

【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26年2月19日
【計算期間】	第18特定期間（自 平成25年5月21日 至 平成25年11月19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「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2「東証株価指数（TOPIX）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数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東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

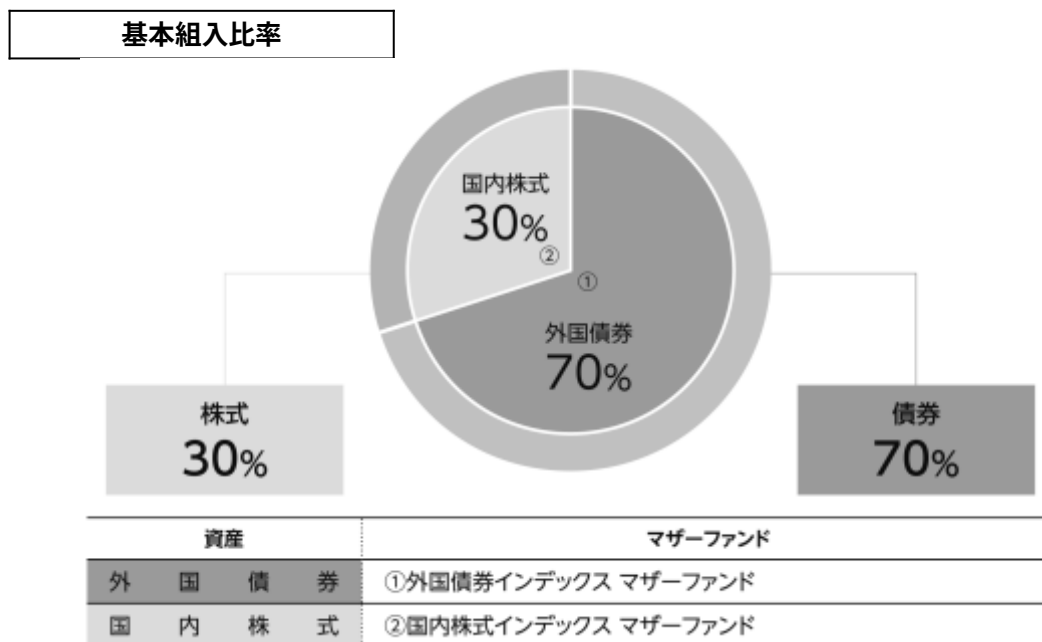
④東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

- ⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数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。
- ⑧以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動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。



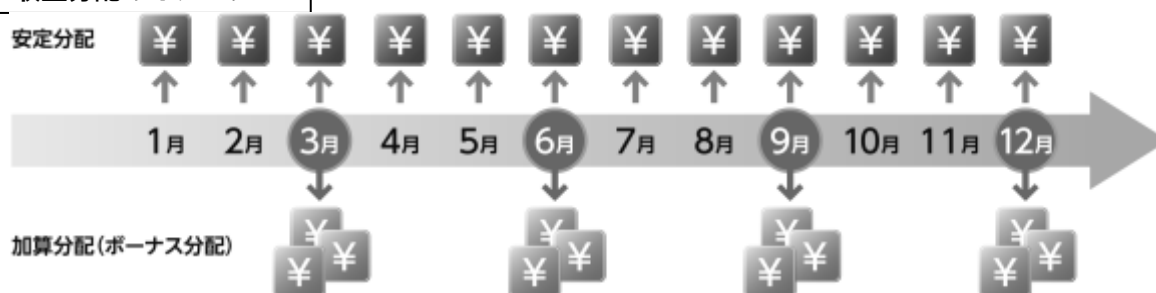
- 資産配分比率が、時価の変動等によって基本組入比率から変化した場合（最大で±5%程度）、一定のルールに基づいて基本組入比率に戻します。
- 外国債券には3%程度の円短期金融資産を含みます。

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

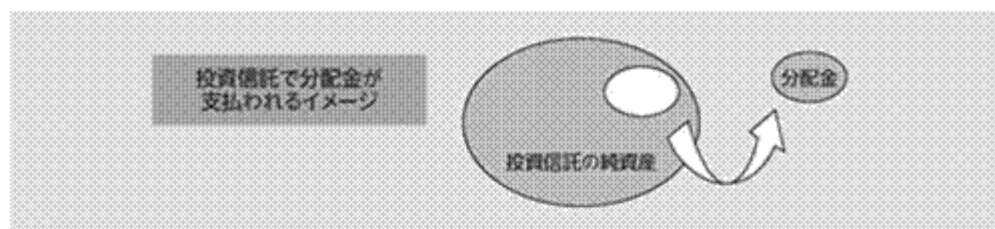


※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

- 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]

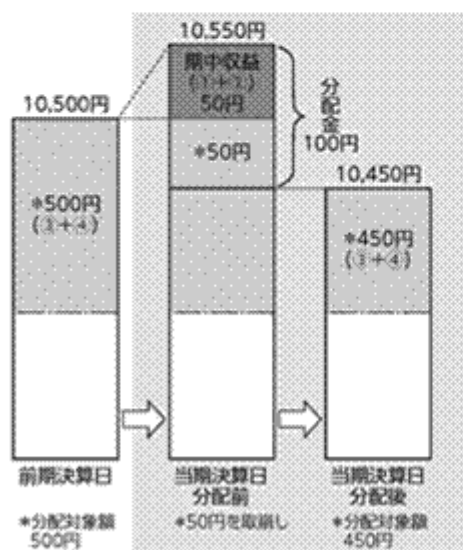
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



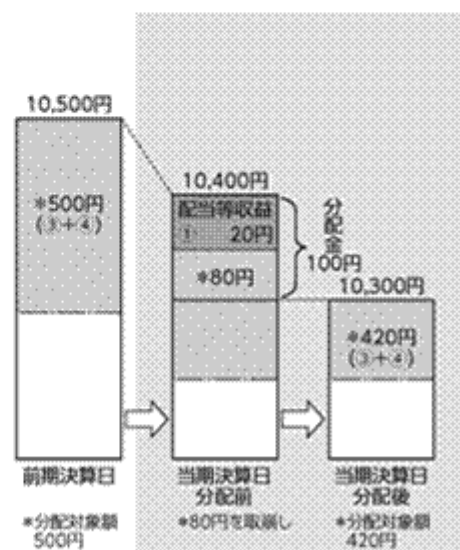
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(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)



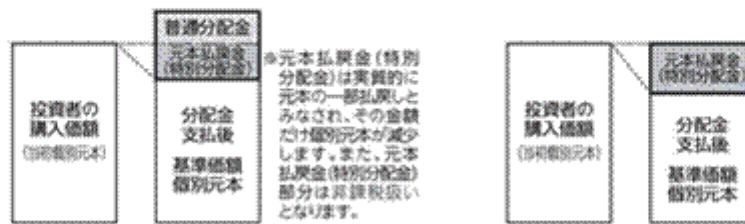
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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。分配金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
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	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	ファミリーファンド	あり ()
	年6回 (隔月)	欧州		
	年6回 (隔月)	アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
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))	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	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

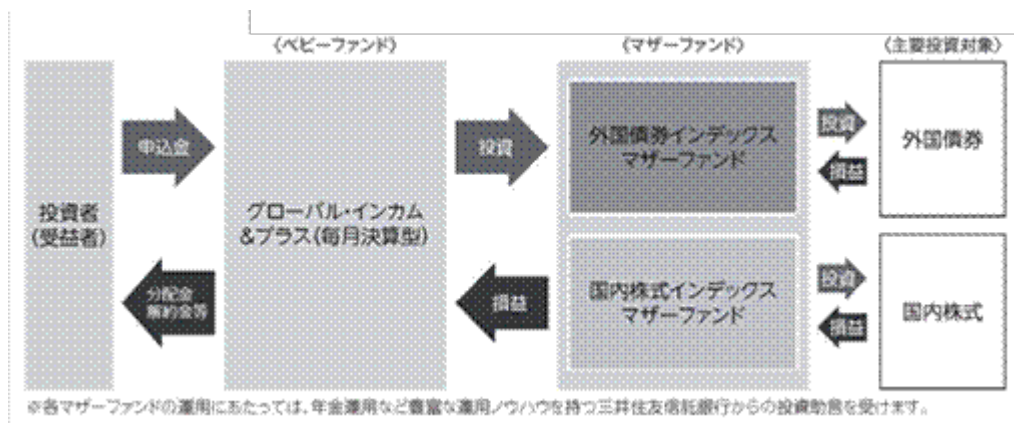
本ファンドの名称を「住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」から「グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）」に変更

