	4.35
	カナダ	7,213,255,411	4.35
	フランス	6,912,084,439	4.17
	ドイツ	6,679,900,799	4.03
	オーストラリア	5,189,205,963	3.13
	オランダ	2,638,701,234	1.59
	スペイン	2,557,700,390	1.54
	スウェーデン	2,279,390,748	1.37
	イタリア	1,791,541,821	1.08
	香港	1,645,971,748	0.99
	アイルランド	1,394,563,163	0.84
	シンガポール	1,024,998,569	0.62
	デンマーク	958,794,087	0.58
	ベルギー	893,005,012	0.54
	ジャージー	875,140,194	0.53
	キュラソー	712,638,107	0.43
	フィンランド	629,815,531	0.38
	バミューダ	622,819,044	0.38
	ノルウェー	506,564,033	0.31
	イスラエル	363,114,858	0.22
	ルクセンブルク	289,149,491	0.17
	オーストリア	207,033,104	0.12
	ケイマン	187,881,906	0.11
	ポルトガル	139,629,802	0.08
	ニュージーランド	96,245,548	0.06
	英ヴァージン諸島	91,720,996	0.06
	パナマ	81,119,644	0.05
	リベリア	42,409,060	0.03
ガーンジー	38,258,847	0.02	
マン島	34,035,870	0.02	
モーリシャス	13,931,904	0.01	
小計	156,049,283,806	94.05	
新株予約権証券	香港	542,893	0.00
投資信託受益証券	オーストラリア	84,319,516	0.05
	シンガポール	15,629,555	0.01
	香港	14,085,981	0.01
	小計	114,035,052	0.07
投資証券	アメリカ	2,395,752,629	1.44
	オーストラリア	380,845,586	0.23
	フランス	225,923,102	0.14

	イギリス	222,322,432	0.13
	香港	62,925,187	0.04
	シンガポール	51,124,527	0.03
	カナダ	35,611,217	0.02
	オランダ	16,529,287	0.01
	小計	3,391,033,967	2.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,365,133,046	3.84
合計(純資産総額)		165,920,028,764	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
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	46,945	45,296.15	2,126,428,156	60,778.98	2,853,269,277	1.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	227,655	9,480.13	2,158,200,793	10,409.78	2,369,839,490	1.43
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	413,638	3,595.45	1,487,216,567	4,156.73	1,719,381,938	1.04
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	146,967	8,993.76	1,321,786,881	10,366.68	1,523,561,079	0.92
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	526,964	2,421.59	1,276,093,914	2,745.84	1,446,960,726	0.87
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	260,622	4,157.75	1,083,602,996	5,076.11	1,322,947,686	0.80
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	167,691	7,607.67	1,275,738,846	7,832.96	1,313,518,320	0.79
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	100,148	12,964.77	1,298,396,136	12,925.78	1,294,491,185	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	141,545	8,294.99	1,174,114,699	8,459.16	1,197,352,991	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	195,750	5,604.55	1,097,092,267	5,756.42	1,126,819,410	0.68
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	337,428	2,971.58	1,002,696,185	3,258.89	1,099,641,949	0.66
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	36,616	29,358.82	1,075,002,747	29,636.37	1,085,165,543	0.65
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	53,768	21,320.30	1,146,350,202	20,020.23	1,076,448,108	0.65
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	119,620	8,295.16	992,267,744	8,808.46	1,053,668,045	0.64

イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	996,027	1,277.75	1,272,681,467	1,055.18	1,050,994,113	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	217,991	4,976.58	1,084,850,740	4,799.06	1,046,154,002	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	277,712	3,709.35	1,030,131,423	3,634.44	1,009,329,323	0.61
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	152,060	4,894.49	744,257,213	6,025.25	916,200,913	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	555,179	1,369.84	760,508,344	1,563.77	868,175,817	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	206,810	4,361.95	902,095,106	4,162.88	860,926,805	0.52
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	967,994	832.26	805,631,785	867.83	840,063,350	0.51
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	111,418	5,693.69	634,380,198	7,298.19	813,150,023	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,416	45,652.21	658,122,332	55,032.82	793,353,151	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	199,898	3,888.52	777,309,050	3,936.87	786,973,638	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	189,918	3,565.69	677,190,137	4,115.68	781,643,062	0.47
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,416	45,511.63	656,095,793	54,147.29	780,587,433	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	157,793	5,310.06	837,891,481	4,941.69	779,765,289	0.47
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	57,815	11,530.28	666,623,467	13,184.35	762,253,709	0.46
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	83,342	9,579.66	798,388,823	8,741.34	728,521,249	0.44
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	252,135	3,076.97	775,814,201	2,875.81	725,094,584	0.44

(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。

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	94.05
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.04
合計	96.16

(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。

c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率(%)
----	---------	----	---------

株式	外国	エネルギー	10.32
		素材	5.52
		資本財	7.36
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.76
		耐久消費財・アパレル	1.51
		消費者サービス	1.64
		メディア	2.78
		小売	2.79
		食品・生活必需品小売り	2.12
		食品・飲料・タバコ	5.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.74
		ヘルスケア機器・サービス	2.83
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.77
		銀行	9.44
		各種金融	3.86
		保険	4.13
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	6.35
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.87		
電気通信サービス	3.21		
公益事業	3.26		
半導体・半導体製造装置	1.45		
合計		94.05	

(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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	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	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	83	38,187,323.50	38,839,850	3,985,357,008	2.40
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	22	3,595,853	3,659,920	342,934,504	0.21
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	スイスフラン	36	2,977,642	3,030,120	351,887,835	0.21
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	181	5,560,534.50	5,703,310	808,387,159	0.49
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	26	3,534,057	3,560,050	339,130,363	0.20
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	イギリスポンド	67	4,402,276.25	4,499,720	776,966,652	0.47

(注) 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。

外国債券インデックス マザーファンド

(1) 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	82,793,168,477	37.42
	フランス	22,991,282,441	10.39
	イタリア	22,989,938,758	10.39
	ドイツ	19,171,637,172	8.67
	イギリス	17,174,151,522	7.76
	スペイン	12,496,615,199	5.65
	オランダ	6,271,771,396	2.84
	ベルギー	6,024,198,141	2.72
	カナダ	4,996,177,548	2.26
	オーストリア	3,819,992,882	1.73
	オーストラリア	3,627,282,790	1.64
	メキシコ	2,279,797,200	1.03
	アイルランド	1,859,063,853	0.84
	デンマーク	1,781,413,712	0.81
	ポーランド	1,558,637,552	0.70
	フィンランド	1,510,518,107	0.68
	スウェーデン	1,185,695,418	0.54
	マレーシア	1,111,189,678	0.50
	南アフリカ	1,059,500,071	0.48
	スイス	890,749,991	0.40
シンガポール	773,090,955	0.35	
ノルウェー	748,294,274	0.34	
	小計	217,114,167,137	98.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,112,335,919	1.86
合計(純資産総額)		221,226,503,056	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。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	34,400,000	10,265.10	3,531,195,913	10,289.65	3,539,642,579	0.375	2015/06/30	1.60

アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,511.36	2,922,160,415	10,441.16	2,902,644,896	1.375	2015/11/30	1.31
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,270.02	2,074,544,645	10,289.85	2,078,551,530	0.375	2015/06/15	0.94
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,193.86	1,834,895,265	10,227.53	1,840,955,668	0.250	2016/04/15	0.83
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,242.16	1,628,503,916	10,265.00	1,632,136,311	0.250	2015/10/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,577.84	1,586,677,274	10,466.01	1,569,902,940	1.750	2015/07/31	0.71
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,245.76	1,434,407,643	10,273.82	1,438,335,675	0.250	2015/07/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,595.08	1,387,955,962	10,469.62	1,371,521,131	1.875	2015/06/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,272.28	1,366,214,184	10,280.43	1,367,298,488	0.625	2016/07/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	11,145.61	1,393,201,306	10,803.10	1,350,388,681	4.250	2015/08/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	12,400,000	10,235.34	1,269,183,090	10,178.83	1,262,175,150	0.750	2017/06/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	10,283.47	1,234,016,590	10,252.38	1,230,285,888	0.750	2017/01/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,116.55	1,264,569,764	9,788.63	1,223,579,152	2.000	2023/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,762.27	1,152,702,699	11,359.44	1,113,225,908	4.500	2017/05/15	0.50
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,747.23	1,105,317,434	16,532.12	1,091,120,473	4.250	2019/04/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,688.47	1,100,912,914	10,561.01	1,087,784,440	2.000	2016/01/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,077.73	1,108,550,346	9,836.53	1,082,018,438	1.250	2020/02/29	0.49
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	7,200,000	15,071.60	1,085,155,770	14,687.52	1,057,501,729	3.250	2015/07/04	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,133.78	1,057,709,687	10,881.67	1,033,758,672	3.000	2017/02/28	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	10,321.53	1,032,153,990	10,282.24	1,028,224,345	0.875	2017/01/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,000,000	15,076.88	1,055,381,866	14,632.67	1,024,286,944	3.500	2015/04/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	10,267.87	1,026,787,487	10,180.83	1,018,083,593	1.500	2019/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	10,160.85	1,016,085,264	10,170.41	1,017,041,466	1.500	2019/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,154.28	1,025,582,845	10,045.75	1,014,621,710	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,174.02	1,017,402,201	10,078.82	1,007,882,712	0.750	2017/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/31/19	10,000,000	10,006.85	1,000,685,144	9,803.06	980,306,274	1.125	2019/12/31	0.44

アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,584.05	977,573,238	9,540.92	973,174,484	1.750	2023/05/15	0.44
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000	16,535.38	959,052,527	16,466.21	955,040,718	3.750	2021/04/25	0.43
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	5,100,000	17,271.53	880,848,190	18,673.60	952,353,965	6.500	2027/11/01	0.43
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000	14,852.93	935,734,879	15,062.07	948,910,534	3.750	2016/08/01	0.43

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.14
合計	98.14

(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。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

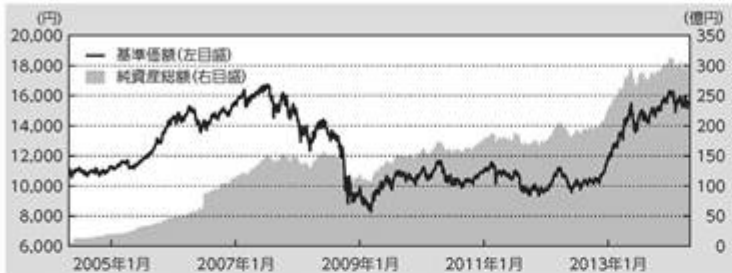
資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	14	1,665,118.52	1,668,078.16	171,161,499	0.08
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	7	864,090.52	868,000	89,065,480	0.04
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	5	667,613.75	671,875	68,941,093	0.03
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	8	883,252	883,600	125,241,464	0.06
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	9	1,128,476	1,131,120	160,324,948	0.07
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	14	2,009,926	2,019,500	286,243,930	0.13

(注) 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。

(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：2014年4月30日

基準価額・純資産の推移


基準価額	15,530円
純資産総額	298.19億円

※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(1万円当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

決算期	2009年9月	2010年9月	2011年9月	2012年10月	2013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
国内株式 インデックス マザーファンド	49.1%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ ソフトバンク	日本	株式	輸送用機器 銀行業 情報・通信業	-	-	2.2% 1.2% 1.1%
外国株式 インデックス マザーファンド	26.2%	APPLE INC EXXON MOBIL MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア エネルギー ソフトウェア・サービス	-	-	0.5% 0.4% 0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	17.2%	第113回利付国債(5年) 第332回利付国債(10年) 第116回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.3% 0.6% 0.2%	2018/06/20 2023/12/20 2018/12/20	0.3% 0.2% 0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	5.1%	T 0.375% 06/30/15 T 1.375% 11/30/15 T 0.375% 06/15/15	アメリカ	国債証券	-	0.375% 1.375% 0.375%	2015/06/30 2015/11/30 2015/06/15	0.1% 0.1% 0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2014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】

本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。

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、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または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により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また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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

（イ）申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。

取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。

取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

本ファンドの受益権の販売価額は、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。

申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとします。

本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」（以下、「分配金再投資コース」と読み替えるものとします。）専用ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金再投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金再投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。

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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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。

（ロ）申込単位

1円以上1円単位

（ハ）申込手数料

ありません。

2【換金（解約）手続等】

（イ）受益権の買取請求

本ファンドにおいては、指定販売会社による受益権の買取は行っておりません。ご換金は解約請求制のみとなります。

（ロ）受益権のご解約の請求

ご解約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者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、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

受益者が前記のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、

委託者は、前記のご解約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。

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額（解約価額）とします。信託財産留保金の控除はありません。

「信託財産留保金」（「信託財産留保額」ということがあります。）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頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドは、ご解約による換金時および償還時の差益が非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。

解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

委託者は、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、前記によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

前記により、ご解約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ご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、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ご解約の請求を受け付けたものとして、前記の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

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。）

（ハ）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（ロ）受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

(イ) 基準価額の算出方法

基準価額とは、投資信託財産に属する有価証券（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を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純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

[主要な投資対象の評価方法]

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

1) 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。

2) 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。

(ロ) 基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

(ハ) 基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「2換金（解約）手続等（ロ）受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当りに換算した価額で行われます。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

平成13年10月1日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

(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、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、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、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

(イ) 信託の終了

(a) 委託者は、投資信託約款に定める信託終了前にこの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ときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、

この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- (b)委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c)委託者は、前記(a)および(b)の事項について、あらかじめ、解約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すべ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。
- (d)前記(c)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- (e)前記(d)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、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f)委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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、この投資信託契約に係るすべ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。
- (g)前記(d)から(f)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、前記(d)の一定の期間が一月を下らずにその公告およ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。

委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ)投資信託約款の変更 (d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(ロ)投資信託約款の変更

- (a)委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (b)委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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すべ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。
- (c)前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- (d)前記(c)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、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e)委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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すべ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。

委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

- (ハ) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続
指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。
- (ニ) 運用報告書
委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。
- (ホ) 信託事務処理の再信託
受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。
- (ヘ) 公告
委託者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。

4【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

本ファンドの収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対して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。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

分配金は、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金請求権

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、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による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、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

(ハ) 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、ご解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

(ニ) 反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、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。

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

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12期計算期間(平成24年10月2日から平成25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75】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	525,802,771	847,133,522
親投資信託受益証券	18,953,947,869	27,841,590,216
未収入金	8,460,000	12,850,000
未収利息	952	890
流動資産合計	19,488,211,592	28,701,574,628
資産合計	19,488,211,592	28,701,574,628
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,771,745	32,863,021
未払受託者報酬	3,028,919	4,392,447
未払委託者報酬	29,279,538	42,460,295
その他未払費用	977,004	1,317,078
流動負債合計	48,057,206	81,032,841
負債合計	48,057,206	81,032,841
純資産の部		
元本等		
元本	18,946,913,975	19,133,264,738
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	493,240,411	9,487,277,049
（分配準備積立金）	979,678,432	5,251,110,534
元本等合計	19,440,154,386	28,620,541,787
純資産合計	19,440,154,386	28,620,541,787
負債純資産合計	19,488,211,592	28,701,574,628

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日)	第12期 (自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)
営業収益		
受取利息	305,622	396,002
有価証券売買等損益	983,109,976	9,148,792,347
営業収益合計	983,415,598	9,149,188,349
営業費用		
受託者報酬	5,862,803	7,903,192
委託者報酬	56,673,660	76,397,449
その他費用	977,004	1,317,078
営業費用合計	63,513,467	85,617,719
営業利益又は営業損失()	919,902,131	9,063,570,630
経常利益又は経常損失()	919,902,131	9,063,570,630
当期純利益又は当期純損失()	919,902,131	9,063,570,630
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()	59,967,904	1,047,039,734
期首剰余金又は期首欠損金()	454,116,466	493,240,411
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,422,650	1,134,965,262
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,043,028	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	56,379,622	1,134,965,262
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	157,459,520
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	157,459,520
期末剰余金又は期末欠損金()	493,240,411	9,487,277,049

<参考>

「DCマイセレクション75」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25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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,417,478,657
株式	142,069,740,440
派生商品評価勘定	6,156,000
未収入金	1,527,722,213
未収配当金	1,057,549,694
未収利息	1,489
差入委託証拠金	83,700,000
流動資産合計	146,162,348,493
資産合計	146,162,348,493
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,541,400
前受金	24,334,000
未払金	19,539,100
未払解約金	249,773,767
流動負債合計	315,188,267
負債合計	315,188,267
純資産の部	
元本等	
元本	149,271,308,678
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,424,148,452
元本等合計	145,847,160,226
純資産合計	145,847,160,226
負債純資産合計	146,162,348,493

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成25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 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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 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 原則として、株式の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の計上基準 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25年 9月30日現在
1. 計算期間の期首元本額	202,283,825,678円
計算期間中の追加設定元本額	22,045,665,274円
計算期間中の一部解約元本額	75,058,182,274円
計算日の元本額	149,271,308,678円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,243,873,831円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,581,752,558円
SBI資産設計オープン(分配型)	28,221,189円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,368,293,897円
世界経済インデックスファンド	239,081,429円
マイセレクション25	73,980,936円
マイセレクション50	142,735,656円
マイセレクション75	162,458,306円
日本株式インデックス・オープン	17,466,433,859円
DCマイセレクション25	4,673,661,015円
DCマイセレクション50	15,706,940,536円
DCマイセレクション75	14,799,139,344円
DC日本株式インデックス・オープン	3,886,196,205円
DCマイセレクションS25	1,621,858,394円
DCマイセレクションS50	5,151,158,994円
DCマイセレクションS75	3,278,138,792円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,301,063,563円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	15,356,726円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	409,007,923円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	417,923,333円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	191,648,376円
DC世界経済インデックスファンド	161,708,897円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	353,273,682円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	206,231,329円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	460,400,831円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	229,655,665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)	2,202,503,139円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,541,631円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	27,603,008円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,205,519,135円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	4,489,155,648円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	10,460,220,518円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,688,246,205円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,507,680,570円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,948,488,646円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,595,260,285円

世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,178,647,580円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,238,706,638円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,188,274,062円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,361,448,159円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,227,171,504円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,675,643,502円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	131,316,892円
F0Fs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,015,311,643円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,449,181,875円
日本株式ファンド・シリーズ2	509,090,344円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
2. 計算日における受益権総数	149,271,308,678口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 3,424,148,452円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9771円 (9,771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25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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(株価変動リスク)、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コンプライアンス会議に報告します。 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25年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(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>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	2,121,438,888
合計	2,121,438,888

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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	2,611,790,400	-	2,596,405,000	15,385,400
	合計	2,611,790,400	-	2,596,405,000	15,385,400

(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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年9月30日現在)

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	41,000	284.00	11,644,000	
日本水産	103,100	211.00	21,754,100	
マルハニチロホールディングス	185,000	186.00	34,410,000	
サカタのタネ	14,100	1,354.00	19,091,400	
ホクト	9,800	1,779.00	17,434,200	
住石ホールディングス	28,200	169.00	4,765,800	
日鉄鉱業	24,000	548.00	13,152,000	
三井松島産業	63,000	165.00	10,395,000	
国際石油開発帝石	466,300	1,158.00	539,975,400	
日本海洋掘削	2,400	7,550.00	18,120,000	
関東天然瓦斯開発	10,000	755.00	7,550,000	
石油資源開発	13,700	4,220.00	57,814,000	
ショーボンドホールディングス	8,500	4,465.00	37,952,500	
ミライト・ホールディングス	28,000	837.00	23,436,000	
タマホーム	4,600	1,216.00	5,593,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,710.00	2,394,000	
安藤・間	56,900	327.00	18,606,300	
東急建設	35,680	563.00	20,087,840	
コムシスホールディングス	46,600	1,368.00	63,748,800	
ミサワホーム	12,600	1,554.00	19,580,400	
高松コンストラクショングループ	7,400	1,769.00	13,090,600	
東建コーポレーション	3,750	5,440.00	20,400,000	
ヤマウラ	5,000	299.00	1,495,000	
大成建設	485,000	483.00	234,255,000	
大林組	288,000	586.00	168,768,000	
清水建設	294,000	479.00	140,826,000	
長谷工コーポレーション	119,900	703.00	84,289,700	
松井建設	13,000	400.00	5,200,000	
鹿島建設	424,000	399.00	169,176,000	
不動テトラ	67,700	181.00	12,253,700	
鉄建建設	58,000	312.00	18,096,000	
太平工業	19,000	385.00	7,315,000	
西松建設	126,000	285.00	35,910,000	
三井住友建設	198,000	124.00	24,552,000	
前田建設工業	62,000	604.00	37,448,000	
ナカノフード建設	13,500	250.00	3,375,000	
奥村組	85,000	426.00	36,210,000	

大和小田急建設	4,500	267.00	1,201,500	
東鉄工業	12,500	2,201.00	27,512,500	
イチケン	18,000	182.00	3,276,000	
戸田建設	111,000	336.00	37,296,000	
熊谷組	71,000	234.00	16,614,000	
青木あすなろ建設	5,500	592.00	3,256,000	
北野建設	25,000	225.00	5,625,000	
植木組	20,000	205.00	4,100,000	
三井ホーム	13,000	484.00	6,292,000	
矢作建設工業	13,900	525.00	7,297,500	
ピーエス三菱	8,200	487.00	3,993,400	
大東建託	36,400	9,810.00	357,084,000	
新日本建設	16,300	321.00	5,232,300	
N I P P O	22,000	1,682.00	37,004,000	
東亜道路工業	20,000	477.00	9,540,000	
前田道路	28,000	1,629.00	45,612,000	
日本道路	30,000	590.00	17,700,000	
東亜建設工業	86,000	215.00	18,490,000	
東洋建設	29,800	317.00	9,446,600	
五洋建設	115,000	274.00	31,510,000	
大林道路	13,000	545.00	7,085,000	
福田組	18,000	376.00	6,768,000	
住友林業	66,200	1,064.00	70,436,800	
日本基礎技術	11,900	425.00	5,057,500	
日成ビルド工業	37,000	194.00	7,178,000	
巴コーポレーション	13,000	521.00	6,773,000	
パナホーム	36,000	646.00	23,256,000	
大和ハウス工業	260,000	1,848.00	480,480,000	
ライト工業	22,700	775.00	17,592,500	
積水ハウス	288,000	1,318.00	379,584,000	
日特建設	10,300	416.00	4,284,800	
北陸電気工事	7,000	348.00	2,436,000	
ユアテック	15,000	321.00	4,815,000	
西部電気工業	8,000	420.00	3,360,000	
四電工	8,000	354.00	2,832,000	
中電工	13,900	1,371.00	19,056,900	
関電工	44,000	594.00	26,136,000	
きんでん	52,000	1,055.00	54,860,000	
東京エネシス	11,000	526.00	5,786,000	
トーエネック	14,000	585.00	8,190,000	
住友電設	7,100	1,337.00	9,492,700	
日本電設工業	17,000	1,067.00	18,139,000	
協和エクシオ	34,500	1,156.00	39,882,000	

新日本空調	7,100	618.00	4,387,800	
N D S	15,000	285.00	4,275,000	
九電工	16,000	528.00	8,448,000	
三機工業	21,000	603.00	12,663,000	
日揮	96,000	3,540.00	339,840,000	
中外炉工業	32,000	258.00	8,256,000	
ヤマト	11,000	360.00	3,960,000	
太平電業	12,000	718.00	8,616,000	
高砂熱学工業	27,600	833.00	22,990,800	
三晃金属工業	16,000	286.00	4,576,000	
朝日工業社	11,000	366.00	4,026,000	
明星工業	10,000	394.00	3,940,000	
大気社	13,800	2,342.00	32,319,600	
ダイダン	13,000	537.00	6,981,000	
日比谷総合設備	11,800	1,192.00	14,065,600	
東芝プラントシステム	16,000	1,627.00	26,032,000	
東洋エンジニアリング	55,000	425.00	23,375,000	
千代田化工建設	69,000	1,180.00	81,420,000	
新興プランテック	19,700	820.00	16,154,000	
日本製粉	59,000	493.00	29,087,000	
日清製粉グループ本社	95,600	990.00	94,644,000	
日東富士製粉	7,000	304.00	2,128,000	
昭和産業	39,000	304.00	11,856,000	
鳥越製粉	7,600	641.00	4,871,600	
協同飼料	33,000	115.00	3,795,000	
中部飼料	8,500	558.00	4,743,000	
日本配合飼料	27,000	126.00	3,402,000	
東洋精糖	15,000	107.00	1,605,000	
日本甜菜製糖	49,000	183.00	8,967,000	
三井製糖	38,000	309.00	11,742,000	
森永製菓	95,000	211.00	20,045,000	
中村屋	22,000	404.00	8,888,000	
江崎グリコ	35,000	930.00	32,550,000	
名糖産業	4,200	1,032.00	4,334,400	
不二家	55,000	194.00	10,670,000	
山崎製パン	70,000	1,060.00	74,200,000	
モロゾフ	15,000	315.00	4,725,000	
亀田製菓	5,400	2,937.00	15,859,800	
カルビー	35,100	2,846.00	99,894,600	
森永乳業	82,000	310.00	25,420,000	
六甲バター	2,800	788.00	2,206,400	
ヤクルト本社	56,100	4,915.00	275,731,500	
明治ホールディングス	28,400	5,370.00	152,508,000	

雪印メグミルク	18,800	1,452.00	27,297,600	
プリマハム	55,000	206.00	11,330,000	
日本ハム	73,000	1,405.00	102,565,000	
伊藤ハム	53,000	409.00	21,677,000	
丸大食品	46,000	318.00	14,628,000	
米久	3,800	771.00	2,929,800	
S Foods	6,000	903.00	5,418,000	
サッポロホールディングス	158,000	426.00	67,308,000	
アサヒグループホールディングス	192,700	2,579.00	496,973,300	
キリンホールディングス	410,000	1,429.00	585,890,000	
宝ホールディングス	76,000	895.00	68,020,000	
オエノンホールディングス	23,000	250.00	5,750,000	
養命酒製造	7,000	813.00	5,691,000	
コカ・コーラウエスト	29,500	1,961.00	57,849,500	
コカ・コーライーストジャパン	19,800	1,578.00	31,244,400	
サントリー食品インターナショナル	49,300	3,315.00	163,429,500	
ダイドードリンコ	4,800	4,025.00	19,320,000	
伊藤園	26,100	2,231.00	58,229,100	
キーコーヒー	8,400	1,563.00	13,129,200	
ユニカフェ	2,600	540.00	1,404,000	
ジャパンフーズ	1,300	1,274.00	1,656,200	
日清オイリオグループ	41,000	341.00	13,981,000	
不二製油	23,300	1,705.00	39,726,500	
かどや製油	700	2,692.00	1,884,400	
J-オイルミルズ	41,000	313.00	12,833,000	
キッコーマン	78,000	1,795.00	140,010,000	
味の素	236,000	1,290.00	304,440,000	
キューピー	48,800	1,559.00	76,079,200	
ハウス食品	33,700	1,525.00	51,392,500	
カゴメ	34,400	1,669.00	57,413,600	
焼津水産化学工業	4,500	873.00	3,928,500	
アリアケジャパン	8,700	2,432.00	21,158,400	
ニチレイ	102,000	534.00	54,468,000	
東洋水産	44,000	2,878.00	126,632,000	
日清食品ホールディングス	37,500	4,030.00	151,125,000	
永谷園	9,000	882.00	7,938,000	
フジッコ	10,000	1,211.00	12,110,000	
ロック・フィールド	5,000	1,944.00	9,720,000	
日本たばこ産業	532,800	3,530.00	1,880,784,000	
ケンコーマヨネーズ	2,900	893.00	2,589,700	
わらべや日洋	5,700	1,739.00	9,912,300	
なとり	4,400	938.00	4,127,200	
ミヨシ油脂	34,000	159.00	5,406,000	

片倉工業	10,300	1,331.00	13,709,300	
グンゼ	67,000	267.00	17,889,000	
東洋紡	379,000	188.00	71,252,000	
ユニチカ	246,000	59.00	14,514,000	
富士紡ホールディングス	43,000	222.00	9,546,000	
日清紡ホールディングス	57,000	809.00	46,113,000	
倉敷紡績	92,000	166.00	15,272,000	
シキボウ	55,000	127.00	6,985,000	
日本毛織	28,000	775.00	21,700,000	
トーア紡コーポレーション	38,000	76.00	2,888,000	
ダイドーリミテッド	10,100	706.00	7,130,600	
帝国繊維	9,000	851.00	7,659,000	
帝人	340,000	226.00	76,840,000	
東レ	694,000	645.00	447,630,000	
サカイオーベックス	24,000	148.00	3,552,000	
住江織物	29,000	252.00	7,308,000	
日本フェルト	5,100	436.00	2,223,600	
イチカワ	6,000	297.00	1,782,000	
日本バイリーン	11,000	510.00	5,610,000	
芦森工業	27,000	137.00	3,699,000	
アツギ	75,000	113.00	8,475,000	
ダイニック	17,000	171.00	2,907,000	
セーレン	24,100	666.00	16,050,600	
東海染工	12,000	120.00	1,440,000	
小松精練	15,000	516.00	7,740,000	
ワコールホールディングス	53,000	1,046.00	55,438,000	
ホギメディカル	5,700	5,440.00	31,008,000	
レナウン	19,400	134.00	2,599,600	
クラウディア	1,700	1,070.00	1,819,000	
T S Iホールディングス	47,000	663.00	31,161,000	
三陽商会	47,000	255.00	11,985,000	
オンワードホールディングス	60,000	864.00	51,840,000	
ルック	19,000	322.00	6,118,000	
ゴールドウイン	21,000	483.00	10,143,000	
デサント	23,000	707.00	16,261,000	
キング	2,800	429.00	1,201,200	
ヤマトインターナショナル	5,500	440.00	2,420,000	
特種東海製紙	52,000	206.00	10,712,000	
王子ホールディングス	396,000	460.00	182,160,000	
日本製紙	43,200	1,550.00	66,960,000	
三菱製紙	127,000	89.00	11,303,000	
北越紀州製紙	55,500	464.00	25,752,000	
中越パルプ工業	34,000	154.00	5,236,000	

巴川製紙所	14,000	176.00	2,464,000	
大王製紙	38,000	605.00	22,990,000	
レンゴー	72,000	541.00	38,952,000	
トーモク	28,000	304.00	8,512,000	
ザ・パック	6,300	1,796.00	11,314,800	
クラレ	152,600	1,175.00	179,305,000	
旭化成	559,000	739.00	413,101,000	
共和レザー	5,300	321.00	1,701,300	
コープケミカル	13,000	149.00	1,937,000	
昭和電工	597,000	133.00	79,401,000	
住友化学	616,000	374.00	230,384,000	
日本化成	17,000	140.00	2,380,000	
住友精化	17,000	587.00	9,979,000	
日産化学工業	61,400	1,477.00	90,687,800	
ラサ工業	32,000	243.00	7,776,000	
クレハ	63,000	354.00	22,302,000	
多木化学	4,000	775.00	3,100,000	
テイカ	15,000	322.00	4,830,000	
石原産業	161,000	102.00	16,422,000	
片倉チッカリン	6,000	262.00	1,572,000	
日本曹達	53,000	583.00	30,899,000	
東ソー	240,000	404.00	96,960,000	
トクヤマ	130,000	383.00	49,790,000	
セントラル硝子	80,000	325.00	26,000,000	
東亜合成	105,000	437.00	45,885,000	
ダイソー	36,000	306.00	11,016,000	
関東電化工業	21,000	218.00	4,578,000	
電気化学工業	179,000	382.00	68,378,000	
信越化学工業	160,700	6,000.00	964,200,000	
日本カーバイド工業	26,000	339.00	8,814,000	
堺化学工業	33,000	353.00	11,649,000	
エア・ウォーター	74,000	1,447.00	107,078,000	
大陽日酸	118,000	658.00	77,644,000	
日本化学工業	33,000	175.00	5,775,000	
日本パーカライジング	21,000	2,008.00	42,168,000	
高压ガス工業	13,000	529.00	6,877,000	
チタン工業	10,000	340.00	3,400,000	
四国化成工業	13,000	829.00	10,777,000	
戸田工業	13,000	314.00	4,082,000	
ステラ ケミファ	3,900	1,555.00	6,064,500	
保土谷化学工業	20,000	202.00	4,040,000	
日本触媒	65,000	1,138.00	73,970,000	
大日精化工業	32,000	429.00	13,728,000	

