

【表紙】	
【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年8月20日
【計算期間】	第17特定期間（自 平成24年11月20日 至 平成25年5月20日）
【ファンド名】	グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）
【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・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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

日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、日本の株式にも投資し分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

なお、信託金の限度額は、5,000億円とします。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.日本を除く世界の主要国の公社債および日本の株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

●原則として、為替ヘッジは行いません。

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
外 国 債 券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)*1
国 内 株 式	東証株価指数(TOPIX)*2

*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「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インク（CGMI社）が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、CGMI社の知的財産であり、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、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行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「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額で加重平均し、指数化したものです。具体的には、1968年1月4日の東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化しています。当該指数は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、下記の点をご認識ください。

①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

②(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

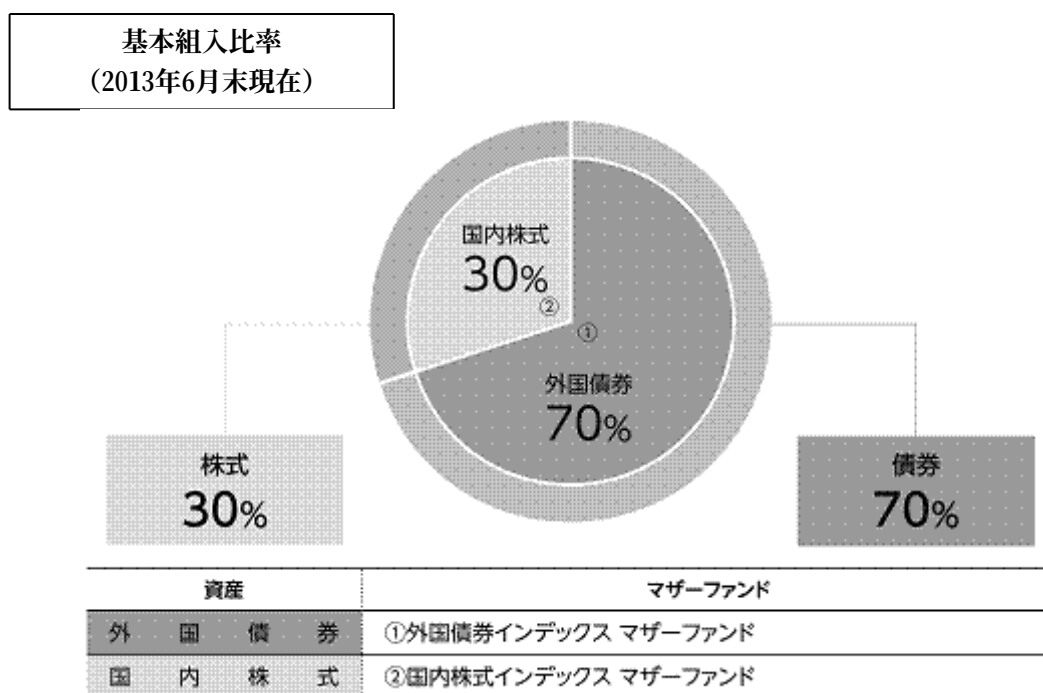
③(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

④(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対

し、責任を負いません。

- ⑤本ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。
- ⑥本ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ⑦(株)東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。
- ⑧(株)東京証券取引所は、委託者又は「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑨前記の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の発行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. 債券70%、株式30%を基本組入比率として運用します。



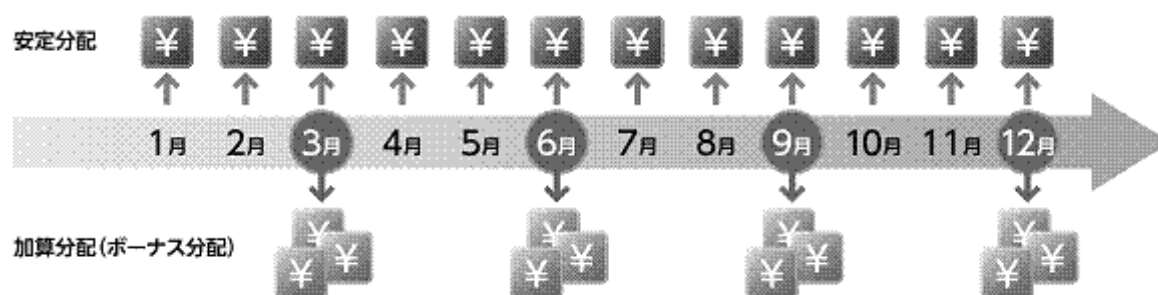
- 資産配分比率が、時価の変動等によって基本組入比率から変化した場合（最大で±5%程度）、一定のルールに基づいて基本組入比率に戻します。
- 外国債券には3%程度の円短期金融資産を含みます。

4. 原則として、毎決算時（年12回）に収益の分配を目指します。また、年4回（3月、6月、9月、12月）の決算時には、加算分配（以下「ボーナス分配」ということがあります。）を目指します。

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、毎月19日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、毎決算時に安定した分配を行うことを目指します。
- 年4回（3月、6月、9月、12月）の決算時には、売買益を配当等収益に加算して分配することを目指します。

収益分配のイメージ

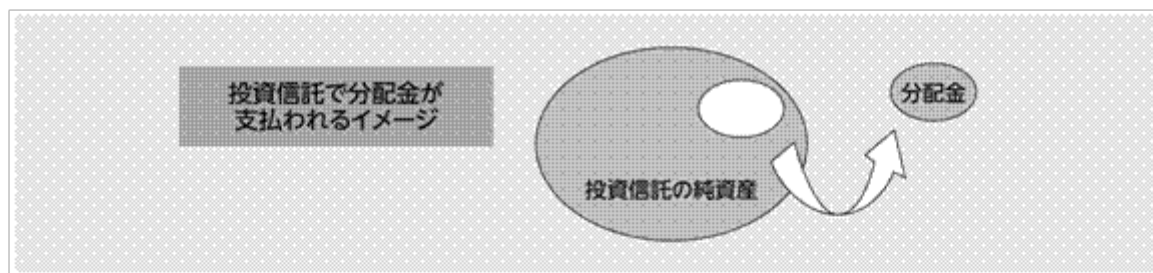


※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

- 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。
- 売買益が確保できた場合でも、基準価額水準、市況動向等を勘案して、ボーナス分配を行わないことがあります。

[収益分配金に関する留意事項]

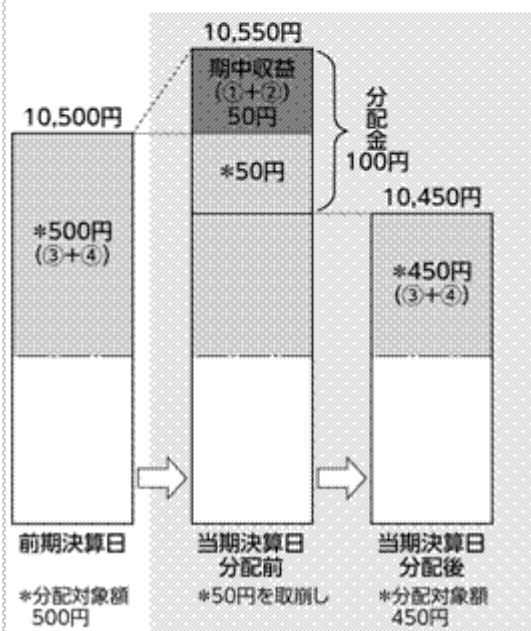
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



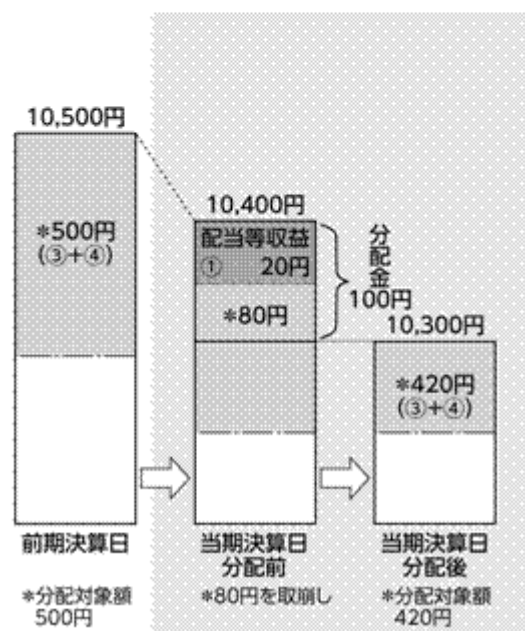
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
- また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）



（前期決算日から基準価額が下落した場合）



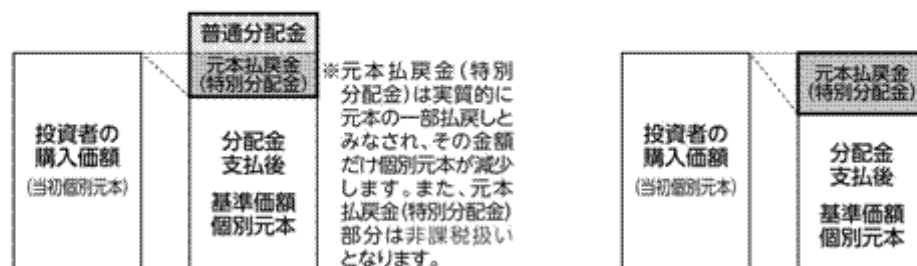
（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

- 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。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)

(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注)普通分配金に対する課税については、下記「4手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

！ 主な投資制限

- 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35%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、取得時において投資信託財産の純資産総額の75%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。

①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
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産
		()
		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。

②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 （ ）
		アジア		
		オセアニア		
不動産投信	年12回 （毎月）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
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		
資産複合 （ ） 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 （ ）	中近東 （中東） 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・ファンズのものをいいます。）、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いいます。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12回（毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。

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いいます。
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いいます。
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いいます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成16年12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

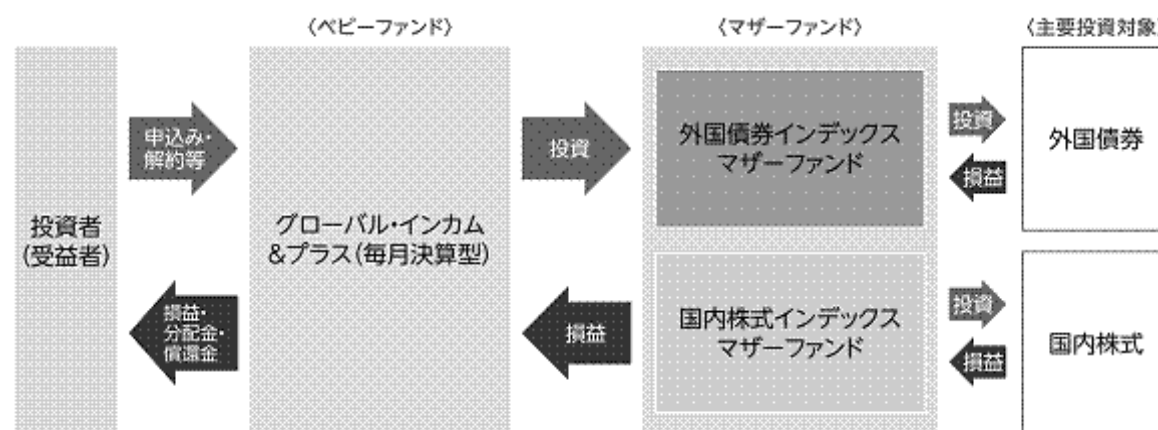
本ファンドの名称を「住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」から「グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」に変更
本ファンドの主要投資対象である「住信 外国債券インデックス マザーファンド」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」および「国内株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(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

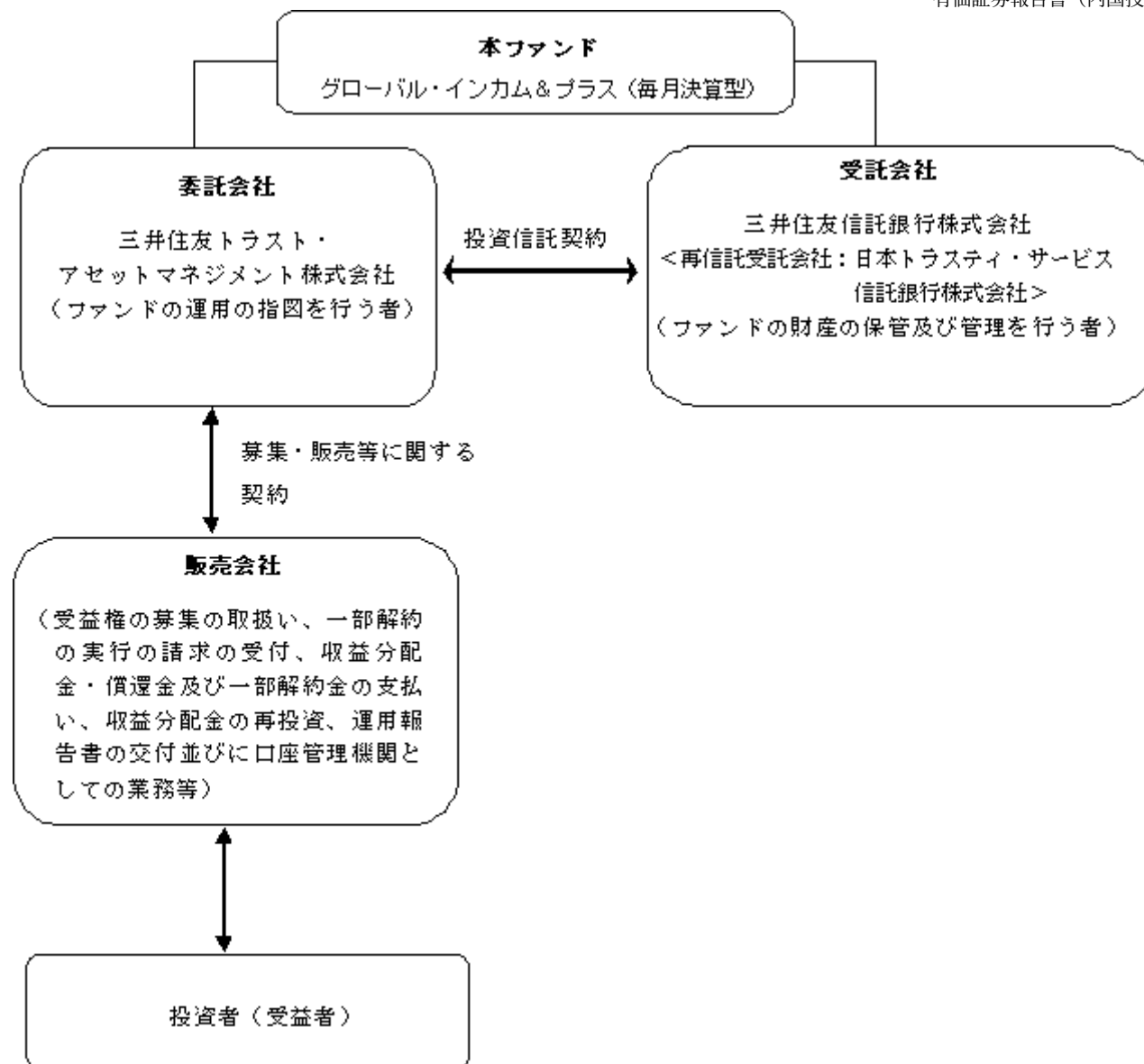
ファミリーファンド方式（※）で運用します。

※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（グローバル・インカム&プラス（毎月決算型））とし、その資金をマザーファンド（外国債券インデックス マザーファンド及び国内株式インデックス 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。



※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) 本ファンドの関係法人図



（ハ）委託会社等の概況

①資本金

平成25年6月28日現在 3億円

②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

③大株主の状況（平成25年6月28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、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、日本の株式にも投資し分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ) 運用方法

①投資対象

外国債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンド（以下総称して、またはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して、またはそれぞれを「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。

②投資態度

- 1)主として、外国債券インデックス マザーファンドの受益証券および国内株式インデックス マザーファンドの受益証券への投資を通して、外国債券と国内株式への分散投資を行います。
- 2)基本資産配分比率は、外国債券70%（円短期金融資産3%程度を含みます。）、国内株式30%とし、各資産ごとの許容乖離幅は±5%とします。
- 3)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。
- 4)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、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、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引および通貨に係る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（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。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、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（スワップ取引）、ならびに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。
- 5)ただし、資金動向、市況動向、投資信託財産の規模等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(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、シティグループ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

- ①シティグループ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。
- ②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。
- ③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。
- ④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。

⑤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。

⑥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

①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。

②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。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（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

①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。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③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。

④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。

⑤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

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純

資産総額の5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(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26条、第27条および第28条に定めるものに限りま。

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、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外国債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

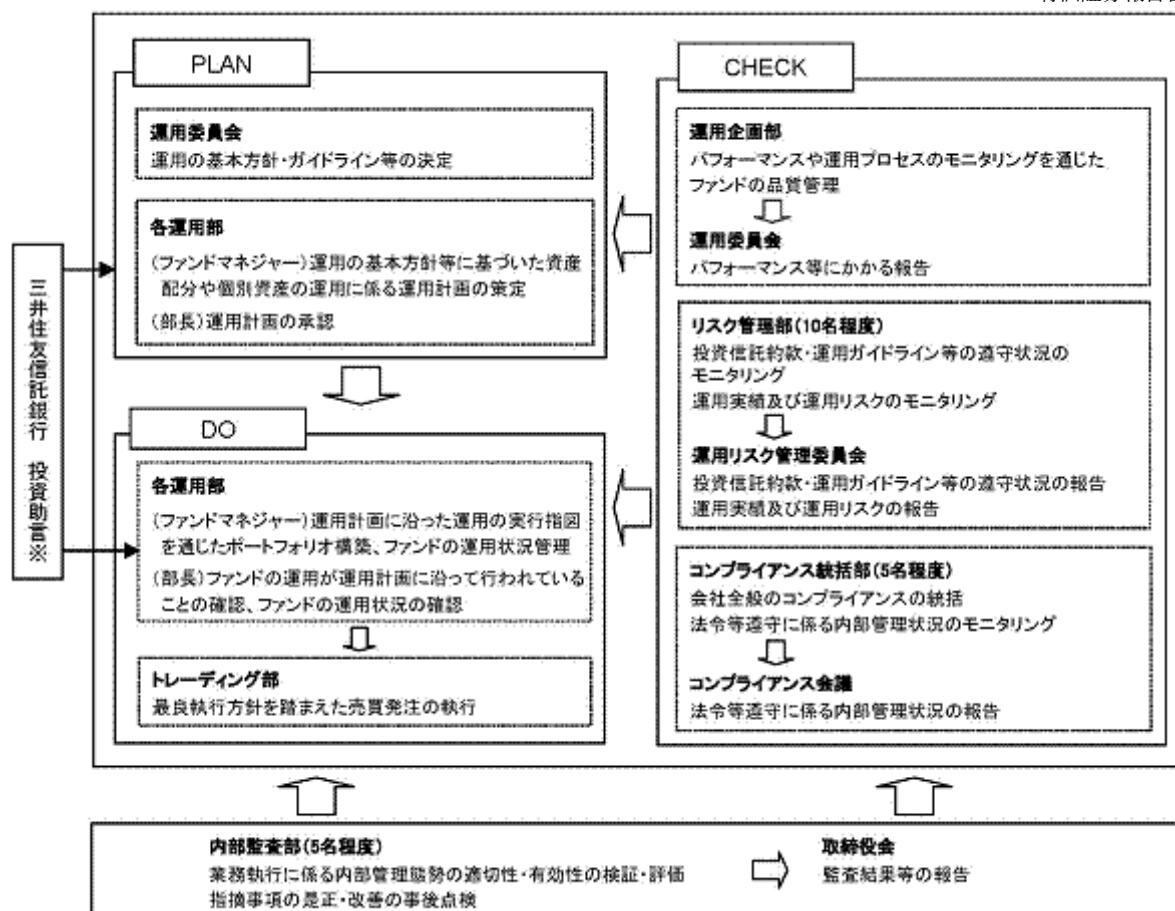
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（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25年8月20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。

① 分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。（以下「みなし売買益」といいます。））等の全額とします。

② 分配対象額についての分配方針

原則として、外国債券インデックス マザーファンドからのみなし配当等収益を原資として、毎決算期に安定した分配を行うことを目指します。また3月、6月、9月、12月の決算時には国内株式インデックス マザーファンドからのみなし売買益を外国債券インデックス マザーファンドからの配当等収益に加算して分配することを目指します。ただし、国内株式インデックス マザーファンドからのみなし売買益が確保できた場合でも、外国債券インデックス マザーファンドの基準価額が下落した場合には、加算分配を行わないことがあります。委託者はこのほか、基準価額水準、市況動

向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

③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

①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) 投資信託財産に属する配当等収益（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をいいます。以下同じ。）とみなし配当等収益との合計額から諸経費、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て得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（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。

②前記①におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の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の割合を乗じて得た額をいいます。

③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

①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35%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②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」）

③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」）

④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、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」）

⑤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」）

⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）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」）

⑦外貨建資産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75%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑧委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の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、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22条）

- ⑨委託者は、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、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ます。信用取引の指図は、当該売付に係る建玉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売付に係る建玉の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額の合計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25条）
- ⑩委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および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、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26条）
- ⑪委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに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。）を行うことを指図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27条）
- ⑫委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」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外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。（投資信託約款第28条）
- ⑬委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第29条）

- 1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- 2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ⑭委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付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30条）
- ⑮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することができ、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31条）
- ⑯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につき円換算した額が、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33条）
- ⑰委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の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40条）

※前記①から⑦における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑦に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド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⑨、⑪、⑫および⑬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】

(1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様
の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むこと
があります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 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。

④ 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。

⑤ カントリーリスク

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

⑥ 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。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

- ① 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。
- ② 本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。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ① 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。
- ② 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】

申込手数料（受益権1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜 2.0%）の率を上限として、指定販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細については、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、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。）