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

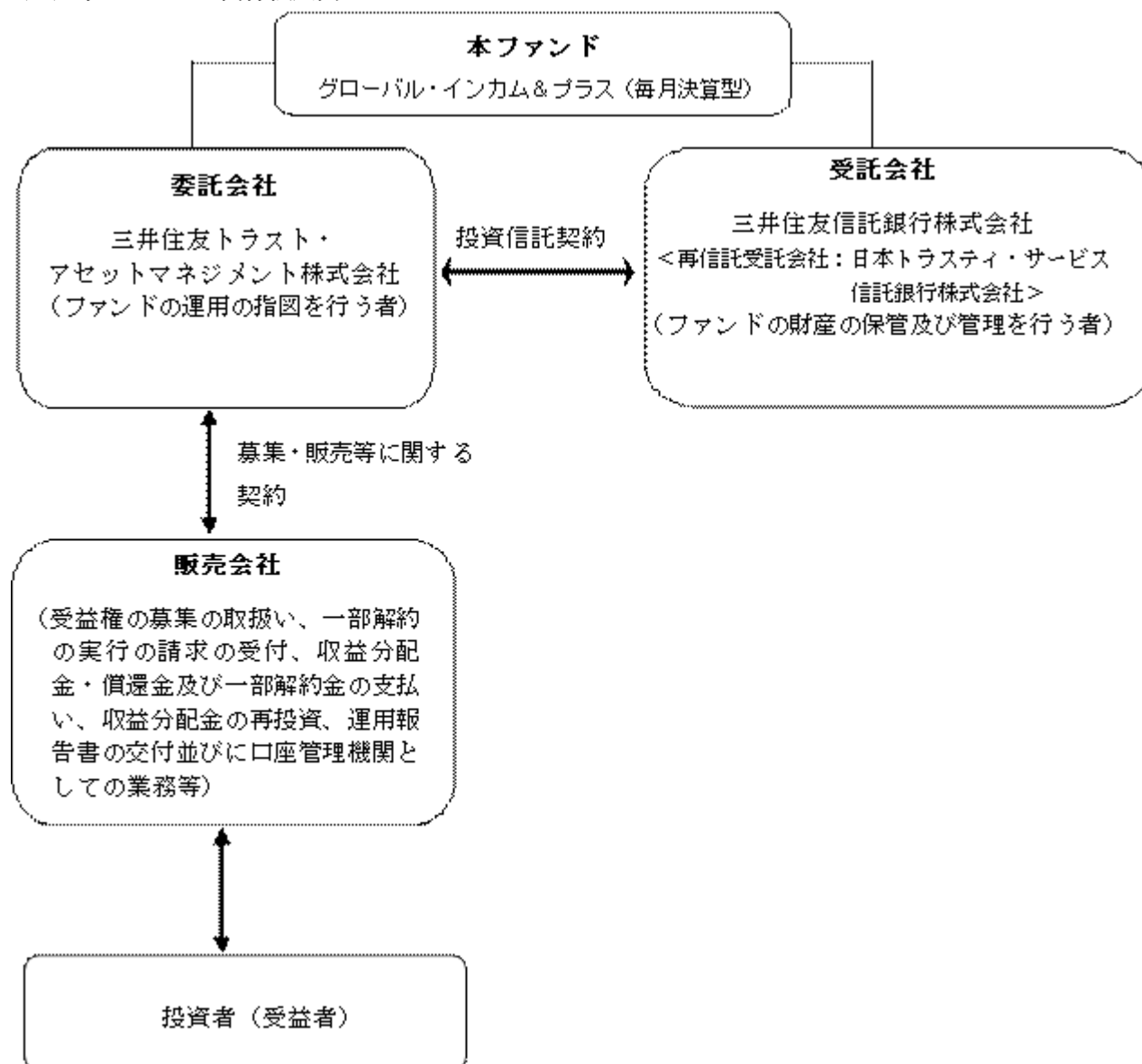
(3) 【ファンドの仕組み】**(イ) ファミリーファンド方式での運用**

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。



(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12月30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12月30日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(イ) 基本方針

本ファンドは、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つては、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

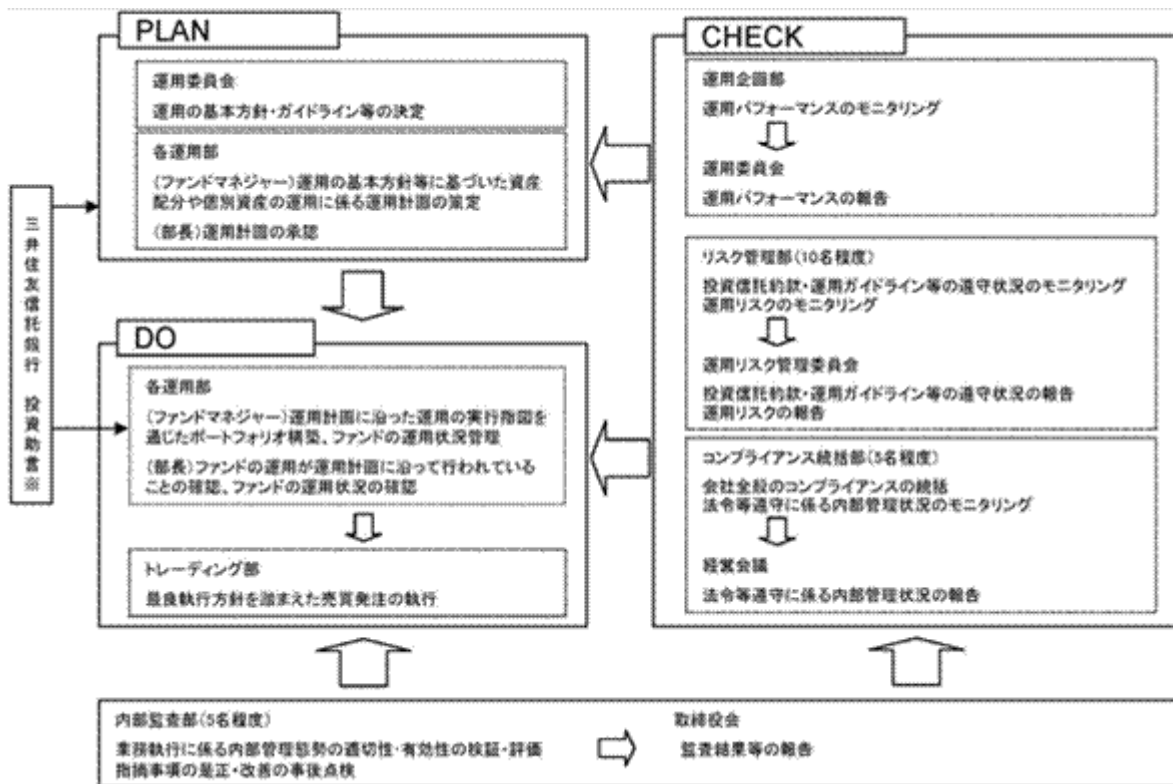
(ロ) 委託者は、信託金を、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された外国債券インデックス マザーファンドおよび国内株式インデックス マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号および第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26年2月19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賃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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第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るものとします。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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことを指図することができます。金利先渡し取引および為替先渡し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。金利先渡し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し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し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、為替先渡し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し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し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解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分

配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 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 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。

⑥ カントリーリスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

- ① 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経営会議に報告します。
- 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。

※消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。

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】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.26%

（※）（税抜 1.20%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.5565%	（税抜 0.53%）
販売会社	年率 0.63%	（税抜 0.6%）
受託会社	年率 0.0735%	（税抜 0.07%）

※消費税率が8%になった場合は、1.296%となります。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.5724%	（税抜 0.53%）
販売会社	年率 0.648%	（税抜 0.6%）
受託会社	年率 0.0756%	（税抜 0.07%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

②信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

（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26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。

④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。

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。

(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26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。

※上記は、平成26年1月1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12月30日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,845,890,431	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		116,297,866	1.67
合計(純資産総額)		6,962,188,297	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	1,891,092,335	2.4688	4,668,728,757	2.4939	4,716,195,174	67.74
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	1,996,526,912	1.0338	2,064,009,522	1.0667	2,129,695,257	30.59

(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	98.33
合計	98.33

(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
第18特定期間末 (平成25年11月19日)	7,086,429,852	7,095,014,692	8,255	8,265
平成24年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	—
7月末日	7,294,196,176	—	7,858	—
8月末日	7,072,211,808	—	7,767	—
9月末日	7,124,681,813	—	8,030	—
10月末日	7,074,360,155	—	8,147	—
11月末日	7,138,642,414	—	8,455	—
12月末日	6,962,188,297	—	8,670	—

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
第18特定期間(平成25年 5月21日～平成25年11月19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
第18特定期間(平成25年 5月21日～平成25年11月19日)	△2.1

(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
第18特定期間 (平成25年 5月21日～平成25年11月19日)	18,582,737	1,270,884,312	8,584,840,356

(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	85,169,631,452	37.90
	フランス	22,510,515,433	10.02
	イタリア	22,335,172,486	9.94
	ドイツ	19,765,794,047	8.80
	イギリス	17,210,995,601	7.66
	スペイン	11,615,156,578	5.17
	オランダ	6,216,134,239	2.77
	ベルギー	6,124,025,604	2.73
	カナダ	5,450,308,824	2.43
	オーストリア	3,726,490,822	1.66
	オーストラリア	3,222,846,418	1.43
	メキシコ	2,298,628,030	1.02
	ポーランド	1,905,073,674	0.85
	アイルランド	1,837,354,547	0.82
	デンマーク	1,747,526,428	0.78
	フィンランド	1,463,940,472	0.65
	スウェーデン	1,218,529,948	0.54
	マレーシア	1,123,165,512	0.50
	南アフリカ	1,073,560,019	0.48
	スイス	833,169,281	0.37
	シンガポール	788,862,487	0.35
	ノルウェー	722,248,177	0.32
	小計	218,359,130,079	97.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,337,023,714	2.82
合計(純資産総額)		224,696,153,793	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 0.375% 06/30/15	34,400,000	10,543.21	3,626,866,166	10,559.78	3,632,567,712	0.375	2015/06/30	1.62
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,796.15	3,001,330,144	10,741.95	2,986,264,339	1.375	2015/11/30	1.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,548.26	2,130,750,025	10,560.40	2,133,202,283	0.375	2015/06/15	0.95
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,926.59	2,097,906,505	10,807.00	2,074,944,671	2.375	2015/02/28	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	10,513.47	2,039,614,326	10,424.75	2,022,403,231	0.750	2017/06/30	0.90
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,470.04	1,884,607,855	10,481.36	1,886,645,671	0.250	2016/04/15	0.84
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,519.65	1,672,624,771	10,523.56	1,673,246,365	0.250	2015/10/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,864.43	1,629,664,924	10,784.77	1,617,715,912	1.750	2015/07/31	0.72
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,523.35	1,473,269,871	10,537.55	1,475,258,275	0.250	2015/07/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	14,000,000	10,601.18	1,484,165,214	10,532.20	1,474,509,021	0.875	2017/02/28	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,882.13	1,425,559,681	10,795.47	1,414,207,417	1.875	2015/06/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,550.59	1,403,228,855	10,547.43	1,402,809,442	0.625	2016/07/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	11,447.57	1,430,947,137	11,215.38	1,401,923,718	4.250	2015/08/15	0.62
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000	15,434.48	1,358,234,275	15,169.03	1,334,875,423	3.250	2015/07/04	0.59

アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,390.64	1,298,830,596	9,777.39	1,222,174,078	2.000	2023/02/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	10,555.87	1,213,926,066	10,561.84	1,214,612,546	0.375	2015/04/15	0.54
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	15,430.20	1,218,985,912	15,128.13	1,195,122,649	3.500	2015/04/25	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	12,080.94	1,183,932,730	11,760.86	1,152,564,800	4.500	2017/05/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	10,000,000	11,672.99	1,167,299,640	11,231.85	1,123,185,694	3.125	2019/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,978.05	1,130,739,811	10,885.42	1,121,199,126	2.000	2016/01/31	0.50
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	17,138.32	1,131,129,490	16,657.17	1,099,373,838	4.250	2019/04/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,350.76	1,138,584,163	9,974.99	1,097,249,876	1.250	2020/02/29	0.49
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000	15,506.47	1,069,946,674	15,665.54	1,080,922,608	4.500	2018/08/01	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,435.43	1,086,366,085	11,230.00	1,066,850,416	3.000	2017/02/28	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,429.39	1,053,368,834	10,259.67	1,036,227,203	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,449.66	1,044,966,553	10,303.31	1,030,331,339	0.750	2017/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	9,500,000	10,966.88	1,041,853,923	10,841.37	1,029,930,982	2.500	2015/03/31	0.46
ドイツ	国債証券	OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000	15,130.09	1,028,846,322	14,895.69	1,012,907,067	2.500	2015/02/27	0.45
イギリス	国債証券	UKT 1% 09/07/17	5,800,000	17,461.14	1,012,746,259	17,044.63	988,589,101	1.000	2017/09/07	0.44
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	11,364.21	988,686,436	11,193.36	973,822,738	3.000	2016/08/31	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	97.18
合計	97.18

(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	36	4,330,269	4,293,562.68	452,498,570	0.20
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	19	2,366,466.72	2,336,703.22	246,265,152	0.11
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	12	1,558,548	1,539,375	162,234,731	0.07
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	21	2,316,069	2,315,040	335,796,552	0.15
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	24	2,999,856	2,981,520	432,469,476	0.19
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	33	4,629,702	4,585,680	665,152,884	0.30

(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	146,429,269,300	98.54
新株予約権証券	日本	6,251,000	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,166,504,019	1.46
合計(純資産総額)		148,602,024,319	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	1,107,200	6,201.76	6,866,588,672	6,420.00	7,108,224,000	4.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,947,400	613.44	3,648,373,056	694.00	4,127,495,600	2.78
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	385,500	5,328.83	2,054,263,965	9,200.00	3,546,600,000	2.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	593,800	4,197.57	2,492,517,066	5,420.00	3,218,396,000	2.17
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	715,900	3,996.48	2,861,080,032	4,330.00	3,099,847,000	2.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,162,300	200.88	2,041,402,824	228.00	2,317,004,400	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	308,500	5,195.03	1,602,666,755	5,660.00	1,746,110,000	1.18
日本	株式	三菱地所	不動産業	550,000	2,651.20	1,458,160,000	3,145.00	1,729,750,000	1.16
日本	株式	ファナック	電気機器	88,700	15,255.84	1,353,193,008	19,250.00	1,707,475,000	1.15
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	494,000	3,609.02	1,782,855,880	3,420.00	1,689,480,000	1.14
日本	株式	KDDI	情報・通信業	243,700	4,850.37	1,182,035,169	6,470.00	1,576,739,000	1.06
日本	株式	キヤノン	電気機器	461,200	3,655.13	1,685,745,956	3,330.00	1,535,796,000	1.03
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,910,000	700.43	1,337,821,300	796.00	1,520,360,000	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	312,100	4,676.77	1,459,619,917	4,825.00	1,505,882,500	1.01
日本	株式	三井不動産	不動産業	370,000	2,982.59	1,103,558,300	3,785.00	1,400,450,000	0.94
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	328,400	3,677.19	1,207,589,196	4,180.00	1,372,712,000	0.92
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,605,800	839.34	1,347,812,172	809.00	1,299,092,200	0.87
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,521,000	274.60	966,866,600	352.00	1,239,392,000	0.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	612,600	1,847.90	1,132,023,540	2,017.00	1,235,614,200	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	146,300	7,705.81	1,127,360,003	8,380.00	1,225,994,000	0.83
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	191,900	5,421.04	1,040,297,576	6,230.00	1,195,537,000	0.80
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	646,900	1,518.99	982,634,631	1,725.00	1,115,902,500	0.75
日本	株式	パナソニック	電気機器	908,900	836.34	760,149,426	1,224.00	1,112,493,600	0.75
日本	株式	デンソー	輸送用機器	196,500	4,469.72	878,299,980	5,550.00	1,090,575,000	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	304,100	3,148.84	957,562,244	3,515.00	1,068,911,500	0.72
日本	株式	三井物産	卸売業	722,900	1,369.24	989,823,596	1,465.00	1,059,048,500	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	796,000	1,044.47	831,398,120	1,320.00	1,050,720,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	261,100	3,467.64	905,400,804	3,980.00	1,039,178,000	0.70
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,116,600	1,121.01	1,251,719,766	884.00	987,074,400	0.66
日本	株式	住友不動産	不動産業	188,000	4,111.80	773,018,400	5,230.00	983,240,000	0.66

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.54

新株予約権証券	0.00
合計	98.54

(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	0.07
		鉱業	0.46
		建設業	2.51
		食料品	3.71
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.29
		化学	5.17
		医薬品	4.26
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.91
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.75
		非鉄金属	1.05
		金属製品	0.69
		機械	5.16
		電気機器	11.79
		輸送用機器	11.75
		精密機器	1.34
		その他製品	1.42
		電気・ガス業	2.15
		陸運業	3.60
		海運業	0.39
		空運業	0.46
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	7.26
		卸売業	4.32
		小売業	4.18
		銀行業	9.87
		証券、商品先物取引業	1.83
		保険業	2.34
		その他金融業	1.45
		不動産業	3.74
		サービス業	2.09
合計			98.54

(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	142	1,795,554,000	1,849,550,000	1,849,550,000	1.24

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

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績



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（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又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、）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ないものとし、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。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ます。）を行うものとします。

- 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1万口あ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18特定期間(平成25年5月21日から平成25年11月19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17特定期間 (平成25年 5月20日現在)	第18特定期間 (平成25年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,253,873	117,890,391
親投資信託受益証券	8,238,685,107	6,953,592,005
未収入金	45,940,000	35,190,000
未収利息	168	159
流動資産合計	8,402,879,148	7,106,672,555
資産合計	8,402,879,148	7,106,672,555
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,837,141	8,584,840
未払解約金	28,543,403	4,585,527
未払受託者報酬	511,354	410,840
未払委託者報酬	8,254,711	6,632,160
その他未払費用	36,517	29,336
流動負債合計	47,183,126	20,242,703
負債合計	47,183,126	20,242,703
純資産の部		
元本等		
元本	9,837,141,931	8,584,840,356
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,481,445,909	△1,498,410,504
（分配準備積立金）	120,001,731	122,727,825
元本等合計	8,355,696,022	7,086,429,852
純資産合計	8,355,696,022	7,086,429,852
負債純資産合計	8,402,879,148	7,106,672,555

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	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18特定期間 (自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月19日)
営業収益		
受取利息	17,238	31,475
有価証券売買等損益	2,537,720,344	△165,603,102
営業収益合計	2,537,737,582	△165,571,627
営業費用		
受託者報酬	2,829,558	2,703,891
委託者報酬	45,677,141	43,648,471
その他費用	202,051	193,070
営業費用合計	48,708,750	46,545,432
営業利益又は営業損失（△）	2,489,028,832	△212,117,059
経常利益又は経常損失（△）	2,489,028,832	△212,117,059
当期純利益又は当期純損失（△）	2,489,028,832	△212,117,059
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（△）	27,255,992	△9,017,327
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△4,307,047,786	△1,481,445,909
剰余金増加額又は欠損金減少額	435,227,806	244,166,704
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	435,227,806	244,166,704
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,533,605	3,573,620
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,533,605	3,573,620
分配金	62,865,164	54,457,947
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,481,445,909	△1,498,410,504

(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18特定期間(自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月19日) 第18特定期間は前特定期間末日が休業日のため、平成25年 5月21日から平成25年11月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第17特定期間 (平成25年 5月20日現在)	第18特定期間 (平成25年11月19日現在)
1. 期首元本額	11,334,344,184円	9,837,141,931円
期中追加設定元本額	30,551,318円	18,582,737円
期中一部解約元本額	1,527,753,571円	1,270,884,312円
2. 当該特定期間の末日における受益権総数	9,837,141,931口	8,584,840,356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 1,481,445,909円	元本の欠損 1,498,410,504円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8494円 (8,494円)	0.8255円 (8,255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17特定期間 自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日	第18特定期間 自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月19日
		第95期 自 平成24年11月20日 至 平成24年12月19日	第101期 自 平成25年5月21日 至 平成25年6月19日
費用控除後の配当等収益額	A	12,475,788円 (12,671,654円)	5,207,376円 (13,280,530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	4,470,309円	4,162,619円
分配準備積立金額	D	89,327,948円	116,993,828円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	106,274,045円	126,363,823円
当ファンドの期末残存口数	F	11,075,108,171口	9,595,105,105口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	95.95円	131.69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	11,075,108円	9,595,105円