カネカ	112,000	640.00	71,680,000	
三菱瓦斯化学	141,000	824.00	116,184,000	
三井化学	380,000	269.00	102,220,000	
J S R	82,200	1,821.00	149,686,200	
東京応化工業	17,300	2,180.00	37,714,000	
大阪有機化学工業	6,000	449.00	2,694,000	
三菱ケミカルホールディングス	560,500	458.00	256,709,000	
日本合成化学工業	18,000	936.00	16,848,000	
ダイセル	107,000	885.00	94,695,000	
住友ベークライト	70,000	355.00	24,850,000	
積水化学工業	184,000	998.00	183,632,000	
日本ゼオン	77,000	1,252.00	96,404,000	
アイカ工業	25,200	1,955.00	49,266,000	
宇部興産	452,000	185.00	83,620,000	
積水樹脂	13,000	1,422.00	18,486,000	
タキロン	21,000	422.00	8,862,000	
旭有機材工業	32,000	225.00	7,200,000	
日立化成	38,800	1,579.00	61,265,200	
ニチバン	9,000	397.00	3,573,000	
リケンテクノス	14,000	415.00	5,810,000	
大倉工業	21,000	388.00	8,148,000	
積水化成成品工業	23,000	276.00	6,348,000	
群栄化学工業	24,000	532.00	12,768,000	
タイガースポリマー	4,500	414.00	1,863,000	
ミライアル	2,200	1,594.00	3,506,800	
日本カーリット	7,200	529.00	3,808,800	
日本化薬	63,000	1,411.00	88,893,000	
日本精化	7,400	657.00	4,861,800	
A D E K A	38,600	1,162.00	44,853,200	
日油	70,000	631.00	44,170,000	
ハリマ化成グループ	7,700	479.00	3,688,300	
花王	233,100	3,060.00	713,286,000	
第一工業製薬	16,000	243.00	3,888,000	
三洋化成工業	28,000	676.00	18,928,000	
大日本塗料	51,000	172.00	8,772,000	
日本ペイント	78,000	1,567.00	122,226,000	
関西ペイント	101,000	1,302.00	131,502,000	
神東塗料	3,000	235.00	705,000	
中国塗料	28,000	611.00	17,108,000	
日本特殊塗料	6,900	414.00	2,856,600	
藤倉化成	10,400	513.00	5,335,200	
太陽ホールディングス	7,300	3,050.00	22,265,000	
D I C	318,000	271.00	86,178,000	

サカティンクス	18,000	890.00	16,020,000	
東洋インキＳＣホールディングス	81,000	510.00	41,310,000	
T & K T O K A	3,000	2,035.00	6,105,000	
富士フイルムホールディングス	191,500	2,354.00	450,791,000	
資生堂	159,500	1,764.00	281,358,000	
ライオン	103,000	598.00	61,594,000	
高砂香料工業	30,000	513.00	15,390,000	
マンダム	9,600	3,430.00	32,928,000	
ミルボン	4,800	4,025.00	19,320,000	
ファンケル	22,600	1,195.00	27,007,000	
コーセー	16,100	2,840.00	45,724,000	
ドクターシーラボ	61	291,800.00	17,799,800	
シーボン	700	1,998.00	1,398,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,100	3,520.00	32,032,000	
ノエビアホールディングス	6,000	1,678.00	10,068,000	
エステー	5,500	1,000.00	5,500,000	
コニシ	6,500	1,899.00	12,343,500	
長谷川香料	11,300	1,436.00	16,226,800	
星光PMC	3,800	466.00	1,770,800	
小林製薬	13,600	5,620.00	76,432,000	
荒川化学工業	7,000	875.00	6,125,000	
メック	6,500	438.00	2,847,000	
日本高純度化学	24	215,300.00	5,167,200	
J C U	1,300	4,345.00	5,648,500	
新田ゼラチン	5,300	1,177.00	6,238,100	
アース製薬	6,500	3,725.00	24,212,500	
イハラケミカル工業	14,000	705.00	9,870,000	
北興化学工業	9,000	300.00	2,700,000	
大成ラミック	2,500	2,446.00	6,115,000	
クミアイ化学工業	18,000	697.00	12,546,000	
日本農薬	20,000	1,084.00	21,680,000	
アキレス	71,000	138.00	9,798,000	
有沢製作所	14,000	631.00	8,834,000	
日東電工	73,900	6,390.00	472,221,000	
レック	2,800	1,263.00	3,536,400	
きもと	8,100	978.00	7,921,800	
藤森工業	7,600	3,205.00	24,358,000	
前澤化成工業	6,300	1,054.00	6,640,200	
J S P	5,900	1,604.00	9,463,600	
エフピコ	4,400	7,380.00	32,472,000	
天馬	7,200	1,337.00	9,626,400	
信越ポリマー	17,600	340.00	5,984,000	
東リ	23,000	209.00	4,807,000	

ニフコ	20,000	2,624.00	52,480,000	
日本バルカー工業	37,000	275.00	10,175,000	
ユニ・チャーム	49,500	5,730.00	283,635,000	
協和発酵キリン	107,000	1,008.00	107,856,000	
武田薬品工業	335,700	4,635.00	1,555,969,500	
アステラス製薬	194,300	5,000.00	971,500,000	
大日本住友製薬	63,400	1,336.00	84,702,400	
塩野義製薬	130,600	2,061.00	269,166,600	
田辺三菱製薬	74,600	1,377.00	102,724,200	
わかもと製薬	10,000	276.00	2,760,000	
あすか製薬	11,000	714.00	7,854,000	
日本新薬	19,000	1,692.00	32,148,000	
ピオフェルミン製薬	1,000	2,634.00	2,634,000	
中外製薬	89,200	2,014.00	179,648,800	
科研製薬	35,000	1,489.00	52,115,000	
エーザイ	110,300	3,990.00	440,097,000	
ロート製薬	38,000	1,385.00	52,630,000	
小野薬品工業	43,800	6,030.00	264,114,000	
久光製薬	27,800	5,480.00	152,344,000	
有機合成薬品工業	6,000	291.00	1,746,000	
持田製薬	6,600	6,430.00	42,438,000	
参天製薬	30,700	4,765.00	146,285,500	
扶桑薬品工業	30,000	321.00	9,630,000	
日本ケミファ	12,000	478.00	5,736,000	
ツムラ	24,400	2,878.00	70,223,200	
日医工	13,000	2,290.00	29,770,000	
キッセイ薬品工業	16,600	2,248.00	37,316,800	
生化学工業	17,100	1,327.00	22,691,700	
栄研化学	6,400	1,833.00	11,731,200	
日水製薬	3,600	1,132.00	4,075,200	
鳥居薬品	5,400	2,640.00	14,256,000	
東和薬品	4,600	4,875.00	22,425,000	
富士製薬工業	2,500	1,737.00	4,342,500	
沢井製薬	11,800	6,890.00	81,302,000	
ゼリア新薬工業	14,100	2,135.00	30,103,500	
第一三共	282,600	1,778.00	502,462,800	
キョーリン製薬ホールディングス	23,900	2,095.00	50,070,500	
大幸薬品	4,200	1,652.00	6,938,400	
ダイト	2,900	1,456.00	4,222,400	
大塚ホールディングス	177,900	2,846.00	506,303,400	
大正製薬ホールディングス	21,600	6,470.00	139,752,000	
日本コークス工業	72,500	137.00	9,932,500	
昭和シェル石油	80,100	1,098.00	87,949,800	

コスモ石油	248,000	184.00	45,632,000	
ニチレキ	11,000	878.00	9,658,000	
東燃ゼネラル石油	135,000	907.00	122,445,000	
ユシロ化学工業	4,800	939.00	4,507,200	
ビーピー・カストロール	3,700	452.00	1,672,400	
AOCホールディングス	20,800	357.00	7,425,600	
MORESCO	1,900	1,118.00	2,124,200	
出光興産	10,600	8,500.00	90,100,000	
JXホールディングス	994,600	509.00	506,251,400	
横浜ゴム	100,000	968.00	96,800,000	
東洋ゴム工業	74,000	591.00	43,734,000	
ブリヂストン	280,900	3,575.00	1,004,217,500	
住友ゴム工業	69,900	1,511.00	105,618,900	
藤倉ゴム工業	5,000	416.00	2,080,000	
オカモト	31,000	311.00	9,641,000	
フコク	3,700	825.00	3,052,500	
ニッタ	8,800	2,094.00	18,427,200	
東海ゴム工業	16,600	955.00	15,853,000	
三ツ星ベルト	23,000	521.00	11,983,000	
パンドー化学	30,000	389.00	11,670,000	
日東紡績	66,000	414.00	27,324,000	
旭硝子	441,000	609.00	268,569,000	
日本板硝子	408,000	126.00	51,408,000	
石塚硝子	12,000	286.00	3,432,000	
日本山村硝子	36,000	185.00	6,660,000	
日本電気硝子	159,000	525.00	83,475,000	
オハラ	3,400	636.00	2,162,400	
住友大阪セメント	159,000	395.00	62,805,000	
太平洋セメント	494,000	428.00	211,432,000	
デイ・シイ	9,800	678.00	6,644,400	
日本ヒューム	9,000	865.00	7,785,000	
日本コンクリート工業	15,000	524.00	7,860,000	
三谷セキサン	2,800	1,517.00	4,247,600	
ジャパンパイル	6,800	1,064.00	7,235,200	
東海カーボン	84,000	340.00	28,560,000	
日本カーボン	47,000	197.00	9,259,000	
東洋炭素	5,000	1,830.00	9,150,000	
ノリタケカンパニーリミテド	46,000	261.00	12,006,000	
TOTO	132,000	1,374.00	181,368,000	
日本碍子	117,000	1,488.00	174,096,000	
日本特殊陶業	77,000	2,169.00	167,013,000	
MARUWA	2,000	3,490.00	6,980,000	
品川リフラクトリーズ	23,000	222.00	5,106,000	

黒崎播磨	21,000	237.00	4,977,000	
ヨータイ	4,000	314.00	1,256,000	
イソライト工業	4,400	201.00	884,400	
東京窯業	11,000	253.00	2,783,000	
ニッカトー	3,100	418.00	1,295,800	
フジインコーポレーテッド	8,200	1,324.00	10,856,800	
ニチアス	40,000	661.00	26,440,000	
ニチハ	10,200	1,339.00	13,657,800	
新日鐵住金	3,811,000	333.00	1,269,063,000	
神戸製鋼所	1,244,000	182.00	226,408,000	
合同製鐵	50,000	194.00	9,700,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	228,600	2,543.00	581,329,800	
日新製鋼ホールディングス	38,300	1,300.00	49,790,000	
東京製鐵	50,200	580.00	29,116,000	
共英製鋼	8,400	1,793.00	15,061,200	
大和工業	18,600	3,640.00	67,704,000	
東京鐵鋼	18,000	427.00	7,686,000	
大阪製鐵	4,500	1,934.00	8,703,000	
淀川製鋼所	64,000	433.00	27,712,000	
東洋鋼鈹	19,000	376.00	7,144,000	
丸一鋼管	30,000	2,438.00	73,140,000	
モリ工業	14,000	412.00	5,768,000	
大同特殊鋼	139,000	576.00	80,064,000	
日本高周波鋼業	36,000	121.00	4,356,000	
日本冶金工業	67,500	362.00	24,435,000	
山陽特殊製鋼	45,000	511.00	22,995,000	
愛知製鋼	48,000	537.00	25,776,000	
日立金属	75,000	1,204.00	90,300,000	
日本金属	23,000	153.00	3,519,000	
大平洋金属	57,000	403.00	22,971,000	
日本電工	38,000	296.00	11,248,000	
栗本鐵工所	39,000	292.00	11,388,000	
虹技	7,000	207.00	1,449,000	
日本鑄鉄管	10,000	237.00	2,370,000	
三菱製鋼	55,000	319.00	17,545,000	
日亜鋼業	13,000	348.00	4,524,000	
日本精線	6,000	480.00	2,880,000	
シンニッタン	7,100	373.00	2,648,300	
新家工業	20,000	179.00	3,580,000	
大紀アルミニウム工業所	17,000	310.00	5,270,000	
日本輕金属ホールディングス	188,400	151.00	28,448,400	
三井金属鋳業	228,000	285.00	64,980,000	
東邦亜鉛	51,000	316.00	16,116,000	

三菱マテリアル	524,000	405.00	212,220,000	
住友金属鉱山	232,000	1,386.00	321,552,000	
DOWAホールディングス	99,000	988.00	97,812,000	
古河機械金属	152,000	223.00	33,896,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,800	2,105.00	18,524,000	
東邦チタニウム	15,200	816.00	12,403,200	
住友軽金属工業	219,000	107.00	23,433,000	
古河スカイ	30,000	329.00	9,870,000	
古河電気工業	282,000	226.00	63,732,000	
住友電気工業	316,500	1,422.00	450,063,000	
フジクラ	144,000	380.00	54,720,000	
昭和電線ホールディングス	115,000	121.00	13,915,000	
タツタ電線	17,400	750.00	13,050,000	
沖電線	12,000	184.00	2,208,000	
カナレ電気	1,300	1,533.00	1,992,900	
平河ヒューテック	2,200	777.00	1,709,400	
リョービ	51,000	441.00	22,491,000	
アサヒホールディングス	13,700	1,650.00	22,605,000	
稲葉製作所	4,000	1,346.00	5,384,000	
トーカロ	5,200	1,463.00	7,607,600	
アルファC o	4,100	1,041.00	4,268,100	
SUMCO	56,300	797.00	44,871,100	
川田テクノロジーズ	2,500	2,888.00	7,220,000	
東洋製罐グループホールディングス	63,600	1,924.00	122,366,400	
ホッカンホールディングス	26,000	305.00	7,930,000	
コロナ	4,100	1,105.00	4,530,500	
横河ブリッジホールディングス	18,000	1,399.00	25,182,000	
日本橋梁	13,000	211.00	2,743,000	
駒井ハルテック	22,000	252.00	5,544,000	
高田機工	10,000	230.00	2,300,000	
三和ホールディングス	83,000	598.00	49,634,000	
文化シャッター	26,000	507.00	13,182,000	
三協立山	12,300	2,172.00	26,715,600	
東洋シャッター	4,400	614.00	2,701,600	
LIXILグループ	124,800	2,019.00	251,971,200	
日本ファイルコン	8,200	432.00	3,542,400	
ノーリツ	17,600	2,115.00	37,224,000	
長府製作所	9,600	2,248.00	21,580,800	
リンナイ	13,900	7,280.00	101,192,000	
ダイニチ工業	4,600	877.00	4,034,200	
日東精工	15,000	348.00	5,220,000	
三洋工業	16,000	196.00	3,136,000	
岡部	18,100	1,199.00	21,701,900	

東ブレ	17,700	1,262.00	22,337,400	
高周波熱錬	12,600	952.00	11,995,200	
サンコール	4,000	597.00	2,388,000	
モリテック スチール	4,500	281.00	1,264,500	
パイオラックス	3,800	3,075.00	11,685,000	
日本発條	64,900	1,004.00	65,159,600	
中央発條	12,000	330.00	3,960,000	
三益半導体工業	7,800	864.00	6,739,200	
アタカ大機	6,000	547.00	3,282,000	
日本製鋼所	138,000	569.00	78,522,000	
三浦工業	13,300	2,703.00	35,949,900	
タクマ	30,000	927.00	27,810,000	
ツガミ	24,000	484.00	11,616,000	
オークマ	58,000	852.00	49,416,000	
東芝機械	44,000	507.00	22,308,000	
アマダ	137,000	883.00	120,971,000	
アイダエンジニアリング	21,100	899.00	18,968,900	
滝澤鉄工所	26,000	154.00	4,004,000	
富士機械製造	27,400	978.00	26,797,200	
牧野フライス製作所	42,000	694.00	29,148,000	
オーエスジー	36,800	1,715.00	63,112,000	
ダイジェット工業	13,000	161.00	2,093,000	
旭ダイヤモンド工業	21,500	973.00	20,919,500	
森精機製作所	47,300	1,523.00	72,037,900	
ディスコ	10,000	5,620.00	56,200,000	
日東工器	5,300	1,842.00	9,762,600	
豊和工業	5,700	864.00	4,924,800	
大阪機工	35,000	167.00	5,845,000	
東洋機械金属	8,300	382.00	3,170,600	
津田駒工業	22,000	186.00	4,092,000	
島精機製作所	11,700	2,158.00	25,248,600	
日阪製作所	11,000	937.00	10,307,000	
やまびこ	3,500	2,763.00	9,670,500	
ベガサスミシン製造	10,000	395.00	3,950,000	
ナブテスコ	44,300	2,392.00	105,965,600	
三井海洋開発	7,400	3,075.00	22,755,000	
レオン自動機	10,000	252.00	2,520,000	
S M C	25,600	23,340.00	597,504,000	
新川	8,000	656.00	5,248,000	
ホソカワミクロン	15,000	692.00	10,380,000	
ユニオンツール	3,900	2,089.00	8,147,100	
オイレス工業	9,400	2,253.00	21,178,200	
サトーホールディングス	9,400	2,005.00	18,847,000	

日本エアーテック	3,700	487.00	1,801,900	
日精樹脂工業	7,300	671.00	4,898,300	
ワイエイシイ	4,400	553.00	2,433,200	
小松製作所	418,000	2,439.00	1,019,502,000	
住友重機械工業	245,000	446.00	109,270,000	
日立建機	45,800	2,195.00	100,531,000	
日工	12,000	452.00	5,424,000	
巴工業	3,300	1,702.00	5,616,600	
井関農機	86,000	348.00	29,928,000	
TOWA	8,900	552.00	4,912,800	
丸山製作所	21,000	278.00	5,838,000	
北川鉄工所	39,000	195.00	7,605,000	
クボタ	467,000	1,417.00	661,739,000	
荏原実業	2,400	1,331.00	3,194,400	
三菱化工機	28,000	192.00	5,376,000	
月島機械	15,000	1,036.00	15,540,000	
帝国電機製作所	2,900	1,987.00	5,762,300	
新東工業	18,100	737.00	13,339,700	
澁谷工業	5,800	2,081.00	12,069,800	
アイチ コーポレーション	14,900	528.00	7,867,200	
小森コーポレーション	21,800	1,442.00	31,435,600	
鶴見製作所	7,000	949.00	6,643,000	
住友精密工業	16,000	432.00	6,912,000	
酒井重工業	18,000	401.00	7,218,000	
荏原製作所	184,000	550.00	101,200,000	
石井鐵工所	16,000	326.00	5,216,000	
西島製作所	10,400	963.00	10,015,200	
ダイキン工業	116,800	5,210.00	608,528,000	
オルガノ	16,000	496.00	7,936,000	
トーヨーカネツ	48,000	294.00	14,112,000	
栗田工業	44,400	2,083.00	92,485,200	
椿本チエイン	46,000	684.00	31,464,000	
大同工業	21,000	271.00	5,691,000	
日本コンベヤ	28,000	156.00	4,368,000	
木村化工機	9,900	584.00	5,781,600	
アネスト岩田	14,000	495.00	6,930,000	
ダイフク	39,500	1,061.00	41,909,500	
加藤製作所	22,000	589.00	12,958,000	
油研工業	20,000	233.00	4,660,000	
タダノ	41,000	1,257.00	51,537,000	
フジテック	25,000	1,234.00	30,850,000	
CKD	24,100	863.00	20,798,300	
キトー	5,600	1,516.00	8,489,600	

平和	19,000	1,706.00	32,414,000	
理想科学工業	5,700	2,295.00	13,081,500	
SANKYO	25,900	4,795.00	124,190,500	
日本金銭機械	8,000	2,356.00	18,848,000	
マースエンジニアリング	4,900	1,895.00	9,285,500	
福島工業	4,800	1,535.00	7,368,000	
オーイズミ	3,300	1,330.00	4,389,000	
ダイコク電機	3,600	2,124.00	7,646,400	
アマノ	24,500	1,015.00	24,867,500	
サンデン	51,000	443.00	22,593,000	
マックス	13,000	1,139.00	14,807,000	
グローリー	25,600	2,465.00	63,104,000	
新晃工業	3,900	834.00	3,252,600	
大和冷機工業	14,000	618.00	8,652,000	
セガサミーホールディングス	92,000	2,829.00	260,268,000	
日本ピストンリング	31,000	181.00	5,611,000	
リケン	31,000	417.00	12,927,000	
T P R	9,700	1,804.00	17,498,800	
ホシザキ電機	18,700	3,385.00	63,299,500	
大豊工業	6,300	1,277.00	8,045,100	
日本精工	190,000	1,001.00	190,190,000	
NTN	186,000	442.00	82,212,000	
ジェイテクト	91,000	1,342.00	122,122,000	
不二越	80,000	547.00	43,760,000	
日本トムソン	30,000	557.00	16,710,000	
T H K	56,900	2,174.00	123,700,600	
ユーシン精機	4,300	1,829.00	7,864,700	
前澤給装工業	3,300	1,268.00	4,184,400	
イーグル工業	11,000	1,599.00	17,589,000	
前澤工業	7,800	392.00	3,057,600	
日本ピラー工業	9,000	721.00	6,489,000	
キッツ	35,700	443.00	15,815,100	
日立工機	23,000	775.00	17,825,000	
マキタ	52,100	5,700.00	296,970,000	
日立造船	67,800	769.00	52,138,200	
三菱重工業	1,434,000	563.00	807,342,000	
I H I	585,000	413.00	241,605,000	
イビデン	52,100	1,603.00	83,516,300	
コニカミノルタ	226,000	824.00	186,224,000	
ブラザー工業	110,600	1,106.00	122,323,600	
ミネベア	117,000	500.00	58,500,000	
日立製作所	2,055,000	647.00	1,329,585,000	
東芝	1,689,000	440.00	743,160,000	

三菱電機	856,000	1,030.00	881,680,000	
富士電機	258,000	400.00	103,200,000	
東洋電機製造	17,000	339.00	5,763,000	
安川電機	94,000	1,379.00	129,626,000	
シンフォニアテクノロジー	52,000	175.00	9,100,000	
明電舎	85,000	359.00	30,515,000	
オリジン電気	13,000	334.00	4,342,000	
山洋電気	13,000	730.00	9,490,000	
デンヨー	8,500	1,228.00	10,438,000	
東芝テック	54,000	604.00	32,616,000	
芝浦メカトロニクス	17,000	246.00	4,182,000	
マブチモーター	12,100	5,170.00	62,557,000	
日本電産	46,200	8,100.00	374,220,000	
東光高岳ホールディングス	4,300	1,707.00	7,340,100	
ダイヘン	47,000	393.00	18,471,000	
ヤーマン	1,100	1,295.00	1,424,500	
JVCケンウッド	53,300	188.00	10,020,400	
第一精工	3,600	1,379.00	4,964,400	
日新電機	17,000	527.00	8,959,000	
大崎電気工業	11,000	605.00	6,655,000	
オムロン	90,500	3,545.00	320,822,500	
日東工業	12,600	1,637.00	20,626,200	
I D E C	11,200	921.00	10,315,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	165,000	570.00	94,050,000	
サクサホールディングス	22,000	158.00	3,476,000	
メルコホールディングス	5,300	1,371.00	7,266,300	
テクノメディカ	1,800	2,163.00	3,893,400	
日本電気	1,108,000	227.00	251,516,000	
富士通	825,000	366.00	301,950,000	
沖電気工業	311,000	185.00	57,535,000	
岩崎通信機	37,000	104.00	3,848,000	
電気興業	23,000	626.00	14,398,000	
サンケン電気	43,000	501.00	21,543,000	
ナカヨ通信機	8,000	303.00	2,424,000	
アイホン	5,000	1,680.00	8,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	22,200	468.00	10,389,600	
セイコーエプソン	58,400	1,607.00	93,848,800	
ワコム	62,900	939.00	59,063,100	
アルバック	14,400	898.00	12,931,200	
アクセル	4,300	1,940.00	8,342,000	
E I Z O	7,300	2,534.00	18,498,200	
日本信号	21,600	752.00	16,243,200	
京三製作所	19,000	352.00	6,688,000	

能美防災	11,000	824.00	9,064,000	
ホーチキ	8,000	478.00	3,824,000	
エレコム	2,700	1,343.00	3,626,100	
日本無線	18,000	360.00	6,480,000	
パナソニック	977,800	948.00	926,954,400	
シャープ	454,000	360.00	163,440,000	
アンリツ	45,900	1,246.00	57,191,400	
富士通ゼネラル	20,000	1,130.00	22,600,000	
日立国際電気	20,000	1,179.00	23,580,000	
ソニー	537,800	2,098.00	1,128,304,400	
T D K	48,200	3,850.00	185,570,000	
帝国通信工業	20,000	177.00	3,540,000	
ミツミ電機	32,600	692.00	22,559,200	
タムラ製作所	33,000	255.00	8,415,000	
アルプス電気	62,700	791.00	49,595,700	
パイオニア	104,300	169.00	17,626,700	
日本電波工業	7,700	915.00	7,045,500	
日本トリム	2,300	6,000.00	13,800,000	
ローランド ディー . ジー .	3,900	2,663.00	10,385,700	
フォスター電機	8,800	2,034.00	17,899,200	
クラリオン	45,000	129.00	5,805,000	
S M K	25,000	447.00	11,175,000	
ヨコオ	6,700	530.00	3,551,000	
東光	40,000	353.00	14,120,000	
ホシデン	23,200	529.00	12,272,800	
ヒロセ電機	14,900	15,060.00	224,394,000	
日本航空電子工業	20,000	1,133.00	22,660,000	
T O A	9,000	825.00	7,425,000	
古野電気	5,200	654.00	3,400,800	
ユニデン	25,000	230.00	5,750,000	
アルパイン	16,700	1,067.00	17,818,900	
スミダコーポレーション	8,100	464.00	3,758,400	
アイコム	4,800	2,323.00	11,150,400	
リオン	2,100	1,384.00	2,906,400	
船井電機	8,700	1,059.00	9,213,300	
横河電機	85,700	1,398.00	119,808,600	
新電元工業	28,000	715.00	20,020,000	
アズビル	24,000	2,279.00	54,696,000	
日本光電工業	17,000	4,015.00	68,255,000	
チノー	15,000	221.00	3,315,000	
共和電業	10,000	362.00	3,620,000	
日本電子材料	3,800	362.00	1,375,600	
堀場製作所	15,800	3,675.00	58,065,000	

アドバンテスト	58,400	1,131.00	66,050,400	
小野測器	9,000	442.00	3,978,000	
エスベック	8,900	768.00	6,835,200	
パナソニック デバイスSUNX	7,500	426.00	3,195,000	
キーエンス	21,000	37,250.00	782,250,000	
日置電機	4,500	1,394.00	6,273,000	
シスメックス	30,300	6,260.00	189,678,000	
メガチップス	7,000	1,567.00	10,969,000	
OBARA GROUP	5,600	2,428.00	13,596,800	
日本電産コバル電子	8,900	510.00	4,539,000	
澤藤電機	6,000	246.00	1,476,000	
コーセル	12,400	1,191.00	14,768,400	
日立メディコ	6,000	1,320.00	7,920,000	
新日本無線	6,000	438.00	2,628,000	
オブテックス	5,400	1,481.00	7,997,400	
千代田インテグレ	3,800	1,364.00	5,183,200	
レーザーテック	6,300	978.00	6,161,400	
スタンレー電気	66,600	2,085.00	138,861,000	
岩崎電気	33,000	228.00	7,524,000	
ウシオ電機	52,000	1,215.00	63,180,000	
岡谷電機産業	4,600	341.00	1,568,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	7,300	277.00	2,022,100	
日本セラミック	4,900	1,415.00	6,933,500	
遠藤照明	2,100	2,207.00	4,634,700	
日本デジタル研究所	7,300	1,164.00	8,497,200	
古河電池	7,000	527.00	3,689,000	
双信電機	4,200	345.00	1,449,000	
図研	5,000	806.00	4,030,000	
日本電子	32,000	469.00	15,008,000	
カシオ計算機	81,600	908.00	74,092,800	
ファナック	89,100	16,210.00	1,444,311,000	
日本シイエムケイ	19,000	277.00	5,263,000	
エンプラス	3,800	6,220.00	23,636,000	
大真空	7,000	388.00	2,716,000	
ローム	45,200	4,030.00	182,156,000	
浜松ホトニクス	33,400	3,695.00	123,413,000	
三井ハイテック	12,400	712.00	8,828,800	
新光電気工業	28,700	1,028.00	29,503,600	
京セラ	142,300	5,210.00	741,383,000	
太陽誘電	41,600	1,277.00	53,123,200	
村田製作所	90,000	7,490.00	674,100,000	
ユーシン	12,600	732.00	9,223,200	
双葉電子工業	15,900	1,257.00	19,986,300	

北陸電気工業	34,000	143.00	4,862,000	
ニチコン	27,000	1,081.00	29,187,000	
日本ケミコン	50,000	486.00	24,300,000	
K O A	10,800	971.00	10,486,800	
市光工業	24,000	188.00	4,512,000	
小糸製作所	43,000	1,864.00	80,152,000	
ミツバ	16,000	1,756.00	28,096,000	
スター精密	15,000	962.00	14,430,000	
大日本スクリーン製造	88,000	538.00	47,344,000	
キヤノン電子	7,900	1,810.00	14,299,000	
キヤノン	496,200	3,130.00	1,553,106,000	
リコー	257,000	1,131.00	290,667,000	
M U T O Hホールディングス	12,000	492.00	5,904,000	
東京エレクトロン	72,000	5,260.00	378,720,000	
トヨタ紡織	29,900	1,313.00	39,258,700	
鬼怒川ゴム工業	16,000	598.00	9,568,000	
ユニプレス	15,100	2,079.00	31,392,900	
豊田自動織機	77,900	4,230.00	329,517,000	
モリタホールディングス	15,000	757.00	11,355,000	
三櫻工業	10,800	722.00	7,797,600	
デンソー	211,400	4,580.00	968,212,000	
東海理化電機製作所	20,000	2,076.00	41,520,000	
三井造船	331,000	201.00	66,531,000	
佐世保重工業	56,000	101.00	5,656,000	
川崎重工業	666,000	425.00	283,050,000	
名村造船所	7,400	1,300.00	9,620,000	
サノヤスホールディングス	4,600	204.00	938,400	
日本車輛製造	31,000	581.00	18,011,000	
ニチユ三菱フォークリフト	11,000	501.00	5,511,000	
近畿車輛	15,000	330.00	4,950,000	
日産自動車	1,081,100	984.00	1,063,802,400	
いすゞ自動車	496,000	646.00	320,416,000	
トヨタ自動車	1,099,400	6,270.00	6,893,238,000	
日野自動車	107,000	1,444.00	154,508,000	
三菱自動車工業	217,800	1,084.00	236,095,200	
エフテック	3,000	1,653.00	4,959,000	
G M B	600	1,193.00	715,800	
武蔵精密工業	9,100	2,506.00	22,804,600	
日産車体	29,000	1,709.00	49,561,000	
新明和工業	35,000	764.00	26,740,000	
極東開発工業	15,900	1,263.00	20,081,700	
日信工業	17,400	1,862.00	32,398,800	
トピー工業	64,000	217.00	13,888,000	

ティラド	29,000	320.00	9,280,000	
曙ブレーキ工業	39,700	453.00	17,984,100	
タチエス	11,500	1,487.00	17,100,500	
N O K	41,400	1,528.00	63,259,200	
フタバ産業	26,100	406.00	10,596,600	
カヤバ工業	65,000	634.00	41,210,000	
シロキ工業	19,000	222.00	4,218,000	
大同メタル工業	12,000	1,010.00	12,120,000	
プレス工業	36,000	433.00	15,588,000	
カルソニックカンセイ	58,000	525.00	30,450,000	
太平洋工業	17,400	727.00	12,649,800	
ケーヒン	17,700	1,577.00	27,912,900	
河西工業	10,000	601.00	6,010,000	
アイシン精機	78,300	4,185.00	327,685,500	
富士機工	10,000	306.00	3,060,000	
マツダ	1,355,000	437.00	592,135,000	
ダイハツ工業	91,000	1,900.00	172,900,000	
今仙電機製作所	6,300	1,412.00	8,895,600	
本田技研工業	722,000	3,735.00	2,696,670,000	
スズキ	178,900	2,352.00	420,772,800	
富士重工業	270,000	2,710.00	731,700,000	
ヤマハ発動機	130,100	1,434.00	186,563,400	
ショーワ	20,200	1,318.00	26,623,600	
T B K	9,000	549.00	4,941,000	
エクセディ	11,600	2,411.00	27,967,600	
豊田合成	24,200	2,416.00	58,467,200	
愛三工業	8,900	972.00	8,650,800	
ヨロズ	6,300	1,949.00	12,278,700	
エフ・シー・シー	14,000	2,262.00	31,668,000	
シマノ	37,000	8,770.00	324,490,000	
タカタ	15,500	2,470.00	38,285,000	
テイ・エス テック	18,100	3,860.00	69,866,000	
日本電産トーソク	4,100	997.00	4,087,700	
テルモ	65,600	5,030.00	329,968,000	
クリエートメディック	2,900	916.00	2,656,400	
日機装	30,000	1,033.00	30,990,000	
島津製作所	102,000	930.00	94,860,000	
J M S	14,000	321.00	4,494,000	
ショットモリテックス	1,900	284.00	539,600	
長野計器	6,100	727.00	4,434,700	
ブイ・テクノロジー	18	279,600.00	5,032,800	
東京計器	27,000	291.00	7,857,000	
愛知時計電機	10,000	289.00	2,890,000	