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率1.2600% (税抜1.20%)	純資産総額に対して 年率0.5565% (税抜0.53%)	純資産総額に対して 年率0.6300% (税抜0.60%)	純資産総額に対して 年率0.0735% (税抜0.07%)

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

上記により日々計算された信託報酬は、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するものとします。マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

(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。

(イ) 個人の受益者に対する課税

①収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適

用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

②一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記①の表の通りです。

③損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

（ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（ハ）個別元本について

- ①追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ③ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ④受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「（二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

（二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

- ①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- ②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（ホ）少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。（平成26年1月1日以降）

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※上記は、平成25年6月28日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下の記載は、平成25年6月28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	7,404,935,333	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		101,483,165	1.35
合計(純資産総額)		7,506,418,498	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

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	外国債券インデックス マザーファンド	2,262,063,587	2.2438	5,075,618,277	2.2549	5,100,727,182	67.95
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	2,501,854,671	0.8981	2,246,915,681	0.9210	2,304,208,151	30.70

(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	98.65
合計	98.65

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間末 (平成17年 5月19日)	18,962,804,741	19,000,040,591	10,130	10,150
第2特定期間末 (平成17年11月21日)	35,032,126,773	35,095,181,771	11,057	11,077
第3特定期間末 (平成18年 5月19日)	45,361,352,974	45,484,011,750	10,331	10,359
第4特定期間末 (平成18年11月20日)	49,533,545,081	49,687,012,639	10,309	10,341

第5特定期間末 (平成19年 5月21日)	51,364,860,333	51,520,508,099	10,555	10,587
第6特定期間末 (平成19年11月19日)	45,249,619,809	45,399,624,945	9,653	9,685
第7特定期間末 (平成20年 5月19日)	41,711,251,849	41,855,319,201	9,265	9,297
第8特定期間末 (平成20年11月19日)	29,024,124,752	29,160,032,944	6,834	6,866
第9特定期間末 (平成21年 5月19日)	29,310,152,365	29,441,699,434	7,130	7,162
第10特定期間末 (平成21年11月19日)	26,417,198,216	26,512,139,722	6,956	6,981
第11特定期間末 (平成22年 5月19日)	18,917,284,466	18,945,437,343	6,719	6,729
第12特定期間末 (平成22年11月19日)	14,727,139,464	14,749,825,713	6,492	6,502
第13特定期間末 (平成23年 5月19日)	11,752,276,627	11,770,784,289	6,350	6,360
第14特定期間末 (平成23年11月21日)	8,893,416,845	8,908,744,163	5,802	5,812
第15特定期間末 (平成24年 5月21日)	7,706,373,531	7,719,351,627	5,938	5,948
第16特定期間末 (平成24年11月19日)	7,027,296,398	7,038,630,742	6,200	6,210
第17特定期間末 (平成25年 5月20日)	8,355,696,022	8,365,533,163	8,494	8,504
平成24年 6月末日	7,597,730,469	—	5,994	—
7月末日	7,285,327,057	—	5,878	—
8月末日	7,136,643,130	—	5,920	—
9月末日	7,002,563,938	—	5,967	—
10月末日	6,973,845,152	—	6,077	—
11月末日	7,110,212,863	—	6,328	—
12月末日	7,481,872,316	—	6,793	—
平成25年 1月末日	7,765,421,025	—	7,211	—
2月末日	7,690,464,195	—	7,285	—
3月末日	7,730,090,385	—	7,487	—
4月末日	8,125,966,338	—	8,116	—
5月末日	7,867,162,316	—	8,103	—
6月末日	7,506,418,498	—	7,847	—

②【分配の推移】

期 間	1 万口当たりの分配金(円)
第1特定期間(平成16年12月 1日～平成17年 5月19日)	284
第2特定期間(平成17年 5月20日～平成17年11月21日)	450
第3特定期間(平成17年11月22日～平成18年 5月19日)	796
第4特定期間(平成18年 5月20日～平成18年11月20日)	498
第5特定期間(平成18年11月21日～平成19年 5月21日)	460
第6特定期間(平成19年 5月22日～平成19年11月19日)	460
第7特定期間(平成19年11月20日～平成20年 5月19日)	192
第8特定期間(平成20年 5月20日～平成20年11月19日)	192
第9特定期間(平成20年11月20日～平成21年 5月19日)	192
第10特定期間(平成21年 5月20日～平成21年11月19日)	157
第11特定期間(平成21年11月20日～平成22年 5月19日)	75
第12特定期間(平成22年 5月20日～平成22年11月19日)	60
第13特定期間(平成22年11月20日～平成23年 5月19日)	60
第14特定期間(平成23年 5月20日～平成23年11月21日)	60

第15特定期間(平成23年11月22日～平成24年 5月21日)	60
第16特定期間(平成24年 5月22日～平成24年11月19日)	60
第17特定期間(平成24年11月20日～平成25年 5月20日)	60

③【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1特定期間(平成16年12月 1日～平成17年 5月19日)	4.1
第2特定期間(平成17年 5月20日～平成17年11月21日)	13.6
第3特定期間(平成17年11月22日～平成18年 5月19日)	0.6
第4特定期間(平成18年 5月20日～平成18年11月20日)	4.6
第5特定期間(平成18年11月21日～平成19年 5月21日)	6.8
第6特定期間(平成19年 5月22日～平成19年11月19日)	△4.2
第7特定期間(平成19年11月20日～平成20年 5月19日)	△2.0
第8特定期間(平成20年 5月20日～平成20年11月19日)	△24.2
第9特定期間(平成20年11月20日～平成21年 5月19日)	7.1
第10特定期間(平成21年 5月20日～平成21年11月19日)	△0.2
第11特定期間(平成21年11月20日～平成22年 5月19日)	△2.3
第12特定期間(平成22年 5月20日～平成22年11月19日)	△2.5
第13特定期間(平成22年11月20日～平成23年 5月19日)	△1.3
第14特定期間(平成23年 5月20日～平成23年11月21日)	△7.7
第15特定期間(平成23年11月22日～平成24年 5月21日)	3.4
第16特定期間(平成24年 5月22日～平成24年11月19日)	5.4
第17特定期間(平成24年11月20日～平成25年 5月20日)	38.0

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(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1特定期間 (平成16年12月 1日～平成17年 5月19日)	18,885,326,762	166,108,872	18,719,217,890
第2特定期間 (平成17年 5月20日～平成17年11月21日)	14,183,294,408	1,219,557,238	31,682,955,060
第3特定期間 (平成17年11月22日～平成18年 5月19日)	13,597,711,085	1,371,727,992	43,908,938,153
第4特定期間 (平成18年 5月20日～平成18年11月20日)	5,378,481,363	1,237,815,238	48,049,604,278
第5特定期間 (平成18年11月21日～平成19年 5月21日)	3,154,610,709	2,540,962,757	48,663,252,230
第6特定期間 (平成19年 5月22日～平成19年11月19日)	1,264,004,858	3,050,652,076	46,876,605,012
第7特定期間 (平成19年11月20日～平成20年 5月19日)	394,517,612	2,250,074,850	45,021,047,774
第8特定期間 (平成20年 5月20日～平成20年11月19日)	294,216,237	2,843,953,735	42,471,310,276
第9特定期間 (平成20年11月20日～平成21年 5月19日)	311,957,545	1,674,808,504	41,108,459,317
第10特定期間 (平成21年 5月20日～平成21年11月19日)	133,670,009	3,265,526,700	37,976,602,626
第11特定期間 (平成21年11月20日～平成22年 5月19日)	65,952,926	9,889,678,417	28,152,877,135
第12特定期間 (平成22年 5月20日～平成22年11月19日)	64,112,475	5,530,740,099	22,686,249,511

第13特定期間 (平成22年11月20日～平成23年 5月19日)	30,814,885	4,209,401,837	18,507,662,559
第14特定期間 (平成23年 5月20日～平成23年11月21日)	32,114,595	3,212,458,498	15,327,318,656
第15特定期間 (平成23年11月22日～平成24年 5月21日)	24,470,201	2,373,692,339	12,978,096,518
第16特定期間 (平成24年 5月22日～平成24年11月19日)	21,751,501	1,665,503,835	11,334,344,184
第17特定期間 (平成24年11月20日～平成25年 5月20日)	30,551,318	1,527,753,571	9,837,141,931

(注)当該特定期間中において、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)

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	92,032,446,962	40.04
	フランス	22,652,730,365	9.85
	イタリア	21,939,986,281	9.54
	ドイツ	20,030,706,388	8.71
	イギリス	16,563,969,101	7.21
	スペイン	11,058,933,069	4.81
	オランダ	6,170,214,095	2.68
	カナダ	6,012,231,280	2.62
	ベルギー	5,968,480,572	2.60
	オーストリア	4,010,103,088	1.74
	オーストラリア	3,415,034,330	1.49
	メキシコ	2,317,011,796	1.01
	デンマーク	1,905,927,871	0.83
	アイルランド	1,809,502,274	0.79
	ポーランド	1,669,048,333	0.73
	フィンランド	1,458,225,349	0.63
	南アフリカ	1,263,258,201	0.55
	スウェーデン	1,201,559,341	0.52
	マレーシア	1,179,811,269	0.51
	シンガポール	898,465,453	0.39
	スイス	861,176,695	0.37
	ノルウェー	715,798,768	0.31
	小計	225,134,620,881	97.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,728,737,022	2.06
合計(純資産総額)		229,863,357,903	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

① 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 2.625% 07/31/14	33,900,000	10,141.95	3,438,122,168	10,119.33	3,430,455,994	2.625	2014/07/31	1.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,099.55	2,807,677,568	10,069.27	2,799,258,180	1.375	2015/11/30	1.22
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	10,259.52	2,123,721,028	10,236.99	2,119,057,443	2.500	2015/03/31	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	20,600,000	9,917.16	2,042,936,628	9,834.15	2,025,836,950	0.875	2017/02/28	0.88

アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,221.58	1,962,544,855	10,201.56	1,958,699,845	2.375	2015/02/28	0.85
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,835.12	1,908,013,819	9,736.14	1,888,812,632	0.750	2017/06/30	0.82
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	9,794.49	1,763,008,714	9,763.49	1,757,428,368	0.250	2016/04/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	10,123.57	1,619,772,085	10,100.46	1,616,074,960	2.625	2014/06/30	0.70
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,163.43	1,524,515,276	10,139.17	1,520,875,914	1.750	2015/07/31	0.66
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	10,580.90	1,481,326,308	10,488.66	1,468,413,327	2.750	2016/11/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,844.36	1,378,211,183	9,833.19	1,376,647,597	0.250	2015/07/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,920.57	1,397,833,665	10,708.56	1,370,696,775	3.125	2019/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,708.95	1,338,619,207	10,665.24	1,333,155,349	4.250	2015/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,179.99	1,333,579,362	10,157.08	1,330,577,577	1.875	2015/06/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	10,139.17	1,277,535,768	10,123.76	1,275,594,777	2.125	2014/11/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	10,129.92	1,266,241,243	10,108.36	1,263,545,423	2.375	2014/08/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	13,100,000	9,756.55	1,278,109,212	9,618.30	1,259,997,533	0.750	2018/02/28	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	10,346.94	1,241,633,220	10,309.77	1,237,173,564	4.250	2014/08/15	0.54
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000	13,341.28	1,227,398,263	13,236.14	1,217,725,609	4.250	2014/08/01	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,874.78	1,135,600,824	9,867.47	1,134,759,352	0.375	2015/04/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,301.45	1,107,542,725	11,170.13	1,094,672,881	4.500	2017/05/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	11,500,000	9,752.90	1,121,583,521	9,491.40	1,091,511,643	2.000	2023/02/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.5% 03/31/19	11,000,000	10,000.53	1,100,058,363	9,811.63	1,079,279,361	1.500	2019/03/31	0.47
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,672.82	1,080,153,459	13,600.08	1,074,406,369	3.500	2015/04/25	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,269.72	1,057,781,933	10,231.79	1,053,874,724	2.000	2016/01/31	0.46
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 07/04/14	7,700,000	13,447.77	1,035,478,488	13,390.76	1,031,089,253	4.250	2014/07/04	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 05/31/14	10,100,000	10,066.38	1,016,704,949	10,046.93	1,014,740,655	2.250	2014/05/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/21	9,500,000	10,865.69	1,032,241,155	10,600.54	1,007,051,595	3.125	2021/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,697.59	1,016,271,300	10,595.15	1,006,539,393	3.000	2017/02/28	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	9,800,000	10,291.10	1,008,527,949	10,158.42	995,526,000	1.875	2017/08/31	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	97.94
合計	97.94

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

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	31	3,769,053.77	3,751,726.64	369,882,729	0.16
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	17	2,172,443.07	2,152,890.71	212,253,495	0.09
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	11	1,514,700.25	1,491,531.25	147,050,065	0.06
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	18	1,986,372	1,986,390	255,310,706	0.11
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	19	2,384,176	2,377,280	305,551,798	0.13
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	29	4,126,056	4,102,340	527,273,760	0.23

(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	144,623,012,770	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,576,791,147	1.75
合計(純資産総額)		147,199,803,917	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

① 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	1,181,200	6,191.07	7,312,893,888	5,990.00	7,075,388,000	4.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,871,600	613.57	4,216,235,053	612.00	4,205,419,200	2.86
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	686,300	4,195.22	2,879,182,769	4,550.00	3,122,665,000	2.12
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	775,700	4,000.05	3,102,844,612	3,685.00	2,858,454,500	1.94
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	439,500	5,318.46	2,337,463,775	5,790.00	2,544,705,000	1.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,738,200	200.88	2,358,009,380	206.00	2,418,069,200	1.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	572,500	3,610.20	2,066,843,248	3,505.00	2,006,612,500	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	382,000	5,196.11	1,984,914,990	5,140.00	1,963,480,000	1.33
日本	株式	キヤノン	電気機器	571,200	3,659.62	2,090,375,080	3,235.00	1,847,832,000	1.26
日本	株式	三菱地所	不動産業	635,000	2,651.00	1,683,389,480	2,641.00	1,677,035,000	1.14
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	360,700	4,677.54	1,687,190,716	4,480.00	1,615,936,000	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,208,000	700.90	1,547,608,000	637.00	1,406,496,000	0.96
日本	株式	ファナック	電気機器	95,700	15,227.00	1,457,224,044	14,380.00	1,376,166,000	0.93
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	379,600	3,678.36	1,396,308,980	3,625.00	1,376,050,000	0.93
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,856,000	840.29	1,559,594,655	731.00	1,356,736,000	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	256,100	4,809.77	1,231,782,226	5,160.00	1,321,476,000	0.90
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	169,600	7,703.92	1,306,585,897	7,710.00	1,307,616,000	0.89
日本	株式	三井不動産	不動産業	428,000	2,980.70	1,275,741,860	2,917.00	1,248,476,000	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	708,100	1,847.47	1,308,199,848	1,699.00	1,203,061,900	0.82
日本	株式	ソニー	電気機器	577,800	2,064.31	1,192,760,094	2,078.00	1,200,668,400	0.82
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,161,500	1,131.98	1,314,796,876	1,005.00	1,167,307,500	0.79
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	7,477	151,866.18	1,135,503,486	154,100.00	1,152,205,700	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	172,700	6,516.77	1,125,446,631	6,580.00	1,136,366,000	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	208,700	5,420.09	1,131,172,783	5,390.00	1,124,893,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	351,500	3,149.06	1,106,895,890	3,145.00	1,105,467,500	0.75
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	4,070,000	274.44	1,116,993,050	268.00	1,090,760,000	0.74
日本	株式	デンソー	輸送用機器	227,200	4,468.82	1,015,316,784	4,665.00	1,059,888,000	0.72
日本	株式	小松製作所	機械	449,100	2,714.50	1,219,081,964	2,293.00	1,029,786,300	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	301,800	3,468.84	1,046,897,808	3,380.00	1,020,084,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	783,300	1,366.68	1,070,526,084	1,246.00	975,991,800	0.66

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.25
合計	98.25

(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	0.42
		建設業	2.44
		食料品	4.00
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.25
		化学	5.50
		医薬品	4.46
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	1.59
		非鉄金属	0.92
		金属製品	0.66
		機械	4.93
		電気機器	11.39
		輸送用機器	11.70
		精密機器	1.32
		その他製品	1.31
		電気・ガス業	2.61
		陸運業	3.97
		海運業	0.33
		空運業	0.61
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.65
		卸売業	4.35
		小売業	4.29
		銀行業	10.20
		証券、商品先物取引業	1.79
		保険業	2.39
		その他金融業	1.23
		不動産業	3.41
		サービス業	2.06
合計			98.25

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

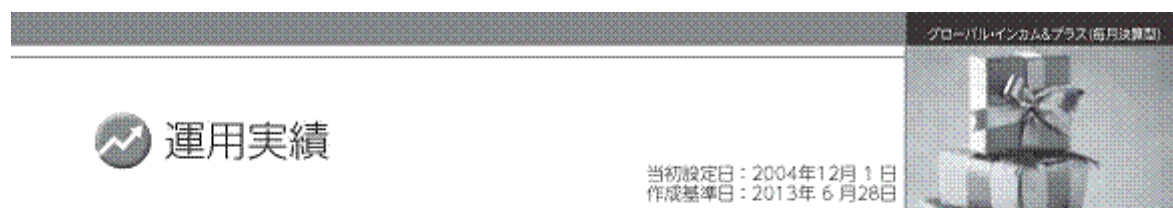
③ その他投資資産の主要なもの

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	東京証券取引所	買建	円	203	2,191,325,500	2,295,930,000	2,295,930,000	1.56

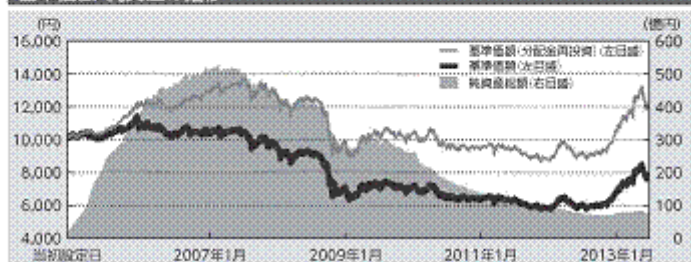
(注)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

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



基準価額・純資産の推移



※基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	7,847円
純資産総額	75億円

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額：4,126円 直近1年間分配金合計額：120円

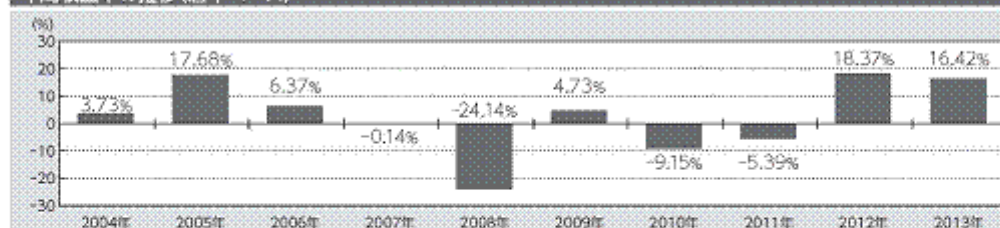
決算期	2013年2月	2013年3月	2013年4月	2013年5月	2013年6月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円

※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
外国債券 インデックス マザーファンド	68.0%	〒2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	—	2.625%	2014/07/31	1.0%
		〒1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	—	1.375%	2015/11/30	0.8%
		〒2.5% 03/31/15	アメリカ	国債証券	—	2.500%	2015/03/31	0.6%
		〒0.875% 02/28/17	アメリカ	国債証券	—	0.875%	2017/02/28	0.6%
		〒2.375% 02/28/15	アメリカ	国債証券	—	2.375%	2015/02/28	0.6%
国内株式 インデックス マザーファンド	30.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	1.5%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.9%
		三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	—	—	0.7%
		本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	—	—	0.6%
		ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	—	—	0.5%

年間収益率の推移（暦年ベース）



※収益率は分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。
※2004年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013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、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

- ①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。
- ②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。ただし、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、ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受け付けません。ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。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。）

- ③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。
- ④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。
- ⑤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、
- ⑥申込みには、収益の分配がなされた場合、税金を差し引いた後の分配金を受領する「一般コース」と、税金を差し引いた後の分配金が自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」があり（以下、「一般コース」は「分配金受取りコース」、「自動けいぞく投資コース」は「分配金再投資コース」とそれぞれ読み替えるものとし、）、「自動けいぞく投資コース」を選択した場合には、取得申込者は指定販売会社との間で「分配金再投資に関する契約」を別途締結します。なお、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、指定販売会社によって取扱いコースが異なる場合があります。取扱いコースの詳細については、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②に記載されている先と同じです。

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、）を行うものとし、

⑦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

指定販売会社が個別に定める単位とします。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「(イ) 申込手続②」に記載されている先と同じです。

(ハ) 申込手数料

- ①「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料」をご覧ください。
- ②分配金再投資に関する契約にもとづき収益分配金を再投資する場合には、申込手数料はかかりません。

2【換金（解約）手続等】

(イ) 受益権の買取請求

本ファンドのご換金の方法は、ご解約の請求のほか受益権の買取の方法によることができます。ただし、受益権の買取は、指定販売会社によっては行わない場合がありますので、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「1申込（販売）手続等（イ）申込手続②」に記載されている先と同じです。

(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。

①受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に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。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、ご解約の請求を受け付けられないものとします。ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続②」に記載されている先と同じです。なお、解約単位は、指定販売会社が個別に定める単位とします。

②受益者が、前記①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ます。

③委託者は、前記①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。

④ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額[※]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。

⑤ご解約の受取金額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた額（解約代金）となります。

⑥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。

⑦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①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。

⑧前記⑦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④の規定に準じて計算された価額とします。

⑨解約単位および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、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続②」に記載されている先と同じです。

（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「1申込（販売）手続等（イ）申込手続②」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】

①本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

②マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1)わが国の取引所に上場されている株式

原則として、本ファンドの基準価額計算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）価格情報会社の提供する価額