		第96期 自 平成24年12月20日 至 平成25年1月21日	第102期 自 平成25年6月20日 至 平成25年7月19日
費用控除後の配当等収益額	A	16,605,168円 (16,893,586円)	14,326,000円 (14,613,674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	4,412,080円	4,119,059円
分配準備積立金額	D	88,780,893円	110,132,984円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,798,141円	128,578,043円
当ファンドの期末残存口数	F	10,841,511,493口	9,388,183,248口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	101.27円	136.95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	10,841,511円	9,388,183円
		第97期 自 平成25年1月22日 至 平成25年2月19日	第103期 自 平成25年7月20日 至 平成25年8月19日
費用控除後の配当等収益額	A	13,002,074円 (13,306,440円)	5,199,621円 (13,147,048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	4,406,912円	4,070,113円
分配準備積立金額	D	92,782,777円	112,581,768円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	110,191,763円	121,851,502円
当ファンドの期末残存口数	F	10,647,586,118口	9,188,160,895口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	103.48円	132.61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	10,647,586円	9,188,160円
		第98期 自 平成25年2月20日 至 平成25年3月19日	第104期 自 平成25年8月20日 至 平成25年9月19日
費用控除後の配当等収益額	A	13,145,415円 (13,554,885円)	12,494,018円 (12,963,808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	4,341,091円	3,981,998円
分配準備積立金額	D	92,676,011円	105,513,142円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	110,162,517円	121,989,158円
当ファンドの期末残存口数	F	10,377,116,222口	8,929,703,127口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	106.15円	136.61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	10,377,116円	8,929,703円
		第99期 自 平成25年3月20日 至 平成25年4月19日	第105期 自 平成25年9月20日 至 平成25年10月21日
費用控除後の配当等収益額	A	34,084,606円 (34,726,389円)	24,887,519円 (27,796,469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	4,263,731円	3,949,912円
分配準備積立金額	D	92,738,301円	107,117,886円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	131,086,638円	135,955,317円
当ファンドの期末残存口数	F	10,086,702,379口	8,771,956,393口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	129.95円	154.98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	10,086,702円	8,771,956円
		第100期 自 平成25年4月20日 至 平成25年5月20日	第106期 自 平成25年10月22日 至 平成25年11月19日
費用控除後の配当等収益額	A	16,040,137円 (16,327,476円)	10,736,349円 (11,391,440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	4,209,326円	3,894,973円
分配準備積立金額	D	113,798,735円	120,576,316円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	134,048,198円	135,207,638円
当ファンドの期末残存口数	F	9,837,141,931口	8,584,840,356口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	136.26円	157.49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	9,837,141円	8,584,840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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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17特定期間 (平成25年 5月20日現在)	第18特定期間 (平成25年11月19日現在)
	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)	計算期間(自 平成25年10月22日 至 平成25年11月19日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	489,238,320	121,327,296
合計	489,238,320	121,327,296

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(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	2,026,076,978	4,793,090,306	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,134,250,419	2,160,501,699	
親投資信託受益証券 小計		4,160,327,397	6,953,592,005	
合計		4,160,327,397	6,953,592,005	

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。

<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11月19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11月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	410,830,528
コール・ローン	2,622,570,774
国債証券	222,649,597,086
派生商品評価勘定	642,617
未収入金	21,349,303
未収利息	2,054,654,784
前払費用	134,810,345
差入委託証拠金	39,950,257
流動資産合計	227,934,405,694
資産合計	227,934,405,694
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,904,825
未払金	1,037,750
未払解約金	1,265,671,905
流動負債合計	1,268,614,480
負債合計	1,268,614,480
純資産の部	
元本等	
元本	95,814,953,992
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	130,850,837,222
元本等合計	226,665,791,214
純資産合計	226,665,791,214
負債純資産合計	227,934,405,694

(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11月19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11月19日現在
1. 特定期間の期首元本額	104,375,420,897円
特定期間中の追加設定元本額	16,942,952,805円
特定期間中の一部解約元本額	25,503,419,710円
計算日の元本額	95,814,953,992円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,947,157,159円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	238,816,597円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,026,076,978円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,538,787,522円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	594,699,628円

SBI資産設計オープン(分配型)	9,674,152円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,479,767,797円
世界経済インデックスファンド	496,992,811円
マイセクション25	14,298,044円
マイセクション50	7,204,954円
マイセクション75	6,135,099円
DCマイセクション25	997,107,113円
DCマイセクション50	932,126,582円
DCマイセクション75	597,041,836円
DC外国債券インデックス・オープン	1,175,247,671円
DCマイセクションS25	354,478,394円
DCマイセクションS50	305,798,478円
DCマイセクションS75	135,256,578円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,659,339円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	39,241,634円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	27,141,591円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	9,647,112円
DC世界経済インデックスファンド	368,801,003円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	10,149,120,049円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	258,018,876円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	23,256,474円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	8,581,483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)	325,395,764円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,055,787,007円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,723,258,417円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	18,130,936,691円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,252,973,462円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,004,702,676円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,237,482,036円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,154,286,422円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,899,339,103円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,448,898,197円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,333,021,106円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,325,317,380円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	503,012,292円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	682,206,140円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,448,176,867円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	852,127,494円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	335,520,490円
外国債券ファンド・シリーズ1	528,428,339円
コア投資戦略ファンド(安定型)	750,732,478円
コア投資戦略ファンド(成長型)	779,780,146円
分散投資コア戦略ファンドA	26,032,275円
分散投資コア戦略ファンドS	53,117,730円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
コア投資戦略ファンド(切替型)	39,117円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	260,500円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,070,811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)	8,220,679,299円

2. 計算日における受益権総数	95,814,953,992口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3657円 (23,657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11月19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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月19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11月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△3,461,196,374
合計	△3,461,196,374

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年11月19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11月19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	712,825,104	—	713,374,156	549,052
合計		712,825,104	—	713,374,156	549,052

(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11月19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	461,191,400	—	459,402,000	△1,789,400
	カナダドル	44,973,360	—	44,974,300	940
	イギリスポンド	90,161,680	—	90,092,800	△68,880
	ユーロ	388,465,920	—	388,512,000	46,080
	計	984,792,360	—	982,981,100	△1,811,260
合計		984,792,360	—	982,981,100	△1,811,260

(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11月19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11月19日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年11月19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	10,009,765.60	
		T 0.25% 02/15/15	8,000,000.00	8,007,187.51	
		T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,946,210.96	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	14,003,007.76	
		T 0.25% 10/15/15	18,700,000.00	18,691,964.79	
		T 0.25% 12/15/14	2,000,000.00	2,002,304.68	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	3,002,402.34	
		T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,802,250.00	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,528,750.00	
		T 0.375% 06/15/15	20,200,000.00	20,248,132.76	
		T 0.375% 06/30/15	34,400,000.00	34,481,968.66	
		T 0.375% 11/15/14	4,000,000.00	4,009,140.64	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,361,564.50	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	989,238.28	
		T 0.625% 11/30/17	11,500,000.00	11,340,078.12	
		T 0.75% 02/28/18	10,100,000.00	9,964,478.50	
		T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,386,035.17	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,364,382.76	
		T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,897,070.30	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,463,046.87	
		T 0.875% 02/28/17	14,000,000.00	14,088,320.26	
		T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,255,351.55	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,413,480.47	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,727,187.50	
		T 1% 09/30/16	7,900,000.00	8,008,470.71	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,851,875.00	
		T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,040,494.11	
		T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,910,898.44	
		T 1.125% 12/31/19	8,700,000.00	8,385,984.37	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	893,671.87	
		T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,637,558.58	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,366,904.29	
		T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,390,031.27	
		T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,682,437.50	
		T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,218,218.75	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,917,976.58	
		T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,402,152.44	
		T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	2,001,562.50	
		T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,408,765.63	
		T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,418,585.95	

T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,870,121.07	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,206,445.33	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	7,892,880.87	
T 1.75% 05/15/22	10,000,000.00	9,507,226.60	
T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	9,458,109.42	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,382,910.10	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,445,410.18	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,193,804.66	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,162,523.46	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,109,570.32	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,590,039.07	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,676,996.06	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	5,852,578.14	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	11,928,222.62	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,230,367.16	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,352,984.38	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,069,380.86	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	12,855,691.42	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,534,894.53	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	6,022,451.15	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,100,234.38	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,735,500.09	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,446,796.88	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,214,765.64	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	579,261.72	
T 2.5% 03/31/15	9,500,000.00	9,797,246.07	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,051,796.88	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,378,408.18	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,323,144.55	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,753,945.34	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,339,843.76	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,647,417.00	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	640,816.40	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,068,152.35	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,552,656.24	
T 2.75% 08/15/42	9,200,000.00	7,539,328.14	
T 2.75% 11/15/42	11,000,000.00	8,996,152.33	
T 2.75% 11/30/16	5,000,000.00	5,324,121.10	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,194,099.62	
T 2.875% 05/15/43	8,400,000.00	7,039,429.65	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,212,500.00	
T 3% 05/15/42	5,500,000.00	4,768,564.46	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,301,353.48	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,773,232.43	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	885,273.44	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,025,458.96	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	13,911,750.01	

T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,674,001.97	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,986,865.21	
T 3.125% 11/15/41	3,500,000.00	3,124,638.68	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,795,718.75	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,687,060.55	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,783,417.96	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,354,656.28	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,277,013.67	
T 3.5% 02/15/39	3,400,000.00	3,308,890.64	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,733,297.85	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,754,277.37	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,338,902.33	
T 3.75% 08/15/41	5,900,000.00	5,941,599.60	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,591,210.95	
T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,339,289.05	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,539,609.38	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,726,873.05	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,090,615.22	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	660,878.90	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,369,628.87	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,192,789.07	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,495,410.15	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,573,113.27	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,498,718.75	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,241,210.94	
T 4.375% 11/15/39	4,000,000.00	4,491,328.12	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	2,866,748.05	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,061,175.81	
T 4.5% 05/15/38	1,500,000.00	1,716,972.66	
T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,320,953.12	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,359,322.25	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,634,277.35	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,341,232.41	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,486,544.91	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	613,339.84	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,364,750.00	
T 5.25% 02/15/29	800,000.00	994,109.37	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,615,732.41	
T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,040,687.51	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,526,226.56	
T 6.0% 02/15/26	1,000,000.00	1,315,937.50	
T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	2,979,266.01	
T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,517,183.59	
T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,564,474.60	
T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,432,848.60	
T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,616,582.02	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,427,912.10	

	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,862,070.32	
アメリカドル小計		860,620,000.00	881,692,128.04 (88,063,409,748)	
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,982.00	
	CAN 1% 11/01/15	1,000,000.00	998,030.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	2,300,000.00	2,263,832.50	
	CAN 1.25% 09/01/18	850,000.00	830,828.25	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	1,918,906.50	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,650,627.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,800,000.00	1,837,593.00	
	CAN 2% 12/01/14	3,200,000.00	3,233,072.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,066,225.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,100,000.00	1,086,860.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,051,130.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,200,000.00	2,290,497.00	
	CAN 3% 12/01/15	2,900,000.00	3,009,489.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,600,000.00	1,713,200.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,900,000.00	2,066,402.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,000,000.00	2,167,880.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	2,963,655.00	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,302,026.50	
	CAN 4% 06/01/17	3,100,000.00	3,377,047.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,350,000.00	2,750,510.50	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,947,391.25	
	CAN 4.5% 06/01/15	6,400,000.00	6,735,264.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,150,000.00	2,852,190.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,800,000.00	2,447,901.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,950,000.00	2,740,588.50	
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,034,621.25	
カナダドル小計		54,800,000.00	59,535,750.25 (5,702,334,158)	
オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,450,000.00	1,275,978.25	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,200,000.00	1,089,078.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	850,000.00	723,868.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,400,000.00	1,452,395.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,850,000.00	2,978,948.25	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,550,000.00	1,597,964.75	
	ACGB 4.75% 06/15/16	3,150,000.00	3,293,561.25	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,050,000.00	2,127,244.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,500,000.00	2,714,325.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,000,000.00	3,259,605.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,950,000.00	3,271,859.75	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,700,000.00	3,025,579.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,550,000.00	2,868,673.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,488,576.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,250,000.00	2,362,668.75	