東京精密	15,400	1,798.00	27,689,200	
マニー	2,600	3,385.00	8,801,000	
ニコン	159,800	1,713.00	273,737,400	
トプコン	19,700	1,524.00	30,022,800	
オリンパス	113,200	2,983.00	337,675,600	
理研計器	7,000	783.00	5,481,000	
タムロン	6,600	2,166.00	14,295,600	
HOYA	208,100	2,319.00	482,583,900	
ノーリツ鋼機	7,700	656.00	5,051,200	
エー・アンド・デイ	7,800	586.00	4,570,800	
日本電産コバル	6,800	981.00	6,670,800	
シチズンホールディングス	96,600	688.00	66,460,800	
リズム時計工業	39,000	147.00	5,733,000	
大研医器	2,100	1,842.00	3,868,200	
松風	4,200	885.00	3,717,000	
セイコーホールディングス	55,000	418.00	22,990,000	
ニプロ	45,600	946.00	43,137,600	
パラマウントベッドホールディングス	7,400	3,075.00	22,755,000	
SHO-BI	2,600	422.00	1,097,200	
前田工織	6,800	1,283.00	8,724,400	
永大産業	12,000	507.00	6,084,000	
ダンロップスポーツ	4,700	1,243.00	5,842,100	
バンダイナムコホールディングス	88,500	1,835.00	162,397,500	
共立印刷	14,000	256.00	3,584,000	
フランスベッドホールディングス	54,000	205.00	11,070,000	
パイロットコーポレーション	7,500	3,705.00	27,787,500	
トッパン・フォームズ	15,300	958.00	14,657,400	
フジシールインターナショナル	10,400	2,971.00	30,898,400	
タカラトミー	28,900	453.00	13,091,700	
廣済堂	7,300	539.00	3,934,700	
タカノ	3,900	468.00	1,825,200	
プロネクサス	10,200	604.00	6,160,800	
ホクシン	8,700	185.00	1,609,500	
ウッドワン	16,000	284.00	4,544,000	
大建工業	35,000	280.00	9,800,000	
凸版印刷	242,000	791.00	191,422,000	
大日本印刷	261,000	1,038.00	270,918,000	
図書印刷	17,000	267.00	4,539,000	
共同印刷	28,000	286.00	8,008,000	
日本写真印刷	13,400	1,645.00	22,043,000	
光村印刷	8,000	266.00	2,128,000	
宝印刷	5,200	697.00	3,624,400	
アシックス	79,700	1,692.00	134,852,400	

ツツミ	4,300	2,572.00	11,059,600	
ローランド	7,900	1,025.00	8,097,500	
小松ウオール工業	3,400	1,895.00	6,443,000	
ヤマハ	62,900	1,400.00	88,060,000	
河合楽器製作所	32,000	194.00	6,208,000	
クリナップ	8,800	862.00	7,585,600	
ピジョン	12,900	4,820.00	62,178,000	
兼松日産農林	13,000	169.00	2,197,000	
キングジム	7,200	702.00	5,054,400	
リンテック	18,300	2,088.00	38,210,400	
イトーキ	18,900	512.00	9,676,800	
任天堂	48,900	11,130.00	544,257,000	
三菱鉛筆	7,100	2,350.00	16,685,000	
タカラスタANDARD	39,000	791.00	30,849,000	
コクヨ	44,500	764.00	33,998,000	
ナカバヤシ	18,000	216.00	3,888,000	
グローブライド	41,000	144.00	5,904,000	
岡村製作所	33,000	675.00	22,275,000	
美津濃	42,000	588.00	24,696,000	
アデランス	10,700	1,416.00	15,151,200	
東京電力	725,900	611.00	443,524,900	
中部電力	261,800	1,346.00	352,382,800	
関西電力	349,200	1,260.00	439,992,000	
中国電力	118,300	1,560.00	184,548,000	
北陸電力	83,800	1,434.00	120,169,200	
東北電力	213,800	1,206.00	257,842,800	
四国電力	77,100	1,667.00	128,525,700	
九州電力	189,000	1,401.00	264,789,000	
北海道電力	80,100	1,323.00	105,972,300	
沖縄電力	5,100	3,390.00	17,289,000	
電源開発	53,100	3,200.00	169,920,000	
東京瓦斯	1,003,000	538.00	539,614,000	
大阪瓦斯	830,000	418.00	346,940,000	
東邦瓦斯	218,000	514.00	112,052,000	
北海道瓦斯	15,000	262.00	3,930,000	
西部瓦斯	96,000	239.00	22,944,000	
静岡瓦斯	22,300	668.00	14,896,400	
東武鉄道	486,000	518.00	251,748,000	
相鉄ホールディングス	137,000	377.00	51,649,000	
東京急行電鉄	504,000	700.00	352,800,000	
京浜急行電鉄	220,000	928.00	204,160,000	
小田急電鉄	274,000	975.00	267,150,000	
京王電鉄	239,000	704.00	168,256,000	

京成電鉄	128,000	1,022.00	130,816,000	
富士急行	23,000	822.00	18,906,000	
新京成電鉄	11,000	390.00	4,290,000	
東日本旅客鉄道	157,400	8,440.00	1,328,456,000	
西日本旅客鉄道	73,800	4,205.00	310,329,000	
東海旅客鉄道	71,200	12,580.00	895,696,000	
鴻池運輸	3,400	1,629.00	5,538,600	
西日本鉄道	111,000	383.00	42,513,000	
ハマキョウレックス	2,400	2,823.00	6,775,200	
サカイ引越センター	1,600	2,872.00	4,595,200	
近畿日本鉄道	850,000	366.00	311,100,000	
阪急阪神ホールディングス	541,000	545.00	294,845,000	
南海電気鉄道	178,000	371.00	66,038,000	
京阪電気鉄道	192,000	400.00	76,800,000	
神戸電鉄	14,000	383.00	5,362,000	
名糖運輸	3,500	644.00	2,254,000	
名古屋鉄道	299,000	288.00	86,112,000	
山陽電気鉄道	18,000	428.00	7,704,000	
日本通運	339,000	492.00	166,788,000	
ヤマトホールディングス	159,400	2,212.00	352,592,800	
山九	104,000	324.00	33,696,000	
丸運	4,600	254.00	1,168,400	
丸全昭和運輸	29,000	339.00	9,831,000	
センコー	34,000	494.00	16,796,000	
トナミホールディングス	18,000	211.00	3,798,000	
日本梱包運輸倉庫	26,100	1,718.00	44,839,800	
日本石油輸送	10,000	220.00	2,200,000	
福山通運	52,000	639.00	33,228,000	
セイノーホールディングス	66,000	1,000.00	66,000,000	
神奈川中央交通	10,000	530.00	5,300,000	
日立物流	14,900	1,366.00	20,353,400	
日本郵船	679,000	310.00	210,490,000	
商船三井	418,000	443.00	185,174,000	
川崎汽船	382,000	230.00	87,860,000	
N S ユナイテッド海運	37,000	261.00	9,657,000	
乾汽船	10,900	394.00	4,294,600	
飯野海運	40,500	635.00	25,717,500	
共栄タンカー	17,000	251.00	4,267,000	
日本航空	96,400	5,940.00	572,616,000	
A N A ホールディングス	1,682,000	214.00	359,948,000	
パスコ	8,000	409.00	3,272,000	
トランコム	2,300	2,933.00	6,745,900	
日新	32,000	281.00	8,992,000	

三菱倉庫	61,000	1,481.00	90,341,000	
三井倉庫	40,000	547.00	21,880,000	
住友倉庫	57,000	610.00	34,770,000	
澁澤倉庫	22,000	460.00	10,120,000	
東陽倉庫	14,000	272.00	3,808,000	
日本トランスシティ	20,000	345.00	6,900,000	
ケイヒン	16,000	187.00	2,992,000	
中央倉庫	3,100	1,004.00	3,112,400	
安田倉庫	6,700	1,192.00	7,986,400	
東洋埠頭	25,000	295.00	7,375,000	
宇徳	6,900	325.00	2,242,500	
上組	95,000	834.00	79,230,000	
サンリツ	2,200	531.00	1,168,200	
キムラユニティー	1,900	995.00	1,890,500	
キューソー流通システム	2,700	1,020.00	2,754,000	
郵船ロジスティクス	6,700	1,077.00	7,215,900	
近鉄エクスプレス	7,700	3,525.00	27,142,500	
東海運	4,600	280.00	1,288,000	
エーアイティー	1,400	1,436.00	2,010,400	
N E C ネットエスアイ	7,900	2,375.00	18,762,500	
システナ	9,000	755.00	6,795,000	
デジタルアーツ	3,100	996.00	3,087,600	
新日鉄住金ソリューションズ	5,600	1,932.00	10,819,200	
コア	3,200	777.00	2,486,400	
ソフトクリエイティブホールディングス	2,800	753.00	2,108,400	
デジタルハーツ	1,600	2,013.00	3,220,800	
I T ホールディングス	28,000	1,239.00	34,692,000	
ネオス	1,700	1,400.00	2,380,000	
電算システム	1,900	1,148.00	2,181,200	
グリー	43,900	765.00	33,583,500	
コーエーテクモホールディングス	16,700	1,059.00	17,685,300	
三菱総合研究所	3,300	2,136.00	7,048,800	
ボルテージ	1,200	887.00	1,064,400	
電算	500	1,898.00	949,000	
ヒト・コミュニケーションズ	900	1,438.00	1,294,200	
ブレインパッド	700	1,317.00	921,900	
K L a b	5,700	868.00	4,947,600	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	2,794.00	5,029,200	
ネクソン	70,000	1,196.00	83,720,000	
アイスタイル	2,400	553.00	1,327,200	
エイチーム	800	2,676.00	2,140,800	
ブロードリーフ	8,300	2,133.00	17,703,900	

ドワンゴ	7,600	1,887.00	14,341,200	
ベリサーブ	500	1,870.00	935,000	
マクロミル	13,500	593.00	8,005,500	
ティーガイア	10,500	1,014.00	10,647,000	
テクマトリックス	2,500	587.00	1,467,500	
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	2,672.00	8,550,400	
ザッパラス	47	71,100.00	3,341,700	
インターネットイニシアティブ	11,000	2,827.00	31,097,000	
ビットアイル	6,400	838.00	5,363,200	
SRAホールディングス	4,100	1,116.00	4,575,600	
朝日ネット	7,000	437.00	3,059,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,000	2,400.00	4,800,000	
フェイス	2,910	1,198.00	3,486,180	
野村総合研究所	47,800	3,410.00	162,998,000	
サイバネットシステム	7,000	350.00	2,450,000	
インテージ	5,000	1,251.00	6,255,000	
ソースネクスト	4,200	898.00	3,771,600	
クレスコ	1,900	767.00	1,457,300	
フジ・メディア・ホールディングス	81,700	2,158.00	176,308,600	
オービック	29,100	3,165.00	92,101,500	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,700	790.00	1,343,000	
ヤフー	611,400	557.00	340,549,800	
トレンドマイクロ	37,300	3,655.00	136,331,500	
日本オラクル	16,900	3,660.00	61,854,000	
アルファシステムズ	2,800	1,224.00	3,427,200	
フューチャーアーキテクト	10,200	591.00	6,028,200	
シーエーシー	5,200	872.00	4,534,400	
ソフトバンク・テクノロジー	2,000	1,607.00	3,214,000	
トーセ	2,100	712.00	1,495,200	
オービックビジネスコンサルタント	5,400	3,565.00	19,251,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	10,000	3,490.00	34,900,000	
アイティフォー	9,400	400.00	3,760,000	
東計電算	1,500	1,400.00	2,100,000	
エックスネット	800	1,370.00	1,096,000	
大塚商会	7,600	12,520.00	95,152,000	
サイボウズ	127	29,420.00	3,736,340	
ソフトブレーン	11,700	135.00	1,579,500	
アグレックス	2,300	852.00	1,959,600	
電通国際情報サービス	5,200	1,061.00	5,517,200	
EMシステムズ	1,300	2,011.00	2,614,300	
ウェザーニューズ	2,200	2,296.00	5,051,200	
C I J	7,900	398.00	3,144,200	

WOWOW	2,600	3,445.00	8,957,000	
ネットワンシステムズ	30,800	743.00	22,884,400	
アルゴグラフィックス	3,100	1,736.00	5,381,600	
マーベラスAQL	12,900	536.00	6,914,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	15,600	2,860.00	44,616,000	
日本ユニシス	23,300	845.00	19,688,500	
兼松エレクトロニクス	5,300	1,277.00	6,768,100	
東京放送ホールディングス	45,600	1,333.00	60,784,800	
日本テレビホールディングス	77,100	1,819.00	140,244,900	
テレビ朝日	21,400	2,280.00	48,792,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	73,300	511.00	37,456,300	
テレビ東京ホールディングス	6,100	1,728.00	10,540,800	
アイ・ティー・シーネットワーク	7,500	934.00	7,005,000	
日本電信電話	355,600	5,080.00	1,806,448,000	
K D D I	238,300	5,040.00	1,201,032,000	
光通信	7,900	6,170.00	48,743,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	695,900	1,592.00	1,107,872,800	
G M Oインターネット	28,200	1,276.00	35,983,200	
学研ホールディングス	28,000	303.00	8,484,000	
ゼンリン	11,200	1,102.00	12,342,400	
昭文社	5,100	607.00	3,095,700	
K A D O K A W A	7,300	3,465.00	25,294,500	
インプレスホールディングス	7,100	130.00	923,000	
アイネット	3,700	712.00	2,634,400	
松竹	56,000	962.00	53,872,000	
東宝	60,300	2,046.00	123,373,800	
東映	35,000	593.00	20,755,000	
A O I P r o .	3,900	636.00	2,480,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	52,200	3,305.00	172,521,000	
D T S	8,100	1,554.00	12,587,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,700	1,555.00	47,738,500	
シーイーシー	5,500	617.00	3,393,500	
カブコン	16,200	1,888.00	30,585,600	
ジャステック	5,400	769.00	4,152,600	
S C S K	20,100	2,360.00	47,436,000	
日本システムウエア	3,200	414.00	1,324,800	
アイネス	11,500	605.00	6,957,500	
T K C	7,100	1,695.00	12,034,500	
富士ソフト	11,700	1,857.00	21,726,900	
N S D	16,700	1,103.00	18,420,100	
コナミ	38,100	2,266.00	86,334,600	

福井コンピュータホールディングス	1,200	753.00	903,600	
J B C Cホールディングス	7,100	976.00	6,929,600	
ミロク情報サービス	5,500	455.00	2,502,500	
ソフトバンク	409,100	6,790.00	2,777,789,000	
ハウスイ	7,000	136.00	952,000	
高千穂交易	3,600	950.00	3,420,000	
伊藤忠食品	2,100	3,280.00	6,888,000	
エレマテック	4,000	1,348.00	5,392,000	
J A L U X	2,400	1,167.00	2,800,800	
あらた	19,000	360.00	6,840,000	
トーメンデバイス	1,300	1,642.00	2,134,600	
東京エレクトロン デバイス	1,700	1,593.00	2,708,100	
双日	532,100	192.00	102,163,200	
アルフレッサ ホールディングス	21,900	5,060.00	110,814,000	
横浜冷凍	21,000	809.00	16,989,000	
山下医科器械	700	1,675.00	1,172,500	
ラサ商事	3,700	448.00	1,657,600	
アルコニックス	2,400	2,071.00	4,970,400	
神戸物産	600	2,390.00	1,434,000	
あい ホールディングス	15,100	1,169.00	17,651,900	
ダイワボウホールディングス	77,000	181.00	13,937,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,900	745.00	11,845,500	
八洲電機	6,200	418.00	2,591,600	
U K Cホールディングス	5,000	1,841.00	9,205,000	
T O K A Iホールディングス	33,100	349.00	11,551,900	
ミタチ産業	2,100	429.00	900,900	
シップヘルスケアホールディングス	12,100	3,825.00	46,282,500	
富士興産	3,100	592.00	1,835,200	
協栄産業	10,000	195.00	1,950,000	
小野建	7,400	1,209.00	8,946,600	
佐鳥電機	6,300	555.00	3,496,500	
エコートレーディング	2,100	791.00	1,661,100	
伯東	5,200	947.00	4,924,400	
コンドーテック	6,900	713.00	4,919,700	
中山福	4,900	758.00	3,714,200	
ナガイレーベン	11,200	1,593.00	17,841,600	
三菱食品	9,300	2,690.00	25,017,000	
松田産業	6,200	1,403.00	8,698,600	
メディバルホールディングス	84,500	1,211.00	102,329,500	
アドヴァン	4,300	1,198.00	5,151,400	
S P K	2,000	1,813.00	3,626,000	
アズワン	5,500	2,025.00	11,137,500	

スズデン	2,800	532.00	1,489,600	
尾家産業	2,800	817.00	2,287,600	
シモジマ	5,200	1,010.00	5,252,000	
ドウシシャ	9,000	1,404.00	12,636,000	
高速	5,100	947.00	4,829,700	
黒田電気	11,300	1,310.00	14,803,000	
丸文	7,600	437.00	3,321,200	
ハピネット	5,200	754.00	3,920,800	
トーメンエレクトロニクス	4,300	1,087.00	4,674,100	
エクセル	3,700	1,141.00	4,221,700	
マルカキカイ	2,800	1,514.00	4,239,200	
ガリバーインターナショナル	28,500	587.00	16,729,500	
日本エム・ディ・エム	7,900	266.00	2,101,400	
進和	5,000	1,107.00	5,535,000	
エスケイジャパン	2,200	284.00	624,800	
ダイトエレクトロン	4,000	397.00	1,588,000	
シークス	5,400	1,291.00	6,971,400	
田中商事	2,900	582.00	1,687,800	
オーハシテクニカ	4,600	820.00	3,772,000	
マクニカ	4,300	2,609.00	11,218,700	
白銅	2,800	795.00	2,226,000	
伊藤忠商事	673,800	1,202.00	809,907,600	
丸紅	693,000	772.00	534,996,000	
高島	16,000	284.00	4,544,000	
ヨンドシーホールディングス	6,500	1,360.00	8,840,000	
長瀬産業	47,800	1,247.00	59,606,600	
蝶理	5,400	1,115.00	6,021,000	
豊田通商	94,100	2,564.00	241,272,400	
三共生興	14,500	342.00	4,959,000	
兼松	180,000	133.00	23,940,000	
ツカモトコーポレーション	14,000	190.00	2,660,000	
三井物産	729,000	1,426.00	1,039,554,000	
日本紙パルプ商事	44,000	325.00	14,300,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,600	2,200.00	56,320,000	
カメイ	10,100	746.00	7,534,600	
東都水産	15,000	228.00	3,420,000	
OUGホールディングス	7,000	188.00	1,316,000	
スターゼン	28,000	276.00	7,728,000	
山善	32,500	637.00	20,702,500	
椿本興業	10,000	271.00	2,710,000	
住友商事	498,500	1,322.00	659,017,000	
内田洋行	20,000	278.00	5,560,000	
三菱商事	659,000	1,986.00	1,308,774,000	

第一実業	19,000	431.00	8,189,000	
キヤノンマーケティングジャパン	24,100	1,304.00	31,426,400	
西華産業	29,000	242.00	7,018,000	
佐藤商事	7,600	588.00	4,468,800	
菱洋エレクトロ	10,000	885.00	8,850,000	
東京産業	8,500	328.00	2,788,000	
ユアサ商事	86,000	198.00	17,028,000	
神鋼商事	21,000	211.00	4,431,000	
小林産業	3,500	314.00	1,099,000	
阪和興業	84,000	464.00	38,976,000	
カナデン	8,000	648.00	5,184,000	
菱電商事	12,000	680.00	8,160,000	
フルサト工業	4,300	999.00	4,295,700	
岩谷産業	94,000	396.00	37,224,000	
すてきナイスグループ	33,000	255.00	8,415,000	
昭光通商	27,000	153.00	4,131,000	
ニチモウ	12,000	191.00	2,292,000	
極東貿易	10,000	204.00	2,040,000	
イワキ	13,000	206.00	2,678,000	
三愛石油	20,000	425.00	8,500,000	
稲畑産業	20,800	945.00	19,656,000	
G S Iクレオス	23,000	151.00	3,473,000	
明和産業	6,800	328.00	2,230,400	
ワキタ	7,000	1,296.00	9,072,000	
東邦ホールディングス	27,100	1,790.00	48,509,000	
サンゲツ	15,000	2,593.00	38,895,000	
ミツウロコグループホールディングス	13,700	481.00	6,589,700	
シナネン	18,000	383.00	6,894,000	
伊藤忠エネクス	18,700	510.00	9,537,000	
サンリオ	21,300	6,030.00	128,439,000	
サンワテクノス	4,200	962.00	4,040,400	
リョーサン	13,800	1,793.00	24,743,400	
新光商事	9,300	840.00	7,812,000	
トーヨー	18,000	353.00	6,354,000	
三信電気	12,100	610.00	7,381,000	
東陽テクニカ	11,600	1,238.00	14,360,800	
モスフードサービス	11,100	1,935.00	21,478,500	
加賀電子	8,400	839.00	7,047,600	
ソーダニッカ	9,000	411.00	3,699,000	
立花エレテック	5,200	1,054.00	5,480,800	
P a l t a c	10,000	1,354.00	13,540,000	
ヤマタネ	39,000	192.00	7,488,000	
丸紅建材リース	7,000	205.00	1,435,000	

日鐵商事	7,000	340.00	2,380,000	
トラスコ中山	9,700	2,008.00	19,477,600	
オートバックスセブン	29,700	1,504.00	44,668,800	
加藤産業	12,200	2,101.00	25,632,200	
イノテック	7,400	454.00	3,359,600	
イエローハット	8,000	1,839.00	14,712,000	
富士エレクトロニクス	4,400	1,293.00	5,689,200	
J Kホールディングス	7,100	606.00	4,302,600	
日伝	3,800	2,309.00	8,774,200	
北沢産業	6,500	179.00	1,163,500	
杉本商事	4,600	898.00	4,130,800	
因幡電機産業	11,300	2,946.00	33,289,800	
住金物産	44,000	349.00	15,356,000	
バイテック	2,000	713.00	1,426,000	
ミスミグループ本社	31,400	2,845.00	89,333,000	
江守商事	2,000	1,367.00	2,734,000	
アルテック	4,100	312.00	1,279,200	
タキヒヨー	13,000	418.00	5,434,000	
スズケン	32,500	3,230.00	104,975,000	
ジェコス	5,900	720.00	4,248,000	
ローソン	32,000	7,690.00	246,080,000	
サンエー	6,400	2,765.00	17,696,000	
キリン堂	3,000	653.00	1,959,000	
ダイユーエイト	1,700	633.00	1,076,100	
カワチ薬品	5,900	1,945.00	11,475,500	
エービーシー・マート	10,000	4,785.00	47,850,000	
ハードオフコーポレーション	4,100	761.00	3,120,100	
アスクル	7,200	2,277.00	16,394,400	
ゲオホールディングス	14,500	918.00	13,311,000	
アダストリアホールディングス	7,800	4,670.00	36,426,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	11,000	353.00	3,883,000	
くらコーポレーション	5,000	1,633.00	8,165,000	
キャンドウ	4,000	1,718.00	6,872,000	
パル	4,900	2,456.00	12,034,400	
エディオン	36,500	491.00	17,921,500	
サーラコーポレーション	7,300	523.00	3,817,900	
あみやき亭	1,500	2,942.00	4,413,000	
ひらまつ	8,700	666.00	5,794,200	
ゲンキー	700	2,065.00	1,445,500	
大黒天物産	1,700	2,846.00	4,838,200	
ハニーズ	6,680	1,071.00	7,154,280	
アルペン	6,500	2,038.00	13,247,000	
クオール	4,300	552.00	2,373,600	

ジェイアイエヌ	4,300	3,690.00	15,867,000	
ビックカメラ	321	46,450.00	14,910,450	
D C Mホールディングス	41,700	696.00	29,023,200	
M o n o t a R O	13,000	2,871.00	37,323,000	
J . フロント リテイリング	199,000	794.00	158,006,000	
ドトール・日レスホールディングス	14,800	1,722.00	25,485,600	
マツモトキヨシホールディングス	14,500	3,175.00	46,037,500	
ブロンコビリー	1,300	1,920.00	2,496,000	
スタートトゥデイ	23,400	2,765.00	64,701,000	
物語コーポレーション	1,200	4,465.00	5,358,000	
ココカラファイン	8,800	3,125.00	27,500,000	
三越伊勢丹ホールディングス	167,900	1,454.00	244,126,600	
ウエルシアホールディングス	3,000	5,190.00	15,570,000	
クリエイトSDホールディングス	3,600	3,590.00	12,924,000	
丸善C H Iホールディングス	4,900	292.00	1,430,800	
ブックオフコーポレーション	4,700	672.00	3,158,400	
あさひ	4,900	1,662.00	8,143,800	
日本調剤	1,070	2,686.00	2,874,020	
コスモス薬品	4,300	12,910.00	55,513,000	
一六堂	1,100	505.00	555,500	
セブン&アイ・ホールディングス	353,300	3,580.00	1,264,814,000	
ツルハホールディングス	8,300	8,660.00	71,878,000	
サンマルクホールディングス	2,700	4,960.00	13,392,000	
フェリシモ	2,400	1,107.00	2,656,800	
トリドール	7,300	971.00	7,088,300	
クスリのアオキ	1,200	6,410.00	7,692,000	
メディカルシステムネットワーク	6,200	424.00	2,628,800	
総合メディカル	2,000	3,765.00	7,530,000	
はるやま商事	3,500	628.00	2,198,000	
カップ・クリエイトホールディングス	6,200	1,880.00	11,656,000	
ライトオン	6,300	930.00	5,859,000	
良品計画	9,000	8,870.00	79,830,000	
三城ホールディングス	10,400	481.00	5,002,400	
コナカ	10,800	928.00	10,022,400	
ハウス オブ ローゼ	900	1,324.00	1,191,600	
G - 7ホールディングス	2,500	797.00	1,992,500	
イオン北海道	6,900	558.00	3,850,200	
コジマ	12,500	288.00	3,600,000	
ヒマラヤ	2,000	1,372.00	2,744,000	
コーナン商事	11,100	1,077.00	11,954,700	
エコス	2,900	601.00	1,742,900	
ワタミ	10,000	1,652.00	16,520,000	
マルシェ	2,100	834.00	1,751,400	

ドン・キホーテ	24,900	6,150.00	153,135,000	
西松屋チェーン	16,700	789.00	13,176,300	
ゼンショーホールディングス	32,200	1,139.00	36,675,800	
幸楽苑	5,200	1,216.00	6,323,200	
ハークスレイ	2,400	769.00	1,845,600	
サイゼリヤ	12,500	1,317.00	16,462,500	
ポブラ	3,400	567.00	1,927,800	
ユナイテッドアローズ	9,000	4,130.00	37,170,000	
ハイデイ日高	4,400	2,180.00	9,592,000	
京都きもの友禅	5,600	1,096.00	6,137,600	
コロワイド	28,000	1,006.00	28,168,000	
壱番屋	3,400	4,100.00	13,940,000	
トップカルチャー	3,100	496.00	1,537,600	
P L A N T	1,600	966.00	1,545,600	
スギホールディングス	13,500	4,210.00	56,835,000	
スクロール	11,000	282.00	3,102,000	
ファミリーマート	26,000	4,245.00	110,370,000	
木曽路	10,300	1,858.00	19,137,400	
サトレストランシシステムズ	4,900	650.00	3,185,000	
千趣会	15,200	884.00	13,436,800	
タカキュー	6,500	332.00	2,158,000	
ケーヨー	14,300	469.00	6,706,700	
上新電機	18,000	843.00	15,174,000	
日本瓦斯	11,600	1,185.00	13,746,000	
ベスト電器	26,400	157.00	4,144,800	
マルエツ	18,000	320.00	5,760,000	
ロイヤルホールディングス	14,100	1,562.00	22,024,200	
東天紅	6,000	194.00	1,164,000	
いなげや	9,400	1,012.00	9,512,800	
島忠	19,100	2,434.00	46,489,400	
チヨダ	10,000	2,087.00	20,870,000	
ライフコーポレーション	5,400	1,300.00	7,020,000	
カスミ	17,400	618.00	10,753,200	
リンガーハット	7,600	1,408.00	10,700,800	
MrMax	8,500	328.00	2,788,000	
テンアライド	6,400	324.00	2,073,600	
A O K Iホールディングス	7,300	3,455.00	25,221,500	
オークワ	13,000	908.00	11,804,000	
コメリ	13,000	2,410.00	31,330,000	
青山商事	23,300	2,676.00	62,350,800	
しまむら	9,800	9,770.00	95,746,000	
C F Sコーポレーション	5,700	393.00	2,240,100	
はせがわ	2,600	717.00	1,864,200	

高島屋	114,000	919.00	104,766,000	
松屋	17,800	1,262.00	22,463,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	55,000	812.00	44,660,000	
近鉄百貨店	21,000	347.00	7,287,000	
ニッセンホールディングス	16,900	324.00	5,475,600	
パルコ	16,200	988.00	16,005,600	
丸井グループ	110,400	919.00	101,457,600	
原信ナルスホールディングス	4,700	1,751.00	8,229,700	
ダイエー	48,850	295.00	14,410,750	
イズミヤ	33,000	455.00	15,015,000	
イオン	308,700	1,351.00	417,053,700	
ユニグループ・ホールディングス	81,600	633.00	51,652,800	
イズミ	21,200	2,860.00	60,632,000	
東武ストア	11,000	260.00	2,860,000	
平和堂	17,400	1,528.00	26,587,200	
フジ	9,400	1,760.00	16,544,000	
ヤオコー	4,300	3,565.00	15,329,500	
ゼビオ	11,500	2,214.00	25,461,000	
ケーズホールディングス	21,100	2,687.00	56,695,700	
Olympicグループ	5,000	739.00	3,695,000	
日産東京販売ホールディングス	12,000	304.00	3,648,000	
アインファーマシーズ	5,100	4,165.00	21,241,500	
元気寿司	2,600	1,259.00	3,273,400	
ヤマダ電機	385,300	290.00	111,737,000	
アークランドサカモト	5,500	1,468.00	8,074,000	
ニトリホールディングス	16,750	9,000.00	150,750,000	
グルメ杵屋	6,000	694.00	4,164,000	
愛眼	6,700	279.00	1,869,300	
吉野家ホールディングス	22,900	1,150.00	26,335,000	
松屋フーズ	4,100	1,555.00	6,375,500	
サガミチェーン	10,000	885.00	8,850,000	
関西スーパーマーケット	3,800	867.00	3,294,600	
王将フードサービス	2,500	3,285.00	8,212,500	
プレナス	9,400	1,891.00	17,775,400	
ミニストップ	6,300	1,530.00	9,639,000	
アークス	14,400	1,822.00	26,236,800	
パロー	18,200	1,487.00	27,063,400	
藤久	700	1,647.00	1,152,900	
ベルク	4,200	1,786.00	7,501,200	
大庄	4,000	1,330.00	5,320,000	
ファーストリテイリング	19,700	36,850.00	725,945,000	
サンドラッグ	16,100	4,900.00	78,890,000	
東京デリカ	3,700	1,596.00	5,905,200	

ヤマザワ	2,200	1,509.00	3,319,800	
やまや	1,700	1,492.00	2,536,400	
ペルーナ	21,100	501.00	10,571,100	
島根銀行	1,900	1,290.00	2,451,000	
じもとホールディングス	60,600	211.00	12,786,600	
新生銀行	731,000	238.00	173,978,000	
あおぞら銀行	307,000	291.00	89,337,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,398,000	627.00	4,011,546,000	
りそなホールディングス	802,800	502.00	403,005,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,659,000	485.00	804,615,000	
三井住友フィナンシャルグループ	638,700	4,745.00	3,030,631,500	
第四銀行	108,000	354.00	38,232,000	
北越銀行	85,000	218.00	18,530,000	
西日本シティ銀行	296,000	267.00	79,032,000	
千葉銀行	326,000	716.00	233,416,000	
横浜銀行	522,000	561.00	292,842,000	
常陽銀行	315,000	527.00	166,005,000	
群馬銀行	189,000	574.00	108,486,000	
武蔵野銀行	13,500	3,585.00	48,397,500	
千葉興業銀行	16,200	784.00	12,700,800	
筑波銀行	35,100	355.00	12,460,500	
東京都民銀行	16,000	1,130.00	18,080,000	
七十七銀行	132,000	483.00	63,756,000	
青森銀行	62,000	261.00	16,182,000	
秋田銀行	58,000	265.00	15,370,000	
山形銀行	51,000	435.00	22,185,000	
岩手銀行	6,100	4,730.00	28,853,000	
東邦銀行	70,000	302.00	21,140,000	
東北銀行	43,000	147.00	6,321,000	
みちのく銀行	42,000	198.00	8,316,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	343,000	443.00	151,949,000	
静岡銀行	247,000	1,116.00	275,652,000	
十六銀行	106,000	386.00	40,916,000	
スルガ銀行	82,000	1,687.00	138,334,000	
八十二銀行	156,000	610.00	95,160,000	
山梨中央銀行	50,000	408.00	20,400,000	
大垣共立銀行	113,000	283.00	31,979,000	
福井銀行	73,000	217.00	15,841,000	
北國銀行	95,000	373.00	35,435,000	
清水銀行	2,900	2,871.00	8,325,900	
滋賀銀行	79,000	557.00	44,003,000	
南都銀行	82,000	395.00	32,390,000	
百五銀行	76,000	404.00	30,704,000	