（b）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。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続②」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1万口当た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16年12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、毎月20日から翌月19日までとします。（第1計算期間は、平成16年12月1日から平成17年2月21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**

- ①(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10億口を下回ることとなった場合には、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。
- ②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。
- ③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投資信託委託業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 ①(d)」に該当する場合を除き、この信託は当該投資信託委託業者と受託者との間において存続します。
- ④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

- ①(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。

②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①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、6計算期間の末日（5月および11月）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。ただし、第1作成期は、当初の4計算期間とします。

(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

受益者は、委託者が支払いを決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。収益分配金の支払いは指定販売会社の営業所等において行います。

前記にかかわらず、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者については、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。この場合、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、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。

受益者が収益分配金について支払開始日から5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。

※分配金は、決算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（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末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、取得申込者としします。）

に、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後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)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17特定期間(平成24年11月20日から平成25年5月20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】

グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16特定期間 (平成24年11月19日現在)	第17特定期間 (平成25年 5月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,869,587	118,253,873
親投資信託受益証券	6,967,344,763	8,238,685,107
未収入金	24,920,000	45,940,000
未収利息	87	168
流動資産合計	7,051,134,437	8,402,879,148
資産合計	7,051,134,437	8,402,879,148
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,334,344	9,837,141
未払解約金	5,010,295	28,543,403
未払受託者報酬	435,302	511,354
未払委託者報酬	7,027,016	8,254,711
その他未払費用	31,082	36,517
流動負債合計	23,838,039	47,183,126
負債合計	23,838,039	47,183,126
純資産の部		
元本等		
元本	11,334,344,184	9,837,141,931
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,307,047,786	△1,481,445,909
（分配準備積立金）	91,458,326	120,001,731
元本等合計	7,027,296,398	8,355,696,022
純資産合計	7,027,296,398	8,355,696,022
負債純資産合計	7,051,134,437	8,402,879,148

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16特定期間 (自 平成24年 5月22日 至 平成24年11月19日)	第17特定期間 (自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日)
営業収益		
受取利息	26,558	17,238
有価証券売買等損益	420,623,293	2,537,720,344
営業収益合計	420,649,851	2,537,737,582
営業費用		
受託者報酬	2,666,247	2,829,558
委託者報酬	43,040,781	45,677,141
その他費用	190,379	202,051
営業費用合計	45,897,407	48,708,750
営業利益又は営業損失（△）	374,752,444	2,489,028,832
経常利益又は経常損失（△）	374,752,444	2,489,028,832
当期純利益又は当期純損失（△）	374,752,444	2,489,028,832
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△3,796,045	27,255,992
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△5,271,722,987	△4,307,047,786
剰余金増加額又は欠損金減少額	667,128,123	435,227,806
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	667,128,123	435,227,806
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,724,507	8,533,605
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,724,507	8,533,605
分配金	72,276,904	62,865,164
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,307,047,786	△1,481,445,909

(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17特定期間(自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日) 第17特定期間は当特定期間末日が休業日のため、平成24年11月20日から平成25年 5月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第16特定期間 (平成24年11月19日現在)	第17特定期間 (平成25年 5月20日現在)
1. 期首元本額	12,978,096,518円	11,334,344,184円
期中追加設定元本額	21,751,501円	30,551,318円
期中一部解約元本額	1,665,503,835円	1,527,753,571円
2. 当該特定期間の末日における受益権総数	11,334,344,184口	9,837,141,931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 4,307,047,786円	元本の欠損 1,481,445,909円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6200円 (6,200円)	0.8494円 (8,494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16特定期間 自 平成24年 5月22日 至 平成24年11月19日	第17特定期間 自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日
		第89期 自 平成24年5月22日 至 平成24年6月19日	第95期 自 平成24年11月20日 至 平成24年12月19日
費用控除後の配当等収益額	A	6,176,913円 (13,826,300円)	12,475,788円 (12,671,654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	－円
収益調整金額	C	4,972,498円	4,470,309円
分配準備積立金額	D	89,063,711円	89,327,948円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,213,122円	106,274,045円
当ファンドの期末残存口数	F	12,782,919,973口	11,075,108,171口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	78.39円	95.95円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	12,782,919円	11,075,108円

		第90期 自 平成24年6月20日 至 平成24年7月19日	第96期 自 平成24年12月20日 至 平成25年1月21日
費用控除後の配当等収益額	A	12,465,625円 (15,643,721円)	16,605,168円 (16,893,586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	－円
収益調整金額	C	4,895,846円	4,412,080円
分配準備積立金額	D	80,741,541円	88,780,893円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	98,103,012円	109,798,141円
当ファンドの期末残存口数	F	12,520,593,366口	10,841,511,493口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	78.35円	101.27円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	12,520,593円	10,841,511円
		第91期 自 平成24年7月20日 至 平成24年8月20日	第97期 自 平成25年1月22日 至 平成25年2月19日
費用控除後の配当等収益額	A	12,974,305円 (14,193,731円)	13,002,074円 (13,306,440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	－円
収益調整金額	C	4,801,434円	4,406,912円
分配準備積立金額	D	78,711,231円	92,782,777円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	96,486,970円	110,191,763円
当ファンドの期末残存口数	F	12,217,562,091口	10,647,586,118口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	78.97円	103.48円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	12,217,562円	10,647,586円
		第92期 自 平成24年8月21日 至 平成24年9月19日	第98期 自 平成25年2月20日 至 平成25年3月19日
費用控除後の配当等収益額	A	12,321,391円 (13,344,007円)	13,145,415円 (13,554,885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	－円
収益調整金額	C	4,679,726円	4,341,091円
分配準備積立金額	D	77,036,743円	92,676,011円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	94,037,860円	110,162,517円
当ファンドの期末残存口数	F	11,847,291,485口	10,377,116,222口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	79.37円	106.15円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	11,847,291円	10,377,116円
		第93期 自 平成24年9月20日 至 平成24年10月19日	第99期 自 平成25年3月20日 至 平成25年4月19日
費用控除後の配当等収益額	A	28,794,202円 (32,842,270円)	34,084,606円 (34,726,389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	－円

収益調整金額	C	4,600,809円	4,263,731円
分配準備積立金額	D	75,701,822円	92,738,301円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,096,833円	131,086,638円
当ファンドの期末残存口数	F	11,574,195,788口	10,086,702,379口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	94.25円	129.95円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	11,574,195円	10,086,702円
		第94期 自 平成24年10月20日 至 平成24年11月19日	第100期 自 平成25年4月20日 至 平成25年5月20日
費用控除後の配当等収益額	A	11,823,835円 (12,528,667円)	16,040,137円 (16,327,476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	－円
収益調整金額	C	4,534,155円	4,209,326円
分配準備積立金額	D	90,968,835円	113,798,735円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	107,326,825円	134,048,198円
当ファンドの期末残存口数	F	11,334,344,184口	9,837,141,931口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	94.69円	136.26円
1万口当たり分配金額	H	10円	10円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	11,334,344円	9,837,141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. 金銭債権の特定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16特定期間 (平成24年11月19日現在)	第17特定期間 (平成25年 5月20日現在)
	計算期間(自 平成24年10月20日 至 平成24年11月19日)の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成25年4月20日 至 平成25年 5月20日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	132,562,088	489,238,320
合計	132,562,088	489,238,320

(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】

① 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	外国債券インデックス マザーファンド	2,329,068,251	5,586,270,200	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,573,910,633	2,652,414,907	
親投資信託受益証券 小計		4,902,978,884	8,238,685,107	
合計		4,902,978,884	8,238,685,107	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

- ③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。
- ④ 不動産等明細表
該当事項はありません。
- ⑤ 商品明細表
該当事項はありません。
- ⑥ 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。
- ⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。
- ⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考>

「グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)」は、「外国債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス 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5月20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。

「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 5月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	482,128,922
コール・ローン	742,314,776
国債証券	245,486,675,149
派生商品評価勘定	7,014,641
未収入金	1,882,830,189
未収利息	2,413,308,413
前払費用	102,169,534
差入委託証拠金	42,146,997
流動資産合計	251,158,588,621
資産合計	251,158,588,621
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,449,201
未払金	1,071,570
未払解約金	801,177,010
流動負債合計	810,697,781
負債合計	810,697,781
純資産の部	
元本等	
元本	104,375,420,897
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	145,972,469,943
元本等合計	250,347,890,840
純資産合計	250,347,890,840
負債純資産合計	251,158,588,621

(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 5月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	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25年 5月20日現在
1. 特定期間の期首元本額	112,043,277,020円
特定期間中の追加設定元本額	5,676,994,441円
特定期間中の一部解約元本額	13,344,850,564円
計算日の元本額	104,375,420,897円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	5,697,187,575円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	272,308,013円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,329,068,251円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,841,400,250円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	542,021,536円
SBI資産設計オープン(分配型)	11,357,851円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,246,849,775円
世界経済インデックスファンド	412,395,404円
マイセレクション25	15,046,167円
マイセレクション50	9,868,947円
マイセレクション75	7,572,346円
DCマイセレクション25	939,837,011円
DCマイセレクション50	912,152,748円
DCマイセレクション75	595,989,596円
DC外国債券インデックス・オープン	1,128,070,048円
DCマイセレクションS25	304,529,136円

DCマイセレクションS50	278,390,433円
DCマイセレクションS75	122,278,031円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,645,265円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	32,234,378円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	22,919,009円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	8,048,444円
DC世界経済インデックスファンド	191,698,301円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	7,509,073,784円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	4,866,742,338円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	37,068,202円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,158,303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)	451,213,379円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,437,626,062円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,418,527,566円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	27,941,704,852円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,059,741,282円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,289,518,601円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,284,621,950円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,290,817,362円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,575,370,682円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,832,264,629円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,406,083,407円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,443,068,276円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	526,446,336円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	711,400,538円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	4,018,091,067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)	864,581,522円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	333,124,175円
外国債券ファンド・シリーズ1	372,230,996円
コア投資戦略ファンド(安定型)	523,655,262円
コア投資戦略ファンド(成長型)	469,175,457円
分散投資コア戦略ファンドA	26,720円
分散投資コア戦略ファンドS	45,561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)	778,174,073円
2. 計算日における受益権総数	104,375,420,897口
3. 1口当たり純資産額	2.3985円
(1万口当たり純資産額)	(23,985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 5月20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	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 5月20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。
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 5月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,139,513,437
合計	3,139,513,437

(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24年5月30日から平成25年5月20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)

I. 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 5月20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	1,421,778,434	—	1,419,922,588	△1,855,846
	合計	1,421,778,434	—	1,419,922,588	△1,855,846

(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 5月20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	962,591,625	—	967,724,400	5,132,775
	カナダドル	81,272,240	—	80,878,500	△393,740
	イギリスポンド	153,088,590	—	152,870,200	△218,390
	ユーロ	787,897,060	—	788,582,600	685,540
	計	1,984,849,515	—	1,990,055,700	5,206,185
	売 建				
	アメリカドル	808,081,520	—	812,515,000	△4,433,480
	カナダドル	55,224,950	—	54,961,500	263,450
	オーストラリアドル	28,133,280	—	28,078,400	54,880
	イギリスポンド	145,315,755	—	145,126,500	189,255
	マレーシアリンギット	13,669,029	—	13,697,238	△28,209
	スウェーデンクローナ	30,829,380	—	30,833,400	△4,020
	ノルウェークローネ	8,246,620	—	8,248,500	△1,880
	デンマーククローネ	17,680,100	—	17,690,000	△9,900
	メキシコペソ	26,508,480	—	26,489,400	19,080
	ポーランドズロチ	15,119,040	—	15,182,400	△63,360
	南アフリカランド	11,522,175	—	11,466,000	56,175
	ユーロ	844,459,810	—	845,286,700	△826,890
	計	2,004,790,139	—	2,009,575,038	△4,784,899

合計	3,989,639,654	—	3,999,630,738	421,286
----	---------------	---	---------------	---------

(注)時価の算定方法

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

- ① 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ② 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 5月20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 5月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年5月20日現在)

① 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	10,005,468.80	
		T 0.25% 02/15/15	5,700,000.00	5,702,003.89	
		T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,930,390.58	
		T 0.25% 04/30/14	9,000,000.00	9,009,492.21	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,994,804.74	
		T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,990,781.28	
		T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	10,007,421.90	
		T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,800,093.74	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,527,626.91	
		T 0.375% 06/15/15	10,000,000.00	10,023,437.50	
		T 0.375% 11/15/14	4,000,000.00	4,010,468.76	
		T 0.625% 11/30/17	4,000,000.00	3,979,765.64	
		T 0.75% 02/28/18	13,100,000.00	13,074,669.97	
		T 0.75% 03/31/18	3,000,000.00	2,991,210.93	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,479,949.14	
		T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,995,898.40	
		T 0.875% 01/31/18	3,400,000.00	3,414,808.59	
		T 0.875% 02/28/17	22,900,000.00	23,159,861.41	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,421,792.97	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,944,980.48	
		T 1% 09/30/16	7,900,000.00	8,037,015.62	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,960,546.88	
		T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,220,511.70	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	912,779.29	

T 1.25% 02/29/20	10,000,000.00	9,989,257.80	
T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,708,234.37	
T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,487,914.06	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,994,300.79	
T 1.375% 11/30/15	29,100,000.00	29,874,105.39	
T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	2,043,593.76	
T 1.5% 03/31/19	11,000,000.00	11,292,831.99	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,444,201.18	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,423,974.61	
T 1.625% 11/15/22	3,000,000.00	2,935,722.66	
T 1.75% 05/15/22	12,500,000.00	12,481,201.12	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,484,570.35	
T 1.875% 04/30/14	6,000,000.00	6,098,437.50	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,546,730.43	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,298,421.92	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,152,636.73	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,627,246.10	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,754,849.64	
T 2% 02/15/22	10,000,000.00	10,234,765.60	
T 2% 02/15/23	11,500,000.00	11,596,806.64	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,465,156.25	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,346,501.97	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	12,970,371.07	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,585,835.92	
T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,318,175.75	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	6,152,949.24	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,136,250.00	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,930,500.09	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,496,664.05	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,304,062.52	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	591,905.27	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	12,851,806.62	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,189,609.36	
T 2.5% 03/31/15	20,700,000.00	21,568,429.79	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,062,675.78	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,432,296.87	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,440,039.05	
T 2.625% 06/30/14	16,000,000.00	16,439,687.52	
T 2.625% 07/31/14	37,400,000.00	38,500,085.84	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,980,390.62	
T 2.625% 11/15/20	9,500,000.00	10,313,437.50	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,687,770.49	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	658,910.15	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,153,949.21	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,681,718.72	
T 2.75% 08/15/42	9,200,000.00	8,478,734.35	
T 2.75% 11/15/42	5,800,000.00	5,337,925.77	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,094,843.82	

T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,288,095.70	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,363,349.64	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	7,780,312.48	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,419,959.01	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,830,722.66	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,142,255.83	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	14,355,500.03	
T 3.125% 05/15/21	9,500,000.00	10,641,298.84	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,265,166.00	
T 3.125% 11/15/41	9,300,000.00	9,293,279.26	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,871,656.25	
T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,627,128.88	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,840,976.58	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,661,921.85	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,426,972.64	
T 3.5% 02/15/39	4,500,000.00	4,863,955.09	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,954,285.18	
T 3.625% 02/15/21	14,500,000.00	16,794,511.75	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,495,359.37	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	7,862,832.04	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,761,035.15	
T 3.875% 08/15/40	7,000,000.00	8,043,574.21	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,670,953.15	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,833,091.80	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,212,968.75	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	732,574.21	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	12,607,968.72	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,606,445.37	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,162,902.36	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,319,019.51	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	6,107,324.20	
T 4.375% 02/15/38	2,000,000.00	2,484,726.56	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	6,102,031.25	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,491,992.18	
T 4.375% 11/15/39	6,500,000.00	8,090,849.58	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	3,157,031.25	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,302,539.03	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,531,523.44	
T 4.5% 08/15/39	4,000,000.00	5,073,828.12	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,420,292.96	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,750,195.30	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,486,824.22	
T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	1,962,158.20	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,481,300.75	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,523,158.20	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	676,513.67	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,472,843.74	
T 5.25% 02/15/29	1,900,000.00	2,556,316.41	

	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,746,494.13	
	T 5.375% 02/15/31	2,010,000.00	2,773,485.93	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,649,273.43	
	T 6.0% 02/15/26	1,900,000.00	2,684,529.30	
	T 6.125% 08/15/29	900,000.00	1,323,263.67	
	T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	3,211,282.03	
	T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,815,446.88	
	T 6.25% 08/15/23	3,500,000.00	4,919,277.33	
	T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,504,335.94	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,639,843.75	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,835,457.02	
	T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,332,068.35	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,569,888.67	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,997,257.82	
アメリカドル小計		923,810,000.00	982,639,693.18 (101,074,318,840)	
カナダドル	CAN 0.75% 05/01/14	1,000,000.00	997,340.00	
	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,945.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	1,700,000.00	1,691,865.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	950,000.00	913,933.25	
	CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	906,084.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,434,391.00	
	CAN 2% 12/01/14	5,300,000.00	5,377,830.50	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,088,530.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,155,320.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,100,000.00	3,252,117.00	
	CAN 3% 12/01/15	2,900,000.00	3,037,126.50	
	CAN 3.0% 06/01/14	5,150,000.00	5,253,334.75	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,900,000.00	2,116,353.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,350,000.00	2,640,930.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,700,000.00	2,069,367.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,050,000.00	3,441,559.00	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,330,352.75	
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,651,832.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,750,000.00	3,561,332.50	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,993,040.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,208,740.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,705,183.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,350,000.00	3,390,027.75	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,160,000.00	3,151,515.60	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,200,000.00	3,341,360.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	950,000.00	1,615,831.25	
カナダドル小計		58,910,000.00	66,525,241.85 (6,648,532,670)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	950,000.00	904,552.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	550,000.00	521,287.25	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,382,387.50	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,900,000.00	3,176,080.00	

	ACGB 4.5% 10/21/14	3,000,000.00	3,084,930.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,250,000.00	1,417,175.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,750,000.00	2,929,423.75	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,200,000.00	1,263,114.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,800,000.00	3,161,046.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,500,000.00	2,804,400.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,800,000.00	3,346,658.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,750,000.00	3,269,007.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,350,000.00	2,833,653.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,588,992.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,900,000.00	3,102,333.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,247,610.00	
オーストラリアドル小計		34,400,000.00	38,032,649.50 (3,814,294,418)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	4,450,000.00	4,493,365.25	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	833,532.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,750,000.00	3,702,562.50	
	UKT 2% 01/22/16	3,650,000.00	3,802,460.50	
	UKT 2.75% 01/22/15	2,750,000.00	2,861,031.25	
	UKT 3.25% 01/22/44	700,000.00	691,820.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,800,000.00	1,952,469.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,584,142.50	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,481,365.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,200,000.00	3,716,912.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,050,000.00	2,372,987.75	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	3,015,553.50	
	UKT 4% 09/07/16	5,000,000.00	5,575,550.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	3,000,000.00	3,592,485.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,850,000.00	3,436,245.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,264,857.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,000,000.00	2,423,200.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,150,000.00	3,749,870.25	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,950,000.00	3,516,960.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	2,987,662.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,650,000.00	3,198,907.75	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,400,000.00	4,056,421.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,550,000.00	3,163,249.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,500,000.00	4,349,817.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,700,000.00	4,528,356.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,850,000.00	3,138,220.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,900,000.00	3,710,332.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,800,000.00	3,605,756.00	
	UKT 5% 03/07/18	3,150,000.00	3,766,344.75	
	UKT 5% 03/07/25	2,700,000.00	3,492,396.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,100,000.00	5,409,952.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,760,000.00	2,546,816.80	
	UKT 8% 06/07/21	2,600,000.00	3,865,134.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,295,000.00	2,742,949.57	

	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	2,008,155.00	
イギリスポンド小計		98,605,000.00	115,637,841.37 (18,046,441,524)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	113,523.00	
	SWISS 3% 01/08/18	3,950,000.00	4,490,340.25	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	863,944.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,100,000.00	2,771,328.00	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	427,527.00	
スイスフラン小計		7,250,000.00	8,666,662.25 (918,059,532)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	500,000.00	500,732.50	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	615,891.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	400,000.00	429,880.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	450,000.00	485,309.25	
	SIGB 2.5% 06/01/19	650,000.00	715,741.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	500,000.00	512,400.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,320,862.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	450,000.00	492,126.75	
	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	395,447.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	1,036,552.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	600,000.00	689,403.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,100,000.00	1,297,813.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	2,000,000.00	2,076,940.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	892,040.00	
	SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	884,081.25	
シンガポールドル小計		11,300,000.00	12,345,220.25 (1,009,468,659)	
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	704,364.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	300,000.00	301,663.50	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,579,299.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	408,688.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	3,000,000.00	3,016,980.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,100,000.00	1,139,880.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,350,000.00	1,380,159.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,200,407.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,000,000.00	2,046,900.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,800,000.00	4,865,712.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,130,233.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,150,000.00	1,214,400.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	747,530.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,942,032.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,786,196.75	
	MGS 4.262% 09/15/16	6,100,000.00	6,347,568.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,754,590.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	300,000.00	329,523.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,352,513.50	
	MGS 5.094% 04/30/14	1,800,000.00	1,837,071.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,500,000.00	1,799,062.50	