オーストラリアドル小計		33,650,000.00	35,530,325.50 (3,326,704,376)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	6,550,000.00	6,514,564.50	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,300,000.00	3,265,581.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	821,444.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,350,000.00	3,138,313.50	
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,195,666.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,550,000.00	2,447,247.75	
	UKT 2.75% 01/22/15	3,250,000.00	3,339,017.50	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,500,000.00	2,363,987.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,250,000.00	1,256,093.75	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,300,000.00	2,420,922.50	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,600,000.00	3,989,304.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,324,405.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,650,000.00	2,925,719.25	
	UKT 4% 01/22/60	1,900,000.00	2,135,353.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	2,858,894.25	
	UKT 4% 09/07/16	3,400,000.00	3,709,825.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,750,000.00	3,102,811.25	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	3,379,875.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,149,954.50	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,000,000.00	2,258,380.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,500,000.00	2,831,975.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,750,000.00	3,147,485.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,200,000.00	2,542,254.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	2,463,006.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	1,950,000.00	2,231,853.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,650,000.00	3,083,142.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,000,000.00	3,553,095.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,750,000.00	3,212,605.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,800,000.00	3,016,370.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,103,100.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,350,000.00	2,865,131.75	
	UKT 5% 03/07/18	3,300,000.00	3,811,797.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	2,896,668.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,700,000.00	2,285,148.50	
	UKT 8% 06/07/21	2,300,000.00	3,222,173.50	
	UKT 8% 12/07/15	2,195,000.00	2,534,325.05	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,923,112.50	
イギリスポンド小計		96,745,000.00	107,320,601.05 (17,272,177,532)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	111,013.50	
	SWISS 3% 01/08/18	3,350,000.00	3,746,070.50	
	SWISS 3% 05/12/19	200,000.00	228,915.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	847,704.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,900,000.00	2,412,800.50	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	402,576.00	

スイスフラン小計		6,650,000.00	7,749,079.50 (848,291,732)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	150,000.00	149,942.25	
	SIGB 0.5% 04/01/18	500,000.00	498,605.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	350,000.00	356,648.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	700,000.00	714,301.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	550,000.00	586,349.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	907,902.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	426,305.25	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,302,037.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	400,000.00	390,548.00	
	SIGB 3% 09/01/24	400,000.00	417,620.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	969,925.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	700,000.00	766,045.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	200,000.00	207,352.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	900,000.00	968,562.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	875,936.00	
	SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	861,780.00	
シンガポールドル小計		9,850,000.00	10,399,859.25 (833,548,718)	
マレーシア リングgit	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	701,368.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	300,000.00	301,158.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,529,115.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,250,000.00	1,196,250.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,254,376.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,350,000.00	1,316,648.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,035,660.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,390,664.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	3,900,000.00	3,936,718.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,700,000.00	1,722,159.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	800,000.00	803,132.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	342,216.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	675,146.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,786,588.75	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,718,237.50	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,100,000.00	5,258,712.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,606,540.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	650,000.00	673,637.25	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,340,774.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,200,000.00	1,325,652.00	
マレーシアリングgit小計		36,650,000.00	36,914,755.25 (1,156,170,134)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	12,000,000.00	11,256,000.00	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	7,988,170.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	6,900,000.00	7,626,880.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	9,360,372.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	10,550,000.00	11,501,082.50	

	SGB 4.25% 03/12/19	11,800,000.00	13,420,435.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	9,850,000.00	10,465,083.25	
	SGB 5% 12/01/20	8,000,000.00	9,667,000.00	
スウェーデンクローナ小計		75,100,000.00	81,285,023.25 (1,228,216,701)	
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	5,100,000.00	4,768,857.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,800,000.00	9,510,952.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,200,000.00	9,957,068.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,950,000.00	8,870,808.75	
	NGB 5% 05/15/15	11,750,000.00	12,348,721.25	
ノルウェークローネ小計		42,800,000.00	45,456,407.00 (740,939,434)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	7,450,000.00	7,266,208.50	
	DGB 2% 11/15/14	9,050,000.00	9,232,176.50	
	DGB 2.5% 11/15/16	3,500,000.00	3,736,162.50	
	DGB 3% 11/15/21	14,250,000.00	15,967,837.50	
	DGB 4% 11/15/15	13,000,000.00	14,015,430.00	
	DGB 4% 11/15/17	9,250,000.00	10,555,822.50	
	DGB 4% 11/15/19	13,500,000.00	15,905,970.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,500,000.00	23,842,700.00	
	DGB 7% 11/10/24	4,300,000.00	6,567,046.00	
デンマーククローネ小計		91,800,000.00	107,089,353.50 (1,937,246,404)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,500,000.00	10,783,737.50	
	MBONO 4.75% 06/14/18	10,400,000.00	10,283,936.00	
	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,630,256.00	
	MBONO 6% 06/18/15	73,900,000.00	76,479,479.50	
	MBONO 6.5% 06/10/21	18,400,000.00	19,243,916.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,420,076.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	21,288,921.50	
	MBONO 8% 12/07/23	27,100,000.00	30,701,996.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	48,400,000.00	54,980,706.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	35,642,377.50	
メキシコペソ小計		278,450,000.00	302,455,402.50 (2,347,053,923)	
ポーランドズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	1,500,000.00	1,430,130.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	5,000,000.00	5,047,450.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,700,000.00	2,623,023.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,200,432.50	
	POLGB 4.75% 10/25/16	4,650,000.00	4,864,365.00	
	POLGB 5% 04/25/16	2,300,000.00	2,408,215.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	5,978,280.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,435,168.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	3,050,000.00	3,169,392.25	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,250,000.00	4,616,775.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,550,000.00	1,720,600.75	
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,900,000.00	5,414,745.00	

	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,088,456.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	10,200,000.00	10,854,789.00	
ポーランドズロチ小計		53,800,000.00	56,851,821.50 (1,835,745,316)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,200,000.00	24,105,367.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	13,100,000.00	9,774,368.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	10,450,000.00	7,769,104.75	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	13,415,500.00	
	SAGB 7% 02/28/31	11,900,000.00	10,112,382.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	12,900,000.00	12,847,239.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,300,000.00	5,294,488.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,700,000.00	13,217,652.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	13,500,000.00	14,160,757.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	4,900,000.00	4,709,316.50	
	SAGB 8.75% 12/21/14	1,700,000.00	1,775,548.00	
南アフリカランド小計		120,650,000.00	117,181,723.25 (1,153,068,156)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,110,593.00	
	BGB 2.25% 06/22/23	400,000.00	395,420.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,050,000.00	1,142,793.75	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,100,000.00	3,345,985.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,045,000.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	650,000.00	675,996.75	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,000,000.00	2,131,540.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,650,000.00	3,007,577.75	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,602,220.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,556,940.00	
	BGB 4% 03/28/32	1,300,000.00	1,442,025.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,950,000.00	3,277,966.25	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,100,000.00	2,400,636.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,120,636.50	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,402,446.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,100,000.00	3,607,439.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,150,000.00	1,359,271.25	
	BGB 5% 03/28/35	2,800,000.00	3,528,770.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,650,000.00	3,450,710.75	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,800,000.00	2,121,786.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,492,431.75	
	BTNS 1% 07/25/17	3,000,000.00	3,039,870.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,664,264.00	
	BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,265,406.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,341,920.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	2,300,000.00	2,362,353.00	
	BTNS 2.5% 07/25/16	5,000,000.00	5,285,725.00	
	BTPS 2.75% 12/01/15	3,000,000.00	3,089,400.00	
	BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,908,661.00	
	BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,046,828.50	

BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,896,810.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	837,724.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,672,540.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,318,943.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	5,500,000.00	5,738,865.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000.00	6,655,288.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	5,400,000.00	5,534,730.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,857,087.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,600,000.00	3,292,308.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,900,000.00	3,048,132.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,559,213.50	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,084,658.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,143,933.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,842,615.25	
BTPS 4.5% 02/01/18	5,050,000.00	5,487,254.25	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,350,000.00	6,862,191.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,720,119.75	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,150,000.00	2,233,774.75	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	2,794,905.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,150,000.00	3,307,405.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000.00	7,515,618.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	4,900,000.00	5,332,768.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,700,000.00	3,985,973.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,340,560.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	900,000.00	879,786.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,222,528.00	
BTPS 5% 03/01/22	2,350,000.00	2,576,269.75	
BTPS 5% 03/01/25	3,400,000.00	3,661,749.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,100,000.00	3,241,174.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,350,000.00	3,422,443.75	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	2,879,436.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,381,260.50	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,800,000.00	4,116,825.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,367,015.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	4,618,035.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	2,954,029.00	
BTPS 6% 05/01/31	4,700,000.00	5,469,695.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	6,300,000.00	7,676,613.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,457,935.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,129,960.00	
DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,572,946.00	
DBR 1.5% 05/15/23	3,500,000.00	3,456,915.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,903,349.50	
DBR 1.75% 07/04/22	3,900,000.00	3,996,096.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,732,392.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,100,000.00	2,268,084.00	
DBR 2.25% 09/04/21	2,800,000.00	3,006,304.00	