京都銀行	151,000	862.00	130,162,000	
三重銀行	35,000	203.00	7,105,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	575,000	206.00	118,450,000	
広島銀行	249,000	418.00	104,082,000	
山陰合同銀行	49,000	762.00	37,338,000	
中国銀行	63,000	1,380.00	86,940,000	
鳥取銀行	27,000	187.00	5,049,000	
伊予銀行	90,000	1,028.00	92,520,000	
百十四銀行	93,000	390.00	36,270,000	
四国銀行	61,000	226.00	13,786,000	
阿波銀行	69,000	531.00	36,639,000	
鹿児島銀行	59,000	670.00	39,530,000	
大分銀行	50,000	323.00	16,150,000	
宮崎銀行	56,000	301.00	16,856,000	
肥後銀行	69,000	575.00	39,675,000	
佐賀銀行	51,000	207.00	10,557,000	
十八銀行	53,000	232.00	12,296,000	
沖縄銀行	6,300	3,915.00	24,664,500	
琉球銀行	17,400	1,230.00	21,402,000	
八千代銀行	4,300	2,946.00	12,667,800	
セブン銀行	284,800	328.00	93,414,400	
みずほフィナンシャルグループ	10,930,800	213.00	2,328,260,400	
紀陽ホールディングス	340,000	136.00	46,240,000	
山口フィナンシャルグループ	84,000	964.00	80,976,000	
長野銀行	29,000	175.00	5,075,000	
名古屋銀行	76,000	376.00	28,576,000	
北洋銀行	127,200	413.00	52,533,600	
愛知銀行	3,100	4,695.00	14,554,500	
第三銀行	48,000	160.00	7,680,000	
中京銀行	35,000	177.00	6,195,000	
東日本銀行	37,000	233.00	8,621,000	
大光銀行	30,000	225.00	6,750,000	
愛媛銀行	50,000	240.00	12,000,000	
トマト銀行	33,000	178.00	5,874,000	
みなと銀行	76,000	167.00	12,692,000	
京葉銀行	70,000	516.00	36,120,000	
関西アーバン銀行	118,000	109.00	12,862,000	
栃木銀行	42,000	377.00	15,834,000	
北日本銀行	2,500	2,344.00	5,860,000	
東和銀行	97,000	91.00	8,827,000	
福島銀行	104,000	87.00	9,048,000	
大東銀行	54,000	96.00	5,184,000	
トモニホールディングス	64,800	386.00	25,012,800	

フィデアホールディングス	48,600	200.00	9,720,000	
池田泉州ホールディングス	69,700	506.00	35,268,200	
F P G	6,700	1,125.00	7,537,500	
S B Iホールディングス	108,400	1,266.00	137,234,400	
ジャフコ	11,800	4,700.00	55,460,000	
大和証券グループ本社	837,000	880.00	736,560,000	
野村ホールディングス	1,727,200	765.00	1,321,308,000	
岡三証券グループ	72,000	903.00	65,016,000	
丸三証券	27,100	821.00	22,249,100	
東洋証券	33,000	354.00	11,682,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	96,900	819.00	79,361,100	
水戸証券	27,000	528.00	14,256,000	
いちよし証券	19,200	1,442.00	27,686,400	
松井証券	50,100	1,082.00	54,208,200	
だいこう証券ビジネス	5,400	683.00	3,688,200	
マネックスグループ	92,100	412.00	37,945,200	
カブドットコム証券	34,000	540.00	18,360,000	
極東証券	11,500	1,738.00	19,987,000	
岩井コスモホールディングス	8,800	1,466.00	12,900,800	
マネーパートナーズグループ	9,400	292.00	2,744,800	
N K S Jホールディングス	187,600	2,521.00	472,939,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	252,400	2,560.00	646,144,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	80,900	1,798.00	145,458,200	
第一生命保険	451,700	1,400.00	632,380,000	
東京海上ホールディングス	327,200	3,205.00	1,048,676,000	
T & Dホールディングス	289,700	1,214.00	351,695,800	
全国保証	9,500	4,325.00	41,087,500	
クレディセゾン	75,300	2,659.00	200,222,700	
芙蓉総合リース	8,300	3,685.00	30,585,500	
興銀リース	15,400	2,555.00	39,347,000	
東京センチュリーリース	20,400	3,080.00	62,832,000	
日本証券金融	42,700	736.00	31,427,200	
ポケットカード	12,100	839.00	10,151,900	
リコーリース	6,200	2,741.00	16,994,200	
イオンフィナンシャルサービス	32,800	3,085.00	101,188,000	
アコム	184,100	369.00	67,932,900	
ジャックス	55,000	492.00	27,060,000	
オリエン트コーポレーション	210,000	270.00	56,700,000	
日立キャピタル	18,500	2,365.00	43,752,500	
アプラスフィナンシャル	44,800	169.00	7,571,200	
オリックス	507,600	1,595.00	809,622,000	

三菱UFJリース	221,500	519.00	114,958,500	
日本取引所グループ	109,200	2,173.00	237,291,600	
イー・ギャランティ	4,500	2,088.00	9,396,000	
アサックス	1,500	1,680.00	2,520,000	
NECキャピタルソリューション	5,300	2,379.00	12,608,700	
日本駐車場開発	921	7,830.00	7,211,430	
ヒューリック	142,400	1,468.00	209,043,200	
東京建物不動産販売	4,400	501.00	2,204,400	
三栄建築設計	2,600	841.00	2,186,600	
野村不動産ホールディングス	40,600	2,415.00	98,049,000	
常和ホールディングス	1,900	2,912.00	5,532,800	
フージャースホールディングス	11,300	855.00	9,661,500	
パーク24	44,100	1,745.00	76,954,500	
三井不動産	398,000	3,295.00	1,311,410,000	
三菱地所	591,000	2,896.00	1,711,536,000	
平和不動産	16,000	1,804.00	28,864,000	
東京建物	173,000	898.00	155,354,000	
ダイビル	21,800	1,146.00	24,982,800	
東急不動産	186,000	1,017.00	189,162,000	
京阪神ビルディング	12,800	553.00	7,078,400	
住友不動産	202,000	4,655.00	940,310,000	
大京	130,000	313.00	40,690,000	
テオーシー	29,200	829.00	24,206,800	
東京楽天地	14,000	508.00	7,112,000	
レオパレス21	80,900	720.00	58,248,000	
フジ住宅	10,800	705.00	7,614,000	
空港施設	10,300	920.00	9,476,000	
明和地所	4,100	442.00	1,812,200	
住友不動産販売	6,060	3,230.00	19,573,800	
ゴールドクレスト	6,700	2,658.00	17,808,600	
東栄住宅	5,800	2,307.00	13,380,600	
日本エスリード	3,700	1,147.00	4,243,900	
東急リバブル	9,000	2,145.00	19,305,000	
飯田産業	9,500	1,998.00	18,981,000	
日神不動産	5,100	686.00	3,498,600	
アーネストワン	14,000	2,310.00	32,340,000	
タカラレーベン	35,200	336.00	11,827,200	
サンヨーハウジング名古屋	4,400	1,125.00	4,950,000	
イオンモール	47,900	2,914.00	139,580,600	
タクトホーム	43	217,000.00	9,331,000	
ファースト住建	1,400	1,549.00	2,168,600	
トーセイ	11,600	857.00	9,941,200	
穴吹興産	4,000	340.00	1,360,000	

エヌ・ティ・ティ都市開発	52,500	1,287.00	67,567,500	
サンフロンティア不動産	7,900	1,263.00	9,977,700	
ランドビジネス	5,700	490.00	2,793,000	
グランディハウス	5,700	357.00	2,034,900	
日本空港ビルディング	29,200	2,269.00	66,254,800	
日本工営	30,000	426.00	12,780,000	
ネクスト	4,200	2,302.00	9,668,400	
日本M&Aセンター	4,600	7,520.00	34,592,000	
ノバレーゼ	2,400	685.00	1,644,000	
アコーディア・ゴルフ	39,300	1,211.00	47,592,300	
タケエイ	3,900	1,618.00	6,310,200	
パソナグループ	89	86,800.00	7,725,200	
リンクアンドモチベーション	59	31,550.00	1,861,450	
G C Aサヴィアン	5,400	985.00	5,319,000	
エス・エム・エス	5,000	1,613.00	8,065,000	
テンプホールディングス	13,500	2,478.00	33,453,000	
リニカル	2,600	1,365.00	3,549,000	
クックパッド	5,300	3,665.00	19,424,500	
エスクリ	3,100	919.00	2,848,900	
アイ・ケイ・ケイ	2,100	815.00	1,711,500	
学情	3,000	733.00	2,199,000	
スタジオアリス	3,700	1,288.00	4,765,600	
シミックホールディングス	3,500	1,342.00	4,697,000	
N E C フィールドディング	7,300	1,150.00	8,395,000	
総合警備保障	32,600	1,963.00	63,993,800	
カカクコム	48,200	2,289.00	110,329,800	
ルネサンス	4,100	769.00	3,152,900	
ツクイ	11,000	1,196.00	13,156,000	
総合臨床ホールディングス	3,100	676.00	2,095,600	
キャリアデザインセンター	26	114,200.00	2,969,200	
エムスリー	211	271,700.00	57,328,700	
ベストプライダル	5,400	733.00	3,958,200	
日本E R I	1,700	1,261.00	2,143,700	
アウトソーシング	3,700	1,133.00	4,192,100	
ディー・エヌ・エー	44,100	1,998.00	88,111,800	
博報堂D Yホールディングス	124,000	730.00	90,520,000	
ぐるなび	6,300	1,781.00	11,220,300	
一休	56	163,100.00	9,133,600	
ジャパンベストレスキューシステム	67	77,700.00	5,205,900	
ジェイコムホールディングス	1,600	837.00	1,339,200	
P G Mホールディングス	12,700	963.00	12,230,100	
パリュウコマース	6,000	1,161.00	6,966,000	
J Pホールディングス	14,500	517.00	7,496,500	

イーピーエス	97	95,900.00	9,302,300	
アミューズ	2,800	2,007.00	5,619,600	
ドリームインキュベータ	31	159,000.00	4,929,000	
ケネディクス	106,300	520.00	55,276,000	
電通	83,700	3,730.00	312,201,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,850	2,328.00	8,962,800	
ぴあ	2,700	1,763.00	4,760,100	
イオンファンタジー	2,900	1,334.00	3,868,600	
ネクシィーズ	3,400	405.00	1,377,000	
みらかホールディングス	23,500	4,380.00	102,930,000	
アルプス技研	3,700	1,028.00	3,803,600	
サニックス	13,000	1,264.00	16,432,000	
ダイオーズ	1,700	707.00	1,201,900	
日本空調サービス	2,300	908.00	2,088,400	
オリエンタルランド	26,600	16,220.00	431,452,000	
ダスキン	24,200	1,966.00	47,577,200	
明光ネットワークジャパン	8,900	1,240.00	11,036,000	
ファルコSDホールディングス	4,600	1,368.00	6,292,800	
秀英予備校	3,500	344.00	1,204,000	
田谷	1,400	769.00	1,076,600	
ラウンドワン	28,900	567.00	16,386,300	
リゾートトラスト	15,200	3,520.00	53,504,000	
ビー・エム・エル	5,300	3,215.00	17,039,500	
ワタベウェディング	2,700	736.00	1,987,200	
もしもしホットライン	14,800	1,146.00	16,960,800	
東急コミュニティー	2,300	4,844.00	11,141,200	
リソー教育	10,100	770.00	7,777,000	
早稲田アカデミー	1,100	749.00	823,900	
ユー・エス・エス	99,900	1,421.00	141,957,900	
東京個別指導学院	4,600	215.00	989,000	
テー・オー・ダブリュー	3,000	580.00	1,740,000	
セントラルスポーツ	2,800	1,552.00	4,345,600	
フルキャストホールディングス	8,400	300.00	2,520,000	
リゾートソリューション	8,000	231.00	1,848,000	
リブセンス	2,200	5,150.00	11,330,000	
リロ・ホールディング	3,100	4,385.00	13,593,500	
エイチ・アイ・エス	7,300	5,740.00	41,902,000	
共立メンテナンス	4,400	4,025.00	17,710,000	
イチネンホールディングス	10,300	688.00	7,086,400	
建設技術研究所	5,400	823.00	4,444,200	
スペース	4,400	985.00	4,334,000	
燦ホールディングス	2,000	1,393.00	2,786,000	
スバル興業	7,000	360.00	2,520,000	

東京テアトル	34,000	170.00	5,780,000	
よみうりランド	19,000	910.00	17,290,000	
東京都競馬	69,000	475.00	32,775,000	
カナモト	11,000	2,672.00	29,392,000	
東京ドーム	67,000	767.00	51,389,000	
西尾レントオール	2,800	2,739.00	7,669,200	
トランス・コスモス	11,700	1,722.00	20,147,400	
乃村工藝社	19,000	972.00	18,468,000	
藤田観光	23,000	451.00	10,373,000	
日本管財	3,300	1,764.00	5,821,200	
トーカイ	4,000	2,637.00	10,548,000	
白洋舎	12,000	236.00	2,832,000	
セコム	93,000	6,140.00	571,020,000	
セントラル警備保障	4,000	939.00	3,756,000	
丹青社	9,000	671.00	6,039,000	
メイテック	13,200	2,828.00	37,329,600	
アサツー ディ・ケイ	15,900	2,661.00	42,309,900	
応用地質	8,600	1,746.00	15,015,600	
船井総合研究所	9,200	772.00	7,102,400	
進学会	4,400	384.00	1,689,600	
ベネッセホールディングス	27,200	3,570.00	97,104,000	
イオンディライト	8,700	1,887.00	16,416,900	
ナック	4,000	1,604.00	6,416,000	
ニチイ学館	17,500	982.00	17,185,000	
ダイセキ	13,200	1,807.00	23,852,400	
ステップ	2,700	885.00	2,389,500	
合計	134,317,398	-	142,069,740,440	

B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,170,842,101
国債証券	200,284,351,550
地方債証券	16,249,300,485
特殊債券	23,098,573,934
社債券	15,740,950,750
派生商品評価勘定	139,370
未収入金	1,464,791,600
未収利息	449,772,840
前払費用	17,167,122
流動資産合計	260,475,889,752
資産合計	260,475,889,752
負債の部	
流動負債	
前受金	360,000
未払金	3,965,343,500
未払解約金	218,986,282
流動負債合計	4,184,689,782
負債合計	4,184,689,782
純資産の部	
元本等	
元本	201,273,995,644
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,017,204,326
元本等合計	256,291,199,970
純資産合計	256,291,199,970
負債純資産合計	260,475,889,752

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 9月30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、特殊債券及び社債券 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>
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、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>派生商品取引等損益の計上基準 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25年 9月30日現在
1. 計算期間の期首元本額	160,787,231,334円
計算期間中の追加設定元本額	75,342,225,995円
計算期間中の一部解約元本額	34,855,461,685円
計算日の元本額	201,273,995,644円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	3,779,674円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	917,993,626円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,628,295円
SMT 国内債券インデックス・オープン	3,232,388,497円
世界経済インデックスファンド	118,010,169円
マイセレクション25	162,648,510円
マイセレクション50	124,649,104円
マイセレクション75	41,064,279円
DCマイセレクション25	10,830,584,104円
DCマイセレクション50	13,568,445,275円
DCマイセレクション75	3,727,562,832円
DC日本債券インデックス・オープン	378,360,157円
DC日本債券インデックス・オープンS	43,670,797,679円
DC日本債券インデックス・オープンP	14,413,705,901円
DCマイセレクションS25	3,726,473,774円

DCマイセレクションS50	4,447,964,802円
DCマイセレクションS75	812,579,220円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	33,026,366円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	764,372,316円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	395,575,780円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	88,902,143円
DC世界経済インデックスファンド	85,605,261円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	26,181,691,722円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	54,384,185円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	394,081,873円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	57,329,353円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,573,510円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	7,260,578円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,848,264,442円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,822,155,060円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	7,189,782,470円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	739,657,618円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	17,488,221,977円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,830,727,639円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,523,762,768円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,589,973,150円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,100,549,707円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,567,738,847円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,438,517,140円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,907,649,729円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,970,445,460円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	287,294,207円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,262,762,566円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,937,950,067円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,329,733,223円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,041,265,312円
分散投資コア戦略ファンドA	106,657,509円
分散投資コア戦略ファンドS	34,369,928円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券 105,315,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3. 計算日における受益権総数	201,273,995,644口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2733円 (12,733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25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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(金利変動リスク)、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。
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コンプライアンス会議に報告します。 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25年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	2,691,482,900
地方債証券	197,841,922
特殊債券	260,670,980
社債券	71,825,380
合計	3,221,821,182

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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	288,100,630	-	288,240,000	139,370
	合計	288,100,630	-	288,240,000	139,370

(注)1. 時価の算定方法

債券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. 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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年9月30日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第322回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,050,115,500	
	第323回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,220,146,400	
	第324回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,220,146,400	
	第326回利付国債(2年)	730,000,000	730,102,200	
	第327回利付国債(2年)	710,000,000	710,049,700	
	第328回利付国債(2年)	1,270,000,000	1,270,101,600	
	第329回利付国債(2年)	1,670,000,000	1,672,822,300	
	第330回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,472,616,600	
	第331回利付国債(2年)	1,390,000,000	1,390,000,000	
	第332回利付国債(2年)	1,120,000,000	1,119,888,000	
	第87回利付国債(5年)	2,820,000,000	2,834,043,600	
	第88回利付国債(5年)	2,570,000,000	2,585,394,300	
	第89回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,618,404,200	
	第90回利付国債(5年)	220,000,000	220,772,200	
	第91回利付国債(5年)	200,000,000	201,176,000	
	第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,264,939,200	
	第93回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,926,464,200	
	第94回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,122,021,300	
	第95回利付国債(5年)	620,000,000	627,384,200	
	第96回利付国債(5年)	1,470,000,000	1,483,891,500	
	第97回利付国債(5年)	2,080,000,000	2,095,745,600	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,620,748,000	
	第100回利付国債(5年)	100,000,000	100,502,000	
	第101回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,028,649,600	
	第102回利付国債(5年)	1,880,000,000	1,889,926,400	
	第103回利付国債(5年)	1,940,000,000	1,950,359,600	
	第104回利付国債(5年)	410,000,000	410,774,900	
	第105回利付国債(5年)	3,040,000,000	3,044,468,800	
	第106回利付国債(5年)	2,640,000,000	2,642,059,200	
	第107回利付国債(5年)	1,620,000,000	1,620,324,000	
	第108回利付国債(5年)	790,000,000	786,855,800	
	第109回利付国債(5年)	390,000,000	388,100,700	
第110回利付国債(5年)	1,900,000,000	1,907,543,000		
第111回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,613,440,000		
第112回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,028,323,200		
第113回利付国債(5年)	2,850,000,000	2,859,946,500		

第114回利付国債(5年)	920,000,000	922,704,800	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	175,875,000	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	336,162,000	
第3回利付国債(40年)	340,000,000	380,837,400	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	593,361,500	
第5回利付国債(40年)	740,000,000	787,049,200	
第6回利付国債(40年)	300,000,000	309,780,000	
第265回利付国債(10年)	530,000,000	539,078,900	
第266回利付国債(10年)	470,000,000	477,477,700	
第267回利付国債(10年)	590,000,000	598,673,000	
第268回利付国債(10年)	760,000,000	775,656,000	
第269回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,455,268,100	
第270回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,489,988,400	
第271回利付国債(10年)	680,000,000	692,804,400	
第272回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,097,306,400	
第273回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,633,693,200	
第274回利付国債(10年)	530,000,000	546,345,200	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	288,016,400	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	495,864,000	
第277回利付国債(10年)	410,000,000	424,952,700	
第278回利付国債(10年)	720,000,000	749,793,600	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	460,367,600	
第280回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,467,438,000	
第281回利付国債(10年)	750,000,000	788,152,500	
第282回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,318,653,000	
第283回利付国債(10年)	280,000,000	293,862,800	
第284回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,270,838,800	
第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,518,486,400	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	922,861,200	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	574,803,000	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,215,567,200	
第289回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,613,828,700	
第290回利付国債(10年)	270,000,000	284,331,600	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	880,866,000	
第292回利付国債(10年)	860,000,000	917,061,000	
第293回利付国債(10年)	870,000,000	934,362,600	
第294回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,165,547,900	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	105,998,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,231,523,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	593,768,000	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,751,549,000	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,384,866,500	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	886,390,200	

第301回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,648,000,200	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	212,898,000	
第303回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,555,965,800	
第304回利付国債(10年)	550,000,000	582,923,000	
第305回利付国債(10年)	2,380,000,000	2,523,680,600	
第306回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,536,523,200	
第307回利付国債(10年)	600,000,000	636,624,000	
第308回利付国債(10年)	600,000,000	636,558,000	
第309回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,319,824,800	
第310回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,591,674,300	
第311回利付国債(10年)	160,000,000	164,281,600	
第312回利付国債(10年)	1,900,000,000	2,000,985,000	(注)
第313回利付国債(10年)	980,000,000	1,038,643,200	
第314回利付国債(10年)	680,000,000	710,885,600	
第315回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,293,947,700	
第316回利付国債(10年)	620,000,000	647,633,400	
第317回利付国債(10年)	280,000,000	292,311,600	
第318回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,575,206,400	
第319回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,314,986,400	
第320回利付国債(10年)	1,680,000,000	1,739,421,600	
第321回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,448,594,000	
第322回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,776,087,200	
第323回利付国債(10年)	930,000,000	953,891,700	
第324回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,515,300,200	
第325回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,813,544,400	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	301,695,000	
第327回利付国債(10年)	2,620,000,000	2,658,776,000	
第328回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,149,394,400	
第329回利付国債(10年)	3,610,000,000	3,654,439,100	
第330回利付国債(10年)	1,140,000,000	1,152,768,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	48,936,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	185,782,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	137,252,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	135,326,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,972,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	218,108,600	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	203,185,800	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	52,153,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	234,148,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	147,579,200	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	92,038,500	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	206,879,600	
第13回利付国債(30年)	320,000,000	342,956,800	

第14回利付国債（30年）	300,000,000	342,540,000	
第15回利付国債（30年）	320,000,000	371,158,400	
第16回利付国債（30年）	270,000,000	313,316,100	
第17回利付国債（30年）	310,000,000	354,333,100	
第18回利付国債（30年）	370,000,000	416,364,700	
第19回利付国債（30年）	260,000,000	292,630,000	
第20回利付国債（30年）	230,000,000	267,559,000	
第21回利付国債（30年）	280,000,000	315,484,400	
第22回利付国債（30年）	500,000,000	583,025,000	
第23回利付国債（30年）	340,000,000	396,593,000	
第24回利付国債（30年）	290,000,000	338,380,700	
第25回利付国債（30年）	320,000,000	360,972,800	
第26回利付国債（30年）	540,000,000	620,038,800	
第27回利付国債（30年）	600,000,000	702,060,000	
第28回利付国債（30年）	510,000,000	597,526,200	
第29回利付国債（30年）	840,000,000	967,654,800	
第30回利付国債（30年）	540,000,000	611,706,600	
第31回利付国債（30年）	660,000,000	734,665,800	
第32回利付国債（30年）	780,000,000	884,793,000	
第33回利付国債（30年）	730,000,000	781,326,300	
第34回利付国債（30年）	960,000,000	1,069,891,200	
第35回利付国債（30年）	920,000,000	983,498,400	
第36回利付国債（30年）	1,140,000,000	1,218,454,800	
第37回利付国債（30年）	860,000,000	898,614,000	
第38回利付国債（30年）	540,000,000	551,140,200	
第39回利付国債（30年）	640,000,000	667,244,800	
第40回利付国債（30年）	180,000,000	183,573,000	
第28回利付国債（20年）	20,000,000	21,434,600	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	64,842,600	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	85,670,400	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	86,668,800	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	54,414,000	
第33回利付国債（20年）	140,000,000	155,232,000	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	55,799,000	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	11,090,900	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	77,805,700	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	78,081,500	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	22,216,600	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	553,200,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	110,247,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	352,420,200	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	90,204,800	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	161,621,600	

第44回利付国債(20年)	170,000,000	193,403,900	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	328,088,600	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	190,587,000	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	101,087,100	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	148,840,900	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	156,577,400	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	242,873,400	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	111,187,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	123,394,700	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	89,924,000	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	226,476,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	156,483,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	167,808,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	266,500,800	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	333,612,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	219,116,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	374,125,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	247,598,400	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	323,939,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	221,218,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	357,440,000	
第65回利付国債(20年)	420,000,000	469,618,800	
第66回利付国債(20年)	230,000,000	254,849,200	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	145,562,300	
第68回利付国債(20年)	290,000,000	333,543,500	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	444,525,900	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	468,944,000	
第71回利付国債(20年)	300,000,000	345,540,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	719,831,700	
第73回利付国債(20年)	390,000,000	441,807,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	228,762,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	148,838,300	
第76回利付国債(20年)	170,000,000	190,836,900	
第77回利付国債(20年)	240,000,000	272,095,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	190,949,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	306,180,000	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	251,981,400	
第81回利付国債(20年)	190,000,000	215,370,700	
第82回利付国債(20年)	710,000,000	813,021,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	332,139,900	
第84回利付国債(20年)	690,000,000	782,142,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	331,971,700	
第86回利付国債(20年)	400,000,000	467,468,000	

第 8 7 回利付国債(20年)	290,000,000	335,440,100	
第 8 8 回利付国債(20年)	550,000,000	642,614,500	
第 8 9 回利付国債(20年)	320,000,000	369,993,600	
第 9 0 回利付国債(20年)	560,000,000	647,164,000	
第 9 1 回利付国債(20年)	440,000,000	513,915,600	
第 9 2 回利付国債(20年)	900,000,000	1,028,169,000	
第 9 3 回利付国債(20年)	430,000,000	485,341,000	
第 9 4 回利付国債(20年)	500,000,000	570,675,000	
第 9 5 回利付国債(20年)	680,000,000	792,832,400	
第 9 6 回利付国債(20年)	300,000,000	342,069,000	
第 9 7 回利付国債(20年)	590,000,000	679,261,100	
第 9 8 回利付国債(20年)	320,000,000	364,252,800	
第 9 9 回利付国債(20年)	850,000,000	966,373,500	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	550,000,000	631,796,000	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	255,000,000	299,729,550	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	400,000,000	469,724,000	
第 1 0 3 回利付国債(20年)	270,000,000	313,416,000	
第 1 0 4 回利付国債(20年)	340,000,000	385,254,000	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	540,000,000	610,966,800	
第 1 0 6 回利付国債(20年)	480,000,000	549,619,200	
第 1 0 7 回利付国債(20年)	230,000,000	259,810,300	
第 1 0 8 回利付国債(20年)	600,000,000	660,840,000	
第 1 0 9 回利付国債(20年)	200,000,000	219,692,000	
第 1 1 0 回利付国債(20年)	890,000,000	1,002,967,700	
第 1 1 1 回利付国債(20年)	300,000,000	341,469,000	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	700,000,000	786,933,000	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,278,327,600	
第 1 1 4 回利付国債(20年)	540,000,000	603,919,800	
第 1 1 5 回利付国債(20年)	560,000,000	634,726,400	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	470,000,000	531,320,900	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	770,000,000	858,773,300	
第 1 1 8 回利付国債(20年)	950,000,000	1,042,739,000	
第 1 1 9 回利付国債(20年)	380,000,000	405,809,600	
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,122,836,000	
第 1 2 2 回利付国債(20年)	280,000,000	298,009,600	
第 1 2 3 回利付国債(20年)	680,000,000	752,821,200	
第 1 2 4 回利付国債(20年)	460,000,000	502,117,600	
第 1 2 5 回利付国債(20年)	380,000,000	425,641,800	
第 1 2 6 回利付国債(20年)	430,000,000	468,502,200	
第 1 2 7 回利付国債(20年)	360,000,000	386,611,200	
第 1 2 8 回利付国債(20年)	500,000,000	535,865,000	
第 1 2 9 回利付国債(20年)	500,000,000	528,010,000	
第 1 3 0 回利付国債(20年)	740,000,000	779,693,600	

	第131回利付国債（20年）	450,000,000	467,032,500	
	第132回利付国債（20年）	330,000,000	341,639,100	
	第133回利付国債（20年）	760,000,000	798,904,400	
	第134回利付国債（20年）	370,000,000	388,011,600	
	第135回利付国債（20年）	180,000,000	185,877,000	
	第136回利付国債（20年）	530,000,000	538,829,800	
	第137回利付国債（20年）	290,000,000	298,911,700	
	第138回利付国債（20年）	850,000,000	848,138,500	
	第139回利付国債（20年）	520,000,000	527,212,400	
	第140回利付国債（20年）	920,000,000	945,769,200	
	第141回利付国債（20年）	860,000,000	882,360,000	
	第142回利付国債（20年）	280,000,000	291,874,800	
	第143回利付国債（20年）	1,090,000,000	1,097,324,800	
	第144回利付国債（20年）	250,000,000	247,575,000	
	第145回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,440,836,700	
	第146回利付国債（20年）	320,000,000	326,569,600	
	第9回ポーランド共和国円貨債券	100,000,000	101,842,000	
	国債証券 小計	190,485,000,000	200,284,351,550	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	114,876,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	112,544,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	110,931,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	107,191,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,744,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,784,000	
	第23回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,842,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	202,038,000	
	第618回東京都公募公債	100,000,000	101,587,000	
	第622回東京都公募公債	100,000,000	101,936,000	
	第633回東京都公募公債	129,000,000	134,710,830	
	第639回東京都公募公債	50,000,000	52,455,000	
	第649回東京都公募公債	102,000,000	108,087,360	
	第650回東京都公募公債	140,000,000	149,016,000	
	第674回東京都公募公債	100,000,000	106,181,000	
	第678回東京都公募公債	100,000,000	106,240,000	
	第683回東京都公募公債	100,000,000	105,746,000	
	第691回東京都公募公債	100,000,000	105,263,000	
	第695回東京都公募公債	100,000,000	104,887,000	
	第696回東京都公募公債	100,000,000	104,775,000	
	平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	104,019,000	
	平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	105,328,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	116,385,500	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,408,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,642,000	

第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	115,484,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,165,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	105,269,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	105,999,000	
第167回神奈川県公募公債	140,000,000	149,758,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	211,988,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	207,588,000	
第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,997,000	
第284回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,998,000	
第290回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,712,000	
第291回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,857,000	
第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,318,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,034,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,977,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,764,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	104,861,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	104,734,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	96,662,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	207,366,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	106,310,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,486,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,405,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,687,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,367,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,204,538	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	103,310,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,303,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	113,758,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,205,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	212,292,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,151,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,901,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,605,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	115,129,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,113,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,034,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	102,083,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,851,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,335,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	203,532,010	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	103,370,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	107,100,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,542,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	209,278,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	105,215,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	101,465,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	105,438,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	106,595,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	107,051,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,701,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,258,800	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	101,551,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,075,000	
平成22年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,678,000	
第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,541,000	
第29回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,720,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,207,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,428,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,826,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	126,492,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,268,000	
第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	143,761,800	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,397,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	168,776,784	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,126,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,823,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,847,468	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,048,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,766,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,191,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,651,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,660,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,229,335	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,914,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,274,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,188,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	263,642,500	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,282,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,662,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,091,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,055,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,005,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,499,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,216,000	
第119回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,837,000	
平成17年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,068,000	