マレーシアリングット小計		41,250,000.00	42,884,775.25 (1,457,653,510)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	7,600,000.00	7,432,914.00	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	8,099,358.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	7,150,000.00	8,563,733.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,050,000.00	10,463,429.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,050,000.00	12,297,821.25	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,800,000.00	13,769,656.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	5,900,000.00	6,381,676.00	
	SGB 5% 12/01/20	12,800,000.00	16,000,320.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	15,300,000.00	16,163,991.00	
スウェーデンクローナ小計		88,250,000.00	99,172,899.00 (1,522,303,999)	
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	4,000,000.00	3,979,340.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,600,000.00	9,828,725.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,800,000.00	10,913,868.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	6,200,000.00	7,254,248.00	
	NGB 5% 05/15/15	11,000,000.00	11,834,570.00	
ノルウェークローネ小計		39,600,000.00	43,810,751.00 (769,316,787)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	3,900,000.00	3,933,072.00	
	DGB 2% 11/15/14	9,650,000.00	9,955,470.75	
	DGB 2.5% 11/15/16	2,400,000.00	2,604,084.00	
	DGB 3% 11/15/21	15,400,000.00	17,879,631.00	
	DGB 4% 11/15/15	15,300,000.00	16,850,884.50	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,456,249.00	
	DGB 4% 11/15/19	14,100,000.00	17,138,056.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	19,300,000.00	28,574,325.50	
	DGB 7% 11/10/24	4,300,000.00	6,871,593.50	
デンマーククローネ小計		94,150,000.00	115,263,366.75 (2,039,008,957)	
メキシコペソ	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,942,512.00	
	MBONO 6% 06/18/15	75,000,000.00	78,246,000.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	7,500,000.00	8,479,725.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	32,300,000.00	35,819,731.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	47,301,655.50	
	MBONO 8% 12/07/23	21,800,000.00	27,772,219.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	55,200,000.00	74,377,860.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	43,956,911.25	
メキシコペソ小計		279,150,000.00	332,896,613.75 (2,776,357,758)	
ポーランドズロチ	POLGB 3.75% 04/25/18	4,400,000.00	4,604,094.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,300,000.00	2,457,837.50	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,260,755.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	6,100,000.00	6,520,991.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	6,190,212.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,688,880.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,150,000.00	5,439,507.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,950,000.00	4,560,097.25	

	POLGB 5.75% 04/25/29	1,550,000.00	1,987,495.25	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,400,000.00	6,524,388.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,353,672.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,400,000.00	9,131,010.00	
ポーランドズロチ小計		50,950,000.00	56,718,939.75 (1,794,587,253)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,300,000.00	26,837,615.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,850,000.00	10,463,886.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	12,100,000.00	10,091,884.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	8,700,000.00	7,331,403.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	14,670,040.00	
	SAGB 7% 02/28/31	9,200,000.00	8,737,976.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	15,300,000.00	16,438,702.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	3,500,000.00	3,885,787.50	
	SAGB 8% 12/21/18	12,700,000.00	14,103,032.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	14,000,000.00	15,469,860.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	3,900,000.00	4,213,404.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	6,000,000.00	6,347,220.00	
南アフリカランド小計		128,550,000.00	138,590,810.50 (1,514,797,558)	
ユーロ	BGB 3% 09/28/19	750,000.00	836,040.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,650,000.00	4,002,717.75	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	956,848.50	
	BGB 3.75% 09/28/15	1,900,000.00	2,061,823.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,950,000.00	4,609,373.50	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,660,260.50	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,680,506.00	
	BGB 4% 03/28/32	300,000.00	356,112.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	3,300,000.00	3,739,857.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,600,000.00	3,046,238.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,000,000.00	2,489,260.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,641,525.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,448,844.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	1,950,000.00	2,353,006.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,600,000.00	1,983,184.00	
	BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	3,933,589.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,350,000.00	4,613,569.75	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	1,995,757.50	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,547,518.50	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,678,544.00	
	BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,288,902.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,379,376.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,512,318.00	
	BTNS 2.5% 07/25/16	5,500,000.00	5,879,857.50	
	BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,305,570.00	
	BTPS 2.75% 12/01/15	1,600,000.00	1,641,056.00	
	BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,921,429.00	
	BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,053,125.00	

BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,893,352.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,000,000.00	3,084,270.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	831,628.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,676,011.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,320,406.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,050,000.00	6,332,262.75	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,000,000.00	7,380,135.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,250,000.00	7,458,836.25	
BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,521,334.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,000,000.00	3,713,320.00	
BTPS 4% 09/01/20	5,300,000.00	5,554,188.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,625,426.50	
BTPS 4.25% 02/01/19	5,000,000.00	5,356,325.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,135,407.50	
BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000.00	9,572,232.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,050,000.00	2,190,394.25	
BTPS 4.5% 02/01/18	4,250,000.00	4,606,893.75	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,350,000.00	6,847,109.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	3,600,000.00	3,895,470.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,900,000.00	3,025,831.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	1,000,000.00	1,052,770.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	4,600,000.00	4,989,482.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,237,896.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,700,000.00	6,140,667.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,360,360.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,224,219.25	
BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,206,700.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,000,000.00	4,358,520.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,720,150.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,350,000.00	3,523,513.25	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,200,000.00	3,377,200.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	5,040,000.00	5,592,837.60	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,800,000.00	6,358,946.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,380,486.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,500,000.00	3,966,462.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	3,021,824.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,000,000.00	5,935,975.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,800,000.00	4,680,194.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,482,806.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,147,664.00	
DBR 1.5% 02/15/23	2,100,000.00	2,133,442.50	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,961,842.50	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,603,610.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,790,359.00	
DBR 2.25% 09/04/20	1,400,000.00	1,543,619.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,800,000.00	4,169,208.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,582,256.00	
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	1,896,552.00	

DBR 3% 07/04/20	4,700,000.00	5,430,638.50	
DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,203,342.00	
DBR 3.25% 07/04/15	5,300,000.00	5,669,304.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,528,840.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,680,513.00	
DBR 3.5% 01/04/16	4,600,000.00	5,021,843.00	
DBR 3.5% 07/04/19	3,900,000.00	4,589,734.50	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,706,608.25	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,579,911.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	4,136,440.00	
DBR 4% 07/04/16	4,000,000.00	4,490,540.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,268,195.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,950,000.00	5,252,176.75	
DBR 4.25% 07/04/14	7,700,000.00	8,067,367.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,731,888.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,050,000.00	4,845,460.50	
DBR 4.25% 07/04/39	2,350,000.00	3,295,616.50	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,748,900.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,150,000.00	4,535,527.50	
DBR 4.75% 07/04/40	2,700,000.00	4,087,813.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,950,000.00	4,448,260.75	
DBR 5.625% 01/04/28	2,500,000.00	3,704,612.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	661,976.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,500,000.00	2,220,892.50	
DBR 6.25% 01/04/30	1,300,000.00	2,080,617.50	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,702,745.00	
FRTR 0.25% 11/25/15	1,400,000.00	1,402,401.00	
FRTR 1% 05/25/18	1,900,000.00	1,928,291.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,800,000.00	5,010,312.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,200,000.00	4,573,926.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	1,300,000.00	1,358,539.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,500,000.00	7,240,642.50	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,346,200.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	5,050,000.00	5,492,380.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,728,095.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,419,741.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,487,852.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,650,000.00	6,449,729.25	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,879,915.50	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,450,000.00	7,601,034.75	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,200,000.00	7,262,990.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,800,000.00	5,580,864.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	2,934,012.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,600,000.00	1,964,128.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,908,735.50	
FRTR 4% 10/25/38	4,500,000.00	5,429,250.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,000,000.00	7,170,000.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,674,830.00	

FRTR 4.25% 10/25/18	4,000,000.00	4,742,640.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,900,000.00	7,202,956.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,773,050.25	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,600,000.00	4,783,932.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,792,775.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,000,000.00	5,607,880.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,900,000.00	5,770,947.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,408,804.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,611,650.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,646,226.40	
IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	830,580.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,500,000.00	1,638,142.50	
IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	745,790.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,850,000.00	4,204,970.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	883,452.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,185,090.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,250,777.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	570,190.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,350,000.00	1,584,015.75	
NETHER 0.75% 04/15/15	1,000,000.00	1,013,660.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,950,000.00	2,014,291.50	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,250,000.00	1,263,637.50	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,136,420.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,265,910.50	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,250,000.00	1,289,318.75	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,463,336.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,150,000.00	4,434,669.25	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,550,000.00	2,945,772.75	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,750,000.00	3,217,596.25	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,900,000.00	2,279,905.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,890,833.75	
NETHER 3.75% 07/15/14	3,850,000.00	4,015,858.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,450,000.00	3,183,297.25	
NETHER 4% 07/15/16	2,800,000.00	3,132,850.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,150,000.00	2,558,403.25	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,850,000.00	3,336,609.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,700,000.00	3,153,829.50	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	3,014,508.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	846,777.25	
OBL 0.5% 02/23/18	2,150,000.00	2,167,597.75	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,430,444.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,068,085.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	519,747.50	
OBL 1.75% 10/09/15	2,000,000.00	2,084,640.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,651,287.50	
OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000.00	7,105,592.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,932,867.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,421,440.00	

RAGB 3.15% 06/20/44	600,000.00	685,356.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,105,890.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	900,000.00	942,979.50	
RAGB 3.4% 11/22/22	900,000.00	1,047,987.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,650,000.00	2,844,417.25	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,749,072.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	400,000.00	473,666.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	671,350.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,700,000.00	3,219,453.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,650,000.00	2,975,804.25	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,150,000.00	2,823,444.50	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,000,000.00	2,098,640.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	700,000.00	814,845.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,500,000.00	1,802,047.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,000,000.00	3,564,465.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,400,000.00	1,863,687.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,400,000.00	2,125,781.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	597,702.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	813,048.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	628,338.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	707,989.75	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,150,000.00	1,197,380.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,150,000.00	1,336,507.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	470,386.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,400,000.00	1,607,312.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,350,000.00	1,673,709.75	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,525,118.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,275,613.50	
SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,842,777.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	6,259,027.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	1,027,915.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,159,293.50	
SPGB 3.4% 04/30/14	900,000.00	920,529.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	400,000.00	415,942.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,000,000.00	4,159,900.00	
SPGB 4% 04/30/20	3,000,000.00	3,077,835.00	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,750,359.25	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,900,000.00	4,103,502.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,600,000.00	2,360,514.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	6,850,000.00	7,229,353.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,519,988.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000.00	7,762,822.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	900,000.00	960,709.50	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,000,000.00	3,209,490.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,800,000.00	1,835,379.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,951,840.00	
SPGB 4.75% 07/30/14	2,700,000.00	2,816,181.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,900,000.00	3,012,520.00	

	SPGB 4.85% 10/31/20	4,100,000.00	4,396,184.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,100,000.00	2,114,280.00	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,450,000.00	2,680,373.50	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,792,428.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	4,300,000.00	4,758,788.50	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,650,000.00	2,995,334.75	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,228,508.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,475,890.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,650,000.00	3,057,344.75	
	ユーロ小計	687,970,000.00	774,200,285.75 (102,101,533,684)	
国債証券合計			245,486,675,149 (245,486,675,149)	
合計			245,486,675,149 (245,486,675,149)	

(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%	41.2%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.7%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.0%	7.4%
スイスフラン	国債証券 5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 21銘柄	100.0%	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	1.1%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.7%
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%	41.6%

(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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「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 5月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,061,593,846
株式	160,296,180,080
派生商品評価勘定	258,556,250
未収入金	1,710,979,668
未収配当金	1,416,266,221
未収利息	1,511
差入委託証拠金	73,485,000
流動資産合計	164,817,062,576
資産合計	164,817,062,576
負債の部	
流動負債	
前受金	229,964,000
未払解約金	1,585,706,822
流動負債合計	1,815,670,822
負債合計	1,815,670,822
純資産の部	
元本等	
元本	158,182,172,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,819,219,311
元本等合計	163,001,391,754
純資産合計	163,001,391,754
負債純資産合計	164,817,062,576

(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 5月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (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。
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 5月20日現在
1. 特定期間の期首元本額 特定期間中の追加設定元本額 特定期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	196,347,513,789円 7,124,868,060円 45,290,209,406円 158,182,172,443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) SBI資産設計オープン(資産成長型) SBI資産設計オープン(分配型) SMT TOPIXインデックス・オープン 世界経済インデックスファンド マイセレクション25 マイセレクション50 マイセレクション75 日本株式インデックス・オープン DCマイセレクション25 DCマイセレクション50 DCマイセレクション75 DC日本株式インデックス・オープン DCマイセレクションS25 DCマイセレクションS50 DCマイセレクションS75 DC日本株式インデックス・オープンS DCターゲット・イヤー ファンド2015 DCターゲット・イヤー ファンド2025 DCターゲット・イヤー ファンド2035 DCターゲット・イヤー ファンド2045 DC世界経済インデックスファンド 日本株式インデックス・オープン(SMA専用) 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用) マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用) マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用) 日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用) 国内バランス30VA2(適格機関投資家専用) 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用) バランス30VA1(適格機関投資家専用) バランス50VA1(適格機関投資家専用) バランス25VA2(適格機関投資家専用) バランス50VA2(適格機関投資家専用) バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	2,573,910,633円 1,493,671,491円 31,450,795円 6,485,171,787円 212,783,132円 70,598,503円 168,136,044円 177,749,699円 16,940,324,215円 4,410,566,338円 14,985,262,893円 14,971,629,124円 3,719,477,957円 1,482,598,495円 4,833,150,052円 3,119,604,742円 1,199,272,117円 18,202,856円 352,841,374円 360,950,485円 162,061,217円 97,602,342円 363,825,880円 280,487,773円 645,198,896円 305,565,448円 2,661,127,595円 1,541,631円 34,057,582円 1,499,913,870円 6,130,496,509円 14,477,840,271円 4,755,832,454円 9,692,408,858円 1,997,900,700円

バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,989,726,319円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,551,311,287円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,433,431,105円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,281,215,588円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,578,807,412円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,281,385,840円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,731,311,626円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	137,847,852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)	4,342,358,632円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,431,431,380円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,710,131,644円
2. 計算日における受益権総数	158,182,172,443口
3. 1口当たり純資産額	1.0305円
(1万口当たり純資産額)	(10,305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 5月20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 5月20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。
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 5月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	67,805,167,154
合計	67,805,167,154

(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24年5月30日から平成25年5月20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)

I. 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 5月20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	2,379,658,750	—	2,638,215,000	258,556,250
合計		2,379,658,750	—	2,638,215,000	258,556,250

(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。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 5月20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 5月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年5月20日現在)

① 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	43,000	245.00	10,535,000	
日本水産	109,700	230.00	25,231,000	
マルハニチロホールディングス	196,000	210.00	41,160,000	
サカタのタネ	15,100	1,512.00	22,831,200	
ホクト	10,400	1,964.00	20,425,600	
住石ホールディングス	30,000	139.00	4,170,000	
日鉄鉱業	26,000	453.00	11,778,000	
三井松島産業	67,000	180.00	12,060,000	
国際石油開発帝石	1,240	475,500.00	589,620,000	
日本海洋掘削	2,500	10,220.00	25,550,000	
関東天然瓦斯開発	10,000	706.00	7,060,000	
石油資源開発	14,500	4,690.00	68,005,000	
ショーボンドホールディングス	9,100	4,305.00	39,175,500	
ミライト・ホールディングス	29,000	1,021.00	29,609,000	
タマホーム	4,500	1,542.00	6,939,000	
ダイセキ環境ソリューション	11	182,900.00	2,011,900	
安藤・間	57,500	234.00	13,455,000	
東急建設	43,810	256.00	11,215,360	
コムシスホールディングス	49,500	1,350.00	66,825,000	
ミサワホーム	12,900	2,318.00	29,902,200	
高松コンストラクショングループ	7,900	1,621.00	12,805,900	
東建コーポレーション	3,990	5,910.00	23,580,900	
ヤマウラ	9,500	295.00	2,802,500	
大成建設	516,000	398.00	205,368,000	
大林組	307,000	614.00	188,498,000	
清水建設	314,000	425.00	133,450,000	
長谷工コーポレーション	637,500	141.00	89,887,500	
松井建設	13,000	370.00	4,810,000	
鹿島建設	450,000	359.00	161,550,000	
鉄建建設	62,000	133.00	8,246,000	
太平工業	21,000	366.00	7,686,000	
西松建設	133,000	235.00	31,255,000	
三井住友建設	176,000	93.00	16,368,000	
前田建設工業	65,000	502.00	32,630,000	
ナカノフドー建設	17,000	249.00	4,233,000	
奥村組	92,000	416.00	38,272,000	
大和小田急建設	5,000	223.00	1,115,000	
東鉄工業	13,300	1,557.00	20,708,100	
イチケン	20,000	188.00	3,760,000	

戸田建設	119,000	314.00	37,366,000	
熊谷組	74,000	117.00	8,658,000	
青木あすなろ建設	7,500	529.00	3,967,500	
北野建設	25,000	220.00	5,500,000	
植木組	21,000	194.00	4,074,000	
三井ホーム	14,000	575.00	8,050,000	
矢作建設工業	14,800	462.00	6,837,600	
ピーエス三菱	8,200	492.00	4,034,400	
大東建託	38,800	9,760.00	378,688,000	
新日本建設	15,600	343.00	5,350,800	
N I P P O	24,000	1,551.00	37,224,000	
東亜道路工業	22,000	488.00	10,736,000	
前田道路	29,000	1,526.00	44,254,000	
日本道路	31,000	604.00	18,724,000	
東亜建設工業	89,000	159.00	14,151,000	
東洋建設	31,700	299.00	9,478,300	
五洋建設	121,500	274.00	33,291,000	
大林道路	14,000	487.00	6,818,000	
福田組	18,000	385.00	6,930,000	
住友林業	70,400	1,331.00	93,702,400	
日本基礎技術	12,300	333.00	4,095,900	
日成ビルド工業	41,000	203.00	8,323,000	
巴コーポレーション	13,800	364.00	5,023,200	
パナホーム	39,000	739.00	28,821,000	
大和ハウス工業	254,000	2,207.00	560,578,000	
ライト工業	23,700	523.00	12,395,100	
積水ハウス	306,000	1,469.00	449,514,000	
日特建設	11,200	364.00	4,076,800	
北陸電気工事	7,000	392.00	2,744,000	
ユアテック	16,000	309.00	4,944,000	
西部電気工業	10,000	436.00	4,360,000	
四電工	9,000	341.00	3,069,000	
中電工	14,800	1,118.00	16,546,400	
関電工	47,000	466.00	21,902,000	
きんでん	68,000	880.00	59,840,000	
東京エネシス	11,000	468.00	5,148,000	
トーエネック	14,000	474.00	6,636,000	
住友電設	7,400	1,518.00	11,233,200	
日本電設工業	19,000	1,174.00	22,306,000	
協和エクシオ	36,700	1,181.00	43,342,700	
新日本空調	9,200	625.00	5,750,000	
N D S	16,000	295.00	4,720,000	
九電工	17,000	465.00	7,905,000	
三機工業	24,000	666.00	15,984,000	
日揮	103,000	3,550.00	365,650,000	
中外炉工業	38,000	262.00	9,956,000	
ヤマト	14,000	377.00	5,278,000	
太平電業	13,000	643.00	8,359,000	

高砂熱学工業	29,700	869.00	25,809,300	
三晃金属工業	19,000	239.00	4,541,000	
朝日工業社	12,000	354.00	4,248,000	
大気社	14,800	2,414.00	35,727,200	
ダイダン	15,000	553.00	8,295,000	
日比谷総合設備	12,500	988.00	12,350,000	
東芝プラントシステム	17,000	1,518.00	25,806,000	
東洋エンジニアリング	57,000	499.00	28,443,000	
千代田化工建設	74,000	1,157.00	85,618,000	
新興プランテック	21,000	776.00	16,296,000	
日本製粉	63,000	492.00	30,996,000	
日清製粉グループ本社	92,500	1,333.00	123,302,500	
日東富士製粉	8,000	317.00	2,536,000	
昭和産業	42,000	322.00	13,524,000	
鳥越製粉	8,200	646.00	5,297,200	
協同飼料	35,000	127.00	4,445,000	
中部飼料	9,100	567.00	5,159,700	
日本配合飼料	29,000	137.00	3,973,000	
東洋精糖	16,000	105.00	1,680,000	
日本甜菜製糖	52,000	185.00	9,620,000	
三井製糖	40,000	313.00	12,520,000	
森永製菓	100,000	217.00	21,700,000	
中村屋	24,000	426.00	10,224,000	
江崎グリコ	37,000	1,147.00	42,439,000	
名糖産業	4,600	1,033.00	4,751,800	
不二家	58,000	208.00	12,064,000	
山崎製パン	75,000	1,187.00	89,025,000	
モロゾフ	16,000	316.00	5,056,000	
亀田製菓	5,700	3,470.00	19,779,000	
カルビー	9,300	9,940.00	92,442,000	
森永乳業	86,000	296.00	25,456,000	
ヤクルト本社	59,700	5,100.00	304,470,000	
明治ホールディングス	30,200	4,770.00	144,054,000	
雪印メグミルク	20,000	1,473.00	29,460,000	
プリマハム	57,000	247.00	14,079,000	
日本ハム	78,000	1,608.00	125,424,000	
伊藤ハム	56,000	474.00	26,544,000	
丸大食品	49,000	321.00	15,729,000	
米久	4,100	873.00	3,579,300	
S Foods	6,500	966.00	6,279,000	
サッポロホールディングス	167,000	434.00	72,478,000	
アサヒグループホールディングス	205,100	2,686.00	550,898,600	
麒麟ホールディングス	436,000	1,849.00	806,164,000	
宝ホールディングス	80,000	1,144.00	91,520,000	
オエノンホールディングス	26,000	269.00	6,994,000	
養命酒製造	8,000	868.00	6,944,000	
三国コカ・コーラボトリング	10,700	1,238.00	13,246,600	
コカ・コーラウエスト	34,600	1,988.00	68,784,800	