DBR 2.5% 01/04/21	2,700,000.00	2,955,960.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,600,000.00	2,524,509.00	
DBR 3% 07/04/20	2,800,000.00	3,163,328.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,113,378.00	
DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000.00	9,249,768.00	
DBR 3.25% 07/04/21	2,300,000.00	2,641,389.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,476,991.00	
DBR 3.5% 01/04/16	6,900,000.00	7,398,663.00	
DBR 3.5% 07/04/19	4,050,000.00	4,665,681.00	
DBR 3.75% 01/04/15	1,300,000.00	1,353,885.00	
DBR 3.75% 01/04/17	2,600,000.00	2,884,622.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	4,049,045.00	
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,960,522.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,200,000.00	4,818,009.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,500,000.00	4,340,980.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,652,448.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,857,741.00	
DBR 4.25% 07/04/39	2,000,000.00	2,605,500.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,619,630.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,000,000.00	4,053,135.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,500,000.00	3,513,350.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,650,000.00	3,783,577.25	
DBR 5.625% 01/04/28	1,900,000.00	2,686,913.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	644,039.20	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,280,520.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,898,375.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,577,684.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,300,000.00	2,300,299.00	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,515,662.50	
FRTR 1.75% 05/25/23	3,600,000.00	3,471,786.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,200,000.00	4,273,122.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,200,000.00	5,546,320.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	2,350,000.00	2,343,232.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,200,000.00	6,735,215.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,270,300.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,712,334.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	850,000.00	830,917.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,610,089.75	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,274,736.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,338,248.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,800,000.00	5,247,576.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,763,283.50	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000.00	6,662,083.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,800,000.00	5,490,432.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,800,000.00	4,329,093.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,150,000.00	2,427,608.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,350,000.00	1,527,592.50	

FRTR 4% 10/25/38	3,650,000.00	4,127,675.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,698,702.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,000,000.00	4,553,780.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,800,000.00	5,564,016.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	6,003,516.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,454,569.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,300,000.00	4,134,636.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,670,225.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,300,000.00	5,716,334.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,550,000.00	4,949,782.75	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,259,932.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,549,175.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,588,344.80	
IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	824,212.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,350,000.00	1,476,778.50	
IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	737,390.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,350,000.00	3,628,083.50	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	883,024.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,800,000.00	1,955,106.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,204,913.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	567,545.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,000,000.00	1,167,245.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	1,600,000.00	1,613,952.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	2,250,000.00	2,301,052.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	600,000.00	608,496.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,650,000.00	1,611,357.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,400,000.00	2,484,132.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,234,704.50	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,500,000.00	1,459,192.50	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,442,553.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	3,900,000.00	4,098,139.50	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,550,000.00	2,854,699.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,400,000.00	2,731,296.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	1,966,016.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	2,624,259.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,950,000.00	2,373,803.25	
NETHER 4% 07/15/16	3,850,000.00	4,224,990.00	
NETHER 4% 07/15/19	2,400,000.00	2,783,856.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,919,877.50	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,250,000.00	2,568,915.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,950,000.00	2,660,677.50	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	809,187.50	
OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	4,005,260.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,417,040.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,047,490.00	
OBL 1% 10/12/18	2,000,000.00	2,035,430.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	515,187.50	

OBL 1.75% 10/09/15	2,000,000.00	2,062,580.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,605,332.50	
OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000.00	7,009,134.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,355,143.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	900,000.00	874,957.50	
RAGB 3.15% 06/20/44	600,000.00	631,914.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,250,000.00	1,360,356.25	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,150,000.00	1,292,145.75	
RAGB 3.5% 07/15/15	1,450,000.00	1,530,163.25	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,499,662.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,300,000.00	1,487,707.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	613,432.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,200,000.00	2,551,153.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,050,000.00	2,260,432.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,201,904.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,050,000.00	1,196,076.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,450,000.00	2,869,954.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	2,800,000.00	3,252,144.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,250,000.00	1,584,237.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,000,000.00	1,439,740.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	579,408.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	750,000.00	739,631.25	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	622,626.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	438,543.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	672,802.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,050,000.00	1,187,754.75	
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	797,608.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	2,100,000.00	2,361,481.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,000,000.00	1,185,510.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,200,000.00	1,280,592.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,064,547.00	
SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,849,302.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	6,314,842.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,600,000.00	1,662,432.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	1,800,000.00	1,871,766.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	1,000,000.00	1,024,620.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	1,400,000.00	1,463,063.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	3,550,000.00	3,750,681.50	
SPGB 4% 04/30/20	3,200,000.00	3,353,312.00	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,757,298.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,707,594.25	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,500,000.00	2,244,050.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	4,000,000.00	4,270,480.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,575,176.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,150,000.00	7,452,623.75	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,281,114.50	
SPGB 4.6% 07/30/19	4,500,000.00	4,911,930.00	

	SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	2,683,525.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,750,000.00	1,675,870.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	4,000,000.00	4,228,560.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,950,000.00	3,225,176.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,000,000.00	1,977,300.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	950,000.00	1,006,387.25	
	SPGB 5.15% 10/31/44	650,000.00	660,016.50	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,800,000.00	3,099,516.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,838,515.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	2,350,000.00	2,627,206.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,530,350.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,265,088.25	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,489,891.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,500,000.00	2,873,387.50	
	ユーロ小計	646,230,000.00	713,102,740.75 (96,204,690,754)	
国債証券合計			222,649,597,086 (222,649,597,086)	
合計			222,649,597,086 (222,649,597,086)	

(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 135銘柄	100.0%	39.6%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.6%
オーストラリアドル	国債証券 15銘柄	100.0%	1.5%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	7.8%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
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%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	1.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券 232銘柄	100.0%	43.2%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成25年12月30日現在）

I 資産総額	6,964,837,468 円
II 負債総額	2,649,171 円
III 純資産総額(I - II)	6,962,188,297 円
IV 発行済口数	8,030,164,482 口
V 1口当たり純資産額(III/IV)	0.8670 円
1万口当たり純資産額	8,670 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	225,437,949,094 円
II 負債総額	741,795,301 円
III 純資産総額(I - II)	224,696,153,793 円
IV 発行済口数	90,099,989,128 口
V 1口当たり純資産額(III/IV)	2.4939 円
1万口当たり純資産額	24,939 円

国内株式インデックス マザーファンド

I 資産総額	148,881,007,686 円
II 負債総額	278,983,367 円
III 純資産総額(I - II)	148,602,024,319 円
IV 発行済口数	139,313,970,663 口
V 1口当たり純資産額(III/IV)	1.0667 円
1万口当たり純資産額	10,667 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たがって取り扱われます。

「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年11月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	360,019,033
株式	143,587,432,800
派生商品評価勘定	18,923,000
未収入金	3,067,156,743
未収配当金	1,033,075,028
未収利息	488
差入委託証拠金	85,500,000
流動資産合計	148,152,107,092
資産合計	148,152,107,092
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,460,000
前受金	25,968,000
未払金	462,600
未払解約金	1,542,387,122
流動負債合計	1,572,277,722
負債合計	1,572,277,722
純資産の部	
元本等	
元本	144,801,195,872
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,778,633,498
元本等合計	146,579,829,370
純資産合計	146,579,829,370
負債純資産合計	148,152,107,092

(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11月19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11月19日現在
1. 特定期間の期首元本額	158,182,172,443円
特定期間中の追加設定元本額	15,326,489,343円
特定期間中の一部解約元本額	28,707,465,914円
計算日の元本額	144,801,195,872円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,134,250,419円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,612,211,708円
SBI資産設計オープン(分配型)	27,165,155円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,274,711,179円
世界経済インデックスファンド	249,556,407円
マイセレクション25	72,337,876円
マイセレクション50	120,801,459円
マイセレクション75	152,342,362円
日本株式インデックス・オープン	16,320,121,332円
DCマイセレクション25	4,702,455,860円
DCマイセレクション50	15,732,292,794円
DCマイセレクション75	14,871,254,823円
DC日本株式インデックス・オープン	3,923,787,208円
DCマイセレクションS25	1,681,908,770円
DCマイセレクションS50	5,271,347,742円
DCマイセレクションS75	3,383,660,255円

DC日本株式インデックス・オープンS	1,286,257,222円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	16,412,459円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	426,740,090円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	429,481,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	199,922,963円
DC世界経済インデックスファンド	175,903,698円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	364,420,776円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	194,272,513円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	398,776,069円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	209,062,872円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	2,062,436,653円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,541,631円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	27,532,868円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,124,700,957円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	4,158,746,147円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,982,236,962円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,348,746,189円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,404,770,090円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,928,628,402円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,462,086,585円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,709,619,126円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,023,232,380円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,167,462,041円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,293,534,680円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,187,823,522円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,611,126,854円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	130,519,544円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,986,302,935円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,449,181,875円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,910,976円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	345,656円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	152,274円
2. 計算日における受益権総数	144,801,195,872口
3. 1口当たり純資産額	1.0123円
(1万口当たり純資産額)	(10,123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11月19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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月19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。

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	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。 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11月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,995,017,128
合計	6,995,017,128

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年11月19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11月19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	2,821,847,000	—	2,837,310,000	15,463,000
	合計	2,821,847,000	—	2,837,310,000	15,463,000

(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11月19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11月19日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年11月19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	36,000	274.00	9,864,000	
日本水産	113,100	218.00	24,655,800	
マルハニチロホールディングス	177,000	188.00	33,276,000	
サカタのタネ	13,600	1,357.00	18,455,200	
ホクト	10,200	1,939.00	19,777,800	
住石ホールディングス	25,500	153.00	3,901,500	
日鉄鉱業	23,000	543.00	12,489,000	
三井松島産業	60,000	159.00	9,540,000	
国際石油開発帝石	447,600	1,160.00	519,216,000	
日本海洋掘削	2,300	6,590.00	15,157,000	
関東天然瓦斯開発	9,000	706.00	6,354,000	
石油資源開発	13,100	3,835.00	50,238,500	
ショーボンドホールディングス	8,200	4,645.00	38,089,000	
ミライト・ホールディングス	26,200	889.00	23,291,800	
タマホーム	4,600	1,044.00	4,802,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,886.00	2,451,800	
安藤・間	58,700	357.00	20,955,900	
東急建設	39,700	553.00	21,954,100	
コムシスホールディングス	44,700	1,441.00	64,412,700	
ミサワホーム	11,500	1,585.00	18,227,500	
高松コンストラクショングループ	7,100	1,884.00	13,376,400	
東建コーポレーション	3,490	5,240.00	18,287,600	
ヤマウラ	5,200	294.00	1,528,800	
大成建設	466,000	480.00	223,680,000	
大林組	277,000	581.00	160,937,000	
清水建設	282,000	499.00	140,718,000	
長谷工コーポレーション	122,800	786.00	96,520,800	
松井建設	16,000	414.00	6,624,000	
鹿島建設	405,000	391.00	158,355,000	
不動テトラ	65,000	185.00	12,025,000	
鉄建建設	56,000	329.00	18,424,000	
日鉄住金テックスエンジ	16,000	418.00	6,688,000	
西松建設	131,000	330.00	43,230,000	
三井住友建設	247,400	128.00	31,667,200	
前田建設工業	60,000	676.00	40,560,000	
ナカノフドー建設	16,700	242.00	4,041,400	
奥村組	82,000	459.00	37,638,000	
大和小田急建設	5,000	272.00	1,360,000	
東鉄工業	11,100	2,105.00	23,365,500	
イチケン	19,000	187.00	3,553,000	
戸田建設	107,000	353.00	37,771,000	
熊谷組	72,000	305.00	21,960,000	
青木あすなろ建設	6,000	597.00	3,582,000	