	平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,533,000	
	平成16年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,613,000	
	平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	103,013,000	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,134,000	
	平成22年度第2回大阪市公募公債(5年)	100,000,000	100,477,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	104,743,000	
	第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	113,143,000	
	第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	111,342,000	
	第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	103,744,000	
	平成22年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,418,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,363,560	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	100,946,000	
	平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	103,359,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	114,373,000	
	平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,692,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	214,214,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	107,270,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,135,000	
	平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	102,973,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,909,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,859,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	106,939,000	
	平成23年度第1回北九州市公募公債(5年)	100,000,000	100,476,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	104,739,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	103,455,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債(10年)	100,000,000	105,228,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	115,190,000	
	地方債証券 小計	15,430,190,000	16,249,300,485	
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	99,273,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,286,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	111,632,840	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,726,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	201,392,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,803,000	
	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	103,030,000	
	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	103,482,000	
	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	110,001,000	
	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	103,581,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,527,000	
	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	220,042,000	
	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	105,359,000	
	第21回道路債券	100,000,000	116,198,000	

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	104,937,000	
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	105,290,000	
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	211,026,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,805,000	
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	334,955,250	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,989,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,119,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,223,000	
第42回道路債券	100,000,000	113,785,000	
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	106,133,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,404,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,937,000	
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	105,378,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,214,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,151,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,186,000	
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	31,555,200	
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	116,826,390	
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	107,319,000	
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	193,579,500	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,685,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,910,000	
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	112,805,000	
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	222,664,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,967,000	
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	317,571,000	
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	146,100,600	
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	109,688,000	
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	105,875,000	

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	103,756,000	
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	207,466,000	
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	205,874,000	
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	210,080,000	
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	109,802,000	
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	104,987,000	
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	105,688,000	
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	104,089,000	
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	100,689,000	
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	102,339,000	
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	204,450,000	
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	102,154,000	
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	101,307,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,104,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,760,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,050,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	146,434,860	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	185,141,280	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,529,960	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,820,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,117,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,281,000	
第3回政府保証公営企業債券(15年)	300,000,000	337,026,000	
第3回公営企業債券(20年)	10,000,000	10,234,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,467,000	
第6回地方公共団体金融機構債券(5年)	100,000,000	100,645,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,749,000	
第7回公営企業債券(30年)	100,000,000	115,301,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,014,000	

第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	45,693,600	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,368,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,206,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,758,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,774,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	102,747,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,017,880	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,048,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,762,050	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,717,610	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,004,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,817,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	106,584,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	107,773,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,375,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,480,000	
第848回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,645,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	143,185,000	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	135,113,400	
第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,392,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,294,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,856,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,389,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,018,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,381,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	223,613,360	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	129,728,700	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	108,426,040	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,117,600	
第7回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,857,000	
第8回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,439,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,287,000	
第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	101,966,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,475,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,855,980	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,079,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,891,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,730,000	
第322回東京交通債券	10,000,000	10,596,300	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,160,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,641,800	
第190回政府保証預金保険機構債	200,000,000	199,608,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	99,782,000	

第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,068,000	48,223,210	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,088,000	35,380,005	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,309,000	37,021,469	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,300,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,625,000	49,167,781	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,003,000	39,453,338	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,120,000	30,743,148	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,596,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,322,000	65,085,628	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,074,000	39,264,331	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,716,000	34,076,939	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	42,255,000	44,889,599	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,614,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,384,000	33,761,651	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	47,235,000	50,226,864	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	50,747,000	53,328,499	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,110,000	53,631,767	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,494,000	62,982,244	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,166,000	63,982,112	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,745,000	63,283,638	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,477,000	70,572,647	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,451,000	72,649,784	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,793,000	74,782,185	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,073,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,236,000	152,267,060	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,294,000	48,995,717	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,063,000	83,265,198	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,857,000	48,414,444	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,419,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,679,000	47,313,966	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,947,000	91,577,797	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,474,000	42,618,498	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,911,000	91,924,895	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,441,000	92,847,477	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,962,000	48,517,594	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,156,000	184,715,246	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,599,000	93,252,847	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,684,000	47,781,494	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,356,000	94,644,581	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,069,000	94,390,059	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,708,000	95,159,199	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,388,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,674,000	191,436,863	

第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,303,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,497,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,852,000	192,905,998	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,791,000	96,515,145	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,293,000	98,319,441	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,435,000	98,607,143	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,927,000	98,990,487	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,381,000	97,949,107	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,797,000	100,130,759	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	160,647,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,485,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,702,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,517,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	113,978,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	152,077,380	
い第718号商工債	100,000,000	100,689,000	
い第721号商工債	150,000,000	150,934,500	
い第722号商工債	100,000,000	100,553,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,548,000	
い第729号商工債	100,000,000	101,188,000	
い第731号商工債	100,000,000	101,253,000	
い第736号商工債	100,000,000	100,683,000	
い第738号商工債	100,000,000	100,704,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,740,000	
い第715号農林債	100,000,000	100,604,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,666,000	
い第722号農林債	100,000,000	100,598,000	
い第723号農林債	200,000,000	201,252,000	
い第740号農林債	100,000,000	100,798,000	
い第743号農林債	100,000,000	100,653,000	
い第746号農林債	100,000,000	100,282,000	
い第748号農林債	100,000,000	100,256,000	
い第752号農林債	100,000,000	99,999,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	100,731,000	
第247回信金中金債(5年)	100,000,000	100,631,000	
第258回信金中金債(5年)	100,000,000	100,910,000	
第259回信金中金債(5年)	100,000,000	100,926,000	
第265回信金中金債(5年)	100,000,000	100,886,000	
第267回信金中金債(5年)	200,000,000	201,514,000	
第5回S B A B銀行A B (p u b l) 円貨債券	100,000,000	100,824,000	
第10回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	100,828,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	103,123,000	
第19回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,916,000	

	第22回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,030,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,788,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,858,000	
	第43回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,066,000	
	第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,080,000	
	特殊債券 小計	22,044,768,000	23,098,573,934	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリク円貨社債	100,000,000	102,419,000	
	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	102,888,000	
	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	104,872,000	
	第9回現代キャピタル・サービシズ・インク円貨社債	100,000,000	100,090,000	
	第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,580,000	
	第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,469,000	
	第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,679,000	
	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	101,519,000	
	第16回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	200,000,000	204,952,000	
	第17回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	200,000,000	201,006,000	
	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	100,880,000	
	第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,656,000	
	第13回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,743,000	
	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	99,916,000	
	第3回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,957,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,135,000	
	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	107,450,000	
	第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,091,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,603,000	
	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	102,147,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,806,000	
	第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,231,000	
	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	102,529,000	
	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	100,061,000	
	第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	99,727,000	
	第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
	第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,143,000	
	第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,442,000	

第15回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,475,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,675,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	105,063,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,954,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,807,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,221,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,289,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,335,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	102,213,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,121,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,446,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,621,000	
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	100,452,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,989,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,164,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	102,316,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,662,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,184,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	103,112,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,434,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,020,000	
第77回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,967,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,403,000	
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	101,298,000	
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	302,433,000	
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	100,636,000	
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	100,172,000	
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	119,705,000	
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	104,473,000	
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	106,597,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,929,000	
第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,292,000	
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	108,992,000	
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	108,149,000	
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	109,706,000	
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	105,230,000	

第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,249,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,807,000	
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	214,060,000	
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	100,508,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,658,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,331,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,737,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,818,000	
第133回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,440,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,776,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,461,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,991,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,039,000	
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	101,192,000	
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	102,157,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,170,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	111,225,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,672,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,193,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,428,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,642,000	
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	100,959,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,353,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,422,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,904,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,587,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,412,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,716,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,488,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,488,810	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,833,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,508,400	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,700,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,600,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,957,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,233,000	
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	102,962,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,265,000	

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	101,046,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,673,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,948,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	107,425,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	99,381,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,526,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,791,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	111,967,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,592,700	
第510回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,873,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,683,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,729,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,502,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,104,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,414,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,732,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,057,000	
第405回中部電力株式会社社債	50,000,000	52,942,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	53,673,500	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,450,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,198,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,070,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,187,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,180,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,524,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,735,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,382,000	
第248回北陸電力株式会社社債	100,000,000	109,192,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,795,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,636,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	109,012,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,710,400	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,203,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,300,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,102,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,753,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,494,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,926,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,308,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,682,740	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,068,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,744,000	

第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,017,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,380,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	111,101,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,038,000	
第42回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	101,195,000	
社債券 小計	15,320,000,000	15,740,950,750	
合計	243,279,958,000	255,373,176,719	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,854,697,158
コール・ローン	645,936,018
株式	152,183,409,467
投資信託受益証券	96,904,568
投資証券	3,132,928,749
派生商品評価勘定	5,643,753
未収入金	1,309,147
未収配当金	275,468,742
未収利息	678
差入委託証拠金	938,058,501
流動資産合計	160,134,356,781
資産合計	160,134,356,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,703,207
未払金	81,628,510
未払解約金	326,737,957
流動負債合計	430,069,674
負債合計	430,069,674
純資産の部	
元本等	
元本	110,876,572,872
剰余金	
剰余金又は欠損金()	48,827,714,235
元本等合計	159,704,287,107
純資産合計	159,704,287,107
負債純資産合計	160,134,356,781

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 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)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 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25年 9月30日現在
1. 計算期間の期首元本額	139,817,550,104円
計算期間中の追加設定元本額	15,448,288,867円
計算期間中の一部解約元本額	44,389,266,099円
計算日の元本額	110,876,572,872円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,098,444,531円
SBI資産設計オープン(分配型)	18,572,334円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,718,110,381円
世界経済インデックスファンド	811,176,860円
マイセレクション25	12,187,532円
マイセレクション50	43,053,405円
マイセレクション75	53,377,856円
外国株式インデックス・オープン	1,143,657,942円
DCマイセレクション25	804,053,100円
DCマイセレクション50	4,607,175,351円
DCマイセレクション75	5,049,073,751円
DC外国株式インデックス・オープン	5,427,199,775円
DCマイセレクションS25	285,618,714円
DCマイセレクションS50	1,497,890,439円
DCマイセレクションS75	1,124,912,966円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	5,046,063円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	134,783,144円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	137,701,943円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	63,175,114円
DC世界経済インデックスファンド	573,309,433円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	12,087,753,001円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	138,012,224円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	78,423,674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)	350,483,544円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	828,250,269円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,039,791,054円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,904,411,650円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,434,452,458円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,393,181,050円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,138,639,619円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,009,969,768円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	13,731,814,130円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	6,384,492,545円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,137,336,064円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,176,644,558円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	360,292,405円

グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,130,631,948円
F0Fs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	5,542,189,254円
外国株式ファンド・シリーズ1	764,535,204円
コア投資戦略ファンド(安定型)	681,912,341円
コア投資戦略ファンド(成長型)	904,037,786円
分散投資コア戦略ファンドA	21,336,546円
分散投資コア戦略ファンドS	29,068,007円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
2. 計算日における受益権総数	110,876,572,872口
3. 1口当たり純資産額	1.4404円
(1万口当たり純資産額)	(14,404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25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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、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コンプライアンス会議に報告します。 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25年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	2,892,747,590
投資信託受益証券	3,311,075
投資証券	290,882,084
合計	2,598,554,431

(注)当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」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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	3,956,030,625	-	3,942,703,799	13,326,826
	合計	3,956,030,625	-	3,942,703,799	13,326,826

(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。

通貨関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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				
	アメリカドル	142,308,783	-	140,745,600	1,563,183
	カナダドル	11,518,560	-	11,378,400	140,160
	オーストラリアドル	8,343,783	-	8,176,500	167,283
	イギリスポンド	36,418,042	-	36,358,400	59,642
	スイスフラン	8,697,040	-	8,640,000	57,040
	ユーロ	79,849,280	-	79,116,000	733,280
	計	287,135,488	-	284,414,900	2,720,588
	売 建				
	アメリカドル	214,050,600	-	214,050,600	-
	カナダドル	22,754,160	-	22,756,800	2,640
	オーストラリアドル	16,351,200	-	16,353,000	1,800
	イギリスポンド	34,773,200	-	34,777,600	4,400
	スイスフラン	17,278,400	-	17,280,000	1,600
	ユーロ	42,193,600	-	42,195,200	1,600
	計	347,401,160	-	347,413,200	12,040
	合計	634,536,648	-	631,828,100	2,732,628

(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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在

該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年9月30日現在)

有価証券明細表

A. 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	29,195	94.53	2,759,803.35	
	APACHE CORP	23,335	86.25	2,012,643.75	
	BAKER HUGHES	26,316	49.53	1,303,431.48	
	CABOT OIL & GAS CORP	25,068	37.11	930,273.48	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,763	59.01	871,164.63	
	CHENIERE ENERGY INC	12,228	33.58	410,616.24	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	31,811	26.21	833,766.31	
	CHEVRON CORP	112,856	122.64	13,840,659.84	
	CIMAREX ENERGY CO	5,441	96.30	523,968.30	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,143	25.20	432,003.60	
	CONCHO RESOURCES INC	6,186	107.93	667,654.98	
	CONOCOPHILLIPS	67,622	70.31	4,754,502.82	
	CONSOL ENERGY INC	14,265	33.50	477,877.50	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	106.67	332,917.07	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,673	169.29	452,512.17	
	DENBURY RESOURCES INC	22,245	18.55	412,644.75	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,974	58.71	1,348,803.54	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,348	62.77	272,923.96	
	ENERGEN CORP	4,302	76.60	329,533.20	
	ENSCO PLC-CL A	13,861	54.50	755,424.50	
	EOG RESOURCES INC	15,840	170.73	2,704,363.20	
	EQT CORPORATION	8,967	90.37	810,347.79	
	EXXON MOBIL	259,757	86.90	22,572,883.30	
	FMC TECHNOLOGIES INC	14,145	55.33	782,642.85	
	HALLIBURTON CO	49,226	48.39	2,382,046.14	
	HELMERICH & PAYNE	6,624	69.07	457,519.68	
	HESS CORP	18,309	78.33	1,434,143.97	
	HOLLYFRONTIER CORP	12,189	42.68	520,226.52	
	KINDER MORGAN INC	40,098	35.84	1,437,112.32	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,362	75.26	478,804.12	
	MARATHON OIL CORP	42,154	34.90	1,471,174.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	18,909	64.94	1,227,950.46	
MURPHY OIL CORP	10,789	61.27	661,042.03		
NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	16.42	327,168.50		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	25,413	78.01	1,982,468.13		
NOBLE CORP	15,867	37.60	596,599.20		

NOBLE ENERGY INC	20,809	67.01	1,394,411.09
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,903	94.46	4,430,457.38
OCEANEERING INTL INC	6,800	80.36	546,448.00
PEABODY ENERGY CORP	16,869	17.49	295,038.81
PHILLIPS 66	34,248	58.53	2,004,535.44
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,884	188.78	1,488,341.52
QEP RESOURCES INC	11,161	27.98	312,284.78
RANGE RESOURCES CORP	9,700	77.31	749,907.00
ROWAN COMPANIES PLC	7,231	36.81	266,173.11
SCHLUMBERGER	77,398	88.82	6,874,490.36
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,913	36.44	762,069.72
SPECTRA ENERGY CORP	39,797	34.17	1,359,863.49
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	9,499	25.39	241,179.61
TESORO CORP	8,166	44.74	365,346.84
VALERO ENERGY CORP	32,935	34.30	1,129,670.50
WEATHERFORD INTL LTD	44,155	15.26	673,805.30
WHITING PETROLEUM CORP	7,534	59.98	451,889.32
WILLIAMS COS	40,595	36.24	1,471,162.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	12,367	107.00	1,323,269.00
AIRGAS INC	3,849	105.93	407,724.57
ALBEMARLE CORP	5,130	62.77	322,010.10
ALCOA	63,694	8.20	522,290.80
ASHLAND INC	4,469	91.35	408,243.15
AVERY DENNISON CORP	5,957	43.57	259,546.49
BALL CORP	8,456	45.00	380,520.00
CELANESE CORP-SERIES A	9,323	52.50	489,457.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,462	210.48	728,681.76
CROWN HOLDINGS INC	8,530	42.55	362,951.50
DOW CHEMICAL CO	70,637	39.02	2,756,255.74
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	53,753	59.01	3,171,964.53
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,170	77.70	712,509.00
ECOLAB INC	15,812	98.11	1,551,315.32
FMC CORP	8,200	71.52	586,464.00
FREEPORT-MCMOR-B	60,777	33.42	2,031,167.34
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,854	81.60	396,086.40
INT'L PAPER CO	24,966	45.44	1,134,455.04
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,206	73.39	1,849,868.34
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,855	96.94	276,763.70
MEADWESTVACO CORP	10,334	38.69	399,822.46
MONSANTO CO	31,175	105.61	3,292,391.75
MOSAIC CO/THE	17,752	43.43	770,969.36
NEWMONT MINING CORP	29,588	27.98	827,872.24

NUCOR CORP	18,922	48.80	923,393.60	
OWENS-ILLINOIS INC	9,681	30.32	293,527.92	
PPG INDUSTRIES INC	8,344	165.27	1,379,012.88	
PRAXAIR INC	17,271	119.86	2,070,102.06	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,201	104.24	437,912.24	
SEALED AIR CORP	11,574	27.49	318,169.26	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,235	180.43	944,551.05	
SIGMA-ALDRICH	7,174	85.53	613,592.22	
VULCAN MATERIALS CO	7,736	51.30	396,856.80	
3 M COMPANY	38,173	120.22	4,589,158.06	
AGCO CORP	5,665	61.22	346,811.30	
AMETEK INC	14,491	45.64	661,369.24	
BOEING CO	41,961	118.74	4,982,449.14	
CATERPILLAR	38,290	83.80	3,208,702.00	
CUMMINS INC	10,494	133.54	1,401,368.76	
DANAHER CORP	34,279	69.87	2,395,073.73	
DEERE&CO	21,462	82.37	1,767,824.94	
DOVER CORP	10,004	89.36	893,957.44	
EATON CORP	27,543	69.69	1,919,471.67	
EMERSON ELECTRIC CO	41,851	64.90	2,716,129.90	
FASTENAL CO	16,785	50.00	839,250.00	
FLOWSERVE CORP	8,598	62.16	534,451.68	
FLUOR CORP	9,680	71.05	687,764.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,478	88.29	1,543,132.62	
GENERAL ELECTRIC CO	601,984	24.05	14,477,715.20	
GRAINGER (VW) INC	3,520	263.92	928,998.40	
HONEYWELL INTL INC	43,515	83.58	3,636,983.70	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,912	76.73	1,911,497.76	
INGERSOLL-RAND PLC	17,650	65.42	1,154,663.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,615	57.79	440,070.85	
JOY GLOBAL INC	6,186	51.21	316,785.06	
KBR INC	9,414	32.88	309,532.32	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,355	95.43	511,027.65	
LOCKHEED MARTIN CORP	15,928	129.24	2,058,534.72	
MASCO CORP	21,437	21.12	452,749.44	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,007	96.25	1,251,923.75	
PACCAR INC	20,593	55.80	1,149,089.40	
PALL CORP	6,617	77.50	512,817.50	
PARKER HANNIFIN CORP	8,885	108.95	968,020.75	
PENTAIR LTD	12,202	65.52	799,475.04	
PRECISION CASTPARTS CORP	8,519	228.09	1,943,098.71	
QUANTA SERVICES INC	12,193	27.64	337,014.52	

RAYTHEON COMPANY	18,898	78.74	1,488,028.52
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,327	107.18	892,487.86
ROCKWELL COLLIN	7,819	68.59	536,305.21
ROPER INDUSTRIES INC	5,890	133.43	785,902.70
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	38.70	270,900.00
SPX CORP	2,519	84.28	212,301.32
STANLEY BLACK&DECKER	9,068	90.59	821,470.12
TEXTRON	16,174	27.90	451,254.60
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	138.67	392,713.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	50,844	109.36	5,560,299.84
XYLEM INC	10,787	27.99	301,928.13
ADT CORPORATION	12,100	41.26	499,246.00
CINTAS CORP	6,063	51.22	310,546.86
DUN & BRADSTREET CORP	2,435	104.17	253,653.95
EQUIFAX INC	7,175	59.81	429,136.75
IHS INC-CLASS A	3,625	114.98	416,802.50
IRON MOUNTAIN INC	8,702	27.72	241,219.44
MANPOWER GROUP	4,455	73.10	325,660.50
NIELSEN HOLDINGS NV	13,430	36.32	487,777.60
REPUBLIC SERVICES INC	17,278	33.75	583,132.50
ROBERT HALF INTL INC	8,611	38.97	335,570.67
STERICYCLE INC	5,128	115.72	593,412.16
TYCO INTERNATIONAL LTD	27,758	34.95	970,142.10
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,032	65.34	590,150.88
WASTE MANAGEMENT INC	26,324	41.39	1,089,550.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,593	60.45	579,896.85
CSX CORP	59,497	25.85	1,537,997.45
DELTA AIR LINES INC	12,452	23.57	293,493.64
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,300	44.14	542,922.00
FEDEX CORP	17,525	113.77	1,993,819.25
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,843	22.32	532,175.76
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,476	72.34	396,133.84
KANSAS CITY SOUTHERN	6,561	110.11	722,431.71
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,344	77.79	1,426,979.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	10,842	14.64	158,726.88
UNION PACIFIC CORP	27,175	156.59	4,255,333.25
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	30.91	166,635.81
UNITED PARCEL SERVICE B	42,190	91.25	3,849,837.50
AUTOLIV INC	5,587	87.74	490,203.38
BORGWARNER INC	6,751	101.51	685,294.01
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	17,352	58.44	1,014,050.88
FORD MOTOR COMPANY	214,249	17.05	3,652,945.45

GENERAL MOTORS CO	44,169	36.37	1,606,426.53
HARLEY-DAVIDSON	13,516	64.65	873,809.40
JOHNSON CONTROLS INC	40,018	42.53	1,701,965.54
TESLA MOTORS INC	4,848	190.86	925,289.28
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	72.19	509,228.26
COACH INC	16,774	54.24	909,821.76
DR HORTON INC	16,578	19.63	325,426.14
FOSSIL GROUP INC	3,299	116.46	384,201.54
GARMIN LTD	6,856	45.19	309,822.64
HASBRO INC	6,870	47.38	325,500.60
LEGGETT & PLATT INC	8,864	30.36	269,111.04
LENNAR CORP-CL A	9,411	35.86	337,478.46
LULULEMON ATHLETICA INC	5,911	72.02	425,710.22
MATTEL INC	20,582	42.09	866,296.38
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,233	74.45	836,296.85
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,720	130.09	483,934.80
NEWELL RUBBERMAID	16,854	27.59	465,001.86
NIKE B	41,809	73.64	3,078,814.76
POLARIS INDUSTRIES INC	3,815	128.20	489,083.00
PULTE GROUP INC	20,375	16.57	337,613.75
PVH CORP	4,650	118.51	551,071.50
RALPH LAUREN CORPORATION	3,565	165.63	590,470.95
TOLL BROTHERS INC	9,562	32.36	309,426.32
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,800	79.99	383,952.00
VF CORP	5,119	198.48	1,016,019.12
WHIRLPOOL CORP	4,625	147.41	681,771.25
BLOCK H & R INC	15,909	26.36	419,361.24
CARNIVAL CORPORATION	23,000	32.88	756,240.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,854	419.00	776,826.00
DARDEN RESTAURANTS INC	7,584	46.70	354,172.80
INT'L GAME TECHNOLOGY	16,160	19.23	310,756.80
LAS VEGAS SANDS CORP	24,094	65.88	1,587,312.72
MARRIOTT INTL A	14,928	42.35	632,200.80
MCDONALD'S CORP	58,570	97.12	5,688,318.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	23,000	20.22	465,060.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,973	38.40	344,563.20
STARBUCKS CORP	43,740	77.32	3,381,976.80
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,573	66.99	775,275.27
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,163	61.65	503,248.95
WYNN RESORTS LTD	4,721	158.00	745,918.00
YUM BRANDS INC	26,280	72.13	1,895,576.40
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	16.83	178,414.83

CBS CORP-CL B	33,422	55.50	1,854,921.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,616	133.57	482,989.12	
COMCAST CORP-CL A	124,406	44.74	5,565,924.44	
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,888	43.03	1,243,050.64	
DIRECTV	30,999	59.96	1,858,700.04	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	8,670	84.84	735,562.80	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,403	77.76	420,137.28	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,632	44.46	561,618.72	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	25,027	17.15	429,213.05	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,715	79.84	935,325.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	9,451	76.11	719,315.61	
LIBERTY MEDIA CORP	5,649	149.02	841,813.98	
NEWS CORP-CLASS A	22,802	16.17	368,708.34	
OMNICOM GROUP	15,107	64.32	971,682.24	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,954	78.11	386,956.94	
SIRIUS XM RADIO INC	186,426	3.91	729,857.79	
THE WALT DISNEY CO	99,952	65.19	6,515,870.88	
TIME WARNER CABLE-A	16,998	112.17	1,906,665.66	
TIME WARNER INC	54,458	66.20	3,605,119.60	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	88,567	33.26	2,945,738.42	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	26,238	33.27	872,938.26	
VIACOM INC-CLASS B	25,341	84.42	2,139,287.22	
ADVANCE AUTO PARTS	4,262	82.06	349,739.72	
AMAZON.COM	21,277	316.01	6,723,744.77	
AUTOZONE INC	2,124	422.57	897,538.68	
BED BATH & BEYOND INC	12,855	77.23	992,791.65	
BEST BUY COMPANY INC	16,090	37.98	611,098.20	
CARMAX INC	13,119	49.22	645,717.18	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,200	53.49	331,638.00	
DOLLAR GENERAL CORP	18,572	56.59	1,050,989.48	
DOLLAR TREE INC	13,077	57.52	752,189.04	
EXPEDIA INC	6,277	52.21	327,722.17	
FAMILY DOLLAR STORES	6,337	72.58	459,939.46	
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,944	49.65	344,769.60	
GAP	17,669	40.67	718,598.23	
GENUINE PARTS CO	9,252	80.39	743,768.28	
HOME DEPOT	85,341	75.96	6,482,502.36	
J.C. PENNEY CO INC	11,122	9.05	100,654.10	
KOHL'S CORP	12,322	52.03	641,113.66	
L BRANDS INC	14,644	61.11	894,894.84	

LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	29,256	23.75	694,830.00
LKQ CORP	17,445	31.56	550,564.20
LOWES COMPANIES	63,592	47.77	3,037,789.84
MACY'S INC	22,416	43.52	975,544.32
NETFLIX INC	3,011	312.40	940,636.40
NORDSTROM INC	9,415	56.45	531,476.75
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,454	126.75	818,044.50
PETSMART INC	5,734	76.62	439,339.08
PRICELINE.COM INC	3,013	1,014.97	3,058,104.61
ROSS STORES INC	12,841	72.55	931,614.55
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,537	59.05	149,809.85
STAPLES INC	40,259	14.59	587,378.81
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,614	63.94	2,277,159.16
TIFFANY & CO	7,453	76.89	573,061.17
TJX COMPANIES INC	42,050	56.47	2,374,563.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,154	66.45	541,833.30
TRIPADVISOR INC	6,995	75.85	530,570.75
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,534	119.11	420,934.74
URBAN OUTFITTERS INC	7,459	37.07	276,505.13
COSTCO WHOLESALE CORP	25,405	115.72	2,939,866.60
CVS CAREMARK CORPORATION	71,282	57.80	4,120,099.60
KROGER CO	28,763	40.69	1,170,366.47
SAFeway INC	15,052	32.25	485,427.00
SYSCO CORP	34,904	32.03	1,117,975.12
WALGREEN CO	53,480	54.51	2,915,194.80
WAL-MART STORES	95,764	74.36	7,121,011.04
WHOLE FOODS MKT INC	20,500	58.34	1,195,970.00
ALTRIA GROUP INC	116,941	34.71	4,059,022.11
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,229	37.12	1,456,180.48
BEAM INC	9,155	64.37	589,307.35
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,852	68.77	539,982.04
BUNGE LIMITED	8,562	76.21	652,510.02
CAMPBELL SOUP CO (US)	11,922	40.96	488,325.12
COCA-COLA CO	233,361	38.40	8,961,062.40
COCA-COLA ENTERPRISES	15,650	40.57	634,920.50
CONAGRA	24,266	30.27	734,531.82
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,671	56.98	551,053.58
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,655	44.98	524,241.90
GENERAL MILLS INC	38,514	48.08	1,851,753.12
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	7,383	74.88	552,839.04
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,250	93.00	860,250.00
HORMEL FOODS CORP	9,753	42.29	412,454.37

JM SMUCKER CO	6,389	104.79	669,503.31	
KELLOGG CO	14,988	59.02	884,591.76	
KRAFT FOODS GROUP INC	35,072	52.88	1,854,607.36	
LORILLARD INC	22,596	45.23	1,022,017.08	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7,531	65.40	492,527.40	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,063	75.24	907,620.12	
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,767	50.40	441,856.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	98,693	31.81	3,139,424.33	
MONSTER BEVERAGE CORP	8,382	53.07	444,832.74	
PEPSICO INC	90,030	80.20	7,220,406.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	95,216	87.33	8,315,213.28	
REYNOLDS AMERICAN INC	19,762	49.34	975,057.08	
TYSON FOODS INC	16,582	28.60	474,245.20	
AVON PRODUCTS INC	27,701	20.73	574,241.73	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,912	60.67	540,691.04	
CLOROX COMPANY	7,719	82.21	634,578.99	
COLGATE-PALMOLIVE CO	54,457	59.93	3,263,608.01	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,136	92.19	381,297.84	
ESTEE LAUDER CO-CL A	14,127	70.42	994,823.34	
HERBALIFE LTD	5,219	68.21	355,987.99	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,391	94.79	2,122,442.89	
PROCTER & GAMBLE CO	159,563	77.21	12,319,859.23	
ABBOTT LABORATORIES	90,754	33.14	3,007,587.56	
AETNA INC	22,530	64.48	1,452,734.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,710	61.28	840,148.80	
BARD C R INC	4,451	115.74	515,158.74	
BAXTER INTERNATIONAL	31,635	66.38	2,099,931.30	
BECTON DICKINSON & CO	11,553	99.89	1,154,029.17	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	80,854	11.52	931,438.08	
CARDINAL HEALTH	20,303	52.28	1,061,440.84	
CAREFUSION CORP	13,118	36.94	484,578.92	
CERNER CORP	18,254	52.61	960,342.94	
CIGNA CORP	17,033	77.65	1,322,612.45	
COVIDIEN PLC	28,117	60.96	1,714,012.32	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,682	56.98	608,660.36	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	8,916	43.39	386,865.24	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,227	68.79	497,145.33	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	47,737	61.93	2,956,352.41	
HCA HOLDINGS INC	15,475	42.07	651,033.25	
HENRY SCHEIN INC	5,073	103.48	524,954.04	
HOLOGIC INC	16,992	20.91	355,302.72	
HUMANA INC	9,454	93.88	887,541.52	

INTUITIVE SURGICAL INC	2,390	367.46	878,229.40
LABORATORY CRP OF AMER	5,326	98.63	525,303.38
MCKESSON CORP	13,193	129.29	1,705,722.97
MEDTRONIC	59,151	53.00	3,135,003.00
OMNICARE INC	7,014	55.25	387,523.50
PATTERSON COMPANIES INC	6,126	39.97	244,856.22
QUEST DIAGNOSTICS	9,200	61.72	567,824.00
RESMED INC	8,978	52.70	473,140.60
ST JUDE MEDICAL INC	16,849	52.39	882,719.11
STRYKER CORP	18,132	67.65	1,226,629.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,383	71.99	4,274,982.17
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,312	74.18	468,224.16
WELLPOINT INC	17,487	83.95	1,468,033.65
ZIMMER HOLDINGS INC	10,087	82.30	830,160.10
ABBVIE INC	92,202	44.33	4,087,314.66
ACTAVIS INC	7,614	144.30	1,098,700.20
AGILENT TECHNOLOGIES	20,667	51.63	1,067,037.21
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,628	116.42	1,353,731.76
ALLERGAN INC	17,732	91.04	1,614,321.28
AMGEN	43,662	113.19	4,942,101.78
BIOGEN IDEC INC	14,029	244.82	3,434,579.78
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,093	74.09	599,610.37
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	95,627	46.20	4,417,967.40
CELGENE CORP	24,284	154.61	3,754,549.24
FOREST LABORATORIES INC	14,275	43.17	616,251.75
GILEAD SCIENCES INC	88,804	63.54	5,642,606.16
HOSPIRA INC	10,412	38.90	405,026.80
ILLUMINA INC	7,915	81.01	641,194.15
JOHNSON & JOHNSON	163,898	86.73	14,214,873.54
LIFE TECHNOLOGIES CORP	10,149	74.91	760,261.59
LILLY (ELI) & CO	59,191	50.50	2,989,145.50
MERCK & CO	175,797	47.79	8,401,338.63
MYLAN INC	23,561	38.34	903,328.74
ONYX PHARMACEUTICALS INC	4,289	124.70	534,838.30
PERRIGO CO	5,318	123.70	657,836.60
PFIZER	382,194	28.88	11,037,762.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,545	305.65	1,389,179.25
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,302	93.01	1,981,299.02
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,996	76.09	988,865.64
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	9,903	23.11	228,858.33
WATERS CORP	5,509	107.28	591,005.52
ZOETIS INC	29,863	31.15	930,232.45