コカ・コーラ セントラル ジャパン	12,800	1,582.00	20,249,600	
ダイドードリンコ	5,200	4,345.00	22,594,000	
伊藤園	27,800	2,334.00	64,885,200	
キーコーヒー	8,900	1,540.00	13,706,000	
ユニカフェ	2,800	548.00	1,534,400	
ジャパンフーズ	1,400	1,364.00	1,909,600	
日清オイリオグループ	44,000	382.00	16,808,000	
不二製油	24,800	1,702.00	42,209,600	
J-オイルミルズ	43,000	306.00	13,158,000	
キッコーマン	83,000	1,959.00	162,597,000	
味の素	251,000	1,510.00	379,010,000	
キューピー	51,900	1,574.00	81,690,600	
ハウス食品	35,900	1,748.00	62,753,200	
カゴメ	36,600	1,786.00	65,367,600	
焼津水産化学工業	4,800	900.00	4,320,000	
アリアケジャパン	9,300	2,371.00	22,050,300	
ニチレイ	109,000	563.00	61,367,000	
東洋水産	47,000	3,450.00	162,150,000	
日清食品ホールディングス	39,900	4,280.00	170,772,000	
永谷園	10,000	887.00	8,870,000	
フジッコ	11,000	1,142.00	12,562,000	
ロック・フィールド	5,300	1,926.00	10,207,800	
日本たばこ産業	566,800	3,790.00	2,148,172,000	
ケンコーマヨネーズ	3,100	909.00	2,817,900	
わらべや日洋	6,200	1,700.00	10,540,000	
なとり	4,700	952.00	4,474,400	
ミヨシ油脂	32,000	167.00	5,344,000	
片倉工業	12,000	1,664.00	19,968,000	
グンゼ	71,000	276.00	19,596,000	
東洋紡	403,000	174.00	70,122,000	
ユニチカ	261,000	64.00	16,704,000	
富士紡ホールディングス	46,000	263.00	12,098,000	
日清紡ホールディングス	61,000	813.00	49,593,000	
倉敷紡績	98,000	186.00	18,228,000	
シキボウ	58,000	130.00	7,540,000	
日本毛織	30,000	832.00	24,960,000	
トーア紡コーポレーション	43,000	77.00	3,311,000	
ダイドーリミテッド	10,800	718.00	7,754,400	
帝国繊維	10,000	830.00	8,300,000	
帝人	362,000	263.00	95,206,000	
東レ	738,000	747.00	551,286,000	
サカイオーベックス	26,000	144.00	3,744,000	
住江織物	28,000	283.00	7,924,000	
日本フェルト	5,500	454.00	2,497,000	
イチカワ	7,000	284.00	1,988,000	
日本バイリーン	12,000	539.00	6,468,000	
芦森工業	27,000	149.00	4,023,000	
アツギ	80,000	118.00	9,440,000	

ダイニック	18,000	195.00	3,510,000	
セーレン	25,700	730.00	18,761,000	
東海染工	13,000	123.00	1,599,000	
小松精練	16,000	526.00	8,416,000	
ワコールホールディングス	57,000	1,059.00	60,363,000	
ホギメディカル	6,000	6,100.00	36,600,000	
レナウン	20,600	157.00	3,234,200	
クラウドピア	1,400	1,371.00	1,919,400	
T S I ホールディングス	50,000	736.00	36,800,000	
三陽商会	50,000	294.00	14,700,000	
オンワードホールディングス	64,000	911.00	58,304,000	
ルック	18,000	370.00	6,660,000	
ゴールドウイン	22,000	539.00	11,858,000	
デサント	24,000	725.00	17,400,000	
ヤマトインターナショナル	6,000	468.00	2,808,000	
特種東海製紙	55,000	215.00	11,825,000	
王子ホールディングス	421,000	411.00	173,031,000	
日本製紙	46,000	1,635.00	75,210,000	
三菱製紙	136,000	103.00	14,008,000	
北越紀州製紙	59,000	520.00	30,680,000	
中越パルプ工業	36,000	152.00	5,472,000	
巴川製紙所	15,000	190.00	2,850,000	
大王製紙	40,000	658.00	26,320,000	
レンゴー	77,000	554.00	42,658,000	
トーモク	30,000	333.00	9,990,000	
ザ・バック	6,700	1,927.00	12,910,900	
クラレ	162,300	1,610.00	261,303,000	
旭化成	595,000	725.00	431,375,000	
共和レザー	5,500	326.00	1,793,000	
コープケミカル	14,000	157.00	2,198,000	
昭和電工	592,000	163.00	96,496,000	
住友化学	655,000	397.00	260,035,000	
日本化成	18,000	160.00	2,880,000	
住友精化	18,000	424.00	7,632,000	
日産化学工業	65,300	1,467.00	95,795,100	
ラサ工業	34,000	146.00	4,964,000	
クレハ	67,000	373.00	24,991,000	
テイカ	16,000	302.00	4,832,000	
石原産業	171,000	86.00	14,706,000	
片倉チッカリン	6,000	316.00	1,896,000	
日本曹達	57,000	517.00	29,469,000	
東ソー	255,000	371.00	94,605,000	
トクヤマ	138,000	340.00	46,920,000	
セントラル硝子	85,000	343.00	29,155,000	
東亜合成	112,000	457.00	51,184,000	
ダイソー	38,000	313.00	11,894,000	
関東電化工業	23,000	293.00	6,739,000	
電気化学工業	191,000	386.00	73,726,000	

信越化学工業	171,000	7,180.00	1,227,780,000	
日本カーバイド工業	28,000	438.00	12,264,000	
堺化学工業	36,000	314.00	11,304,000	
エア・ウォーター	79,000	1,558.00	123,082,000	
大陽日酸	125,000	833.00	104,125,000	
日本化学工業	35,000	146.00	5,110,000	
日本パーカライジング	22,000	1,979.00	43,538,000	
高压ガス工業	14,000	571.00	7,994,000	
チタン工業	11,000	240.00	2,640,000	
四国化成工業	14,000	703.00	9,842,000	
戸田工業	14,000	335.00	4,690,000	
ステラ ケミファ	4,200	1,835.00	7,707,000	
保土谷化学工業	21,000	214.00	4,494,000	
日本触媒	69,000	1,114.00	76,866,000	
大日精化工業	34,000	461.00	15,674,000	
カネカ	119,000	675.00	80,325,000	
三菱瓦斯化学	150,000	833.00	124,950,000	
三井化学	404,000	266.00	107,464,000	
J S R	87,400	2,269.00	198,310,600	
東京応化工業	18,400	2,420.00	44,528,000	
大阪有機化学工業	6,300	474.00	2,986,200	
三菱ケミカルホールディングス	596,000	553.00	329,588,000	
日本合成化学工業	19,000	1,199.00	22,781,000	
ダイセル	113,000	899.00	101,587,000	
住友ベークライト	74,000	448.00	33,152,000	
積水化学工業	196,000	1,209.00	236,964,000	
日本ゼオン	82,000	1,179.00	96,678,000	
アイカ工業	26,700	2,099.00	56,043,300	
宇部興産	456,000	225.00	102,600,000	
積水樹脂	13,000	1,426.00	18,538,000	
タキロン	22,000	407.00	8,954,000	
旭有機材工業	34,000	233.00	7,922,000	
日立化成	41,200	1,752.00	72,182,400	
ニチバン	9,000	422.00	3,798,000	
リケンテクノス	15,000	326.00	4,890,000	
大倉工業	23,000	453.00	10,419,000	
積水化成品工業	24,000	266.00	6,384,000	
群栄化学工業	25,000	239.00	5,975,000	
タイガースポリマー	4,700	424.00	1,992,800	
ミライアル	2,400	2,269.00	5,445,600	
日本カーリット	7,600	689.00	5,236,400	
日本化薬	67,000	1,249.00	83,683,000	
日本精化	7,900	681.00	5,379,900	
A D E K A	41,000	1,007.00	41,287,000	
日油	74,000	553.00	40,922,000	
ハリマ化成グループ	8,100	504.00	4,082,400	
花王	252,800	3,510.00	887,328,000	
第一工業製薬	17,000	268.00	4,556,000	

三洋化成工業	30,000	648.00	19,440,000	
大日本塗料	55,000	172.00	9,460,000	
日本ペイント	83,000	1,218.00	101,094,000	
関西ペイント	108,000	1,427.00	154,116,000	
中国塗料	29,000	512.00	14,848,000	
日本特殊塗料	7,400	448.00	3,315,200	
藤倉化成	11,100	480.00	5,328,000	
太陽ホールディングス	7,800	3,565.00	27,807,000	
D I C	338,000	247.00	83,486,000	
サカタインクス	19,000	771.00	14,649,000	
東洋インキＳＣホールディングス	86,000	494.00	42,484,000	
T&K TOKA	3,200	2,184.00	6,988,800	
富士フイルムホールディングス	203,600	2,495.00	507,982,000	
資生堂	169,600	1,583.00	268,476,800	
ライオン	110,000	631.00	69,410,000	
高砂香料工業	31,000	568.00	17,608,000	
マンダム	10,200	3,555.00	36,261,000	
ミルボン	4,700	3,745.00	17,601,500	
ファンケル	23,900	1,139.00	27,222,100	
コーセー	17,100	2,612.00	44,665,200	
ドクターシーラボ	65	322,500.00	20,962,500	
シーボン	700	2,107.00	1,474,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	11,300	3,635.00	41,075,500	
ノエビアホールディングス	5,800	1,661.00	9,633,800	
エスター	5,900	1,002.00	5,911,800	
コニシ	6,900	1,770.00	12,213,000	
長谷川香料	12,100	1,461.00	17,678,100	
星光PMC	3,900	452.00	1,762,800	
小林製薬	14,400	5,340.00	76,896,000	
荒川化学工業	7,400	821.00	6,075,400	
メック	6,800	658.00	4,474,400	
日本高純度化学	25	264,000.00	6,600,000	
J C U	1,400	5,150.00	7,210,000	
新田ゼラチン	3,800	1,606.00	6,102,800	
アース製薬	6,900	3,730.00	25,737,000	
イハラケミカル工業	16,000	780.00	12,480,000	
北興化学工業	9,000	405.00	3,645,000	
大成ラミック	2,700	2,445.00	6,601,500	
クミアイ化学工業	20,000	737.00	14,740,000	
日本農薬	22,000	1,082.00	23,804,000	
アキレス	75,000	144.00	10,800,000	
有沢製作所	14,800	471.00	6,970,800	
日東電工	78,600	7,150.00	561,990,000	
レック	3,000	1,257.00	3,771,000	
きもと	8,500	825.00	7,012,500	
藤森工業	8,100	3,435.00	27,823,500	
前澤化成工業	6,700	1,094.00	7,329,800	
J S P	6,200	1,631.00	10,112,200	

エフピコ	4,700	6,290.00	29,563,000	
天馬	7,600	1,361.00	10,343,600	
信越ポリマー	18,700	391.00	7,311,700	
東リ	25,000	224.00	5,600,000	
ニフコ	21,300	2,336.00	49,756,800	
日本バルカー工業	40,000	267.00	10,680,000	
ユニ・チャーム	52,600	6,470.00	340,322,000	
協和発酵キリン	114,000	1,228.00	139,992,000	
武田薬品工業	357,100	4,950.00	1,767,645,000	
アステラス製薬	211,600	5,700.00	1,206,120,000	
大日本住友製薬	67,500	1,731.00	116,842,500	
塩野義製薬	138,900	2,287.00	317,664,300	
田辺三菱製薬	79,300	1,388.00	110,068,400	
わかもと製薬	11,000	312.00	3,432,000	
あすか製薬	11,000	739.00	8,129,000	
日本新薬	20,000	1,746.00	34,920,000	
中外製薬	110,700	2,422.00	268,115,400	
科研製薬	37,000	1,723.00	63,751,000	
エーザイ	117,400	4,460.00	523,604,000	
ロート製薬	40,000	1,532.00	61,280,000	
小野薬品工業	46,600	6,660.00	310,356,000	
久光製薬	29,600	5,620.00	166,352,000	
有機合成薬品工業	7,000	322.00	2,254,000	
持田製薬	35,000	1,452.00	50,820,000	
参天製薬	32,600	4,535.00	147,841,000	
扶桑薬品工業	32,000	400.00	12,800,000	
日本ケミファ	13,000	636.00	8,268,000	
ツムラ	26,000	3,135.00	81,510,000	
日医工	13,800	2,504.00	34,555,200	
キッセイ薬品工業	17,700	2,121.00	37,541,700	
生化学工業	18,200	1,341.00	24,406,200	
栄研化学	6,800	2,060.00	14,008,000	
日水製薬	3,800	1,223.00	4,647,400	
鳥居薬品	5,700	2,218.00	12,642,600	
東和薬品	4,900	4,705.00	23,054,500	
富士製薬工業	2,500	2,196.00	5,490,000	
沢井製薬	6,300	12,220.00	76,986,000	
ゼリア新薬工業	14,000	1,560.00	21,840,000	
第一三共	300,600	1,965.00	590,679,000	
キョーリン製薬ホールディングス	25,400	2,431.00	61,747,400	
大幸薬品	4,400	1,699.00	7,475,600	
ダイト	3,100	1,527.00	4,733,700	
大塚ホールディングス	189,200	3,530.00	667,876,000	
大正製薬ホールディングス	22,900	7,180.00	164,422,000	
日本コークス工業	77,000	125.00	9,625,000	
昭和シェル石油	85,200	895.00	76,254,000	
コスモ石油	264,000	216.00	57,024,000	
ニチレキ	12,000	766.00	9,192,000	

東燃ゼネラル石油	144,000	1,087.00	156,528,000	
ユシロ化学工業	5,200	1,060.00	5,512,000	
ビーピー・カストロール	3,900	469.00	1,829,100	
AOCホールディングス	22,100	348.00	7,690,800	
MORESCO	1,800	1,251.00	2,251,800	
出光興産	11,300	8,460.00	95,598,000	
JXホールディングス	1,058,000	553.00	585,074,000	
横浜ゴム	107,000	1,245.00	133,215,000	
東洋ゴム工業	79,000	587.00	46,373,000	
ブリヂストン	298,800	3,645.00	1,089,126,000	
住友ゴム工業	74,300	1,878.00	139,535,400	
藤倉ゴム工業	5,300	372.00	1,971,600	
オカモト	33,000	354.00	11,682,000	
フコク	4,000	911.00	3,644,000	
ニッタ	9,400	2,232.00	20,980,800	
東海ゴム工業	17,600	1,038.00	18,268,800	
三ツ星ベルト	24,000	538.00	12,912,000	
バンドー化学	32,000	402.00	12,864,000	
日東紡績	70,000	373.00	26,110,000	
旭硝子	470,000	814.00	382,580,000	
日本板硝子	434,000	125.00	54,250,000	
石塚硝子	12,000	210.00	2,520,000	
日本山村硝子	38,000	188.00	7,144,000	
日本電気硝子	169,000	638.00	107,822,000	
オハラ	3,700	740.00	2,738,000	
住友大阪セメント	169,000	329.00	55,601,000	
太平洋セメント	526,000	317.00	166,742,000	
デイ・シイ	11,000	331.00	3,641,000	
日本ヒューム	9,000	670.00	6,030,000	
日本コンクリート工業	16,000	313.00	5,008,000	
ジャパンパイル	7,700	603.00	4,643,100	
東海カーボン	83,000	327.00	27,141,000	
日本カーボン	50,000	235.00	11,750,000	
東洋炭素	5,300	2,356.00	12,486,800	
ノリタケカンパニーリミテド	49,000	290.00	14,210,000	
TOTO	147,000	1,101.00	161,847,000	
日本碍子	124,000	1,520.00	188,480,000	
日本特殊陶業	82,000	2,074.00	170,068,000	
MARUWA	2,100	3,780.00	7,938,000	
品川リフラクトリーズ	25,000	216.00	5,400,000	
黒崎播磨	23,000	232.00	5,336,000	
東京窯業	12,000	189.00	2,268,000	
ニッカトー	3,200	497.00	1,590,400	
フジミインコーポレーテッド	8,700	1,280.00	11,136,000	
ニチアス	43,000	657.00	28,251,000	
ニチハ	10,600	1,601.00	16,970,600	
新日鐵住金	4,029,000	277.00	1,116,033,000	
神戸製鋼所	1,323,000	148.00	195,804,000	

合同製鐵	54,000	178.00	9,612,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	243,200	2,324.00	565,196,800	
日新製鋼ホールディングス	40,800	1,002.00	40,881,600	
東京製鐵	53,300	422.00	22,492,600	
共英製鋼	8,900	1,874.00	16,678,600	
大和工業	19,700	3,630.00	71,511,000	
東京鐵鋼	19,000	380.00	7,220,000	
大阪製鐵	4,800	1,984.00	9,523,200	
淀川製鋼所	68,000	441.00	29,988,000	
東洋鋼鈑	20,000	363.00	7,260,000	
住友鋼管	6,500	1,035.00	6,727,500	
丸一鋼管	31,900	2,643.00	84,311,700	
モリ工業	15,000	347.00	5,205,000	
大同特殊鋼	147,000	642.00	94,374,000	
日本高周波鋼業	38,000	101.00	3,838,000	
日本冶金工業	74,500	139.00	10,355,500	
山陽特殊製鋼	48,000	559.00	26,832,000	
愛知製鋼	51,000	468.00	23,868,000	
日立金属	68,000	1,186.00	80,648,000	
日本金属	25,000	136.00	3,400,000	
大太平洋金属	61,000	556.00	33,916,000	
日本電工	38,000	336.00	12,768,000	
栗本鐵工所	42,000	296.00	12,432,000	
日本鑄鉄管	11,000	249.00	2,739,000	
三菱製鋼	58,000	238.00	13,804,000	
日亜鋼業	13,000	322.00	4,186,000	
日本精線	7,000	449.00	3,143,000	
シンニッタン	7,500	415.00	3,112,500	
新家工業	21,000	147.00	3,087,000	
大紀アルミニウム工業所	16,000	323.00	5,168,000	
日本軽金属ホールディングス	200,900	135.00	27,121,500	
三井金属鉱業	243,000	254.00	61,722,000	
東邦亜鉛	54,000	392.00	21,168,000	
三菱マテリアル	558,000	348.00	194,184,000	
住友金属鉱山	247,000	1,446.00	357,162,000	
DOWAホールディングス	105,000	894.00	93,870,000	
古河機械金属	161,000	133.00	21,413,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,400	2,158.00	20,285,200	
東邦チタニウム	16,200	854.00	13,834,800	
住友軽金属工業	231,000	108.00	24,948,000	
古河スカイ	32,000	320.00	10,240,000	
古河電気工業	300,000	288.00	86,400,000	
住友電気工業	336,700	1,449.00	487,878,300	
フジクラ	153,000	386.00	59,058,000	
昭和電線ホールディングス	122,000	98.00	11,956,000	
タツタ電線	17,900	879.00	15,734,100	
日立電線	74,000	200.00	14,800,000	
沖電線	10,000	168.00	1,680,000	

カナレ電気	1,400	1,607.00	2,249,800	
平河ヒューテック	2,300	841.00	1,934,300	
リョービ	53,000	324.00	17,172,000	
アサヒホールディングス	14,400	2,110.00	30,384,000	
稲葉製作所	4,100	1,572.00	6,445,200	
トーカロ	5,400	1,676.00	9,050,400	
アルファC o	3,800	1,130.00	4,294,000	
SUMCO	58,600	1,337.00	78,348,200	
川田テクノロジーズ	2,500	3,115.00	7,787,500	
東洋製罐グループホールディングス	67,700	1,623.00	109,877,100	
ホッカンホールディングス	26,000	326.00	8,476,000	
コロナ	4,400	1,119.00	4,923,600	
横河ブリッジホールディングス	19,000	1,059.00	20,121,000	
駒井ハルテック	21,000	243.00	5,103,000	
高田機工	10,000	230.00	2,300,000	
三和ホールディングス	88,000	606.00	53,328,000	
文化シャッター	26,000	681.00	17,706,000	
三協立山	12,900	2,538.00	32,740,200	
東洋シャッター	3,200	664.00	2,124,800	
LIXILグループ	132,800	2,581.00	342,756,800	
日本ファイルコン	8,900	413.00	3,675,700	
ノーリツ	18,700	1,882.00	35,193,400	
長府製作所	9,200	2,356.00	21,675,200	
リンナイ	15,300	8,150.00	124,695,000	
ダイニチ工業	4,900	831.00	4,071,900	
日東精工	14,000	372.00	5,208,000	
三洋工業	15,000	213.00	3,195,000	
岡部	19,100	1,047.00	19,997,700	
東プレ	18,400	1,015.00	18,676,000	
高周波熱錬	13,000	799.00	10,387,000	
東京製綱	64,000	138.00	8,832,000	
パイオラックス	4,100	3,045.00	12,484,500	
日本発條	69,000	1,284.00	88,596,000	
中央発條	13,000	349.00	4,537,000	
三益半導体工業	8,200	1,081.00	8,864,200	
アタカ大機	6,000	416.00	2,496,000	
日本製鋼所	147,000	723.00	106,281,000	
三浦工業	14,200	2,380.00	33,796,000	
タクマ	33,000	759.00	25,047,000	
ツガミ	25,000	540.00	13,500,000	
オークマ	62,000	989.00	61,318,000	
東芝機械	47,000	587.00	27,589,000	
アマダ	146,000	883.00	128,918,000	
アイダエンジニアリング	22,400	844.00	18,905,600	
滝澤鉄工所	28,000	185.00	5,180,000	
牧野フライス製作所	45,000	730.00	32,850,000	
オーエスジー	39,200	1,724.00	67,580,800	
ダイジェット工業	17,000	165.00	2,805,000	