北野建設	20,000	225.00	4,500,000	
植木組	23,000	221.00	5,083,000	
三井ホーム	12,000	483.00	5,796,000	
矢作建設工業	14,400	817.00	11,764,800	
ピーエス三菱	6,900	483.00	3,332,700	
大東建託	35,000	9,680.00	338,800,000	
新日本建設	22,400	332.00	7,436,800	
N I P P O	21,000	1,762.00	37,002,000	
東亜道路工業	19,000	575.00	10,925,000	
前田道路	29,000	1,623.00	47,067,000	
日本道路	26,000	592.00	15,392,000	
東亜建設工業	85,000	234.00	19,890,000	
東洋建設	32,100	358.00	11,491,800	
五洋建設	111,000	296.00	32,856,000	
大林道路	13,000	588.00	7,644,000	
福田組	18,000	454.00	8,172,000	
住友林業	63,600	1,188.00	75,556,800	
日本基礎技術	12,900	388.00	5,005,200	
日成ビルド工業	33,000	259.00	8,547,000	
巴コーポレーション	11,400	514.00	5,859,600	
パナホーム	35,000	689.00	24,115,000	
大和ハウス工業	253,000	1,956.00	494,868,000	
ライト工業	19,700	773.00	15,228,100	
積水ハウス	242,000	1,373.00	332,266,000	
日特建設	14,000	393.00	5,502,000	
北陸電気工事	7,000	399.00	2,793,000	
ユアテック	15,000	315.00	4,725,000	
西部電気工業	9,000	438.00	3,942,000	
四電工	8,000	348.00	2,784,000	
中電工	13,700	1,695.00	23,221,500	
関電工	42,000	609.00	25,578,000	
きんでん	61,000	1,078.00	65,758,000	
東京エネシス	10,000	536.00	5,360,000	
トーエネック	13,000	601.00	7,813,000	
住友電設	6,400	1,633.00	10,451,200	
日本電設工業	15,000	1,306.00	19,590,000	
協和エクシオ	36,100	1,196.00	43,175,600	
新日本空調	8,200	619.00	5,075,800	
N D S	14,000	284.00	3,976,000	
九電工	19,000	575.00	10,925,000	
三機工業	20,000	615.00	12,300,000	
日揮	93,000	3,795.00	352,935,000	
中外炉工業	28,000	258.00	7,224,000	
ヤマト	9,000	353.00	3,177,000	
太平電業	14,000	671.00	9,394,000	
高砂熱学工業	26,600	822.00	21,865,200	
三晃金属工業	17,000	274.00	4,658,000	
朝日工業社	11,000	356.00	3,916,000	

明星工業	14,000	411.00	5,754,000	
大気社	12,300	2,084.00	25,633,200	
ダイダン	13,000	542.00	7,046,000	
日比谷総合設備	11,300	1,176.00	13,288,800	
東芝プラントシステム	15,000	1,567.00	23,505,000	
東洋エンジニアリング	50,000	386.00	19,300,000	
千代田化工建設	73,000	1,288.00	94,024,000	
新興プランテック	18,900	779.00	14,723,100	
日本製粉	57,000	478.00	27,246,000	
日清製粉グループ本社	91,800	1,087.00	99,786,600	
日東富士製粉	7,000	309.00	2,163,000	
昭和産業	38,000	305.00	11,590,000	
鳥越製粉	7,400	684.00	5,061,600	
協同飼料	32,000	112.00	3,584,000	
中部飼料	8,900	566.00	5,037,400	
日本配合飼料	29,000	125.00	3,625,000	
東洋精糖	15,000	105.00	1,575,000	
日本甜菜製糖	47,000	184.00	8,648,000	
三井製糖	36,000	372.00	13,392,000	
森永製菓	90,000	209.00	18,810,000	
中村屋	22,000	399.00	8,778,000	
江崎グリコ	33,000	1,061.00	35,013,000	
名糖産業	4,100	1,012.00	4,149,200	
不二家	53,000	195.00	10,335,000	
山崎製パン	67,000	1,038.00	69,546,000	
モロゾフ	14,000	312.00	4,368,000	
亀田製菓	5,100	2,838.00	14,473,800	
カルビー	33,700	2,595.00	87,451,500	
森永乳業	78,000	297.00	23,166,000	
六甲バター	4,200	862.00	3,620,400	
ヤクルト本社	53,900	5,170.00	278,663,000	
明治ホールディングス	27,300	5,500.00	150,150,000	
雪印メグミルク	19,900	1,290.00	25,671,000	
プリマハム	46,000	203.00	9,338,000	
日本ハム	64,000	1,566.00	100,224,000	
伊藤ハム	51,000	437.00	22,287,000	
丸大食品	44,000	307.00	13,508,000	
米久	3,000	784.00	2,352,000	
S Foods	6,000	987.00	5,922,000	
サッポロホールディングス	151,000	454.00	68,554,000	
アサヒグループホールディングス	185,100	2,744.00	507,914,400	
キリンホールディングス	394,000	1,531.00	603,214,000	
宝ホールディングス	72,000	989.00	71,208,000	
オエノンホールディングス	22,000	250.00	5,500,000	
養命酒製造	7,000	811.00	5,677,000	
コカ・コーラウエスト	28,400	2,232.00	63,388,800	
コカ・コーライーストジャパン	19,100	1,996.00	38,123,600	
サントリー食品インターナショナル	47,300	3,225.00	152,542,500	

ダイドードリンコ	4,200	4,335.00	18,207,000	
伊藤園	25,100	2,229.00	55,947,900	
キーコーヒー	8,700	1,573.00	13,685,100	
ユニカフェ	2,600	567.00	1,474,200	
ジャパンフーズ	1,200	1,249.00	1,498,800	
日清オイリオグループ	40,000	324.00	12,960,000	
不二製油	22,400	1,672.00	37,452,800	
かどや製油	900	2,728.00	2,455,200	
J-オイルミルズ	39,000	283.00	11,037,000	
キッコーマン	75,000	1,939.00	145,425,000	
味の素	219,000	1,455.00	318,645,000	
キューピー	46,900	1,474.00	69,130,600	
ハウス食品グループ本社	32,400	1,591.00	51,548,400	
カゴメ	35,600	1,694.00	60,306,400	
焼津水産化学工業	4,400	865.00	3,806,000	
アリアケジャパン	8,400	2,437.00	20,470,800	
ニチレイ	98,000	527.00	51,646,000	
東洋水産	45,000	2,931.00	131,895,000	
日清食品ホールディングス	36,000	4,105.00	147,780,000	
永谷園	9,000	896.00	8,064,000	
フジッコ	9,000	1,160.00	10,440,000	
ロック・フィールド	4,800	1,891.00	9,076,800	
日本たばこ産業	510,200	3,700.00	1,887,740,000	
ケンコーマヨネーズ	3,100	891.00	2,762,100	
わらべや日洋	5,400	1,879.00	10,146,600	
なとり	4,300	976.00	4,196,800	
ミヨシ油脂	32,000	156.00	4,992,000	
片倉工業	9,900	1,194.00	11,820,600	
グンゼ	70,000	265.00	18,550,000	
東洋紡	364,000	191.00	69,524,000	
ユニチカ	236,000	63.00	14,868,000	
富士紡ホールディングス	45,000	198.00	8,910,000	
日清紡ホールディングス	55,000	890.00	48,950,000	
倉敷紡績	89,000	183.00	16,287,000	
シキボウ	49,000	138.00	6,762,000	
日本毛織	27,000	786.00	21,222,000	
トーア紡コーポレーション	36,000	81.00	2,916,000	
ダイドーリミテッド	9,700	629.00	6,101,300	
帝国繊維	9,000	1,000.00	9,000,000	
帝人	352,000	219.00	77,088,000	
東レ	624,000	681.00	424,944,000	
サカイオーベックス	23,000	160.00	3,680,000	
住江織物	28,000	291.00	8,148,000	
日本フェルト	4,900	446.00	2,185,400	
イチカワ	6,000	297.00	1,782,000	
日本バイリーン	12,000	587.00	7,044,000	
芦森工業	26,000	138.00	3,588,000	
アツギ	73,000	117.00	8,541,000	