BB&T CORP	41,689	33.97	1,416,175.33
CIT GROUP INC	11,131	48.47	539,519.57
COMERICA INC	10,866	39.19	425,838.54
FIFTH THIRD BANCORP	52,136	18.08	942,618.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,400	46.72	299,008.00
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.12	252,505.44
KEY CORP	55,029	11.36	625,129.44
M & T BANK CORP	6,760	112.08	757,660.80
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,108	15.11	424,711.88
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,088	14.28	315,416.64
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,822	72.63	2,238,601.86
REGIONS FINL CORP	84,188	9.30	782,948.40
SUNTRUST BANKS	32,102	32.60	1,046,525.20
US BANCORP	107,683	36.50	3,930,429.50
WELLS FARGO & CO	292,929	41.59	12,182,917.11
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,300	183.94	607,002.00
AMERICAN EXPRESS	57,565	75.89	4,368,607.85
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,120	91.43	1,108,131.60
BANK NEW YORK CO	67,571	30.24	2,043,347.04
BANK OF AMERICA CORP	627,615	13.90	8,723,848.50
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,410	114.85	7,167,788.50
BLACKROCK INC	7,857	270.95	2,128,854.15
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	34,681	68.92	2,390,214.52
CITIGROUP	177,151	48.89	8,660,912.39
CME GROUP INC	18,876	74.83	1,412,491.08
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29,508	51.29	1,513,465.32
EATON VANCE CORP	7,818	39.11	305,761.98
FRANKLIN RESOURCES INC	24,684	50.82	1,254,440.88
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,359	159.85	4,053,636.15
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,327	181.28	784,398.56
INVESCO LTD	26,264	32.09	842,811.76
JPMORGAN CHASE & CO	220,046	52.24	11,495,203.04
LEGG MASON INC	7,601	33.89	257,597.89
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,488	27.30	504,722.40
MCGRAW-HILL FINANCIAL	15,160	65.92	999,347.20
MOODY'S CORP	11,940	70.35	839,979.00
MORGAN STANLEY	85,586	27.08	2,317,668.88
NASDAQ OMX GROUP	7,871	32.20	253,446.20
NORTHERN TRUST CORP	13,902	54.78	761,551.56
NYSE EURONEXT	14,159	41.95	593,970.05
PRICE T ROWE GROUP INC	15,359	72.45	1,112,759.55
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,476	41.96	313,692.96

SCHWAB (CHARLES) CORP	67,066	21.19	1,421,128.54	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,731	30.82	269,089.42	
SLM CORP	27,003	25.14	678,855.42	
STATE STREET CORP	27,214	66.21	1,801,838.94	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,812	26.28	336,699.36	
ACE LTD	20,211	94.32	1,906,301.52	
AFLAC	27,861	62.21	1,733,232.81	
ALLEGHANY CORP	1,001	406.13	406,536.13	
ALLSTATE CORP	27,284	51.07	1,393,393.88	
AMERICAN INT'L GROUP	81,653	49.15	4,013,244.95	
AON PLC	17,631	75.07	1,323,559.17	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,748	54.17	419,709.16	
ASSURANT INC	4,482	54.30	243,372.60	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,195	43.25	311,183.75	
CHUBB CORPORATION	15,545	89.65	1,393,609.25	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,869	47.46	468,382.74	
EVEREST RE GROUP LTD	3,222	145.45	468,639.90	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	26.51	343,914.23	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,705	31.27	772,525.35	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,170	42.15	681,565.50	
LOEWS CORP	19,248	46.95	903,693.60	
MARSH & MCLENNAN COS	32,664	43.76	1,429,376.64	
METLIFE INC	54,187	47.21	2,558,168.27	
PARTNERRE LTD	3,128	91.39	285,867.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	17,476	43.19	754,788.44	
PROGRESSIVE CORP	34,174	27.32	933,633.68	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,578	78.41	2,162,390.98	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,591	90.25	233,837.75	
TORCHMARK CORP	5,579	72.84	406,374.36	
TRAVELERS COS INC/THE	21,914	85.41	1,871,674.74	
UNUM GROUP	15,540	30.62	475,834.80	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,629	43.65	420,305.85	
WR BERKLEY CORP	6,732	43.22	290,957.04	
XL GROUP PLC	17,569	31.00	544,639.00	
CBRE GROUP INC-A	16,741	23.34	390,734.94	
REALOGY HOLDINGS CORP	8,488	42.84	363,625.92	
WEYERHAEUSER CO	33,573	28.93	971,266.89	
ACCENTURE PLC-CL A	38,379	74.09	2,843,500.11	
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,926	16.82	469,715.32	
ADOBE SYSTEMS INC	28,381	52.03	1,476,663.43	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,333	51.75	586,482.75	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,864	209.28	599,377.92	

ANSYS INC	5,900	86.49	510,291.00
AUTODESK INC	14,251	41.79	595,549.29
AUTOMATIC DATA PROCESS	28,890	72.56	2,096,258.40
CA INC	18,491	30.06	555,839.46
CITRIX SYSTEMS INC	11,103	70.80	786,092.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,975	82.70	1,486,532.50
COMPUTER SCIENCES CORP	9,142	52.02	475,566.84
EBAY	68,000	55.78	3,793,040.00
ELECTRONIC ARTS INC	17,619	25.95	457,213.05
EQUINIX INC	3,100	184.13	570,803.00
FACEBOOK INC-A	96,102	51.24	4,924,266.48
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,541	46.54	816,358.14
FISERV INC	7,952	101.09	803,867.68
GOOGLE INC-CL A	15,784	876.39	13,832,939.76
INTL BUSINESS MACHINES CORP	61,324	186.92	11,462,682.08
INTUIT INC	16,772	66.51	1,115,505.72
LINKEDIN CORP - A	5,331	246.72	1,315,264.32
MASTERCARD INC-CLASS A	6,123	681.85	4,174,967.55
MICROSOFT CORP	462,980	33.29	15,412,604.20
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,487	18.87	292,239.69
ORACLE CORP	219,397	33.78	7,411,230.66
PAYCHEX INC	19,498	40.35	786,744.30
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	53.35	368,115.00
RED HAT INC	11,038	45.95	507,196.10
SAIC INC	19,851	16.03	318,211.53
SALESFORCE.COM INC	32,628	52.43	1,710,686.04
SYMANTEC CORP	41,051	24.73	1,015,191.23
SYNOPSYS INC	9,382	37.61	352,857.02
TERADATA CORP	9,513	56.51	537,579.63
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	29.31	334,925.37
VERISIGN INC	8,776	51.18	449,155.68
VISA INC-CLASS A SHARES	30,154	193.05	5,821,229.70
VMWARE INC-CLASS A	5,218	82.63	431,163.34
WESTERN UNION CO	33,878	18.64	631,485.92
YAHOO	56,726	33.55	1,903,157.30
AMPHENOL CORPORATION	9,512	77.54	737,560.48
APPLE INC	54,895	482.75	26,500,561.25
ARROW ELECTRONICS INC	6,842	48.15	329,442.30
AVNET INC	8,881	41.73	370,604.13
CISCO SYSTEMS	311,138	23.35	7,265,072.30
CORNING	87,703	14.73	1,291,865.19

DELL INC	88,025	13.78	1,212,984.50
EMC CORP	122,307	26.07	3,188,543.49
F5 NETWORKS INC	5,014	86.80	435,215.20
FLEXTRONICS INTL LTD	36,425	9.14	332,924.50
FLIR SYSTEMS INC	8,635	31.32	270,448.20
HARRIS CORP	7,124	59.23	421,954.52
HEWLETT-PACKARD CO	113,177	21.17	2,395,957.09
JUNIPER NETWORKS INC	30,344	19.95	605,362.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,795	59.75	884,001.25
NETAPP INC	21,467	42.58	914,064.86
QUALCOMM	100,592	67.38	6,777,888.96
SANDISK CORP	14,405	59.94	863,435.70
SEAGATE TECHNOLOGY	19,238	43.51	837,045.38
TE CONNECTIVITY LTD	25,033	51.96	1,300,714.68
TRIMBLE NAVIGATION LTD	16,000	29.93	478,880.00
WESTERN DIGITAL CORP	12,902	63.32	816,954.64
XEROX CORP	69,252	10.37	718,143.24
AT&T INC	315,878	33.98	10,733,534.44
CENTURYLINK INC	35,759	31.78	1,136,421.02
CROWN CASTLE INTL CORP	17,584	72.71	1,278,532.64
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	63,307	4.29	271,587.03
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,748	79.83	618,522.84
SPRINT CORP	55,972	6.16	344,787.52
T-MOBILE US INC	8,460	26.07	220,552.20
VERIZON COMMUNICATIONS	167,979	47.00	7,895,013.00
WINDSTREAM HOLDINGS INC	38,003	8.13	308,964.39
AES CORP	36,943	13.47	497,622.21
ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,120	49.71	353,935.20
AMEREN CORPORATION	13,296	35.01	465,492.96
AMERICAN ELECTRIC POWER	28,929	43.44	1,256,675.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,567	40.88	431,978.96
CALPINE CORP	20,101	19.77	397,396.77
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	23.93	539,717.22
CMS ENERGY CORP	16,700	26.21	437,707.00
CONSOLIDATED EDISON INC	17,445	55.15	962,091.75
DOMINION RESOURCES	34,328	62.43	2,143,097.04
DTE ENERGY COMPANY	10,127	66.06	668,989.62
DUKE ENERGY CORP	41,087	66.90	2,748,720.30
EDISON INTL	18,436	45.81	844,553.16
ENTERGY CORP	10,608	63.32	671,698.56
EXELON CORP	49,826	29.74	1,481,825.24
FIRSTENERGY CORP	24,911	36.59	911,493.49

INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,934	55.82	275,415.88		
MDU RESOURCES GROUP INC	10,444	27.79	290,238.76		
NEXTERA ENERGY INC	24,838	80.07	1,988,778.66		
NISOURCE INC	18,279	30.67	560,616.93		
NORTHEAST UTILITIES	18,723	41.44	775,881.12		
NRG ENERGY INC	17,935	27.72	497,158.20		
OGE ENERGY CORP	12,400	35.98	446,152.00		
ONEOK INC	12,458	53.04	660,772.32		
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	18.45	265,200.30		
PG&E CORP	26,134	40.78	1,065,744.52		
PINNACLE WEST CAPITAL	7,000	54.93	384,510.00		
PPL CORPORATION	34,717	30.34	1,053,313.78		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	30,137	33.02	995,123.74		
SCANA CORP	7,835	46.03	360,645.05		
SEMPRA ENERGY	13,767	86.62	1,192,497.54		
SOUTHERN CO	51,760	41.23	2,134,064.80		
WISCONSIN ENERGY CORP	13,316	40.31	536,767.96		
XCEL ENERGY INC	29,084	27.69	805,335.96		
ALTERA CORPORATION	18,638	36.96	688,860.48		
ANALOG DEVICES	17,941	46.89	841,253.49		
APPLIED MATERIALS	71,480	17.60	1,258,048.00		
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,410	42.70	658,007.00		
BROADCOM CORP-CL A	30,854	25.84	797,267.36		
CREE INC	7,602	59.26	450,494.52		
INTEL CORP	289,403	22.98	6,650,480.94		
KLA-TENCOR CORP	9,658	60.91	588,268.78		
LAM RESEARCH CORP	9,670	51.14	494,523.80		
LINEAR TECHNOLOGY CORP	14,528	39.60	575,308.80		
LSI CORP	31,994	7.89	252,432.66		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	23,144	11.69	270,553.36		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	18,304	29.49	539,784.96		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,179	40.30	490,813.70		
MICRON TECHNOLOGY	59,971	17.62	1,056,689.02		
NVIDIA CORP	33,645	15.58	524,189.10		
TEXAS INSTRUMENTS	64,573	40.16	2,593,251.68		
XILINX INC	15,362	46.54	714,947.48		
アメリカドル小計	17,843,646		913,635,036.42 (89,307,824,810)		
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	36.46	252,376.12	
	ARC RESOURCES LTD	18,664	26.16	488,250.24	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	7.97	159,830.38	
	BAYTEX ENERGY CORP	7,544	42.87	323,411.28	

BONAVISTA ENERGY CORP	10,435	12.88	134,402.80	
CAMECO CORP	23,549	18.89	444,840.61	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	63,479	32.44	2,059,258.76	
CANADIAN OIL SANDS LTD	28,862	20.11	580,414.82	
CENOVUS ENERGY INC	44,478	31.04	1,380,597.12	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,215	38.96	865,496.40	
ENBRIDGE	45,292	42.91	1,943,479.72	
ENCANA CORP	43,667	17.87	780,329.29	
ENERPLUS CORP	10,454	17.45	182,422.30	
HUSKY ENERGY INC	20,481	29.80	610,333.80	
IMPERIAL OIL	17,670	45.49	803,808.30	
KEYERA CORP	4,636	59.51	275,888.36	
MEG ENERGY CORP	8,375	35.15	294,381.25	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,856	21.54	384,618.24	
PEMBINA PIPELINE CORP	17,567	34.09	598,859.03	
PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	6.05	190,423.75	
PENN WEST PETROLEUM LTD	29,712	11.51	341,985.12	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,413	30.26	254,577.38	
SUNCOR ENERGY	87,855	37.32	3,278,748.60	
TALISMAN ENERGY INC	61,047	11.85	723,406.95	
TOURMALINE OIL CORP	8,740	41.60	363,584.00	
TRANSCANADA CORP	41,160	45.55	1,874,838.00	
VERMILION ENERGY INC	6,014	56.79	341,535.06	
AGNICO EAGLE MINES	10,066	27.11	272,889.26	
AGRIUM INC	8,901	87.46	778,481.46	
BARRICK GOLD CORP	59,366	19.11	1,134,484.26	
ELDORADO GOLD CORP	43,374	6.86	297,545.64	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,423	19.30	645,063.90	
FRANCO-NEVADA CORP	8,570	46.37	397,390.90	
GOLDCORP INC	47,438	26.55	1,259,478.90	
KINROSS GOLD CORP	67,919	5.15	349,782.85	
NEW GOLD INC	29,614	6.26	185,383.64	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	50,564	32.57	1,646,869.48	
SILVER WHEATON CORP	20,718	25.72	532,866.96	
TECK RESOURCES LTD-CL B	33,778	28.10	949,161.80	
YAMANA GOLD INC	43,938	10.68	469,257.84	
BOMBARDIER B	85,798	4.86	416,978.28	
CAE INC	16,121	11.25	181,361.25	
FINNING INTERNATIONAL INC	10,988	23.87	262,283.56	
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,386	41.35	388,111.10	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,690	104.70	2,585,043.00	
CP RAILWAY LIMITED	10,245	129.09	1,322,527.05	

MAGNA INTERNATIONAL INC	13,795	85.98	1,186,094.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,836	48.43	331,067.48	
TIM HORTONS INC	9,165	59.45	544,859.25	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,741	24.00	545,784.00	
THOMSON REUTERS CORP	22,240	36.23	805,755.20	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,643	92.13	427,759.59	
DOLLARAMA INC	4,200	84.30	354,060.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,961	65.01	517,544.61	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	74.62	156,105.04	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,078	45.80	324,172.40	
METRO INC	5,624	64.74	364,097.76	
SHOPPERS DRUG MART CORP	12,155	59.50	723,222.50	
WESTON (GEORGE) LTD	3,224	81.83	263,819.92	
SAPUTO INC	7,636	49.05	374,545.80	
CATAMARAN CORPORATION	12,239	48.97	599,343.83	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,104	107.98	1,954,869.92	
BANK MONTREAL	37,731	68.60	2,588,346.60	
BANK NOVA SCOTIA	69,765	59.13	4,125,204.45	
CANADIAN IMPERIAL BANK	23,276	82.50	1,920,270.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	9,662	85.51	826,197.62	
ROYAL BANK OF CANADA	84,089	66.54	5,595,282.06	
TORONTO-DOMINION BANK	53,786	92.73	4,987,575.78	
CI FINANCIAL CORP	9,764	31.89	311,373.96	
IGM FINANCIAL INC	5,864	48.49	284,345.36	
ONEX CORP	5,804	54.38	315,621.52	
GREAT-WEST LIFECO INC	16,992	30.49	518,086.08	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	43.30	266,165.10	
INTACT FINANCIAL CORP	7,762	61.92	480,623.04	
MANULIFE FINANCIAL CORP	106,714	17.38	1,854,689.32	
POWER CORP OF CANADA	20,816	29.41	612,198.56	
POWER FINANCIAL CORP	14,791	32.28	477,453.48	
SUN LIFE FINANCIAL INC	35,735	33.30	1,189,975.50	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	32,268	37.85	1,221,343.80	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	17,731	17.29	306,568.99	
FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	16.95	93,801.30	
CGI GROUP INC - CL A	12,038	36.07	434,210.66	
OPEN TEXT CORP	3,673	77.86	285,979.78	
BLACKBERRY LIMITED	28,099	8.28	232,659.72	
BCE INC	15,348	44.20	678,381.60	
BELL ALIANT INC	5,225	25.82	134,909.50	

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,190	44.64	945,921.60	
	TELUS CORP	16,454	34.52	567,992.08	
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	45.20	180,800.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	35.45	204,333.80	
	FORTIS INC	11,903	31.32	372,801.96	
	TRANSALTA CORP	15,621	13.34	208,384.14	
	カナダドル小計	2,184,792		75,701,657.57 (7,178,788,187)	
オーストラリア アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	18.95	160,866.55	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	65,165	14.47	942,937.55	
	SANTOS	57,269	15.66	896,832.54	
	WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	2.02	66,882.20	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,373	38.83	1,490,023.59	
	WORLEYPARSONS LTD	13,182	24.41	321,772.62	
	ALUMINA LIMITED	163,150	1.04	169,676.00	
	AMCOR	71,875	10.68	767,625.00	
	BHP BILLITON LTD	186,979	36.36	6,798,556.44	
	BORAL LIMITED	48,581	4.86	236,103.66	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,738	4.94	443,305.72	
	ILUKA RESOURCES LTD	26,815	11.73	314,539.95	
	INCITEC PIVOT LTD	102,417	2.73	279,598.41	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,080	10.91	306,352.80	
	NEWCREST MINING LIMITED	45,621	11.47	523,272.87	
	ORICA LTD	21,846	20.28	443,036.88	
	RIO TINTO LTD	25,369	63.29	1,605,604.01	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,493	19.74	187,391.82	
	ALS LTD	21,808	10.32	225,058.56	
	BRAMBLES LTD	92,722	9.21	853,969.62	
	SEEK LTD	19,117	12.15	232,271.55	
	ASCIANO GROUP	61,334	5.98	366,777.32	
	AURIZON HOLDINGS LTD	116,346	4.70	546,826.20	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.51	116,494.99	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.87	244,820.09	
	TRANSURBAN GROUP	84,248	6.87	578,783.76	
	CROWN LTD	25,191	15.85	399,277.35	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	47,591	2.74	130,399.34	
	FLIGHT CENTRE LTD	3,263	49.83	162,595.29	
	TABCORP HOLDINGS	45,765	3.28	150,109.20	
TATTS GROUP LTD	87,285	3.10	270,583.50		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.24	99,830.88		
METCASH LTD	55,380	3.23	178,877.40		
WESFARMERS LIMITED	58,607	41.70	2,443,911.90		

	WOOLWORTHS LTD	72,519	35.53	2,576,600.07	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	34,047	12.48	424,906.56	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.46	171,941.92	
	COCHLEAR LIMITED	3,583	61.50	220,354.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,412	36.35	305,776.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	23,448	16.20	379,857.60	
	CSL LIMITED	28,631	65.54	1,876,475.74	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	159,747	31.52	5,035,225.44	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,405	10.20	259,131.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	93,650	73.16	6,851,434.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	136,408	35.11	4,789,284.88	
	WESTPAC BANKING	180,694	33.30	6,017,110.20	
	ASX LTD	10,432	34.76	362,616.32	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	18,200	48.90	889,980.00	
	AMP LTD	174,549	4.70	820,380.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	123,836	5.94	735,585.84	
	QBE INSURANCE GROUP	71,284	14.72	1,049,300.48	
	SUNCORP GROUP LIMITED	76,636	13.33	1,021,557.88	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,469	10.03	285,544.07	
	TELSTRA CORP	253,545	5.02	1,272,795.90	
	AGL ENERGY LTD	32,770	15.68	513,833.60	
	SP AUSNET	87,439	1.20	105,363.99	
	オーストラリアドル小計	3,586,133		58,920,022.05 (5,354,062,403)	
イギリスポ ンド	AMEC PLC	17,698	10.91	193,085.18	
	BG GROUP	198,158	11.92	2,362,043.36	
	BP PLC	1,105,443	4.41	4,876,109.07	
	PETROFAC LTD	15,103	14.10	212,952.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	221,111	20.37	4,505,136.62	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	148,990	21.46	3,197,325.40	
	TULLOW OIL PLC	54,074	10.46	565,614.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	81,139	15.40	1,249,540.60	
	ANTOFAGASTA PLC	22,958	8.30	190,551.40	
	BHP BILLITTON PLC	122,961	18.41	2,263,712.01	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,905	26.74	211,379.70	
	FRESNILLO PLC	11,483	10.00	114,830.00	
	GLENCORE XSTRATA PLC	617,738	3.44	2,125,018.72	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,206	28.13	343,354.78	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,212	45.11	235,113.32	
	REXAM	46,082	4.84	223,313.37	
	RIO TINTO PLC REG	74,004	30.67	2,269,702.68	
VEDANTA RESOURCES PLC	6,684	10.73	71,719.32		

BAE SYSTEMS PLC	188,528	4.66	879,860.17
BUNZL PLC	19,364	13.49	261,220.36
COBHAM PLC	67,822	2.93	199,125.39
IMI PLC	19,153	14.69	281,357.57
INVENSYS PLC	37,986	5.01	190,309.86
MEGGITT PLC	45,930	5.55	255,141.15
MELROSE INDUSTRIES PLC	77,063	2.99	230,572.49
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	109,464	11.25	1,231,470.00
SMITHS GROUP PLC	23,431	14.01	328,268.31
TRAVIS PERKINS PLC	14,589	16.48	240,426.72
WEIR GROUP PLC/THE	12,658	23.68	299,741.44
WOLSELEY LTD	16,321	32.41	528,963.61
AGGREKO PLC	15,998	16.08	257,247.84
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,079	12.01	253,158.79
CAPITA GROUP PLC	39,034	9.94	388,193.13
EXPERIAN PLC	60,166	11.84	712,365.44
G4S PLC	88,705	2.53	225,221.99
INTERTEK GROUP PLC	9,579	33.46	320,513.34
SERCO GROUP PLC	29,062	5.50	159,986.31
EASYJET PLC	9,444	12.74	120,316.56
NEW GKN	97,251	3.52	342,420.77
BURBERRY GROUP PLC	26,334	16.23	427,400.82
PERSIMMON PLC	18,044	10.61	191,446.84
CARNIVAL PLC	10,686	21.13	225,795.18
COMPASS GROUP PLC	105,961	8.49	900,138.69
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,984	18.05	288,511.20
TUI TRAVEL PLC	30,444	3.68	112,094.80
WHITBREAD PLC	10,679	30.30	323,573.70
WILLIAM HILL	51,392	4.02	206,595.84
BRITISH SKY BROADCASTING	60,347	8.73	527,131.04
ITV PLC	221,382	1.75	389,189.55
PEARSON	48,692	12.58	612,545.36
REED ELSEVIER PLC	71,114	8.39	597,002.03
WPP PLC	76,682	12.82	983,063.24
KINGFISHER PLC	141,309	3.87	547,572.37
MARKS & SPENCER GROUP PLC	96,106	4.96	476,974.07
NEXT PLC	9,604	51.70	496,526.80
MORRISON SUPERMARKETS	131,478	2.80	368,138.40
SAINSBURY (J) PLC	71,870	3.94	283,670.89
TESCO	470,374	3.62	1,705,576.12
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,220	18.82	399,360.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	111,675	32.95	3,679,691.25

COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	18.54	208,797.48	
DIAGEO	146,143	19.77	2,889,247.11	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	56,709	22.90	1,298,636.10	
SABMILLER PLC	55,977	31.65	1,771,672.05	
TATE & LYLE	27,775	7.38	204,979.50	
UNILEVER PLC	74,721	24.57	1,835,894.97	
RECKITT BENCKISER PLC	37,659	45.18	1,701,433.62	
SMITH & NEPHEW PLC	53,914	7.75	418,103.07	
ASTRAZENECA	72,894	32.01	2,333,336.94	
GLAXOSMITHKLINE	286,775	15.68	4,498,065.87	
SHIRE PLC	32,255	24.67	795,730.85	
BARCLAYS	907,590	2.65	2,412,374.22	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,098,167	6.77	7,442,277.75	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,725,473	0.74	2,023,118.60	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	126,708	3.66	464,384.82	
STANDARD CHARTERED PLC	142,721	14.95	2,133,678.95	
3I GROUP PLC	57,274	3.65	209,565.56	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,623	3.86	215,205.38	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,852	9.94	127,813.14	
ICAP PLC	32,393	3.76	122,056.82	
INVESTEC PLC	34,476	3.99	137,800.57	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	11,371	15.66	178,069.86	
SCHRODERS PLC	6,124	25.91	158,672.84	
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	12.47	143,766.63	
AVIVA PIC	177,394	4.03	715,607.39	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,676	2.12	105,611.17	
LEGAL & GENERAL GROUP	356,036	1.98	707,799.56	
OLD MUTUAL PLC	294,642	1.88	553,926.96	
PRUDENTIAL	150,889	11.58	1,747,294.62	
RESOLUTION LTD	83,609	3.23	270,307.89	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	215,507	1.22	264,642.59	
STANDARD LIFE PLC	141,984	3.51	499,073.76	
SAGE GROUP PLC	67,266	3.29	221,910.53	
BT GROUP PLC	461,171	3.46	1,597,496.34	
INMARSAT PLC	28,187	7.12	200,691.44	
VODAFONE GROUP PLC	2,848,571	2.17	6,187,096.21	
CENTRICA PLC	299,561	3.67	1,099,388.87	
NATIONAL GRID PLC	210,288	7.39	1,554,028.32	
SEVERN TRENT PLC	14,198	17.71	251,446.58	
SSE PLC	57,087	14.68	838,037.16	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,616	6.89	280,047.32	
ARM HOLDINGS PLC	83,182	10.10	840,138.20	

イギリスポンド小計		17,231,202		98,317,609.31 (15,543,030,855)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	21,416	40.63	870,132.08	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	317.75	151,566.75	
	GIVAUDAN-REG	495	1,328.00	657,360.00	
	HOLCIM LTD	13,638	67.95	926,702.10	
	SIKA AG-BR	125	2,679.00	334,875.00	
	SYNGENTA AG	5,422	374.80	2,032,165.60	
	ABB LTD	128,022	21.53	2,756,313.66	
	GEBERIT AG-REG	2,260	242.50	548,050.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,379	130.90	180,511.10	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,895	135.00	390,825.00	
	SULZER AG-REG	1,508	139.50	210,366.00	
	ADECCO	7,891	64.20	506,602.20	
	SGS SA	326	2,179.00	710,354.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,144	120.80	379,795.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	30,390	91.65	2,785,243.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,795	586.00	1,051,870.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,730	102.70	280,371.00	
	ARYZTA AG	5,078	58.10	295,031.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	896.50	118,338.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	3,695.00	181,055.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	42,900.00	257,400.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	187,742	63.25	11,874,681.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,090	111.90	345,771.00	
	ACTELION LTD-REG	6,418	64.15	411,714.70	
	LONZA GROUP AG-REG	3,389	74.60	252,819.40	
	NOVARTIS	133,917	69.65	9,327,319.05	
	ROCHE HOLDING GENUSS	40,902	243.90	9,975,997.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	496.00	105,648.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	88,338	27.72	2,448,729.36	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,195	42.37	559,072.15	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	68.75	129,250.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,099	223.90	246,066.10	
UBS AG-REG	214,908	18.75	4,029,525.00		
BALOISE HOLDING AG	3,007	101.40	304,909.80		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,929	174.10	335,838.90		
SWISS RE LTD	20,763	75.95	1,576,949.85		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,744	233.70	2,043,472.80		
SWISS PRIME SITE-REG	3,464	69.50	240,748.00		
SWISSCOM	1,396	437.40	610,610.40		

スイスフラン小計		963,572		60,444,051.80 (6,527,957,594)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	35,500	25.95	921,225.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	124,000	94.15	11,674,600.00	
	NWS HOLDINGS LTD	101,000	12.04	1,216,040.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	15.26	869,820.00	
	MTR CORP	84,500	30.95	2,615,275.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	45.35	657,575.00	
	LI & FUNG	346,800	11.40	3,953,520.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	21.40	995,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	125,000	54.95	6,868,750.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	59,600	25.20	1,501,920.00	
	SANDS CHINA LTD	144,000	48.75	7,020,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	12.76	1,250,480.00	
	SJM HOLDINGS LTD	113,000	21.30	2,406,900.00	
	WYNN MACAU LTD	98,000	26.45	2,592,100.00	
	BANK EAST ASIA	76,960	33.25	2,558,920.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	220,000	25.15	5,533,000.00	
	HANG SENG BANK	45,500	126.80	5,769,400.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.68	1,111,040.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	65,000	125.60	8,164,000.00	
	AIA GROUP LTD	699,200	37.20	26,010,240.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	81,000	121.00	9,801,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	133,000	26.50	3,524,500.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,000	48.75	2,730,000.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	35.05	1,402,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	33.55	1,291,675.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	236,500	11.84	2,800,160.00	
	SINO LAND CO	183,400	11.44	2,098,096.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	93,000	107.40	9,988,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	93.40	3,782,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	75,000	22.40	1,680,000.00	
	WHARF HOLDINGS	90,000	69.20	6,228,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	53,000	40.95	2,170,350.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	43,500	36.65	1,594,275.00		
PCCW LTD	232,000	3.36	779,520.00		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	53.60	1,661,600.00		
CLP HOLDINGS	105,000	63.80	6,699,000.00		
HONG KONG & CHINA GAS	324,967	18.64	6,057,384.88		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	81,000	67.65	5,479,650.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	79.00	1,090,200.00		

香港ドル小計		4,633,227		164,548,215.88 (2,074,953,002)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	85,300	10.53	898,209.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	0.93	211,447.59	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	63,000	5.32	335,160.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	54,000	4.56	246,240.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	98,000	4.21	412,580.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.16	154,945.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.95	256,105.00	
	SINGAPORE AIRLINES	33,533	10.43	349,749.19	
	GENTING SINGAPORE PLC	363,000	1.46	531,795.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.09	380,370.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	37.49	224,940.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	1.50	130,935.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	444,000	0.52	230,880.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.25	360,750.00	
	DBS GROUP	97,000	16.53	1,603,410.00	
	OCBC BANK	153,000	10.45	1,598,850.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	75,000	21.28	1,596,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	54,000	7.33	395,820.00	
	CAPITALAND LTD	152,500	3.17	483,425.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	1.98	156,815.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.33	247,920.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	182,000	2.92	531,440.00	
KEPPEL LAND LTD	40,000	3.65	146,000.00		
UOL GROUP LIMITED	31,300	6.36	199,068.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	459,243	3.78	1,735,938.54		
STARHUB LTD	38,000	4.31	163,780.00		
シンガポールドル小計		3,314,239		13,582,572.32 (1,056,452,475)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,789	9.64	393,205.96	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	3.37	227,977.13	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	33,590	4.04	135,703.60	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.37	256,035.84	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.47	139,501.41	
ニュージーランドドル小計		275,563		1,152,423.94 (93,277,193)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,993	141.10	1,974,412.30	
	BOLIDEN AB	17,199	96.60	1,661,423.40	
	ALFA LAVAL AB	18,739	156.60	2,934,527.40	
	ASSA ABLOY B	19,900	294.30	5,856,570.00	
	ATLAS COPCO A	39,998	188.80	7,551,622.40	