旭ダイヤモンド工業	22,900	1,119.00	25,625,100	
森精機製作所	50,300	1,460.00	73,438,000	
ディスコ	10,600	6,930.00	73,458,000	
日東工器	5,500	1,875.00	10,312,500	
豊和工業	62,000	127.00	7,874,000	
大阪機工	37,000	180.00	6,660,000	
東洋機械金属	8,500	256.00	2,176,000	
津田駒工業	23,000	230.00	5,290,000	
島精機製作所	12,400	2,552.00	31,644,800	
日阪製作所	12,000	1,019.00	12,228,000	
やまびこ	3,900	3,685.00	14,371,500	
ペガサスミシン製造	10,900	390.00	4,251,000	
ナブテスコ	47,100	2,400.00	113,040,000	
三井海洋開発	7,900	3,780.00	29,862,000	
レオン自動機	9,000	248.00	2,232,000	
SMC	28,400	22,480.00	638,432,000	
新川	8,200	626.00	5,133,200	
ホソカワミクロン	16,000	855.00	13,680,000	
ユニオンツール	5,300	2,235.00	11,845,500	
オイレス工業	9,900	2,217.00	21,948,300	
サトーホールディングス	10,100	1,992.00	20,119,200	
日本エアータック	4,200	598.00	2,511,600	
日精樹脂工業	8,200	720.00	5,904,000	
ワイエイシイ	4,400	677.00	2,978,800	
小松製作所	444,600	2,920.00	1,298,232,000	
住友重機械工業	261,000	483.00	126,063,000	
日立建機	48,700	2,729.00	132,902,300	
日工	13,000	389.00	5,057,000	
巴工業	3,700	2,006.00	7,422,200	
井関農機	92,000	429.00	39,468,000	
TOWA	9,400	791.00	7,435,400	
丸山製作所	24,000	364.00	8,736,000	
北川鉄工所	43,000	180.00	7,740,000	
クボタ	497,000	1,722.00	855,834,000	
荏原実業	2,300	1,471.00	3,383,300	
三菱化工機	32,000	215.00	6,880,000	
月島機械	16,000	1,092.00	17,472,000	
帝国電機製作所	3,100	1,953.00	6,054,300	
新東工業	19,200	964.00	18,508,800	
澁谷工業	6,000	891.00	5,346,000	
アイチ コーポレーション	15,800	525.00	8,295,000	
小森コーポレーション	23,200	1,370.00	31,784,000	
鶴見製作所	7,000	877.00	6,139,000	
住友精密工業	15,000	521.00	7,815,000	
酒井重工業	18,000	315.00	5,670,000	
荏原製作所	196,000	573.00	112,308,000	
石井鐵工所	18,000	329.00	5,922,000	
西島製作所	11,000	1,073.00	11,803,000	

ダイキン工業	124,300	4,680.00	581,724,000	
オルガノ	16,000	582.00	9,312,000	
トーヨーカネツ	52,000	378.00	19,656,000	
栗田工業	52,600	2,262.00	118,981,200	
椿本チエイン	49,000	645.00	31,605,000	
大同工業	23,000	238.00	5,474,000	
日本コンベヤ	29,000	83.00	2,407,000	
木村化工機	9,800	778.00	7,624,400	
アネスト岩田	15,000	487.00	7,305,000	
ダイフク	42,500	928.00	39,440,000	
加藤製作所	23,000	447.00	10,281,000	
油研工業	23,000	262.00	6,026,000	
タダノ	44,000	1,369.00	60,236,000	
フジテック	27,000	1,030.00	27,810,000	
CKD	25,800	911.00	23,503,800	
キトー	6,000	1,641.00	9,846,000	
平和	20,000	1,937.00	38,740,000	
理想科学工業	6,100	2,286.00	13,944,600	
SANKYO	27,600	4,615.00	127,374,000	
日本金銭機械	8,600	1,658.00	14,258,800	
マースエンジニアリング	5,100	2,180.00	11,118,000	
福島工業	2,600	2,850.00	7,410,000	
オーイズミ	3,800	1,215.00	4,617,000	
ダイコク電機	3,900	2,199.00	8,576,100	
アマノ	27,600	1,154.00	31,850,400	
サンデン	53,000	435.00	23,055,000	
マックス	14,000	1,224.00	17,136,000	
グローリー	27,200	2,786.00	75,779,200	
大和冷機工業	15,000	618.00	9,270,000	
セガサミーホールディングス	97,900	2,684.00	262,763,600	
日本ピストンリング	33,000	208.00	6,864,000	
リケン	34,000	520.00	17,680,000	
TPR	10,600	1,922.00	20,373,200	
ホシザキ電機	19,900	3,500.00	69,650,000	
大豊工業	6,700	1,425.00	9,547,500	
日本精工	203,000	1,066.00	216,398,000	
NTN	198,000	375.00	74,250,000	
ジェイテクト	96,900	1,251.00	121,221,900	
不二越	85,000	523.00	44,455,000	
日本トムソン	32,000	584.00	18,688,000	
THK	60,600	2,510.00	152,106,000	
ユーシン精機	4,500	2,031.00	9,139,500	
前澤給装工業	3,400	1,365.00	4,641,000	
イーグル工業	12,000	1,242.00	14,904,000	
前澤工業	8,400	458.00	3,847,200	
日本ピラー工業	10,000	818.00	8,180,000	
キッツ	38,000	583.00	22,154,000	
日立工機	24,400	936.00	22,838,400	

マキタ	55,400	5,940.00	329,076,000	
日立造船	360,000	165.00	59,400,000	
三菱重工業	1,526,000	746.00	1,138,396,000	
I H I	624,000	427.00	266,448,000	
イビデン	55,500	1,888.00	104,784,000	
コニカミノルタ	240,500	789.00	189,754,500	
ブラザー工業	117,700	1,329.00	156,423,300	
ミネベア	124,000	394.00	48,856,000	
日立製作所	2,186,000	786.00	1,718,196,000	
東芝	1,797,000	545.00	979,365,000	
三菱電機	910,000	1,193.00	1,085,630,000	
富士電機	274,000	389.00	106,586,000	
東洋電機製造	18,000	346.00	6,228,000	
安川電機	100,000	1,430.00	143,000,000	
シンフォニアテクノロジー	55,000	187.00	10,285,000	
明電舎	90,000	391.00	35,190,000	
オリジン電気	13,000	381.00	4,953,000	
山洋電気	14,000	778.00	10,892,000	
デンヨー	9,000	1,536.00	13,824,000	
東芝テック	57,000	592.00	33,744,000	
芝浦メカトロニクス	16,000	314.00	5,024,000	
マブチモーター	12,900	5,500.00	70,950,000	
日本電産	49,200	7,100.00	349,320,000	
東光高岳ホールディングス	4,600	1,454.00	6,688,400	
ダイヘン	50,000	452.00	22,600,000	
ヤーマン	900	1,586.00	1,427,400	
J V C ケンウッド	55,200	289.00	15,952,800	
第一精工	2,900	1,627.00	4,718,300	
日新電機	18,000	643.00	11,574,000	
大崎電気工業	12,000	616.00	7,392,000	
オムロン	96,300	3,380.00	325,494,000	
日東工業	13,400	1,790.00	23,986,000	
I D E C	11,900	971.00	11,554,900	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	175,000	478.00	83,650,000	
サクサホールディングス	23,000	199.00	4,577,000	
メルコホールディングス	5,700	1,581.00	9,011,700	
テクノメディカ	7	721,000.00	5,047,000	
日本電気	1,178,000	266.00	313,348,000	
富士通	878,000	443.00	388,954,000	
沖電気工業	331,000	221.00	73,151,000	
岩崎通信機	40,000	111.00	4,440,000	
電気興業	24,000	584.00	14,016,000	
サンケン電気	46,000	578.00	26,588,000	
ナカヨ通信機	9,000	336.00	3,024,000	
アイホン	5,300	1,635.00	8,665,500	
ルネサスエレクトロニクス	23,600	616.00	14,537,600	
セイコーエプソン	62,200	1,438.00	89,443,600	
ワコム	167	582,000.00	97,194,000	

アルバック	15,300	1,040.00	15,912,000	
アクセル	4,600	2,001.00	9,204,600	
E I Z O	7,700	1,930.00	14,861,000	
日本信号	23,000	784.00	18,032,000	
京三製作所	20,000	366.00	7,320,000	
能美防災	12,000	803.00	9,636,000	
ホーチキ	8,000	486.00	3,888,000	
エレコム	2,900	1,325.00	3,842,500	
日本無線	20,000	350.00	7,000,000	
パナソニック	1,040,100	923.00	960,012,300	
シャープ	471,000	552.00	259,992,000	
アンリツ	48,900	1,561.00	76,332,900	
富士通ゼネラル	22,000	1,094.00	24,068,000	
日立国際電気	21,000	1,126.00	23,646,000	
ソニー	572,100	2,162.00	1,236,880,200	
T D K	51,300	4,225.00	216,742,500	
帝国通信工業	22,000	206.00	4,532,000	
ミツミ電機	34,700	714.00	24,775,800	
タムラ製作所	35,000	231.00	8,085,000	
アルプス電気	66,800	760.00	50,768,000	
パイオニア	110,800	278.00	30,802,400	
日本電波工業	7,700	1,034.00	7,961,800	
日本トリム	1,200	6,050.00	7,260,000	
ローランド ディー. ジー.	4,100	2,427.00	9,950,700	
フォスター電機	9,300	1,829.00	17,009,700	
クラリオン	48,000	167.00	8,016,000	
SMK	27,000	332.00	8,964,000	
ヨコオ	7,200	551.00	3,967,200	
東光	52,000	317.00	16,484,000	
ホシデン	24,800	611.00	15,152,800	
ヒロセ電機	15,800	13,930.00	220,094,000	
日本航空電子工業	21,000	996.00	20,916,000	
T O A	10,000	828.00	8,280,000	
ユニデン	27,000	255.00	6,885,000	
アルパイン	17,800	1,126.00	20,042,800	
スミダコーポレーション	6,100	554.00	3,379,400	
アイコム	5,100	2,492.00	12,709,200	
リオン	2,100	1,125.00	2,362,500	
船井電機	9,200	1,350.00	12,420,000	
横河電機	91,200	1,168.00	106,521,600	
新電元工業	29,000	489.00	14,181,000	
アズビル	25,500	2,337.00	59,593,500	
日本光電工業	18,100	4,155.00	75,205,500	
チノー	16,000	241.00	3,856,000	
共和電業	10,000	327.00	3,270,000	
日本電子材料	4,000	439.00	1,756,000	
堀場製作所	18,000	3,880.00	69,840,000	
アドバンテスト	62,100	1,784.00	110,786,400	

小野測器	10,000	535.00	5,350,000	
エスベック	9,500	888.00	8,436,000	
パナソニック デバイスSUNX	8,100	469.00	3,798,900	
キーエンス	22,300	33,300.00	742,590,000	
日置電機	4,800	1,634.00	7,843,200	
シスメックス	32,200	7,040.00	226,688,000	
メガチップス	7,500	1,645.00	12,337,500	
OBARA GROUP	5,900	3,190.00	18,821,000	
日本電産コパル電子	9,500	478.00	4,541,000	
東京電波	2,700	864.00	2,332,800	
澤藤電機	6,000	294.00	1,764,000	
コーセル	13,300	1,218.00	16,199,400	
日立メディコ	7,000	1,498.00	10,486,000	
新日本無線	7,000	405.00	2,835,000	
オプテックス	5,800	1,632.00	9,465,600	
千代田インテグレ	4,000	1,503.00	6,012,000	
レーザーテック	3,300	2,719.00	8,972,700	
スタンレー電気	70,900	2,083.00	147,684,700	
岩崎電気	33,000	225.00	7,425,000	
ウシオ電機	55,300	1,400.00	77,420,000	
岡谷電機産業	5,000	341.00	1,705,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	8,000	244.00	1,952,000	
日本セラミック	6,000	1,887.00	11,322,000	
日本デジタル研究所	7,700	1,204.00	9,270,800	
古河電池	7,000	603.00	4,221,000	
双信電機	4,600	370.00	1,702,000	
山一電機	9,900	232.00	2,296,800	
図研	5,300	808.00	4,282,400	
日本電子	34,000	566.00	19,244,000	
カシオ計算機	86,800	992.00	86,105,600	
ファナック	94,800	16,170.00	1,532,916,000	
日本シイエムケイ	19,800	411.00	8,137,800	
エンプラス	4,000	7,310.00	29,240,000	
ローム	48,100	4,210.00	202,501,000	
浜松ホトニクス	35,500	3,835.00	136,142,500	
三井ハイテック	13,300	768.00	10,214,400	
新光電気工業	30,600	1,221.00	37,362,600	
京セラ	75,700	10,820.00	819,074,000	
太陽誘電	44,300	1,845.00	81,733,500	
村田製作所	95,500	8,730.00	833,715,000	
ユーシン	12,700	889.00	11,290,300	
双葉電子工業	16,900	1,451.00	24,521,900	
北陸電気工業	37,000	178.00	6,586,000	
ニチコン	28,700	1,076.00	30,881,200	
日本ケミコン	53,000	416.00	22,048,000	
KOA	11,500	1,158.00	13,317,000	
市光工業	22,000	158.00	3,476,000	
小糸製作所	45,000	2,135.00	96,075,000	

ミツバ	17,000	1,483.00	25,211,000	
スター精密	16,000	1,191.00	19,056,000	
大日本スクリーン製造	93,000	594.00	55,242,000	
キャノン電子	8,400	2,065.00	17,346,000	
キャノン	565,500	3,805.00	2,151,727,500	
リコー	274,000	1,339.00	366,886,000	
MUTOHホールディングス	13,000	308.00	4,004,000	
東京エレクトロン	76,600	5,780.00	442,748,000	
トヨタ紡織	31,800	1,678.00	53,360,400	
鬼怒川ゴム工業	17,000	657.00	11,169,000	
ユニプレス	16,000	2,051.00	32,816,000	
豊田自動織機	82,900	4,415.00	366,003,500	
モリタホールディングス	16,000	952.00	15,232,000	
三桜工業	11,500	830.00	9,545,000	
デンソー	224,900	4,890.00	1,099,761,000	
東海理化電機製作所	21,300	2,189.00	46,625,700	
三井造船	352,000	192.00	67,584,000	
佐世保重工業	60,000	125.00	7,500,000	
川崎重工業	709,000	389.00	275,801,000	
日本車輛製造	33,000	603.00	19,899,000	
ニチユ三菱フォークリフト	12,000	508.00	6,096,000	
近畿車輛	16,000	340.00	5,440,000	
日産自動車	1,150,000	1,225.00	1,408,750,000	
いすゞ自動車	528,000	873.00	460,944,000	
トヨタ自動車	1,169,500	6,590.00	7,707,005,000	
日野自動車	114,000	1,723.00	196,422,000	
三菱自動車工業	2,234,000	146.00	326,164,000	
エフテック	3,200	1,905.00	6,096,000	
武蔵精密工業	9,700	2,714.00	26,325,800	
日産車体	31,000	1,285.00	39,835,000	
新明和工業	37,000	890.00	32,930,000	
極東開発工業	16,900	1,235.00	20,871,500	
日信工業	18,500	2,180.00	40,330,000	
トピー工業	68,000	243.00	16,524,000	
ティラド	31,000	409.00	12,679,000	
曙ブレーキ工業	42,300	555.00	23,476,500	
タチエス	12,200	1,757.00	21,435,400	
NOK	44,000	1,841.00	81,004,000	
フタバ産業	27,700	586.00	16,232,200	
カヤバ工業	69,000	627.00	43,263,000	
シロキ工業	20,000	240.00	4,800,000	
大同メタル工業	13,000	723.00	9,399,000	
プレス工業	39,000	595.00	23,205,000	
カルソニックカンセイ	62,000	518.00	32,116,000	
太平洋工業	18,500	825.00	15,262,500	
ケーヒン	18,800	1,709.00	32,129,200	
河西工業	11,000	674.00	7,414,000	
アイシン精機	83,300	4,000.00	333,200,000	

富士機工	11,000	379.00	4,169,000	
マツダ	1,441,000	445.00	641,245,000	
ダイハツ工業	97,000	2,199.00	213,303,000	
今仙電機製作所	6,700	1,607.00	10,766,900	
本田技研工業	768,000	4,275.00	3,283,200,000	
スズキ	190,300	2,802.00	533,220,600	
富士重工業	288,000	2,534.00	729,792,000	
ヤマハ発動機	138,400	1,614.00	223,377,600	
ショーワ	21,500	1,485.00	31,927,500	
T B K	9,000	572.00	5,148,000	
エクセディ	12,400	2,731.00	33,864,400	
豊田合成	25,700	2,765.00	71,060,500	
愛三工業	9,400	1,047.00	9,841,800	
ヨロズ	6,700	1,844.00	12,354,800	
エフ・シー・シー	14,900	2,559.00	38,129,100	
シマノ	36,700	8,680.00	318,556,000	
タカタ	16,500	2,298.00	37,917,000	
テイ・エス テック	19,200	3,565.00	68,448,000	
日本電産トーソク	4,400	869.00	3,823,600	
テルモ	69,800	5,290.00	369,242,000	
クリエートメディック	2,800	938.00	2,626,400	
日機装	32,000	1,462.00	46,784,000	
島津製作所	109,000	830.00	90,470,000	
J M S	15,000	409.00	6,135,000	
ショットモリテックス	2,000	351.00	702,000	
長野計器	6,400	787.00	5,036,800	
ブイ・テクノロジー	19	331,500.00	6,298,500	
東京計器	29,000	216.00	6,264,000	
愛知時計電機	11,000	291.00	3,201,000	
東京精密	16,300	2,365.00	38,549,500	
マニー	2,800	3,815.00	10,682,000	
ニコン	170,000	2,826.00	480,420,000	
トプコン	21,000	1,302.00	27,342,000	
オリンパス	107,400	3,180.00	341,532,000	
理研計器	7,400	760.00	5,624,000	
タムロン	7,000	2,326.00	16,282,000	
HOYA	221,300	2,165.00	479,114,500	
ノーリツ鋼機	8,200	887.00	7,273,400	
エー・アンド・デイ	8,300	935.00	7,760,500	
日本電産コパル	7,100	859.00	6,098,900	
シチズンホールディングス	102,700	672.00	69,014,400	
リズム時計工業	41,000	166.00	6,806,000	
大研医器	1,100	4,805.00	5,285,500	
松風	4,500	933.00	4,198,500	
セイコーホールディングス	58,000	519.00	30,102,000	
ニプロ	48,500	1,210.00	58,685,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,800	3,595.00	28,041,000	
S H O－B I	2,400	429.00	1,029,600	

前田工織	1,000	4,465.00	4,465,000	
永大産業	12,000	496.00	5,952,000	
ダンロップスポーツ	5,000	1,233.00	6,165,000	
バンダイナムコホールディングス	94,100	1,710.00	160,911,000	
共立印刷	14,800	288.00	4,262,400	
フランスベッドホールディングス	57,000	229.00	13,053,000	
パイロットコーポレーション	82	372,500.00	30,545,000	
トッパン・フォームズ	16,300	930.00	15,159,000	
フジシールインターナショナル	11,100	2,979.00	33,066,900	
タカラトミー	31,900	504.00	16,077,600	
廣済堂	7,700	425.00	3,272,500	
タカノ	4,100	479.00	1,963,900	
プロネクス	10,600	717.00	7,600,200	
ホクシン	6,400	182.00	1,164,800	
ウッドワン	18,000	364.00	6,552,000	
大建工業	37,000	293.00	10,841,000	
凸版印刷	257,000	774.00	198,918,000	
大日本印刷	277,000	1,011.00	280,047,000	
図書印刷	18,000	299.00	5,382,000	
共同印刷	30,000	355.00	10,650,000	
日本写真印刷	14,300	2,061.00	29,472,300	
光村印刷	9,000	271.00	2,439,000	
宝印刷	5,200	811.00	4,217,200	
アシックス	84,800	1,717.00	145,601,600	
ツツミ	4,600	2,885.00	13,271,000	
ローランド	8,100	1,019.00	8,253,900	
小松ウオール工業	3,600	2,405.00	8,658,000	
ヤマハ	66,900	1,213.00	81,149,700	
河合楽器製作所	36,000	183.00	6,588,000	
クリナップ	9,300	822.00	7,644,600	
ビジョン	6,900	8,230.00	56,787,000	
兼松日産農林	14,000	177.00	2,478,000	
キングジム	7,600	817.00	6,209,200	
リンテック	19,500	2,005.00	39,097,500	
イトーキ	20,100	543.00	10,914,300	
任天堂	52,100	11,120.00	579,352,000	
三菱鉛筆	7,500	2,042.00	15,315,000	
タカラスタANDARD	42,000	772.00	32,424,000	
コクヨ	47,400	786.00	37,256,400	
ナカバヤシ	20,000	206.00	4,120,000	
グローブライド	44,000	138.00	6,072,000	
岡村製作所	35,000	715.00	25,025,000	
美津濃	45,000	544.00	24,480,000	
アデランス	11,400	1,571.00	17,909,400	
東京電力	772,200	726.00	560,617,200	
中部電力	278,500	1,459.00	406,331,500	
関西電力	371,500	1,447.00	537,560,500	
中国電力	125,900	1,536.00	193,382,400	