	ATLAS COPCO B	23,243	170.50	3,962,931.50	
	SANDVIK AB	63,102	88.45	5,581,371.90	
	SCANIA AB-B SHS	19,061	138.90	2,647,572.90	
	SKANSKA B	21,892	125.30	2,743,067.60	
	SKF AB-B	23,353	180.10	4,205,875.30	
	VOLVO B	87,725	97.00	8,509,325.00	
	SECURITAS B	19,690	74.50	1,466,905.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	171.00	2,330,217.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	41.88	1,082,807.40	
	HENNES & MAURITZ B	55,505	280.70	15,580,253.50	
	SWEDISH MATCH AB	12,270	230.80	2,831,916.00	
	SCA SV CELLULOSA B	34,723	163.20	5,666,793.60	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	103.90	2,192,601.70	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	231.60	2,505,448.80	
	NORDEA BANK AB	163,626	78.15	12,787,371.90	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	91,014	68.85	6,266,313.90	
	SVENSKA HANDELSBK A	29,383	278.70	8,189,042.10	
	SWEDBANK AB-A	53,715	148.90	7,998,163.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	118.90	886,161.70	
	INVESTOR AB-B SHS	27,426	196.90	5,400,179.40	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,279	223.50	2,967,856.50	
	RATOS AB-B SHS	12,127	61.15	741,566.05	
	ERICSSON (LM) B	176,367	87.30	15,396,839.10	
	HEXAGON AB-B SHS	14,104	194.40	2,741,817.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,975	579.00	2,301,525.00	
	TELE2 AB-B SHS	20,353	83.30	1,695,404.90	
	TELIASONERA AB	138,656	49.53	6,867,631.68	
	スウェーデンクローナ小計	1,293,274		155,525,516.03 (2,362,432,588)	
ノルウェーク ローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	88.35	930,237.15	
	SEADRILL LTD	21,855	272.80	5,962,044.00	
	STATOIL ASA	64,973	137.30	8,920,792.90	
	SUBSEA 7 SA	15,716	127.20	1,999,075.20	
	NORSK HYDRO	58,546	25.39	1,486,482.94	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,004	250.00	2,751,000.00	
	ORKLA	45,519	43.85	1,996,008.15	
	DNB ASA	58,845	93.15	5,481,411.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,659	90.95	1,151,336.05	
TELENOR ASA	42,029	139.10	5,846,233.90		
	ノルウェークローネ小計	341,675		36,524,622.04 (594,986,093)	

デンマーク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	35	48,920.00	1,712,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	79	51,650.00	4,080,350.00	
	DSV A/S	10,479	159.70	1,673,496.30	
	CARLSBERG AS-B	6,151	567.50	3,490,692.50	
	COLOPLAST-B	6,468	310.10	2,005,726.80	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	508.50	754,614.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	23,186	937.50	21,736,875.00	
	NOVOZYMES A/S	13,135	211.20	2,774,112.00	
	DANSKE BANK A/S	39,476	121.00	4,776,596.00	
	TRYG A/S	1,646	507.50	835,345.00	
	TDC A/S	41,126	46.86	1,927,164.36	
デンマークローネ小計		143,265		45,767,171.96 (809,163,600)	
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	299	1,138.00	340,262.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,519	30.63	873,536.97	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,880.00	302,680.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	49,326	134.60	6,639,279.60	
	BANK HAPOLIM BM	58,582	17.77	1,041,002.14	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	80,820	13.10	1,058,742.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	39.57	324,474.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	144.70	485,902.60	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.45	720,032.85	
イスラエルシェケル小計		340,898		11,785,912.16 (323,876,866)	
ユーロ	CGG	10,161	17.39	176,699.79	
	ENI	148,103	17.11	2,534,042.33	
	FUGRO NV-CVA	4,431	45.44	201,344.64	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.37	260,153.47	
	NESTE OIL OYJ	8,623	16.66	143,659.18	
	OMV AG	8,574	37.30	319,810.20	
	REPSOL SA	50,929	18.51	942,950.43	
	SAIPEM	15,771	16.16	254,859.36	
	TECHNIP S.A.	6,058	87.79	531,831.82	
	TENARIS SA	28,127	17.23	484,628.21	
	TOTAL SA	124,532	43.67	5,438,935.10	
	VOPAK	4,421	42.70	188,776.70	
	AIR LIQUIDE	18,146	103.30	1,874,481.80	
	AKZO NOBEL	14,190	48.28	685,093.20	
	ARCELORMITTAL	59,519	10.16	605,010.63	
	ARKEMA	3,655	83.39	304,790.45	
	BASF SE	53,472	71.53	3,824,852.16	
	CRH	46,255	17.75	821,257.52	

FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,114	62.44	131,998.16
HEIDELBERGCEMENT AG	8,376	58.15	487,064.40
IMERYS SA	1,975	52.00	102,700.00
K+S AG	10,261	19.30	198,088.60
KONINKLIJKE DSM NV	9,186	56.01	514,507.86
LAFARGE (FRANCE)	11,122	52.13	579,789.86
LANXESS	4,844	48.69	235,854.36
LINDE AG	10,783	147.35	1,588,875.05
SOLVAY SA	3,532	111.35	393,288.20
STORA ENSO OYJ R	31,297	6.62	207,342.62
THYSSEN KRUPP	22,984	17.59	404,288.56
UMICORE	6,637	35.94	238,566.96
UPM KYMMENE CORP	30,064	10.43	313,567.52
VOESTALPINE AG	6,910	35.35	244,268.50
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,693	23.51	227,930.89
ALSTOM RGPT	13,216	26.77	353,858.40
ANDRITZ AG	4,662	43.12	201,048.75
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	32.77	145,072.79
BOUYGUES ORD	11,148	26.93	300,271.38
BRENTAG AG	3,068	124.50	381,966.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	33,878	47.45	1,607,511.10
FERROVIAL SA	24,281	13.30	322,937.30
FIAT INDUSTRIAL	50,975	9.75	497,006.25
FINMECCANICA SPA	25,448	4.54	115,635.71
GEA GROUP AG	10,980	30.66	336,646.80
HOCHTIEF AG	1,793	64.79	116,168.47
KONE OYJ-B	9,274	66.45	616,257.30
KONINKLIJKE PHILIPS	55,723	24.07	1,341,252.61
LEGRAND SA	15,181	41.70	633,047.70
MAN SE	2,099	88.00	184,712.00
METSO OYJ	7,612	29.20	222,270.40
OCI NV	5,400	25.60	138,240.00
OSRAM LICHT AG	4,722	35.10	165,742.20
PRYSMIAN SPA	12,810	18.40	235,704.00
REXEL SA	12,359	18.90	233,585.10
SAFRAN SA	14,689	45.77	672,388.97
SAINT-GOBAIN	23,191	37.36	866,531.71
SCHNEIDER ELECTRIC	30,719	64.64	1,985,676.16
SIEMENS	46,161	89.83	4,146,642.63
THALES SA	5,301	41.29	218,904.79
VALLOUREC	6,501	45.28	294,365.28
VINCI S.A.	26,999	43.23	1,167,166.77

WARTSILA OYJ	10,737	34.21	367,312.77
ZARDOYA OTIS SA	10,201	11.99	122,309.99
ZODIAC AEROSPACE	2,146	117.70	252,584.20
BUREAU VERITAS SA	12,862	23.30	299,748.91
EDENRED	11,350	24.28	275,634.75
RANDSTAD HOLDING NV	7,714	40.99	316,196.86
SOCIETE BIC SA	1,800	86.34	155,412.00
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	21,346	14.34	306,208.37
ABERTIS INFRASTRUCTURAS-R	21,346	0.71	15,155.66
ADP	1,728	77.05	133,142.40
ATLANTIA SPA	19,265	15.34	295,525.10
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,664	14.63	214,534.32
DEUTSCHE POST AG-REG	52,790	24.66	1,301,801.40
FRAPORT AG	2,319	51.73	119,961.87
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	32,020	6.31	202,174.28
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	4.02	229,068.33
TNT EXPRESS	22,191	6.84	151,897.39
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,276	80.10	1,544,007.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,343	60.77	203,154.11
CONTINENTAL AG	6,552	127.85	837,673.20
DAIMLER AG	56,005	58.00	3,248,290.00
FIAT ORD	52,136	5.97	311,251.92
MICHELIN	10,794	83.41	900,327.54
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	38.41	237,296.98
PIRELLI & CO	14,958	9.86	147,485.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,121	65.10	593,777.10
RENAULT SA	11,410	60.01	684,714.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,420	174.55	1,469,711.00
VOLKSWAGEN STAMM	1,758	169.80	298,508.40
ADIDAS AG	12,180	80.12	975,861.60
CHRISTIAN DIOR	3,142	144.75	454,804.50
HUGO BOSS AG	1,699	95.09	161,557.91
KERING	4,403	166.35	732,439.05
LUXOTTICA GROUP SPA	9,878	39.40	389,193.20
LVMH	14,782	146.05	2,158,911.10
ACCOR	9,288	30.93	287,277.84
OPAP SA	14,930	8.30	123,919.00
SODEXO	5,616	69.12	388,177.92
AXEL SPRINGER AG	2,489	41.01	102,086.33
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	23.38	197,790.33
JC DECAUX SA	4,621	26.80	123,842.80
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	94.05	124,428.15

LAGADERE S.C.A	6,639	23.94	158,970.85
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG- REGISTERED	6,369	31.83	202,725.27
PUBLICIS GROUPE	10,591	59.37	628,787.67
REED ELSEVIER NV	41,081	15.02	617,036.62
SES	17,459	21.16	369,519.73
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	36.30	116,886.00
WOLTERS KLUWER	17,576	19.17	337,019.80
INDITEX	12,982	113.70	1,476,053.40
AHOLD (KON.)	60,037	12.86	772,075.82
CARREFOUR	35,096	25.40	891,438.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,282	76.63	251,499.66
COLRUYT SA	4,415	41.22	181,986.30
DELHAIZE GROUP	6,071	47.80	290,224.15
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	39,901	6.42	256,443.72
JERONIMO MARTINS	15,262	15.38	234,805.87
KESKO OYJ-B SHS	4,473	22.43	100,329.39
METRO STAMM	7,548	29.49	222,628.26
ANHEUSER-BUSCH INBEV	46,781	73.80	3,452,437.80
DANONE (GROUPE)	33,286	55.44	1,845,375.84
HEINEKEN HOLDING NV	6,278	46.30	290,671.40
HEINEKEN NV	13,724	51.74	710,079.76
KERRY GROUP PLC-A	9,560	44.50	425,420.00
PERNOD-RICARD	12,357	91.90	1,135,608.30
REMY COINTREAU	1,575	78.99	124,409.25
SUEDZUCKER AG	4,926	21.40	105,441.03
UNILEVER NV-CVA	94,837	28.79	2,730,831.41
BEIERSDORF AG	6,056	66.02	399,817.12
HENKEL AG & CO KGAA	7,819	65.86	514,959.34
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,372	76.22	790,553.84
LOREAL	14,078	127.65	1,797,056.70
CELESIO AG	5,912	16.86	99,676.32
ESSILOR INTERNATIONAL	11,876	80.80	959,580.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,839	48.15	618,262.04
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,471	92.04	687,630.84
BAYER	48,143	87.49	4,212,031.07
ELAN CORPORATION PLC	34,320	11.50	394,680.00
GRIFOLS SA	9,679	30.15	291,870.24
MERCK KGAA	3,762	115.05	432,818.10
ORION OYJ-CLASS B	5,839	18.80	109,773.20

QIAGEN N.V.	13,772	16.00	220,352.00
SANOFI	69,376	75.11	5,210,831.36
UCB (GROUPE)	6,553	43.70	286,398.86
BANCO BILBAO VIZCAYA	331,500	8.36	2,771,340.00
BANCO DE SABADELL SA	146,060	1.85	270,357.06
BANCO SANTANDER SA	665,182	6.08	4,045,636.92
BNP PARIBAS	58,593	50.89	2,981,797.77
CAIXABANK	55,446	3.28	182,029.21
COMMERZBANK AG	58,251	8.67	505,327.42
CREDIT AGRICOLE SA	60,165	8.27	498,045.87
ERSTE GROUP BANK AG	15,199	23.65	359,456.35
INTESA SANPAOLO	685,455	1.58	1,083,704.35
KBC GROEP NV	13,809	36.53	504,511.81
NATIXIS	55,749	3.58	199,804.41
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	24.50	83,317.00
SOCIETE GENERALE	41,403	37.16	1,538,742.49
UNICREDIT SPA	255,991	4.77	1,221,589.05
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	3.89	211,509.37
DEUTSCHE BANK NAMEN	60,108	34.14	2,052,387.66
DEUTSCHE BOERSE	11,621	55.22	641,711.62
EURAZEO	1,975	47.98	94,760.50
EXOR SPA	5,807	27.84	161,666.88
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,858	63.64	309,163.12
ING GROEP	225,867	8.42	1,903,607.07
MEDIOBANCA	30,462	5.28	160,839.36
OKO BANK-A	9,611	12.50	120,137.50
WENDEL	1,898	99.96	189,724.08
AEGON	106,867	5.54	592,043.18
AGEAS	13,907	30.50	424,163.50
ALLIANZ SE-REG	26,882	117.75	3,165,355.50
ASSICURAZIONI GENERALI	68,843	14.96	1,029,891.28
AXA	105,748	17.39	1,839,486.46
CNP ASSURANCES	11,367	13.63	154,989.04
DELTA LLOYD NV	11,075	15.75	174,486.62
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,891	54.81	213,265.71
MAPFRE SA	55,064	2.64	145,754.40
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,574	145.60	1,539,574.40
SAMPO OYJ-A SHS	25,235	32.14	811,052.90
SCOR SE	9,248	24.48	226,437.28
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	38.92	88,114.88
IMMOFINANZ AG	58,893	3.22	190,165.49

AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,953	25.92	594,941.76	
ATOS	3,458	58.00	200,564.00	
CAP GEMINI SA	8,568	44.05	377,463.24	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,709	98.86	366,671.74	
SAP AG	53,641	55.19	2,960,446.79	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,790	27.66	187,811.40	
GEMALTO	4,718	80.23	378,525.14	
NOKIA CORP	223,066	4.91	1,095,254.06	
BELGACOM	9,742	19.85	193,378.70	
DEUTSCHE TELEKOM	164,374	10.78	1,771,951.72	
ELISA A	9,087	17.89	162,566.43	
ILIAD SA	1,349	171.80	231,758.20	
KPN (KON.)	192,845	2.36	456,078.42	
ORANGE	108,509	9.40	1,020,635.65	
PORTUGAL TELECOM	41,591	3.37	140,286.44	
TELECOM ITALIA ORD	601,478	0.58	348,857.24	
TELECOM ITALIA RNC	378,931	0.47	178,665.96	
TELEFONICA	241,971	11.54	2,793,555.19	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	5.91	98,959.76	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	6.09	97,031.97	
VIVENDI	69,784	17.14	1,196,446.68	
ZIGGO NV	8,778	30.32	266,148.96	
ACCIONA SA	1,857	42.23	78,430.39	
E.ON SE	104,845	13.41	1,406,495.67	
ELECTRICITE DE FRANCE	13,993	23.63	330,724.55	
ENAGAS	12,304	18.23	224,301.92	
ENEL	383,213	2.87	1,101,354.16	
ENEL GREEN POWER SPA	110,043	1.61	177,389.31	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	124,604	2.71	338,175.25	
FORTUM OYJ	26,458	16.78	443,965.24	
GAS NATURAL SDG SA	21,106	15.40	325,032.40	
GDF SUEZ	77,259	18.84	1,455,559.56	
IBERDROLA SA	282,941	4.33	1,226,832.17	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,979	42.17	294,304.43	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	24.43	64,093.00	
RWE STAMM	29,150	25.44	741,576.00	
SNAM SPA	120,285	3.73	448,663.05	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	17,972	12.10	217,461.20	
TERNA SPA	83,672	3.35	280,301.20	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	12.79	252,692.03	
VERBUND AG	4,553	17.14	78,038.42	
ASML HOLDING NV	20,806	72.56	1,509,683.36	

	INFINEON TECHNOLOGIES	64,362	7.57	487,477.78	
	STMICROELECTRONICS	37,108	7.00	260,089.97	
	ユーロ小計	9,752,107		158,918,660.81 (20,956,603,801)	
	合計	61,903,593		152,183,409,467 (152,183,409,467)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	335,000.00	264,650.00	
	アメリカドル小計		335,000.00	264,650.00 (25,869,537)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	40,986.00	243,456.84	
		LEND LEASE GROUP	34,217.00	355,172.46	
		SYDNEY AIRPORT	13,063.00	52,121.37	
	オーストラリアドル小計		88,266.00	650,750.67 (59,133,713)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	943,800.00	
香港ドル小計		130,000.00	943,800.00 (11,901,318)		
投資信託受益証券合計				96,904,568 (96,904,568)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,168.00	530,083.84	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	23,534.00	1,753,753.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,422.00	656,187.86	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,321.00	946,605.30	
		BOSTON PROPERTIES	9,032.00	967,236.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,256.00	330,970.32	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,831.00	427,964.15	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	296,557.69	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	20,232.00	1,103,655.60	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,867.00	395,555.43	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	524,519.70	
		HCP INC	27,005.00	1,122,057.75	
		HEALTH CARE REIT INC	16,770.00	1,059,528.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,285.00	771,338.70	
		KIMCO REALTY CORP	25,608.00	521,634.96	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	299,863.90	
		MACERICH CO/THE	8,322.00	476,517.72	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,175.00	478,937.25	
		PROLOGIS INC	29,539.00	1,131,343.70	
PUBLIC STORAGE	8,695.00	1,413,720.05			

	RAYONIER INC	7,845.00	437,751.00	
	REALTY INCOME CORP	11,551.00	465,043.26	
	REGENCY CENTERS CORP	5,612.00	272,013.64	
	SIMON PROPERTY GROUP	18,050.00	2,709,305.00	
	SL GREEN REALTY CORP	5,669.00	502,216.71	
	UDR INC	16,000.00	383,840.00	
	VENTAS INC	17,389.00	1,089,594.74	
	VORNADO REALTY TRUST	10,010.00	844,944.10	
アメリカドル小計		472,424.00	21,912,741.53 (2,141,970,484)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	159,666.65	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	231,764.52	
カナダドル小計		17,018.00	391,431.17 (37,119,417)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	254,872.02	
	DEXUS PROPERTY GROUP	289,071.00	291,961.71	
	FEDERATION CENTRES	89,917.00	204,111.59	
	GOODMAN GROUP	102,048.00	503,096.64	
	GPT GROUP	105,353.00	370,842.56	
	MIRVAC GROUP	215,406.00	381,268.62	
	STOCKLAND	131,200.00	511,680.00	
	WESTFIELD GROUP	121,352.00	1,326,377.36	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	185,818.00	559,312.18	
オーストラリアドル小計		1,366,967.00	4,403,522.68 (400,148,105)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	54,509.00	319,422.74	
	HAMMERSON PLC	45,117.00	229,419.94	
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	130,586.58	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	47,061.00	436,020.16	
	SEGRO PLC	46,969.00	146,120.55	
イギリスポンド小計		233,886.00	1,261,569.97 (199,441,596)	
香港ドル	LINK REIT	136,000.00	5,154,400.00	
香港ドル小計		136,000.00	5,154,400.00 (64,996,984)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	259,740.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	162,800.00	
	CAPITAMALL TRUST	149,000.00	295,765.00	
シンガポールドル小計		370,000.00	718,305.00 (55,869,762)	
ユーロ	CORIO NV	4,573.00	147,182.00	

	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	101,166.15	
	GECINA SA	1,389.00	130,163.19	
	ICADE	2,102.00	142,746.82	
	KLEPIERRE	6,313.00	200,469.31	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,696.00	1,048,064.00	
	ユーロ小計	21,722.00	1,769,791.47 (233,382,401)	
	投資証券合計		3,132,928,749 (3,132,928,749)	
	合計		3,229,833,317 (3,229,833,317)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率	
アメリカドル	株式	573銘柄	97.6%	57.5%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	28銘柄	2.3%	1.4%
カナダドル	株式	92銘柄	99.5%	4.6%
	投資証券	2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式	56銘柄	92.1%	3.4%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.0%	0.0%
	投資証券	9銘柄	6.9%	0.3%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.7%	10.0%
	投資証券	5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	4.2%
香港ドル	株式	39銘柄	96.4%	1.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.6%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	26銘柄	95.0%	0.7%
	投資証券	3銘柄	5.0%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	226銘柄	98.9%	13.5%
	投資証券	6銘柄	1.1%	0.2%

(注)組入時価比率は、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。

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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。

不動産等明細表
該当事項はありません。

商品明細表
該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

借入金明細表
該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 9月30日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	164,456,153
コール・ローン	3,519,815,989
国債証券	223,073,596,062
派生商品評価勘定	17,325,267
未収入金	576,780
未収利息	2,402,608,120
前払費用	105,270,254
差入委託証拠金	31,525,234
流動資産合計	229,315,173,859
資産合計	229,315,173,859
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,305,685
未払金	6,125,320
未払解約金	640,354,680
流動負債合計	671,785,685
負債合計	671,785,685
純資産の部	
元本等	
元本	99,697,021,945
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	128,946,366,229
元本等合計	228,643,388,174
純資産合計	228,643,388,174
負債純資産合計	229,315,173,859

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成25年 9月30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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 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>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 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25年 9月30日現在
1. 計算期間の期首元本額	111,040,348,401円
計算期間中の追加設定元本額	18,932,730,086円
計算期間中の一部解約元本額	30,276,056,542円
計算日の元本額	99,697,021,945円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	5,138,121,705円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	262,755,869円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,086,025,135円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,623,881,421円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	581,835,722円
SBI資産設計オープン(分配型)	10,095,321円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,466,906,479円
世界経済インデックスファンド	472,694,311円
マイセレクション25	14,636,772円
マイセレクション50	8,544,974円
マイセレクション75	6,441,115円
DCマイセレクション25	991,110,212円
DCマイセレクション50	930,634,773円
DCマイセレクション75	594,034,874円
DC外国債券インデックス・オープン	1,165,804,528円
DCマイセレクションS25	341,968,294円
DCマイセレクションS50	298,638,185円
DCマイセレクションS75	130,833,246円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,550,691円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	37,572,806円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	26,394,542円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	9,233,311円
DC世界経済インデックスファンド	336,150,192円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	10,538,359,304円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	7,156,401,286円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,955,842円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,445,303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)	371,992,630円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,135,019,703円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,862,370,770円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	20,200,993,678円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,374,333,444円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,105,859,599円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,247,950,352円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,200,511,358円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,202,921,375円

世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,560,092,544円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,346,143,430円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,377,078,145円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	519,541,714円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	709,439,837円
F0Fs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,680,173,278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)	852,476,888円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	335,520,490円
外国債券ファンド・シリーズ1	528,622,200円
コア投資戦略ファンド(安定型)	751,987,261円
コア投資戦略ファンド(成長型)	767,230,807円
分散投資コア戦略ファンドA	23,860,424円
分散投資コア戦略ファンドS	25,370,149円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
F0Fs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)	1,250,268,857円
2. 計算日における受益権総数	99,697,021,945口
3. 1口当たり純資産額	2.2934円
(1万口当たり純資産額)	(22,934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25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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、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	<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コンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
-------------------	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成25年 9月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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) 国債証券 「(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>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25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	4,933,223,537	
合計	4,933,223,537	

(注) 当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」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年9月30日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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	2,479,700,559	-	2,496,612,506	16,911,947
合計		2,479,700,559	-	2,496,612,506	16,911,947

(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。

通貨関連

区分	種類	平成25年 9月30日現在			
		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				
	アメリカドル	1,614,612,580	-	1,598,862,800	15,749,780
	カナダドル	146,405,040	-	145,013,400	1,391,640
	イギリスポンド	320,616,170	-	320,821,200	205,030
	ユーロ	1,691,680,475	-	1,683,724,500	7,955,975
	計	3,773,314,265	-	3,748,421,900	24,892,365
合計		3,773,314,265	-	3,748,421,900	24,892,365

(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。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 9月30日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年9月30日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

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% 01/15/15	10,000,000.00	10,009,570.30	
		T 0.25% 02/15/15	5,700,000.00	5,704,007.84	
		T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,894,179.62	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,988,515.66	
		T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,983,906.24	
		T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	10,010,937.50	
		T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,790,906.25	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,523,359.37	
		T 0.375% 06/15/15	20,200,000.00	20,233,140.72	
		T 0.375% 06/30/15	39,000,000.00	39,060,937.50	
		T 0.375% 11/15/14	4,000,000.00	4,010,468.76	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,316,105.50	
		T 0.625% 11/30/17	4,000,000.00	3,916,484.36	
		T 0.75% 02/28/18	13,100,000.00	12,838,255.84	
		T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,337,255.85	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,238,585.98	
		T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,825,585.90	
		T 0.875% 01/31/18	3,400,000.00	3,354,179.69	
		T 0.875% 02/28/17	20,600,000.00	20,621,726.61	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,406,152.34	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,670,058.56	
		T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,979,771.51	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,830,703.12	
		T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,006,410.17	
		T 1.125% 12/31/19	8,700,000.00	8,337,386.69	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	888,240.23	
		T 1.25% 02/29/20	10,000,000.00	9,619,921.90	
		T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,650,294.92	
		T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,363,390.63	
		T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,664,402.35	
		T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,204,898.43	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,895,048.83	
		T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,393,464.94	
T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	1,989,375.00			
T 1.5% 03/31/19	9,800,000.00	9,764,398.46			

T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,408,003.91	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,189,394.52	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	7,864,160.13	
T 1.75% 05/15/22	10,000,000.00	9,466,796.90	
T 1.75% 05/15/23	4,800,000.00	4,444,406.25	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,394,921.95	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,461,273.50	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,172,273.44	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,116,011.68	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,094,453.14	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,577,294.92	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,678,203.12	
T 2% 02/15/22	9,200,000.00	8,938,015.64	
T 2% 02/15/23	11,500,000.00	10,944,990.22	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,210,156.27	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,344,593.74	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,046,029.27	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	12,889,898.40	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,548,921.90	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,993,476.56	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,090,898.44	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,787,250.04	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,446,593.77	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,196,796.88	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	576,812.50	
T 2.375% 08/31/14	8,300,000.00	8,471,998.07	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,145,312.50	
T 2.5% 03/31/15	20,700,000.00	21,404,285.20	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,052,402.34	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,377,810.56	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,302,539.05	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,737,187.50	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,314,843.76	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,659,065.44	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	638,132.81	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,053,976.57	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,527,812.48	
T 2.75% 08/15/42	9,200,000.00	7,636,898.47	
T 2.75% 11/15/42	7,000,000.00	5,802,070.32	
T 2.75% 11/30/16	10,200,000.00	10,842,878.86	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,179,474.62	
T 2.875% 05/15/43	3,900,000.00	3,314,847.66	

T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,194,687.50	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	7,019,843.76	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,294,896.51	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,768,242.20	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,012,001.94	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	13,863,750.01	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,661,269.51	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,980,644.51	
T 3.125% 11/15/41	7,000,000.00	6,319,960.92	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,796,140.65	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,687,011.72	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,779,316.41	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,333,726.57	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,260,537.08	
T 3.5% 02/15/39	4,500,000.00	4,420,986.34	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,718,914.06	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,741,289.08	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,327,019.54	
T 3.75% 08/15/41	5,900,000.00	6,005,324.20	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,576,855.45	
T 3.875% 08/15/40	7,000,000.00	7,305,429.67	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,574,765.61	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,719,912.09	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,120,712.89	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	667,312.50	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,419,677.75	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,054,470.73	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,185,781.25	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,550,488.30	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,587,250.00	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,552,503.89	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,263,867.18	
T 4.375% 11/15/39	4,300,000.00	4,875,544.93	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	2,891,699.22	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,051,222.64	
T 4.5% 05/15/38	1,500,000.00	1,732,470.70	
T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,353,125.00	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,370,947.25	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,632,714.85	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,354,574.22	
T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	1,794,550.78	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,485,783.20	

	T 5.0% 05/15/37	500,000.00	618,583.98	
	T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,378,718.76	
	T 5.25% 02/15/29	800,000.00	999,937.50	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,625,101.56	
	T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,061,312.51	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,535,648.43	
	T 6.0% 02/15/26	1,900,000.00	2,511,970.69	
	T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	2,996,436.31	
	T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,610,335.93	
	T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,572,068.35	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,469,187.50	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,620,042.97	
	T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,629,238.27	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,432,328.12	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,866,910.15	
	アメリカドル小計	885,500,000.00	910,900,234.51 (89,040,497,923)	
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,734.00	
	CAN 1% 11/01/15	200,000.00	199,180.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	2,300,000.00	2,246,582.50	
	CAN 1.25% 09/01/18	550,000.00	533,997.75	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,900,000.00	1,729,522.50	
	CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	893,884.50	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,424,885.00	
	CAN 2% 12/01/14	4,500,000.00	4,548,690.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,066,735.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	900,000.00	887,166.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,045,900.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,200,000.00	2,283,424.00	
	CAN 3% 12/01/15	2,900,000.00	3,008,808.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,900,000.00	2,026,340.50	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,250,000.00	2,434,320.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,900,000.00	2,059,552.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,050,000.00	3,332,399.50	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,300,618.25	
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,607,240.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,600,000.00	3,045,211.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,939,393.75	
	CAN 4.5% 06/01/15	6,700,000.00	7,070,208.50	
	CAN 5% 06/01/37	2,150,000.00	2,846,901.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,700,000.00	2,306,866.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,200,000.00	3,086,820.00	

	CAN 8.0% 06/01/27	800,000.00	1,272,640.00	
	カナダドル小計	54,500,000.00	59,397,020.25 (5,632,619,430)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,450,000.00	1,305,522.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	650,000.00	604,552.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,150,000.00	1,011,275.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,360,443.50	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,072,579.00	
	ACGB 4.5% 10/21/14	2,050,000.00	2,094,372.25	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,700,000.00	1,801,209.50	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,750,000.00	2,895,200.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,200,000.00	1,251,540.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,500,000.00	2,746,025.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,300,000.00	3,623,086.50	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,800,000.00	3,173,940.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,450,000.00	2,793,159.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,350,000.00	2,697,976.25	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,521,520.00	
ACGB 6.25% 04/15/15	2,900,000.00	3,065,314.50		
	オーストラリアドル小計	34,650,000.00	37,017,715.25 (3,363,799,784)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	6,550,000.00	6,499,139.25	
	UKT 1.25% 07/22/18	1,000,000.00	987,545.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	820,776.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,750,000.00	3,516,168.75	
	UKT 2% 01/22/16	3,650,000.00	3,765,613.75	
	UKT 2.25% 09/07/23	700,000.00	671,671.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	2,750,000.00	2,834,672.50	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,850,000.00	1,746,205.75	
	UKT 3.5% 07/22/68	800,000.00	796,996.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,800,000.00	1,886,166.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,443,278.50	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,333,270.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,000,000.00	3,324,240.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,900,000.00	2,120,495.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	2,869,017.75	
	UKT 4% 09/07/16	4,800,000.00	5,250,432.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,700,000.00	3,060,220.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	3,737,332.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,156,927.50	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,000,000.00	2,269,310.00	
UKT 4.25% 12/07/40	2,500,000.00	2,837,850.00		

	UKT 4.25% 12/07/46	2,750,000.00	3,142,342.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	2,877,400.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,500,000.00	2,917,837.50	
	UKT 4.5% 03/07/19	1,850,000.00	2,123,559.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,900,000.00	3,393,290.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,300,000.00	3,910,912.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,400,000.00	3,985,871.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,500,000.00	2,708,350.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,119,506.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,700,000.00	3,303,895.50	
	UKT 5% 03/07/18	3,150,000.00	3,647,794.50	
	UKT 5% 03/07/25	2,900,000.00	3,520,034.50	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,100,000.00	5,320,422.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,760,000.00	2,379,097.60	
	UKT 8% 06/07/21	2,300,000.00	3,245,530.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,195,000.00	2,555,342.17	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,933,387.50	
	イギリスポンド小計	100,305,000.00	112,011,900.52 (17,707,961,353)	
スイスフラン	SWISS 3% 01/08/18	3,650,000.00	4,087,890.50	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	851,788.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,050,000.00	2,593,485.75	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	401,181.00	
	スイスフラン小計	6,800,000.00	7,934,345.25 (856,909,287)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	800,000.00	799,548.00	
	SIGB 0.5% 04/01/18	500,000.00	490,502.50	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	610,407.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	700,000.00	708,207.50	
	SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	688,811.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	550,000.00	579,920.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	418,680.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,305,550.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	400,000.00	393,898.00	
	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	363,993.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,050,000.00	1,130,818.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	650,055.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,000,000.00	1,073,435.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	876,444.00	
SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	851,193.75		
	シンガポールドル小計	10,450,000.00	10,941,463.75 (851,027,050)	