北陸電力	89,200	1,612.00	143,790,400	
東北電力	227,400	1,374.00	312,447,600	
四国電力	82,000	2,050.00	168,100,000	
九州電力	201,000	1,560.00	313,560,000	
北海道電力	85,200	1,416.00	120,643,200	
沖縄電力	5,400	3,740.00	20,196,000	
電源開発	56,500	3,465.00	195,772,500	
東京瓦斯	1,093,000	627.00	685,311,000	
大阪瓦斯	883,000	477.00	421,191,000	
東邦瓦斯	231,000	630.00	145,530,000	
北海道瓦斯	16,000	257.00	4,112,000	
西部瓦斯	102,000	244.00	24,888,000	
静岡瓦斯	23,500	772.00	18,142,000	
東武鉄道	517,000	569.00	294,173,000	
相鉄ホールディングス	146,000	374.00	54,604,000	
東京急行電鉄	536,000	742.00	397,712,000	
京浜急行電鉄	234,000	1,049.00	245,466,000	
小田急電鉄	292,000	1,168.00	341,056,000	
京王電鉄	254,000	818.00	207,772,000	
京成電鉄	136,000	989.00	134,504,000	
富士急行	25,000	1,111.00	27,775,000	
新京成電鉄	12,000	394.00	4,728,000	
東日本旅客鉄道	167,900	8,370.00	1,405,323,000	
西日本旅客鉄道	78,500	4,685.00	367,772,500	
東海旅客鉄道	75,700	13,190.00	998,483,000	
鴻池運輸	3,600	1,374.00	4,946,400	
西日本鉄道	118,000	404.00	47,672,000	
ハマキョウレックス	2,600	4,015.00	10,439,000	
サカイ引越センター	1,700	2,453.00	4,170,100	
近畿日本鉄道	822,000	494.00	406,068,000	
阪急阪神ホールディングス	575,000	608.00	349,600,000	
南海電気鉄道	190,000	394.00	74,860,000	
京阪電気鉄道	204,000	428.00	87,312,000	
名糖運輸	3,700	652.00	2,412,400	
名古屋鉄道	318,000	296.00	94,128,000	
日本通運	360,000	499.00	179,640,000	
ヤマトホールディングス	169,500	2,082.00	352,899,000	
山九	111,000	403.00	44,733,000	
丸運	4,900	250.00	1,225,000	
丸全昭和運輸	31,000	364.00	11,284,000	
センコー	36,000	547.00	19,692,000	
トナミホールディングス	19,000	219.00	4,161,000	
日本梱包運輸倉庫	27,800	1,582.00	43,979,600	
日本石油輸送	10,000	236.00	2,360,000	
福山通運	55,000	564.00	31,020,000	
セイノーホールディングス	70,000	890.00	62,300,000	
神奈川中央交通	11,000	610.00	6,710,000	
日立物流	15,800	1,688.00	26,670,400	

日本郵船	722,000	295.00	212,990,000	
商船三井	448,000	437.00	195,776,000	
川崎汽船	407,000	230.00	93,610,000	
N S ユナイテッド海運	39,000	180.00	7,020,000	
乾汽船	11,700	445.00	5,206,500	
飯野海運	44,600	670.00	29,882,000	
共栄タンカー	18,000	264.00	4,752,000	
日本航空	102,500	4,945.00	506,862,500	
A N A ホールディングス	1,789,000	218.00	390,002,000	
パスコ	8,000	422.00	3,376,000	
トランコム	2,400	3,110.00	7,464,000	
日新	34,000	284.00	9,656,000	
三菱倉庫	65,000	1,793.00	116,545,000	
三井倉庫	42,000	663.00	27,846,000	
住友倉庫	61,000	651.00	39,711,000	
澁澤倉庫	24,000	531.00	12,744,000	
東陽倉庫	14,000	288.00	4,032,000	
日本トランスシティ	21,000	373.00	7,833,000	
ケイヒン	17,000	183.00	3,111,000	
安田倉庫	7,100	1,066.00	7,568,600	
東洋埠頭	26,000	202.00	5,252,000	
宇徳	7,400	415.00	3,071,000	
上組	101,000	901.00	91,001,000	
サンリツ	2,400	590.00	1,416,000	
キムラユニティー	2,000	1,010.00	2,020,000	
キューソー流通システム	2,500	976.00	2,440,000	
郵船ロジスティクス	7,200	1,071.00	7,711,200	
近鉄エクスプレス	8,100	3,690.00	29,889,000	
東海運	4,900	273.00	1,337,700	
エーアイティー	1,500	1,433.00	2,149,500	
N E C ネットズエスアイ	8,500	2,364.00	20,094,000	
システナ	9,600	819.00	7,862,400	
デジタルアーツ	3,300	1,387.00	4,577,100	
新日鉄住金ソリューションズ	6,000	2,035.00	12,210,000	
コア	3,400	750.00	2,550,000	
ソフトクリエイイトホールディングス	1,000	1,881.00	1,881,000	
デジタルハーツ	1,700	3,125.00	5,312,500	
I T ホールディングス	29,800	1,523.00	45,385,400	
ネオス	18	72,800.00	1,310,400	
電算システム	1,000	2,543.00	2,543,000	
グリー	46,500	1,007.00	46,825,500	
コーエーテクモホールディングス	17,800	968.00	17,230,400	
三菱総合研究所	3,500	2,095.00	7,332,500	
ボルテージ	1,300	1,011.00	1,314,300	
電算	500	2,092.00	1,046,000	
K L a b	3,000	748.00	2,244,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	2,770.00	4,155,000	
ネクソン	74,000	1,199.00	88,726,000	

アイスタイル	1,900	742.00	1,409,800	
エイチーム	600	3,600.00	2,160,000	
ブロードリーフ	8,400	2,316.00	19,454,400	
ドワンゴ	40	628,000.00	25,120,000	
ベリサーブ	5	230,000.00	1,150,000	
マクロミル	7,000	1,525.00	10,675,000	
ティーガイア	11,200	1,009.00	11,300,800	
テクマトリックス	2,700	685.00	1,849,500	
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	2,380.00	7,378,000	
ザッパラス	50	92,000.00	4,600,000	
インターネットイニシアティブ	10,500	3,770.00	39,585,000	
SRAホールディングス	4,300	1,170.00	5,031,000	
朝日ネット	7,000	489.00	3,423,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,100	2,438.00	5,119,800	
フェイス	308	11,490.00	3,538,920	
野村総合研究所	50,900	2,929.00	149,086,100	
サイバネットシステム	74	35,950.00	2,660,300	
インテージ	2,700	2,778.00	7,500,600	
シンプレクス・ホールディングス	168	44,000.00	7,392,000	
ソースネクスト	2,200	723.00	1,590,600	
クレスコ	2,100	857.00	1,799,700	
フジ・メディア・ホールディングス	869	227,700.00	197,871,300	
オービック	3,100	25,490.00	79,019,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,800	811.00	1,459,800	
ヤフー	6,503	52,000.00	338,156,000	
トレンドマイクロ	35,700	3,315.00	118,345,500	
日本オラクル	18,000	4,455.00	80,190,000	
アルファシステムズ	3,000	1,306.00	3,918,000	
フューチャーアーキテクト	109	53,500.00	5,831,500	
シーエーシー	5,500	989.00	5,439,500	
ソフトバンク・テクノロジー	2,100	1,362.00	2,860,200	
トーセ	2,300	685.00	1,575,500	
オービックビジネスコンサルタント	2,850	6,010.00	17,128,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	10,600	4,325.00	45,845,000	
アイティフォー	10,100	504.00	5,090,400	
東計電算	1,600	1,439.00	2,302,400	
エックスネット	8	144,000.00	1,152,000	
大塚商会	8,100	10,100.00	81,810,000	
サイボウズ	151	26,690.00	4,030,190	
ソフトブレーン	134	16,220.00	2,173,480	
アグレックス	2,400	899.00	2,157,600	
電通国際情報サービス	5,600	1,246.00	6,977,600	
EMシステムズ	1,400	2,242.00	3,138,800	
ウェザーニューズ	2,400	2,395.00	5,748,000	
C I J	8,400	464.00	3,897,600	
WOWOW	28	311,500.00	8,722,000	
ネットワンシステムズ	32,700	903.00	29,528,100	
アルゴグラフィックス	3,300	1,561.00	5,151,300	

マーベラスAQL	107	51,200.00	5,478,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,000	3,235.00	54,995,000	
日本ユニシス	24,800	978.00	24,254,400	
兼松エレクトロニクス	5,700	1,406.00	8,014,200	
東京放送ホールディングス	48,500	1,428.00	69,258,000	
日本テレビホールディングス	82,000	1,805.00	148,010,000	
テレビ朝日	22,800	2,148.00	48,974,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	780	50,000.00	39,000,000	
テレビ東京ホールディングス	6,500	1,361.00	8,846,500	
アイ・ティー・シーネットワーク	7,900	915.00	7,228,500	
NECモバイリング	3,400	5,510.00	18,734,000	
日本電信電話	378,200	5,340.00	2,019,588,000	
KDDI	253,500	5,170.00	1,310,595,000	
光通信	9,100	5,890.00	53,599,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	7,403	165,800.00	1,227,417,400	
GMOインターネット	30,000	1,274.00	38,220,000	
学研ホールディングス	28,000	316.00	8,848,000	
ゼンリン	11,900	1,212.00	14,422,800	
昭文社	5,400	606.00	3,272,400	
角川グループホールディングス	7,700	3,305.00	25,448,500	
インプレスホールディングス	7,600	165.00	1,254,000	
アイネット	3,900	774.00	3,018,600	
松竹	59,000	980.00	57,820,000	
東宝	64,100	2,130.00	136,533,000	
東映	38,000	692.00	26,296,000	
AOI Pro.	4,200	705.00	2,961,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	555	387,500.00	215,062,500	
DTS	8,600	1,640.00	14,104,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,600	1,332.00	43,423,200	
シーイーシー	5,900	696.00	4,106,400	
カプコン	17,300	1,770.00	30,621,000	
ジャステック	5,200	730.00	3,796,000	
SCSK	21,400	2,271.00	48,599,400	
日本システムウエア	3,500	479.00	1,676,500	
アイネス	12,300	818.00	10,061,400	
TKC	7,600	1,734.00	13,178,400	
富士ソフト	12,400	2,459.00	30,491,600	
NSD	17,700	1,139.00	20,160,300	
コナミ	40,600	2,607.00	105,844,200	
福井コンピュータホールディングス	1,300	702.00	912,600	
J B C Cホールディングス	7,500	1,299.00	9,742,500	
ミロク情報サービス	6,000	382.00	2,292,000	
ソフトバンク	435,100	6,080.00	2,645,408,000	
ハウスイ	7,000	138.00	966,000	
高千穂交易	3,800	940.00	3,572,000	
伊藤忠食品	2,200	3,625.00	7,975,000	
エレマテック	4,200	1,372.00	5,762,400	
JALUX	2,600	1,032.00	2,683,200	

あらた	20,000	379.00	7,580,000	
トーメンデバイス	1,400	1,804.00	2,525,600	
東京エレクトロン デバイス	18	162,000.00	2,916,000	
双日	566,000	179.00	101,314,000	
アルフレッサ ホールディングス	23,300	5,700.00	132,810,000	
横浜冷凍	22,300	882.00	19,668,600	
山下医科器械	700	2,359.00	1,651,300	
ラサ商事	4,000	465.00	1,860,000	
アルコニックス	2,500	2,085.00	5,212,500	
あい ホールディングス	16,000	1,052.00	16,832,000	
ダイワボウホールディングス	82,000	178.00	14,596,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,900	877.00	14,821,300	
八洲電機	6,600	408.00	2,692,800	
UKCホールディングス	5,300	2,004.00	10,621,200	
TOKAIホールディングス	35,200	325.00	11,440,000	
ミタチ産業	2,200	567.00	1,247,400	
シップヘルスケアホールディングス	12,800	3,890.00	49,792,000	
富士興産	3,200	674.00	2,156,800	
協栄産業	11,000	193.00	2,123,000	
小野建	7,900	1,047.00	8,271,300	
佐島電機	6,700	588.00	3,939,600	
エコートレーディング	2,300	877.00	2,017,100	
伯東	5,500	1,099.00	6,044,500	
コンドーテック	7,300	619.00	4,518,700	
中山福	5,200	726.00	3,775,200	
ナガイレーベン	11,900	1,611.00	19,170,900	
三菱食品	9,900	2,722.00	26,947,800	
松田産業	6,600	1,424.00	9,398,400	
メディパルホールディングス	89,900	1,489.00	133,861,100	
アドヴァン	4,600	1,383.00	6,361,800	
SPK	2,100	1,793.00	3,765,300	
アズワン	5,900	2,230.00	13,157,000	
スズデン	3,000	508.00	1,524,000	
尾家産業	2,900	816.00	2,366,400	
シモジマ	5,500	1,006.00	5,533,000	
ドウシシャ	9,500	1,644.00	15,618,000	
高速	5,400	975.00	5,265,000	
黒田電気	12,000	1,356.00	16,272,000	
丸文	8,000	502.00	4,016,000	
ハピネット	5,500	802.00	4,411,000	
トーメンエレクトロニクス	4,600	1,330.00	6,118,000	
エクセル	3,900	1,352.00	5,272,800	
マルカキカイ	2,900	1,362.00	3,949,800	
ガリバーインターナショナル	30,300	690.00	20,907,000	
日本エム・ディ・エム	8,400	289.00	2,427,600	
進和	5,300	1,250.00	6,625,000	
エスケイジャパン	2,300	343.00	788,900	
ダイトエレクトロン	4,200	441.00	1,852,200	

シークス	5,700	1,338.00	7,626,600	
田中商事	3,100	615.00	1,906,500	
オーハシテクニカ	4,900	940.00	4,606,000	
マクニカ	4,600	2,350.00	10,810,000	
白銅	3,000	826.00	2,478,000	
伊藤忠商事	716,700	1,388.00	994,779,600	
丸紅	737,000	775.00	571,175,000	
高島	17,000	315.00	5,355,000	
F & A アクアホールディングス	6,900	1,804.00	12,447,600	
長瀬産業	50,900	1,412.00	71,870,800	
蝶理	5,800	1,115.00	6,467,000	
豊田通商	100,100	2,896.00	289,889,600	
三共生興	15,400	398.00	6,129,200	
兼松	191,000	128.00	24,448,000	
ツカモトコーポレーション	15,000	185.00	2,775,000	
三井物産	775,500	1,472.00	1,141,536,000	
日本紙パルプ商事	47,000	311.00	14,617,000	
日立ハイテクノロジーズ	27,300	2,553.00	69,696,900	
カメイ	10,700	875.00	9,362,500	
東都水産	16,000	154.00	2,464,000	
スターゼン	30,000	258.00	7,740,000	
山善	34,600	664.00	22,974,400	
椿本興業	10,000	281.00	2,810,000	
住友商事	530,200	1,407.00	745,991,400	
内田洋行	20,000	315.00	6,300,000	
三菱商事	701,000	1,925.00	1,349,425,000	
第一実業	20,000	491.00	9,820,000	
キヤノンマーケティングジャパン	29,900	1,472.00	44,012,800	
西華産業	31,000	303.00	9,393,000	
佐藤商事	8,100	607.00	4,916,700	
菱洋エレクトロ	10,600	914.00	9,688,400	
東京産業	9,000	337.00	3,033,000	
ユアサ商事	92,000	208.00	19,136,000	
神鋼商事	23,000	206.00	4,738,000	
阪和興業	90,000	390.00	35,100,000	
カナデン	9,000	659.00	5,931,000	
菱電商事	13,000	703.00	9,139,000	
フルサト工業	4,600	1,087.00	5,000,200	
岩谷産業	100,000	441.00	44,100,000	
すてきナイスグループ	35,000	255.00	8,925,000	
昭光通商	32,000	148.00	4,736,000	
ニチモウ	13,000	211.00	2,743,000	
極東貿易	10,000	270.00	2,700,000	
イワキ	14,000	224.00	3,136,000	
三愛石油	21,000	422.00	8,862,000	
稲畑産業	22,200	854.00	18,958,800	
G S I クレオス	24,000	142.00	3,408,000	
明和産業	7,200	402.00	2,894,400	

東邦ホールディングス	28,800	2,077.00	59,817,600	
サンゲツ	15,900	2,753.00	43,772,700	
ミツウロコグループホールディングス	14,500	526.00	7,627,000	
シナネン	19,000	400.00	7,600,000	
伊藤忠エネクス	19,900	557.00	11,084,300	
サンリオ	22,700	5,340.00	121,218,000	
サンワテクノス	4,400	1,020.00	4,488,000	
リョーサン	14,700	1,822.00	26,783,400	
新光商事	9,900	939.00	9,296,100	
トーヨー	19,000	372.00	7,068,000	
三信電気	12,900	671.00	8,655,900	
東陽テクニカ	12,400	1,501.00	18,612,400	
モスフードサービス	11,800	1,939.00	22,880,200	
加賀電子	9,000	862.00	7,758,000	
ソーダニッカ	9,000	422.00	3,798,000	
立花エレテック	5,500	1,075.00	5,912,500	
P a l t a c	10,600	1,278.00	13,546,800	
ヤマタネ	42,000	205.00	8,610,000	
丸紅建材リース	8,000	218.00	1,744,000	
日鐵商事	20,000	299.00	5,980,000	
トラスコ中山	10,300	2,289.00	23,576,700	
オートバックスセブン	33,300	1,666.00	55,477,800	
加藤産業	13,000	2,179.00	28,327,000	
イノテック	7,800	521.00	4,063,800	
イエローハット	8,500	2,010.00	17,085,000	
富士エレクトロニクス	4,600	1,333.00	6,131,800	
J Kホールディングス	7,600	636.00	4,833,600	
日伝	4,100	2,381.00	9,762,100	
北沢産業	7,000	193.00	1,351,000	
杉本商事	4,900	925.00	4,532,500	
因幡電機産業	10,600	3,160.00	33,496,000	
住金物産	47,000	321.00	15,087,000	
バイテック	2,100	789.00	1,656,900	
ミスミグループ本社	33,400	2,967.00	99,097,800	
江守商事	2,000	1,540.00	3,080,000	
アルテック	4,400	295.00	1,298,000	
タキヒヨー	14,000	441.00	6,174,000	
スズケン	34,500	3,575.00	123,337,500	
ジェコス	6,200	770.00	4,774,000	
ローソン	34,000	7,540.00	256,360,000	
サンエー	3,400	5,090.00	17,306,000	
麒麟堂	3,200	771.00	2,467,200	
ダイユーエイト	1,800	678.00	1,220,400	
カワチ薬品	6,300	2,338.00	14,729,400	
エービーシー・マート	10,600	4,125.00	43,725,000	
ハードオフコーポレーション	4,400	723.00	3,181,200	
アスクル	7,700	1,787.00	13,759,900	
ゲオホールディングス	154	103,800.00	15,985,200	

ポイント	8,280	4,790.00	39,661,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	12,000	102.00	1,224,000	
くらコーポレーション	5,300	1,633.00	8,654,900	
キャンドゥ	47	200,700.00	9,432,900	
パル	5,200	3,825.00	19,890,000	
エディオン	38,900	511.00	19,877,900	
サーラコーポレーション	7,700	526.00	4,050,200	
あみやき亭	16	293,100.00	4,689,600	
ひらまつ	9,300	780.00	7,254,000	
ゲンキー	800	2,252.00	1,801,600	
大黒天物産	1,800	2,846.00	5,122,800	
ハニーズ	7,110	1,248.00	8,873,280	
アルペン	6,900	2,026.00	13,979,400	
クオール	2,900	800.00	2,320,000	
ビックカメラ	341	43,450.00	14,816,450	
DCMホールディングス	44,300	889.00	39,382,700	
Monotaro	12,100	3,275.00	39,627,500	
J. フロント リテイリング	212,000	744.00	157,728,000	
ドトール・日レスホールディングス	15,700	1,377.00	21,618,900	
マツモトキヨシホールディングス	15,100	2,700.00	40,770,000	
ブロンコビリー	600	3,740.00	2,244,000	
スタートトゥデイ	24,900	1,689.00	42,056,100	
物語コーポレーション	1,300	4,415.00	5,739,500	
ココカラファイン	9,400	3,430.00	32,242,000	
三越伊勢丹ホールディングス	178,500	1,485.00	265,072,500	
ウエルシアホールディングス	3,200	4,860.00	15,552,000	
クリエイトSDホールディングス	3,800	4,340.00	16,492,000	
丸善CH I ホールディングス	5,200	283.00	1,471,600	
ブックオフコーポレーション	5,000	705.00	3,525,000	
あさひ	5,200	1,755.00	9,126,000	
日本調剤	1,140	3,205.00	3,653,700	
コスモス薬品	4,500	12,380.00	55,710,000	
一六堂	1,100	809.00	889,900	
セブン&アイ・ホールディングス	375,800	3,900.00	1,465,620,000	
ツルハホールディングス	8,800	9,030.00	79,464,000	
サンマルクホールディングス	2,900	5,210.00	15,109,000	
フェリシモ	2,600	1,199.00	3,117,400	
トリドール	7,800	1,318.00	10,280,400	
クスリのアオキ	1,300	7,060.00	9,178,000	
メディカルシステムネットワーク	5,200	484.00	2,516,800	
総合メディカル	2,200	4,065.00	8,943,000	
はるやま商事	3,700	779.00	2,882,300	
カップ・クリエイトホールディングス	6,600	1,827.00	12,058,200	
ライトオン	6,700	983.00	6,586,100	
良品計画	9,500	8,720.00	82,840,000	
三城ホールディングス	11,100	527.00	5,849,700	
コナカ	11,000	1,220.00	13,420,000	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,324.00	1,324,000	

G-7ホールディングス	2,700	836.00	2,257,200	
イオン北海道	5,600	514.00	2,878,400	
コジマ	13,300	327.00	4,349,100	
ヒマラヤ	2,100	1,146.00	2,406,600	
コーナン商事	11,800	1,282.00	15,127,600	
エコス	3,100	609.00	1,887,900	
ワタミ	10,600	1,807.00	19,154,200	
マルシェ	2,200	816.00	1,795,200	
ドン・キホーテ	26,300	5,310.00	139,653,000	
メガネトップ	16,200	1,405.00	22,761,000	
西松屋チェーン	17,700	1,074.00	19,009,800	
ゼンショーホールディングス	34,200	1,241.00	42,442,200	
幸楽苑	5,500	1,221.00	6,715,500	
ハークスレイ	2,500	801.00	2,002,500	
サイゼリヤ	13,300	1,428.00	18,992,400	
ポプラ	3,500	599.00	2,096,500	
ユナイテッドアローズ	9,600	4,240.00	40,704,000	
ハイデイ日高	4,700	2,258.00	10,612,600	
京都きもの友禅	5,900	1,091.00	6,436,900	
コロワイド	30,000	982.00	29,460,000	
壺番屋	3,600	4,570.00	16,452,000	
トップカルチャー	3,300	438.00	1,445,400	
スギホールディングス	14,300	3,610.00	51,623,000	
スクロール	11,700	279.00	3,264,300	
ファミリーマート	27,600	4,555.00	125,718,000	
木曽路	11,000	1,923.00	21,153,000	
千趣会	16,200	976.00	15,811,200	
タカキュー	7,000	411.00	2,877,000	
ケーヨー	15,200	495.00	7,524,000	
上新電機	20,000	860.00	17,200,000	
日本瓦斯	12,400	1,265.00	15,686,000	
ベスト電器	28,100	217.00	6,097,700	
マルエツ	20,000	341.00	6,820,000	
ロイヤルホールディングス	15,000	1,563.00	23,445,000	
東天紅	7,000	213.00	1,491,000	
いなげや	10,000	1,004.00	10,040,000	
島忠	20,300	2,671.00	54,221,300	
チヨダ	10,600	2,841.00	30,114,600	
ライフコーポレーション	5,700	1,351.00	7,700,700	
カスミ	18,400	670.00	12,328,000	
リンガーハット	8,100	1,467.00	11,882,700	
MrMax	9,000	357.00	3,213,000	
テンアライド	6,800	304.00	2,067,200	
AOKIホールディングス	7,700	3,155.00	24,293,500	
オークワ	14,000	1,067.00	14,938,000	
コメリ	13,800	2,949.00	40,696,200	
青山商事	24,800	3,110.00	77,128,000	
しまむら	10,400	12,020.00	125,008,000	

C F Sコーポレーション	6,000	392.00	2,352,000	
はせがわ	2,700	668.00	1,803,600	
高島屋	122,000	1,066.00	130,052,000	
松屋	18,800	1,584.00	29,779,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	58,000	944.00	54,752,000	
ニッセンホールディングス	16,200	361.00	5,848,200	
パルコ	17,200	1,207.00	20,760,400	
丸井グループ	117,300	1,119.00	131,258,700	
原信ナルスホールディングス	5,000	1,724.00	8,620,000	
ダイエー	52,000	365.00	18,980,000	
イズミヤ	35,000	492.00	17,220,000	
イオン	316,800	1,299.00	411,523,200	
ユニーグループ・ホールディングス	86,900	704.00	61,177,600	
イズミ	22,600	2,811.00	63,528,600	
東武ストア	12,000	275.00	3,300,000	
平和堂	18,600	1,740.00	32,364,000	
フジ	10,000	1,790.00	17,900,000	
ヤオコー	4,500	4,150.00	18,675,000	
ゼビオ	12,200	2,255.00	27,511,000	
ケーズホールディングス	22,400	3,180.00	71,232,000	
O l y m p i c	5,300	700.00	3,710,000	
日産東京販売ホールディングス	13,000	368.00	4,784,000	
アインファーマシーズ	5,400	4,465.00	24,111,000	
元気寿司	2,800	1,255.00	3,514,000	
ヤマダ電機	40,980	4,525.00	185,434,500	
アークランドサカモト	5,900	2,029.00	11,971,100	
ニトリホールディングス	17,800	8,280.00	147,384,000	
グルメ杵屋	6,000	692.00	4,152,000	
愛眼	7,100	307.00	2,179,700	
吉野家ホールディングス	244	115,000.00	28,060,000	
松屋フーズ	4,300	1,576.00	6,776,800	
サガミチェーン	11,000	803.00	8,833,000	
プレナス	10,000	1,700.00	17,000,000	
ミニストップ	6,700	1,716.00	11,497,200	
アークス	15,300	1,926.00	29,467,800	
バロー	19,400	1,899.00	36,840,600	
ベルク	4,400	1,865.00	8,206,000	
大庄	4,200	1,286.00	5,401,200	
ファーストリテイリング	21,000	39,200.00	823,200,000	
サンドラッグ	17,100	4,360.00	74,556,000	
東京デリカ	3,100	1,501.00	4,653,100	
ヤマザワ	2,300	1,604.00	3,689,200	
やまや	1,800	1,633.00	2,939,400	
ベルーナ	11,200	1,185.00	13,272,000	
島根銀行	2,000	1,323.00	2,646,000	
じもとホールディングス	64,500	267.00	17,221,500	
新生銀行	777,000	274.00	212,898,000	
あおぞら銀行	326,000	324.00	105,624,000	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,803,300	699.00	4,755,506,700	
りそなホールディングス	924,100	543.00	501,786,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,765,000	546.00	963,690,000	
三井住友フィナンシャルグループ	679,500	4,710.00	3,200,445,000	
第四銀行	115,000	389.00	44,735,000	
北越銀行	91,000	233.00	21,203,000	
西日本シティ銀行	315,000	300.00	94,500,000	
千葉銀行	346,000	738.00	255,348,000	
横浜銀行	555,000	596.00	330,780,000	
常陽銀行	339,000	603.00	204,417,000	
群馬銀行	201,000	618.00	124,218,000	
武蔵野銀行	14,300	3,715.00	53,124,500	
千葉興業銀行	17,200	866.00	14,895,200	
筑波銀行	37,300	468.00	17,456,400	
東京都民銀行	17,000	1,474.00	25,058,000	
七十七銀行	141,000	529.00	74,589,000	
青森銀行	66,000	297.00	19,602,000	
秋田銀行	62,000	283.00	17,546,000	
山形銀行	55,000	485.00	26,675,000	
岩手銀行	6,500	4,465.00	29,022,500	
東邦銀行	76,000	327.00	24,852,000	
東北銀行	46,000	160.00	7,360,000	
みちのく銀行	45,000	233.00	10,485,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	365,000	475.00	173,375,000	
静岡銀行	263,000	1,241.00	326,383,000	
十六銀行	113,000	441.00	49,833,000	
スルガ銀行	88,000	1,844.00	162,272,000	
八十二銀行	166,000	649.00	107,734,000	
山梨中央銀行	53,000	490.00	25,970,000	
大垣共立銀行	120,000	357.00	42,840,000	
福井銀行	77,000	217.00	16,709,000	
北國銀行	101,000	403.00	40,703,000	
清水銀行	3,100	2,915.00	9,036,500	
滋賀銀行	84,000	616.00	51,744,000	
南都銀行	88,000	433.00	38,104,000	
百五銀行	81,000	476.00	38,556,000	
京都銀行	161,000	1,040.00	167,440,000	
三重銀行	37,000	240.00	8,880,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	611,000	231.00	141,141,000	
広島銀行	265,000	488.00	129,320,000	
山陰合同銀行	52,000	829.00	43,108,000	
中国銀行	67,000	1,704.00	114,168,000	
鳥取銀行	29,000	212.00	6,148,000	
伊予銀行	96,000	1,039.00	99,744,000	
百十四銀行	99,000	370.00	36,630,000	
四国銀行	65,000	292.00	18,980,000	
阿波銀行	73,000	622.00	45,406,000	
鹿児島銀行	62,000	718.00	44,516,000	

大分銀行	53,000	357.00	18,921,000	
宮崎銀行	60,000	335.00	20,100,000	
肥後銀行	74,000	683.00	50,542,000	
佐賀銀行	54,000	242.00	13,068,000	
十八銀行	56,000	263.00	14,728,000	
沖縄銀行	6,700	4,620.00	30,954,000	
琉球銀行	18,600	1,538.00	28,606,800	
八千代銀行	4,600	3,835.00	17,641,000	
セブン銀行	303,000	369.00	111,807,000	
みずほフィナンシャルグループ	11,611,300	223.00	2,589,319,900	
紀陽ホールディングス	358,000	171.00	61,218,000	
山口フィナンシャルグループ	90,000	1,033.00	92,970,000	
長野銀行	31,000	189.00	5,859,000	
名古屋銀行	81,000	434.00	35,154,000	
北洋銀行	135,400	333.00	45,088,200	
愛知銀行	3,200	5,070.00	16,224,000	
第三銀行	51,000	172.00	8,772,000	
中京銀行	37,000	203.00	7,511,000	
東日本銀行	39,000	246.00	9,594,000	
大光銀行	32,000	257.00	8,224,000	
愛媛銀行	53,000	260.00	13,780,000	
トマト銀行	35,000	191.00	6,685,000	
みなと銀行	81,000	179.00	14,499,000	
京葉銀行	74,000	602.00	44,548,000	
関西アーバン銀行	125,000	136.00	17,000,000	
栃木銀行	45,000	403.00	18,135,000	
北日本銀行	2,600	2,553.00	6,637,800	
東和銀行	99,000	114.00	11,286,000	
福島銀行	111,000	89.00	9,879,000	
大東銀行	57,000	98.00	5,586,000	
トモニホールディングス	68,900	399.00	27,491,100	
フィデアホールディングス	51,700	276.00	14,269,200	
池田泉州ホールディングス	74,100	543.00	40,236,300	
F P G	2,400	4,900.00	11,760,000	
S B I ホールディングス	115,700	1,663.00	192,409,100	
ジャフコ	12,700	4,550.00	57,785,000	
大和証券グループ本社	890,000	1,005.00	894,450,000	
野村ホールディングス	1,836,900	969.00	1,779,956,100	
岡三証券グループ	77,000	1,110.00	85,470,000	
丸三証券	27,800	913.00	25,381,400	
東洋証券	36,000	414.00	14,904,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	103,300	888.00	91,730,400	
水戸証券	29,000	573.00	16,617,000	
いちよし証券	21,000	1,566.00	32,886,000	
松井証券	53,500	1,231.00	65,858,500	
だいこう証券ビジネス	5,400	754.00	4,071,600	
マネックスグループ	1,021	46,000.00	46,966,000	
カブドットコム証券	35,800	733.00	26,241,400	

極東証券	12,500	2,193.00	27,412,500	
岩井コスモホールディングス	9,500	1,714.00	16,283,000	
NK S Jホールディングス	199,600	2,690.00	536,924,000	
MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	268,500	3,020.00	810,870,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	86,100	1,678.00	144,475,800	
第一生命保険	4,805	165,600.00	795,708,000	
東京海上ホールディングス	348,000	3,350.00	1,165,800,000	
T & Dホールディングス	308,200	1,399.00	431,171,800	
全国保証	10,500	4,105.00	43,102,500	
クレディセゾン	80,600	2,930.00	236,158,000	
芙蓉総合リース	9,300	4,485.00	41,710,500	
興銀リース	14,200	3,925.00	55,735,000	
東京センチュリーリース	22,600	3,200.00	72,320,000	
日本証券金融	39,900	999.00	39,860,100	
大阪証券金融	15,000	387.00	5,805,000	
ポケットカード	14,000	916.00	12,824,000	
リコーリース	6,600	3,375.00	22,275,000	
イオンフィナンシャルサービス	34,300	2,992.00	102,625,600	
アコム	19,450	4,350.00	84,607,500	
ジャックス	59,000	645.00	38,055,000	
オリエントコーポレーション	197,500	402.00	79,395,000	
日立キャピタル	19,200	2,686.00	51,571,200	
オリックス	530,300	1,633.00	865,979,900	
三菱UF J リース	237,100	587.00	139,177,700	
日本取引所グループ	23,300	11,200.00	260,960,000	
イー・ギャランティ	3,800	3,990.00	15,162,000	
アサックス	16	207,000.00	3,312,000	
NE C キャピタルソリューション	5,200	3,465.00	18,018,000	
日本駐車場開発	1,024	8,960.00	9,175,040	
ヒューリック	119,300	1,037.00	123,714,100	
東京建物不動産販売	4,600	592.00	2,723,200	
三栄建築設計	2,700	1,532.00	4,136,400	
野村不動産ホールディングス	43,300	2,612.00	113,099,600	
常和ホールディングス	2,800	2,880.00	8,064,000	
フージャースホールディングス	12,700	1,215.00	15,430,500	
パーク 2 4	47,100	1,887.00	88,877,700	
三井不動産	424,000	3,340.00	1,416,160,000	
三菱地所	629,000	2,894.00	1,820,326,000	
平和不動産	18,300	2,329.00	42,620,700	
東京建物	175,000	914.00	159,950,000	
ダイビル	24,700	1,349.00	33,320,300	
東急不動産	199,000	1,168.00	232,432,000	
京阪神ビルディング	14,800	731.00	10,818,800	
住友不動産	215,000	4,670.00	1,004,050,000	
大京	140,000	361.00	50,540,000	
テーオーシー	31,500	810.00	25,515,000	
東京楽天地	16,000	499.00	7,984,000	
フジ住宅	12,000	753.00	9,036,000	

空港施設	11,500	662.00	7,613,000	
明和地所	4,400	562.00	2,472,800	
住友不動産販売	3,300	6,280.00	20,724,000	
ゴールドクレスト	7,300	2,770.00	20,221,000	
東栄住宅	6,300	2,019.00	12,719,700	
日本エスリード	4,300	1,360.00	5,848,000	
東急リバブル	9,700	2,437.00	23,638,900	
飯田産業	10,400	1,778.00	18,491,200	
日神不動産	6,900	796.00	5,492,400	
アーネストワン	15,100	2,157.00	32,570,700	
タカラレーベン	10,200	2,090.00	21,318,000	
サンヨーハウジング名古屋	4,900	1,396.00	6,840,400	
イオンモール	41,100	3,010.00	123,711,000	
タクトホーム	50	201,100.00	10,055,000	
トーセイ	136	104,000.00	14,144,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	577	156,200.00	90,127,400	
サンフロンティア不動産	101	113,500.00	11,463,500	
ランドビジネス	6,100	646.00	3,940,600	
グランディハウス	6,800	469.00	3,189,200	
日本空港ビルデング	31,300	1,501.00	46,981,300	
日本工営	32,000	386.00	12,352,000	
ネクスト	4,300	919.00	3,951,700	
日本M&Aセンター	4,900	6,440.00	31,556,000	
ノバレーゼ	25	71,100.00	1,777,500	
アコーディア・ゴルフ	422	115,000.00	48,530,000	
タケエイ	1,300	4,470.00	5,811,000	
パソナグループ	98	70,200.00	6,879,600	
リンクアンドモチベーション	80	35,950.00	2,876,000	
G C Aサヴィアン	4,400	1,295.00	5,698,000	
エス・エム・エス	5,300	1,720.00	9,116,000	
テンプホールディングス	13,000	2,399.00	31,187,000	
リニカル	2,600	2,039.00	5,301,400	
クックパッド	5,700	3,405.00	19,408,500	
エスクリ	3,000	1,112.00	3,336,000	
アイ・ケイ・ケイ	2,700	894.00	2,413,800	
学情	3,100	572.00	1,773,200	
スタジオアリス	4,400	1,587.00	6,982,800	
シミックホールディングス	3,600	2,393.00	8,614,800	
N E C フィールディング	7,700	1,366.00	10,518,200	
総合警備保障	34,600	1,765.00	61,069,000	
カカクコム	25,900	2,622.00	67,909,800	
ルネサンス	4,300	759.00	3,263,700	
ツクイ	11,800	1,296.00	15,292,800	
エムスリー	225	228,300.00	51,367,500	
ベストプライダル	29	164,900.00	4,782,100	
アウトソーシング	4,400	1,007.00	4,430,800	
ディー・エヌ・エー	46,900	2,198.00	103,086,200	
博報堂D Yホールディングス	13,180	7,980.00	105,176,400	

ぐるなび	6,600	1,256.00	8,289,600	
一休	62	168,400.00	10,440,800	
ジャパンベストレスキューシステム	12	146,000.00	1,752,000	
ジェイコムホールディングス	1,700	975.00	1,657,500	
PGMホールディングス	143	101,300.00	14,485,900	
バリューコマース	38	148,500.00	5,643,000	
J Pホールディングス	3,000	3,480.00	10,440,000	
イーピーエス	102	151,700.00	15,473,400	
アミューズ	2,900	2,475.00	7,177,500	
ドリームインキュベータ	36	178,600.00	6,429,600	
ケネディクス	907	66,500.00	60,315,500	
電通	86,500	3,685.00	318,752,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	415	21,160.00	8,781,400	
ぴあ	2,800	1,653.00	4,628,400	
イオンファンタジー	3,100	1,851.00	5,738,100	
ネクシィーズ	3,500	420.00	1,470,000	
みらかホールディングス	24,900	4,885.00	121,636,500	
アルプス技研	3,900	1,061.00	4,137,900	
サニックス	13,800	1,388.00	19,154,400	
ダイオーズ	1,800	752.00	1,353,600	
日本空調サービス	2,400	896.00	2,150,400	
オリエンタルランド	28,300	15,380.00	435,254,000	
ダスキン	25,700	1,872.00	48,110,400	
明光ネットワークジャパン	9,000	1,409.00	12,681,000	
ファルコSDホールディングス	4,900	1,713.00	8,393,700	
秀英予備校	3,300	404.00	1,333,200	
田谷	1,500	766.00	1,149,000	
ラウンドワン	31,100	738.00	22,951,800	
リゾートトラスト	16,300	3,300.00	53,790,000	
ビー・エム・エル	5,600	2,618.00	14,660,800	
ワタベウェディング	2,800	807.00	2,259,600	
もしもしホットライン	15,700	1,219.00	19,138,300	
東急コミュニティ	2,400	5,500.00	13,200,000	
リソー教育	968	11,270.00	10,909,360	
早稲田アカデミー	1,100	804.00	884,400	
ユー・エス・エス	10,630	13,020.00	138,402,600	
東京個別指導学院	4,800	234.00	1,123,200	
テー・オー・ダブリュー	3,200	696.00	2,227,200	
セントラルスポーツ	2,900	1,573.00	4,561,700	
フルキャストホールディングス	90	30,450.00	2,740,500	
リゾートソリューション	12,000	235.00	2,820,000	
リブセンス	800	8,320.00	6,656,000	
リロ・ホールディング	3,300	4,760.00	15,708,000	
エイチ・アイ・エス	7,800	4,470.00	34,866,000	
共立メンテナンス	4,900	3,410.00	16,709,000	
イチネンホールディングス	11,300	726.00	8,203,800	
建設技術研究所	5,300	791.00	4,192,300	
スペース	5,200	926.00	4,815,200	

燦ホールディングス	2,100	1,442.00	3,028,200	
スバル興業	7,000	342.00	2,394,000	
東京テアトル	36,000	176.00	6,336,000	
よみうりランド	20,000	934.00	18,680,000	
東京都競馬	74,000	442.00	32,708,000	
カナモト	11,000	2,748.00	30,228,000	
東京ドーム	72,000	706.00	50,832,000	
トランス・コスモス	12,400	1,656.00	20,534,400	
乃村工藝社	20,000	654.00	13,080,000	
藤田観光	24,000	489.00	11,736,000	
日本管財	3,500	1,605.00	5,617,500	
トーカイ	4,200	3,205.00	13,461,000	
白洋舎	13,000	230.00	2,990,000	
セコム	98,900	5,570.00	550,873,000	
セントラル警備保障	4,200	924.00	3,880,800	
丹青社	9,000	451.00	4,059,000	
メイテック	14,000	2,460.00	34,440,000	
アサツー ディ・ケイ	15,700	2,691.00	42,248,700	
応用地質	10,000	2,001.00	20,010,000	
船井総合研究所	9,800	805.00	7,889,000	
進学会	4,600	392.00	1,803,200	
ベネッセホールディングス	29,000	3,815.00	110,635,000	
イオンディライト	9,200	2,092.00	19,246,400	
ナック	4,300	2,289.00	9,842,700	
ニチイ学館	18,600	959.00	17,837,400	
ダイセキ	14,100	1,890.00	26,649,000	
ステップ	2,900	888.00	2,575,200	
合計	140,983,148	—	160,296,180,080	

B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

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25年6月28日現在）

I 資産総額	7,516,216,349 円
II 負債総額	9,797,851 円
III 純資産総額(I － II)	7,506,418,498 円
IV 発行済口数	9,566,038,095 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	0.7847 円
1万口当たり純資産額	7,847 円

(参考情報)

外国債券インデックス マザーファンド

I 資産総額	230,335,464,139 円
II 負債総額	472,106,236 円
III 純資産総額(I － II)	229,863,357,903 円
IV 発行済口数	101,939,432,800 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	2.2549 円
1万口当たり純資産額	22,549 円

国内株式インデックス マザーファンド

I 資産総額	147,912,785,131 円
II 負債総額	712,981,214 円
III 純資産総額(I － II)	147,199,803,917 円
IV 発行済口数	159,823,438,851 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	0.9210 円
1万口当たり純資産額	9,210 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。

①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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

②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た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。

③受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載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。

④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。

⑤償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載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します。）に支払います。

⑥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がって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（イ）資本金の額（平成25年6月28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年における資本金の額の増減	：該当事項はありません。

（ロ）委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取り締役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、または解任されます。

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

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

②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、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）]

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、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）にパフォーマンス等に係るモニタリング状況を報告します。

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

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した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）及びコンプライアンス会議（議長は社長）に報告されます。

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

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

委託会社の機構は平成25年8月20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25年6月28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	317	4,352,908
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	180
単位型公社債投資信託	0	0
合計	319	4,353,089

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。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成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。

(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	当事業年度
(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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	当事業年度
(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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、従来の方々に比べて、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	千円
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	千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

（リース取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成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(株)	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

① 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(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	—	—

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 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

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

③ 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

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

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
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

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

委託会社は、平成25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

（ロ）訴訟事件その他の重要事項

平成25年8月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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

- ①名称：三井住友信託銀行株式会社
- ②資本金の額：342,037百万円（平成25年3月末日現在）
- ③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	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。
マネックス証券株式会社	7,425	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 S B I 証券	47,937	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。

2【関係業務の概要】**(1)受託会社**

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】**(1)受託会社**

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

（参考）再信託受託会社

- ①名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ②設立年月日：平成12年6月20日
- ③資本金の額：51,000百万円（平成25年3月末日現在）
- ④事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【参考情報】

本ファンドについては、当特定期間中に、金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる次の書類を提出しております。

提出年月日	書類名
平成24年11月28日	臨時報告書
平成25年2月8日	有価証券報告書
平成25年2月8日	有価証券届出書
平成25年2月28日	臨時報告書
平成25年3月18日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成25年7月19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」に掲げられているグローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の平成24年11月20日から平成25年5月20日までの特定期間の財務諸表、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、グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）の平成25年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。