マレーシアリンギット	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	696,461.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	300,000.00	300,208.50	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,533,769.25	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	391,092.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,276,444.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,350,000.00	1,335,852.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,070,409.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,000,000.00	2,000,160.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,600,000.00	4,640,963.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,112,204.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	800,000.00	811,028.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,000,000.00	972,695.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	687,410.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,832,060.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,724,836.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,100,000.00	5,224,210.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,636,342.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	650,000.00	673,218.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,338,824.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,200,000.00	1,334,382.00	
マレーシアリンギット小計		36,150,000.00	36,592,570.75 (1,097,045,271)	
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,700,000.00	8,892,184.00	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	7,947,092.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	6,900,000.00	7,407,219.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	9,178,008.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,050,000.00	11,960,962.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,800,000.00	13,266,504.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	8,600,000.00	9,132,942.00	
	SGB 5% 12/01/20	10,750,000.00	12,799,595.00	
スウェーデンクローナ小計		74,800,000.00	80,584,506.00 (1,224,078,646)	
ノルウェークローネ	NGB 2% 05/24/23	5,100,000.00	4,734,993.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,300,000.00	8,913,702.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,000,000.00	9,706,590.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,850,000.00	8,714,677.50	
	NGB 5% 05/15/15	12,100,000.00	12,742,026.00	
ノルウェークローネ小計		42,350,000.00	44,811,988.50 (729,987,292)	
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	5,200,000.00	4,988,282.00	
	DGB 2% 11/15/14	9,050,000.00	9,245,932.50	
	DGB 2.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,192,570.00	

	DGB 3% 11/15/21	14,250,000.00	15,797,336.25	
	DGB 4% 11/15/15	14,650,000.00	15,814,015.75	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,122,951.00	
	DGB 4% 11/15/19	14,100,000.00	16,466,826.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	18,550,000.00	25,251,094.75	
	DGB 7% 11/10/24	4,300,000.00	6,510,092.50	
	デンマーククローネ小計	92,900,000.00	108,389,100.75 (1,916,319,301)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	7,500,000.00	9,968,625.00	
	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,703,810.00	
	MBONO 6% 06/18/15	75,550,000.00	78,336,661.75	
	MBONO 6.5% 06/10/21	7,500,000.00	7,890,750.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,535,122.00	
	MBONO 8% 06/11/20	30,700,000.00	35,040,366.00	
	MBONO 8% 12/07/23	27,100,000.00	31,098,198.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	51,750,000.00	60,764,591.25	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	37,362,592.50	
	メキシコペソ小計	273,150,000.00	303,700,717.00 (2,247,385,305)	
ポーランドズロチ	POLGB 3.75% 04/25/18	4,400,000.00	4,407,700.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,700,000.00	2,612,358.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,185,995.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,200,000.00	5,406,388.00	
	POLGB 5% 04/25/16	2,300,000.00	2,394,426.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	5,939,920.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,406,368.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	3,500,000.00	3,632,737.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,800,000.00	5,180,856.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,650,000.00	1,835,946.75	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,200,000.00	5,720,104.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,073,490.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	9,200,000.00	9,760,050.00	
	ポーランドズロチ小計	52,650,000.00	55,556,339.75 (1,735,580,053)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,700,000.00	24,923,007.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,000,000.00	9,074,360.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,950,000.00	9,026,850.75	
	SAGB 6.5% 02/28/41	10,200,000.00	7,675,296.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	13,486,970.00	
	SAGB 7% 02/28/31	10,350,000.00	8,889,201.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	14,500,000.00	14,473,827.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	4,300,000.00	4,330,874.00	

	SAGB 8% 12/21/18	12,700,000.00	13,243,941.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	13,150,000.00	13,793,035.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	4,400,000.00	4,294,510.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	6,000,000.00	6,242,640.00	
	南アフリカランド小計	130,250,000.00	129,454,512.25 (1,247,941,498)	
ユーロ	BGB 3% 09/28/19	850,000.00	913,112.50	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,100,000.00	3,332,779.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,047,625.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,250,000.00	2,400,918.75	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,950,000.00	4,419,279.75	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,581,175.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,503,186.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,300,000.00	1,408,348.50	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,950,000.00	3,263,496.50	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,100,000.00	2,372,506.50	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,000,000.00	2,234,050.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,600,212.50	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,382,592.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,100,000.00	3,554,894.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,400,000.00	1,628,480.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	3,569,987.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,650,000.00	3,384,646.25	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	1,934,971.50	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,504,116.00	
	BTNS 1% 07/25/17	1,800,000.00	1,809,882.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,654,840.00	
	BTNS 2% 07/12/15	1,500,000.00	1,545,675.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,340,912.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,454,786.50	
	BTNS 2.5% 07/25/16	5,500,000.00	5,801,922.50	
	BTPS 2.75% 12/01/15	1,600,000.00	1,624,752.00	
	BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,876,836.00	
	BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	4,998,441.00	
	BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,859,262.00	
	BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	813,364.00	
	BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,594,943.00	
	BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,285,206.00	
	BTPS 3.75% 08/01/15	8,250,000.00	8,524,477.50	
	BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000.00	6,537,825.00	
	BTPS 3.75% 08/01/21	5,400,000.00	5,384,394.00	
	BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,418,634.00	

BTPS 4% 02/01/37	4,000,000.00	3,557,540.00	
BTPS 4% 09/01/20	5,300,000.00	5,378,917.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,537,006.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	3,947,231.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,036,700.50	
BTPS 4.25% 09/01/19	1,850,000.00	1,917,155.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	5,050,000.00	5,332,648.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,350,000.00	6,624,193.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,564,215.75	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	2,692,224.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,150,000.00	3,182,067.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000.00	7,276,774.50	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,141,839.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,300,000.00	4,459,960.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,199,560.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	900,000.00	851,697.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,182,050.75	
BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,117,660.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,400,000.00	3,530,169.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,513,037.50	
BTPS 5% 09/01/40	3,350,000.00	3,326,935.25	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,200,000.00	3,199,760.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,050,000.00	4,382,464.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,500,000.00	5,730,092.50	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,276,652.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	4,441,325.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	2,849,873.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,000,000.00	5,615,000.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,800,000.00	4,453,296.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,373,860.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,092,168.00	
DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,545,244.00	
DBR 1.5% 05/15/23	2,100,000.00	2,058,021.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,881,744.50	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,477,616.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,716,636.00	
DBR 2.25% 09/04/20	1,400,000.00	1,504,489.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,400,000.00	3,633,461.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,700,000.00	2,941,474.50	
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	1,764,261.00	
DBR 3% 07/04/20	3,600,000.00	4,051,134.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,095,252.00	

DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000.00	9,280,040.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,433,230.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,499,200.00	
DBR 3.5% 01/04/16	4,600,000.00	4,943,482.00	
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	4,014,185.00	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,667,453.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,300,000.00	7,000,560.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	4,035,412.50	
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,969,468.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,157,517.50	
DBR 4.0% 01/04/37	3,600,000.00	4,487,112.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,654,160.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,847,490.50	
DBR 4.25% 07/04/39	2,350,000.00	3,083,799.25	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,618,940.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,150,000.00	4,265,887.50	
DBR 4.75% 07/04/40	2,700,000.00	3,824,415.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,650,000.00	3,786,876.50	
DBR 5.625% 01/04/28	1,900,000.00	2,686,533.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	646,769.20	
DBR 6.25% 01/04/24	1,900,000.00	2,700,004.50	
DBR 6.25% 01/04/30	1,500,000.00	2,280,615.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,576,613.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	1,400,000.00	1,396,248.00	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,492,362.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	1,100,000.00	1,044,818.50	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,500,000.00	5,514,465.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,200,000.00	4,425,099.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	1,700,000.00	1,667,113.50	
FRTR 3% 04/25/22	6,200,000.00	6,642,401.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,275,475.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	5,050,000.00	5,409,787.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,551,969.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,299,068.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,275,416.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,300,000.00	5,712,446.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,739,768.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,450,000.00	7,324,910.25	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,800,000.00	5,447,496.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,800,000.00	5,436,456.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	2,650,836.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,350,000.00	1,494,274.50	

FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,849,461.50	
FRTR 4% 10/25/38	4,500,000.00	4,990,657.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,700,000.00	7,758,533.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,400,000.00	6,121,737.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,000,000.00	4,607,520.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,900,000.00	6,859,723.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,370,564.75	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,300,000.00	4,059,676.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,668,475.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,700,000.00	4,847,462.50	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,900,000.00	5,352,262.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,218,916.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,532,670.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,581,944.00	
IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	801,276.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,500,000.00	1,594,252.50	
IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	736,505.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,600,000.00	3,793,824.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	861,784.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,147,300.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,137,482.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	556,655.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,000,000.00	1,136,885.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	1,600,000.00	1,613,032.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,950,000.00	1,974,784.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	600,000.00	600,993.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,900,000.00	1,829,054.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,044,090.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,226,756.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,500,000.00	1,445,827.50	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,446,130.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,150,000.00	4,371,859.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,550,000.00	2,821,626.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,550,000.00	2,869,540.50	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,900,000.00	2,172,916.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,100,000.00	2,493,613.50	
NETHER 4% 01/15/37	2,150,000.00	2,603,112.50	
NETHER 4% 07/15/16	3,500,000.00	3,841,337.50	
NETHER 4% 07/15/19	2,150,000.00	2,472,145.25	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,899,987.50	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,850,000.00	3,243,670.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	2,835,157.50	

NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	803,599.50	
OBL 0.5% 02/23/18	3,000,000.00	2,984,685.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,407,176.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,037,530.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	514,337.50	
OBL 1.75% 10/09/15	2,000,000.00	2,063,980.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,612,577.50	
OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000.00	7,026,746.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,893,347.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,359,038.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	500,000.00	523,987.50	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,084,335.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	900,000.00	930,663.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,150,000.00	1,280,944.75	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,650,000.00	2,804,124.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,601,488.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	600,000.00	680,751.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	609,472.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,700,000.00	3,104,298.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,500,000.00	2,754,000.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,900,000.00	2,317,458.50	
RAGB 4.3% 09/15/17	500,000.00	567,457.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,000,000.00	2,329,490.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	2,800,000.00	3,239,306.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,400,000.00	1,764,070.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,300,000.00	1,860,644.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	572,826.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	780,732.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	622,077.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	439,098.75	
RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	664,703.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,150,000.00	1,183,206.25	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,050,000.00	1,177,958.25	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	452,032.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,400,000.00	1,568,679.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,250,000.00	1,467,606.25	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,499,904.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,057,315.50	
SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,837,926.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	6,253,384.50	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,600,000.00	1,644,912.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	1,800,000.00	1,850,157.00	

SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,145,559.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	400,000.00	414,702.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	2,950,000.00	3,071,466.25	
SPGB 4% 04/30/20	3,750,000.00	3,815,737.50	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,727,632.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,620,326.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,600,000.00	2,299,973.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	4,000,000.00	4,218,900.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,498,256.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000.00	7,697,332.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,235,754.50	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,000,000.00	3,186,885.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,900,000.00	2,934,901.50	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,886,970.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	3,500,000.00	3,618,615.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	3,350,000.00	3,564,148.75	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,000,000.00	1,946,840.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	450,000.00	464,478.75	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,750,000.00	2,978,800.00	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,757,782.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	4,184,142.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,550,000.00	2,820,924.75	
SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,186,870.00	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,456,169.00	
SPGB 6.0% 01/31/29	2,650,000.00	2,981,448.75	
ユーロ小計	663,180,000.00	723,609,948.20 (95,422,443,869)	
国債証券合計		223,073,596,062 (223,073,596,062)	
合計		223,073,596,062 (223,073,596,062)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 134銘柄	100.0%	39.9%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.5%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.0%	1.5%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	7.9%

スイスフラン	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
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%	0.9%
メキシコペソ	国債証券	9銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券	229銘柄	100.0%	42.8%

(注)組入時価比率は、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。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第12期(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は平成24年10月 2日から平成25年 9月30日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
1. 期首元本額	17,477,796,006円	18,946,913,975円
期中追加設定元本額	2,819,375,711円	3,425,315,153円
期中一部解約元本額	1,350,257,742円	3,238,964,390円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	18,946,913,975口	19,133,264,738口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0260円 (10,260円)	1.4959円 (14,959円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第11期 自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日	第12期 自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日
費用控除後の配当等収益額	A	286,568円 (432,492,322円)	368,434円 (506,870,214円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	4,422,775,524円
収益調整金額	C	7,083,806,817円	7,314,850,661円
分配準備積立金額	D	979,391,864円	827,966,576円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,063,485,249円	12,565,961,195円
当ファンドの期末残存口数	F	18,946,913,975口	19,133,264,738口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	4,255.83円	6,567.59円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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金融商品に係るリスク	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、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、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コンプライアンス会議に報告します。 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

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第11期 (平成24年10月 1日現在)	第12期 (平成25年 9月30日現在)
	計算期間(自 平成23年10月1日 至 平成24年10月 1日)の損益に含ま れた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年10月 2日 至 平成25年 9月30日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	952,182,954	8,198,615,383
合計	952,182,954	8,198,615,383

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	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	14,799,139,344	14,460,239,053	
	国内債券インデックス マザーファンド	3,727,562,832	4,746,305,753	
	外国株式インデックス マザーファンド	5,049,073,751	7,272,685,830	
	外国債券インデックス マザーファンド	594,034,874	1,362,359,580	
親投資信託受益証券 小計		24,169,810,801	27,841,590,216	
合計		24,169,810,801	27,841,590,216	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

- (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13期中間計算期間(平成25年10月1日から平成26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75】 中間財務諸表

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

第13期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	793,832,223
親投資信託受益証券	29,546,226,482
未収入金	3,720,000
未収利息	643
流動資産合計	30,343,779,348
資産合計	30,343,779,348
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,427,754
未払受託者報酬	4,686,197
未払委託者報酬	45,299,909
その他未払費用	774,891
流動負債合計	64,188,751
負債合計	64,188,751
純資産の部	
元本等	
元本	19,241,458,525
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,038,132,072
（分配準備積立金）	4,891,093,981
元本等合計	30,279,590,597
純資産合計	30,279,590,597
負債純資産合計	30,343,779,348

(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)
営業収益	
受取利息	205,728
有価証券売買等損益	1,531,646,266
営業収益合計	1,531,851,994
営業費用	
受託者報酬	4,686,197
委託者報酬	45,299,909
その他費用	774,891
営業費用合計	50,760,997
営業利益又は営業損失()	1,481,090,997
経常利益又は経常損失()	1,481,090,997
中間純利益又は中間純損失()	1,481,090,997
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()	79,823,590
期首剰余金又は期首欠損金()	9,487,277,049
剰余金増加額又は欠損金減少額	827,038,509
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	827,038,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	677,450,893
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	677,450,893
中間剰余金又は中間欠損金()	11,038,132,072

(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期中間計算期間 (平成26年 3月31日現在)
1. 期首元本額	19,133,264,738円
期中追加設定元本額	1,468,786,642円
期中一部解約元本額	1,360,592,855円
2. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	19,241,458,525口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5737円 (15,737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

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(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75」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26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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,283,346,327
株式	138,851,990,500
派生商品評価勘定	71,840,300
未収入金	17,174,000
未収配当金	1,343,627,254
未収利息	1,850
差入委託証拠金	125,475,000
流動資産合計	142,693,455,231
資産合計	142,693,455,231
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,425,000
前受金	31,362,000
未払金	726,470,430
未払解約金	226,685,489
流動負債合計	989,942,919
負債合計	989,942,919
純資産の部	
元本等	
元本	142,374,924,908
剰余金	
剰余金又は欠損金()	671,412,596
元本等合計	141,703,512,312
純資産合計	141,703,512,312
負債純資産合計	142,693,455,231

(2)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 3月31日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 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 原則として、株式の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の計上基準 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 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額 中間計算期間中の追加設定元本額 中間計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	149,271,308,678円 15,766,906,582円 22,663,290,352円 142,374,924,908円
<p>計算日の元本額の内訳</p> <p>グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)</p> <p>SBI資産設計オープン(資産成長型)</p> <p>SBI資産設計オープン(分配型)</p> <p>SMT TOPIXインデックス・オープン</p> <p>世界経済インデックスファンド</p> <p>マイセクション25</p> <p>マイセクション50</p> <p>マイセクション75</p> <p>日本株式インデックス・オープン</p> <p>DCマイセクション25</p> <p>DCマイセクション50</p> <p>DCマイセクション75</p> <p>DC日本株式インデックス・オープン</p> <p>DCマイセクションS25</p> <p>DCマイセクションS50</p>	<p>1,942,613,461円</p> <p>1,738,394,963円</p> <p>20,902,852円</p> <p>6,162,162,435円</p> <p>289,040,727円</p> <p>64,108,253円</p> <p>102,247,911円</p> <p>114,082,921円</p> <p>16,845,767,969円</p> <p>5,017,556,915円</p> <p>16,367,388,900円</p> <p>15,220,349,582円</p> <p>4,060,053,028円</p> <p>1,785,961,287円</p> <p>5,604,384,601円</p>

DCマイセレクションS75	3,678,608,008円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,822,107,647円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	12,502,448円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	444,298,151円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	457,098,594円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	219,521,967円
DC世界経済インデックスファンド	257,297,285円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	385,840,993円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	144,151,973円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	303,888,129円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	167,410,361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)	1,782,224,664円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24,393,202円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	890,092,629円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,221,049,503円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,216,559,941円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,592,570,374円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,891,121,251円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,756,657,218円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,552,950,570円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,858,681,426円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2,511,494,684円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,053,826,389円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,392,859,209円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,132,069,270円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,498,218,851円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	120,150,550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)	3,685,782,326円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,426,806,742円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,437,745円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,234,053円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,900,522円
2. 計算日における受益権総数	142,374,924,908口
3. 「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55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 671,412,596円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9953円 (9,953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26年 3月31日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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	2,784,694,700	-	2,851,110,000	66,415,300
	合計	2,784,694,700	-	2,851,110,000	66,415,300

(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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在

該当事項はありません。

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,876,987,631
国債証券	197,134,324,000
地方債証券	15,546,801,392
特殊債券	22,007,323,071
社債券	14,375,186,050
未収入金	1,978,820,500
未収利息	420,392,221
前払費用	16,515,789
流動資産合計	253,356,350,654
資産合計	253,356,350,654
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	621,260
未払金	2,973,410,860
未払解約金	211,519,360
流動負債合計	3,185,551,480
負債合計	3,185,551,480
純資産の部	
元本等	
元本	194,621,810,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,548,988,751
元本等合計	250,170,799,174
純資産合計	250,170,799,174
負債純資産合計	253,356,350,654

(2)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 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、特殊債券及び社債券 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>
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、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>派生商品取引等損益の計上基準 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 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	201,273,995,644円
中間計算期間中の追加設定元本額	45,336,397,374円
中間計算期間中の一部解約元本額	51,988,582,595円
計算日の元本額	194,621,810,423円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,045,171,289円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,918,632円
SMT 国内債券インデックス・オープン	4,071,867,969円
世界経済インデックスファンド	149,320,950円
マイセレクション25	151,201,006円
マイセレクション50	90,499,776円
マイセレクション75	30,331,309円
DCマイセレクション25	11,773,566,711円
DCマイセレクション50	14,469,195,286円
DCマイセレクション75	3,994,085,347円
DC日本債券インデックス・オープン	390,935,475円
DC日本債券インデックス・オープンス	47,626,450,226円
DC日本債券インデックス・オープンP	15,985,027,091円
DCマイセレクションS25	4,167,316,488円
DCマイセレクションS50	4,836,593,727円
DCマイセレクションS75	912,555,750円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	28,540,709円

DCターゲット・イヤー ファンド2025	907,777,083円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	471,852,623円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	111,653,461円
DC世界経済インデックスファンド	145,214,611円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	971,930,152円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	38,593,415円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	272,629,666円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,689,514円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,471,999円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,471,062,386円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,107,962,367円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,631,575,311円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	563,299,344円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	16,543,438,899円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,860,413,889円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,468,306,403円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,661,545,830円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,285,873,961円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,441,939,562円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,346,819,213円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,717,900,799円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,639,325,948円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	263,112,920円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,983,779,913円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,762,454,701円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,488,747,239円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,063,569,483円
分散投資コア戦略ファンドA	183,925,283円
分散投資コア戦略ファンドS	132,291,866円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
国内債券SMTBセクション(SMA専用)	15,163,150,071円
コア投資戦略ファンド(切替型)	118,482,364円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	7,218,471円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	6,918,855円

2. 担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 105,787,000円

	なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。
3. 計算日における受益権総数	194,621,810,423口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2854円 (12,854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26年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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	579,101,260	-	578,480,000	621,260
合計		579,101,260	-	578,480,000	621,260

(注)1. 時価の算定方法

債券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. 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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在
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」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,130,433,921
コール・ローン	571,576,854
株式	157,870,911,615
投資信託受益証券	110,090,462
投資証券	3,282,576,065
派生商品評価勘定	21,619,798
未収入金	9,272,097
未収配当金	329,040,020
未収利息	463
差入委託証拠金	887,999,830
流動資産合計	165,213,521,125
資産合計	165,213,521,125
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,974,571
未払解約金	268,975,817
流動負債合計	274,950,388
負債合計	274,950,388
純資産の部	
元本等	
元本	99,368,029,056
剰余金	
剰余金又は欠損金()	65,570,541,681
元本等合計	164,938,570,737

純資産合計	164,938,570,737
負債純資産合計	165,213,521,125

(2)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 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)投資信託受益証券及び投資証券 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)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上
基準
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 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	110,876,572,872円
中間計算期間中の追加設定元本額	9,285,648,380円
中間計算期間中の一部解約元本額	20,794,192,196円
計算日の元本額	99,368,029,056円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,112,719,223円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,608,821円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	18,394,437,537円
世界経済インデックスファンド	935,023,188円
マイセレクション25	10,891,846円
マイセレクション50	27,602,927円
マイセレクション75	34,218,668円
外国株式インデックス・オープン	1,071,959,221円
DCマイセレクション25	856,088,384円
DCマイセレクション50	4,483,386,507円
DCマイセレクション75	4,671,766,548円
DC外国株式インデックス・オープン	5,586,982,611円
DCマイセレクションS25	310,256,041円
DCマイセレクションS50	1,530,567,445円
DCマイセレクションS75	1,053,858,507円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	3,763,114円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	133,438,469円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	137,274,828円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	65,931,716円
DC世界経済インデックスファンド	863,652,647円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	12,862,205,531円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	84,239,176円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	52,618,553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)	268,943,763円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	562,333,638円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,966,745,014円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,775,026,585円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,573,916,694円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,951,018,911円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	965,240,603円

バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,046,460,133円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	8,767,332,892円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,618,196,732円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	960,484,972円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,032,646,572円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	331,009,512円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,690,953,929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)	4,875,462,729円
外国株式ファンド・シリーズ1	653,357,249円
コア投資戦略ファンド(安定型)	877,013,494円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,607,006,509円
分散投資コア戦略ファンドA	65,828,314円
分散投資コア戦略ファンドS	196,643,884円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	176,605,903円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	98,723,009円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,193,368円
2. 計算日における受益権総数	99,368,029,056口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6599円 (16,599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26年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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>
------------------------	---

(有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
株式関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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	3,709,629,909	-	3,722,678,051	13,048,142
	合計	3,709,629,909	-	3,722,678,051	13,048,142

(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。

通貨関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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				
	アメリカドル	205,345,455	-	206,849,100	1,503,645
	カナダドル	9,184,700	-	9,316,000	131,300
	オーストラリアドル	9,478,320	-	9,517,000	38,680
	イギリスポンド	32,178,620	-	32,547,000	368,380
	スイスフラン	8,129,730	-	8,129,100	630
	香港ドル	13,148,900	-	13,270,000	121,100
	ユーロ	56,221,390	-	56,656,000	434,610
	計	333,687,115	-	336,284,200	2,597,085
	合計	333,687,115	-	336,284,200	2,597,085

(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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在
該当事項はありません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 3月31日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	155,098,580
コール・ローン	1,041,009,620
国債証券	218,073,800,346
派生商品評価勘定	2,650,090
未収入金	7,648,816
未収利息	2,208,923,479
前払費用	106,939,448
差入委託証拠金	52,301,427
流動資産合計	221,648,371,806
資産合計	221,648,371,806
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	387,876
未払金	4,034,765
未払解約金	531,327,393
流動負債合計	535,750,034
負債合計	535,750,034
純資産の部	
元本等	
元本	88,294,862,045
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,817,759,727
元本等合計	221,112,621,772
純資産合計	221,112,621,772

負債純資産合計	221,648,371,806
---------	-----------------

(2)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 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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)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。 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>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 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 3月31日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	99,697,021,945円
中間計算期間中の追加設定元本額	14,846,423,239円
中間計算期間中の一部解約元本額	26,248,583,139円
計算日の元本額	88,294,862,045円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,256,542,714円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	213,573,872円

グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,776,651,050円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,252,534,917円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	645,884,023円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,434,176円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,627,078,190円
世界経済インデックスファンド	585,776,742円
マイセレクション25	12,947,413円
マイセレクション50	6,276,039円
マイセレクション75	4,574,808円
DCマイセレクション25	1,059,795,002円
DCマイセレクション50	949,814,788円
DCマイセレクション75	602,463,741円
DC外国債券インデックス・オープン	1,200,270,924円
DCマイセレクションS25	373,921,128円
DCマイセレクションS50	318,472,201円
DCマイセレクションS75	139,316,977円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,238,444円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	41,025,132円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	28,799,655円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	10,498,545円
DC世界経済インデックスファンド	551,245,163円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	11,361,734,084円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	275,903,628円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,684,091円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	6,853,193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)	241,962,199円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	877,080,659円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,312,927,428円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	12,059,165,011円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,676,093,303円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,511,136,032円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,195,110,588円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,997,051,076円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,887,817,159円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,551,132,468円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,263,540,287円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,039,974,275円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	475,131,351円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	630,470,565円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,844,624,642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)	879,878,474円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	558,867,418円

外国債券ファンド・シリーズ1	244,709,536円
コア投資戦略ファンド(安定型)	978,887,922円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,346,330,771円
分散投資コア戦略ファンドA	73,333,034円
分散投資コア戦略ファンドS	165,687,113円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
コア投資戦略ファンド(切替型)	149,113,192円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	20,741,283円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	20,060,855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)	27,024,368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)	9,936,463,597円
2. 計算日における受益権総数	88,294,862,045口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5043円 (25,043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26年 3月31日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券 「(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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 3月31日現在

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
債券関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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	236,702,724	-	236,314,848	387,876
合計		236,702,724	-	236,314,848	387,876

(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。

通貨関連

区分	種類	平成26年 3月31日現在			
		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				
	アメリカドル	165,270,120	-	166,714,200	1,444,080
	カナダドル	5,550,120	-	5,587,800	37,680
	イギリスポンド	35,570,750	-	35,964,600	393,850
	ユーロ	78,532,720	-	79,307,200	774,480
	計	284,923,710	-	287,573,800	2,650,090
合計		284,923,710	-	287,573,800	2,650,090

(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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 3月31日現在

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成26年4月30日現在)

資産総額	29,846,779,466 円
負債総額	28,165,889 円
純資産総額(-)	29,818,613,577 円
発行済口数	19,200,380,561 口
1口当たり純資産額(/)	1.5530 円
1万口当たり純資産額	15,530 円

(参考情報)

国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	137,412,645,222 円
負債総額	626,819,682 円
純資産総額(-)	136,785,825,540 円
発行済口数	142,213,828,456 口
1口当たり純資産額(/)	0.9618 円
1万口当たり純資産額	9,618 円

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	257,568,010,824 円
負債総額	4,599,941,566 円
純資産総額(-)	252,968,069,258 円
発行済口数	196,505,755,007 口
1口当たり純資産額(/)	1.2873 円
1万口当たり純資産額	12,873 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	166,096,829,522 円
負債総額	176,800,758 円
純資産総額(-)	165,920,028,764 円
発行済口数	98,603,046,403 口
1口当たり純資産額(/)	1.6827 円
1万口当たり純資産額	16,827 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	221,420,442,137 円
負債総額	193,939,081 円
純資産総額(-)	221,226,503,056 円
発行済口数	87,900,273,333 口
1口当たり純資産額(/)	2.5168 円
1万口当たり純資産額	25,168 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（イ）名義書換

該当事項はありません。

（ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

（ニ）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)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および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に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、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

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または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたが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26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年間にお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、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、招集の経路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）からファンドマネー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リスク管理部及びコンプライアンス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（委員長はリスク管理部担当役員）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26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26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	371	4,892,631
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	371	4,892,631

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。）第2条に基づき、同規則及び「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）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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、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期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	4,826,115	8,192,444
前払費用	30,184	81,751
未収委託者報酬	944,716	2,210,605
未収運用受託報酬	26,998	31,051
未収入金	75,514	676
一年以内返還予定保証金	187,128	-
繰延税金資産	69,857	61,743
その他	31,325	19,263
流動資産合計	6,191,840	10,597,535
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 3,525	1 79,281
器具備品	1 14,970	1 103,209
建設仮勘定	62,454	-
有形固定資産合計	80,949	182,491
無形固定資産		
ソフトウェア	60,130	168,561
ソフトウェア仮勘定	12,151	-
その他無形固定資産	928	1,770
無形固定資産合計	73,209	170,332
投資その他の資産		
投資有価証券	43,194	47,112
長期前払費用	357	-
長期貸付金	-	31,838
会員権	-	25,000
その他の投資	165	633
貸倒引当金	-	31,838
投資その他の資産合計	43,717	72,746
固定資産合計	197,876	425,570
資産合計	6,389,717	11,023,105

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
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
資本剰余金合計	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
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	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	7,821,113	19,128,296
運用受託報酬	98,179	94,659
営業収益合計	7,919,292	19,222,955
営業費用		
支払手数料	3,715,816	9,030,246
広告宣伝費	61,165	73,287
公告費	2,451	2,244
調査費	1,023,870	4,132,154
調査費	86,225	207,030
委託調査費	936,024	3,922,394
図書費	1,620	2,729
営業雑経費	610,455	1,294,879
通信費	10,764	21,905
印刷費	121,287	330,735
協会費	10,136	21,939
諸会費	803	757
情報機器関連費	436,328	874,151
その他営業雑経費	31,135	45,391
営業費用合計	5,413,759	14,532,812
一般管理費		
給料	1,276,685	2,259,238
役員報酬	35,160	78,205
給料・手当	1,048,061	1,967,177
賞与	193,464	213,855
退職給付費用	66,790	64,787
福利費	152,149	190,716
交際費	1,012	879
旅費交通費	25,687	45,160
租税公課	16,148	25,420
不動産賃借料	238,033	129,096
寄付金	2,832	-
減価償却費	55,540	129,966
敷金償却	2,804	-
諸経費	81,858	1 257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213
営業利益	585,991	1,586,929

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
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）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

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。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

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

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期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、当期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24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
	建 物	84,592	千円	23,594
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

（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23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
	諸経費		千円	97,199

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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	-

(注) (1)普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2)普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

平成25年6月28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通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

（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24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	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(*)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。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(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

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) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24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	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（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	-	-	-

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位:千円）

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

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23年4月1日 至 平成24年3月31日）（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（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

（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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

（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。

（注）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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

（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。

（注）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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

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24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

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

（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

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。

（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23年4月1日 至 平成24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㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-

(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

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（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㈱	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。

(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23年4月1日 至 平成24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	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	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	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(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。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（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。

3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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24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）

（企業結合等関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

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。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末

(平成25年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	73,320
器具備品	1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070

(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25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	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,222,467
運用受託報酬	36,913
営業収益合計	11,259,380
営業費用	8,307,878
一般管理費	1 1,553,438
営業利益	1,398,063
営業外収益	2 8,577
営業外費用	9,483
経常利益	1,397,157
税引前中間純利益	1,397,157
法人税、住民税及び事業税	577,514
法人税等調整額	55,190
法人税等合計	522,324
中間純利益	874,833

中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
純資産合計	
当期首残高	8,546,410
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	841,585
当中間期末残高	9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間
(自 平成25年4月1日
至 平成25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。)

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、当期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28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 29,556千円
	器具備品 251,697千円
	計 281,253千円
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28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 23,080千円
	無形固定資産 33,012千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 4,063千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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

（リ - ス取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25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。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	-
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	58,285	58,285	-
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	-

(*)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、及び(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。

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	14,024	13,494	529
小計	14,024	13,494	529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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）	1,535,927千円

（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28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25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28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（ 1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01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28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
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】

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

- (イ) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (ロ) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (ハ) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等（委託者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（ニ）および（ホ）において同じ。）または子法人等（委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (ニ) 委託者の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (ホ) 前記（ハ）および（ニ）に掲げるもののほか、委託者の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(イ) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(ロ) 訴訟事件その他の重要事項

平成26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】

(イ) 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25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。

(ロ) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25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。
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	210,224	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】

(イ) 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。

(ロ) 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】

(イ) 受託会社

該当事項はありません。

(ロ) 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25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まれます。）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25年11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75の平成24年10月2日から平成25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75の平成25年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- 1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
 - 2．財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年5月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクション75の平成25年10月1日から平成26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75の平成26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25年10月1日から平成26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. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7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	高波博之	印
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24年4月1日から平成25年3月31日までの第27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25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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

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。