ダイニック	16,000	194.00	3,104,000	
セーレン	23,200	712.00	16,518,400	
東海染工	12,000	125.00	1,500,000	
小松精練	15,000	492.00	7,380,000	
ワコールホールディングス	51,000	1,103.00	56,253,000	
ホギメディカル	5,400	5,500.00	29,700,000	
レナウン	20,600	137.00	2,822,200	
クラウドシア	2,000	1,103.00	2,206,000	
T S I ホールディングス	42,400	684.00	29,001,600	
三陽商会	46,000	277.00	12,742,000	
オンワードホールディングス	57,000	788.00	44,916,000	
ルック	19,000	285.00	5,415,000	
ゴールドウイン	21,000	468.00	9,828,000	
デサント	20,000	720.00	14,400,000	
キング	5,200	433.00	2,251,600	
ヤマトインターナショナル	5,500	439.00	2,414,500	
特種東海製紙	50,000	205.00	10,250,000	
王子ホールディングス	380,000	461.00	175,180,000	
日本製紙	44,500	1,693.00	75,338,500	
三菱製紙	122,000	90.00	10,980,000	
北越紀州製紙	58,500	468.00	27,378,000	
中越パルプ工業	33,000	178.00	5,874,000	
巴川製紙所	13,000	186.00	2,418,000	
大王製紙	30,000	796.00	23,880,000	
レンゴー	69,000	538.00	37,122,000	
トーモク	27,000	319.00	8,613,000	
ザ・パックス	6,100	1,873.00	11,425,300	
クラレ	136,700	1,239.00	169,371,300	
旭化成	537,000	789.00	423,693,000	
共和レザー	5,800	485.00	2,813,000	
コープケミカル	13,000	147.00	1,911,000	
昭和電工	573,000	148.00	84,804,000	
住友化学	633,000	397.00	251,301,000	
日本化成	16,000	142.00	2,272,000	
住友精化	18,000	711.00	12,798,000	
日産化学工業	58,900	1,579.00	93,003,100	
ラサ工業	32,000	204.00	6,528,000	
クレハ	60,000	422.00	25,320,000	
多木化学	6,000	777.00	4,662,000	
テイカ	14,000	295.00	4,130,000	
石原産業	155,000	96.00	14,880,000	
片倉チッカリン	5,000	277.00	1,385,000	
日本曹達	55,000	643.00	35,365,000	
東ソー	230,000	442.00	101,660,000	
トクヤマ	134,000	408.00	54,672,000	
セントラル硝子	82,000	334.00	27,388,000	
東亜合成	101,000	453.00	45,753,000	
ダイソー	34,000	299.00	10,166,000	

関東電化工業	21,000	242.00	5,082,000	
電気化学工業	172,000	416.00	71,552,000	
信越化学工業	154,300	5,860.00	904,198,000	
日本カーバイド工業	25,000	328.00	8,200,000	
堺化学工業	35,000	320.00	11,200,000	
エア・ウォーター	71,000	1,410.00	100,110,000	
大陽日酸	110,000	656.00	72,160,000	
日本化学工業	32,000	148.00	4,736,000	
日本パーカライジング	20,000	2,062.00	41,240,000	
高圧ガス工業	13,000	554.00	7,202,000	
チタン工業	10,000	257.00	2,570,000	
四国化成工業	12,000	759.00	9,108,000	
戸田工業	16,000	289.00	4,624,000	
ステラ ケミファ	4,400	1,748.00	7,691,200	
保土谷化学工業	26,000	200.00	5,200,000	
日本触媒	73,000	1,264.00	92,272,000	
大日精化工業	33,000	432.00	14,256,000	
カネカ	107,000	635.00	67,945,000	
三菱瓦斯化学	136,000	824.00	112,064,000	
三井化学	391,000	240.00	93,840,000	
J S R	78,900	1,875.00	147,937,500	
東京応化工業	16,600	2,012.00	33,399,200	
大阪有機化学工業	5,800	448.00	2,598,400	
三菱ケミカルホールディングス	538,000	469.00	252,322,000	
日本合成化学工業	18,000	951.00	17,118,000	
ダイセル	112,000	840.00	94,080,000	
住友ベークライト	67,000	356.00	23,852,000	
積水化学工業	177,000	1,175.00	207,975,000	
日本ゼオン	68,000	1,147.00	77,996,000	
アイカ工業	24,200	2,101.00	50,844,200	
宇部興産	433,000	210.00	90,930,000	
積水樹脂	12,000	1,533.00	18,396,000	
タキロン	20,000	408.00	8,160,000	
旭有機材工業	30,000	215.00	6,450,000	
日立化成	37,200	1,542.00	57,362,400	
ニチバン	9,000	383.00	3,447,000	
リケンテクノス	14,000	458.00	6,412,000	
大倉工業	21,000	370.00	7,770,000	
積水化成品工業	24,000	276.00	6,624,000	
群栄化学工業	23,000	507.00	11,661,000	
タイガースポリマー	4,400	449.00	1,975,600	
ミライアル	2,200	1,571.00	3,456,200	
日本化薬	61,000	1,465.00	89,365,000	
カーリットホールディングス	7,000	493.00	3,451,000	
日本精化	7,100	660.00	4,686,000	
A D E K A	37,000	1,152.00	42,624,000	
日油	72,000	705.00	50,760,000	
ハリマ化成グループ	7,500	464.00	3,480,000	

花王	223,800	3,385.00	757,563,000	
第一工業製薬	16,000	247.00	3,952,000	
三洋化成工業	27,000	675.00	18,225,000	
大日本塗料	49,000	172.00	8,428,000	
日本ペイント	74,000	1,670.00	123,580,000	
関西ペイント	104,000	1,360.00	141,440,000	
神東塗料	5,000	225.00	1,125,000	
中国塗料	25,000	571.00	14,275,000	
日本特殊塗料	6,600	622.00	4,105,200	
藤倉化成	10,800	530.00	5,724,000	
太陽ホールディングス	7,000	3,265.00	22,855,000	
D I C	305,000	301.00	91,805,000	
サカタインクス	18,000	1,002.00	18,036,000	
東洋インキ S Cホールディングス	77,000	527.00	40,579,000	
T & K T O K A	3,100	2,090.00	6,479,000	
富士フイルムホールディングス	196,900	2,530.00	498,157,000	
資生堂	153,100	1,752.00	268,231,200	
ライオン	99,000	594.00	58,806,000	
高砂香料工業	31,000	574.00	17,794,000	
マンダム	8,600	3,315.00	28,509,000	
ミルボン	4,600	4,260.00	19,596,000	
ファンケル	20,000	1,093.00	21,860,000	
コーセー	13,900	3,170.00	44,063,000	
ドクターシーラボ	59	326,000.00	19,234,000	
シーボン	800	2,011.00	1,608,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,800	3,465.00	30,492,000	
ノエビアホールディングス	5,800	1,725.00	10,005,000	
エスター	5,300	998.00	5,289,400	
コニシ	6,200	1,985.00	12,307,000	
長谷川香料	10,900	1,443.00	15,728,700	
星光PMC	3,700	473.00	1,750,100	
小林製薬	14,100	5,410.00	76,281,000	
荒川化学工業	7,200	947.00	6,818,400	
メック	6,800	536.00	3,644,800	
日本高純度化学	24	215,700.00	5,176,800	
J C U	1,300	4,825.00	6,272,500	
新田ゼラチン	5,200	1,031.00	5,361,200	
アース製薬	6,200	3,630.00	22,506,000	
イハラケミカル工業	13,000	800.00	10,400,000	
北興化学工業	8,000	306.00	2,448,000	
大成ラミック	2,200	2,527.00	5,559,400	
クミアイ化学工業	18,000	752.00	13,536,000	
日本農薬	20,000	1,351.00	27,020,000	
アキレス	68,000	151.00	10,268,000	
有沢製作所	14,300	578.00	8,265,400	
日東電工	70,900	5,310.00	376,479,000	
レック	2,700	1,235.00	3,334,500	
きもと	6,400	924.00	5,913,600	

藤森工業	7,400	2,756.00	20,394,400	
前澤化成工業	6,000	1,036.00	6,216,000	
J S P	5,600	1,563.00	8,752,800	
エフピコ	4,200	7,600.00	31,920,000	
天馬	6,900	1,296.00	8,942,400	
信越ポリマー	16,900	364.00	6,151,600	
東リ	22,000	206.00	4,532,000	
ニフコ	19,200	2,692.00	51,686,400	
日本バルカー工業	36,000	276.00	9,936,000	
ユニ・チャーム	52,800	6,380.00	336,864,000	
協和発酵キリン	103,000	1,108.00	114,124,000	
武田薬品工業	322,300	4,800.00	1,547,040,000	
アステラス製薬	198,200	6,150.00	1,218,930,000	
大日本住友製薬	60,900	1,450.00	88,305,000	
塩野義製薬	134,400	2,280.00	306,432,000	
田辺三菱製薬	71,600	1,402.00	100,383,200	
わかもと製薬	10,000	267.00	2,670,000	
あすか製薬	10,000	704.00	7,040,000	
日本新薬	20,000	1,765.00	35,300,000	
バイオフェルミン製薬	1,400	2,415.00	3,381,000	
中外製薬	85,700	2,374.00	203,451,800	
科研製薬	31,000	1,572.00	48,732,000	
エーザイ	105,900	3,985.00	422,011,500	
ロート製薬	36,000	1,554.00	55,944,000	
小野薬品工業	39,100	7,730.00	302,243,000	
久光製薬	26,700	5,300.00	141,510,000	
有機合成薬品工業	6,000	270.00	1,620,000	
持田製薬	6,300	6,120.00	38,556,000	
参天製薬	31,600	4,880.00	154,208,000	
扶桑薬品工業	29,000	335.00	9,715,000	
日本ケミファ	12,000	465.00	5,580,000	
ツムラ	25,300	2,785.00	70,460,500	
日医工	13,500	2,274.00	30,699,000	
キッセイ薬品工業	16,000	2,266.00	36,256,000	
生化学工業	17,900	1,313.00	23,502,700	
栄研化学	6,700	1,980.00	13,266,000	
日水製薬	3,500	1,077.00	3,769,500	
鳥居薬品	5,900	2,832.00	16,708,800	
東和薬品	4,400	4,705.00	20,702,000	
富士製薬工業	2,400	1,802.00	4,324,800	
沢井製薬	12,300	6,870.00	84,501,000	
ゼリア新薬工業	13,600	2,090.00	28,424,000	
第一三共	271,300	1,944.00	527,407,200	
キョーリン製薬ホールディングス	22,900	2,033.00	46,555,700	
大幸薬品	4,000	1,706.00	6,824,000	
ダイト	2,800	1,420.00	3,976,000	
大塚ホールディングス	170,800	2,751.00	469,870,800	
大正製薬ホールディングス	20,700	7,150.00	148,005,000	

日本コークス工業	69,400	120.00	8,328,000	
昭和シェル石油	76,900	1,043.00	80,206,700	
コスモ石油	238,000	175.00	41,650,000	
ニチレキ	11,000	1,154.00	12,694,000	
東燃ゼネラル石油	130,000	956.00	124,280,000	
ユシロ化学工業	4,700	923.00	4,338,100	
ビーピー・カストロール	3,500	477.00	1,669,500	
富士石油	21,900	333.00	7,292,700	
MORESCO	2,000	1,700.00	3,400,000	
出光興産	10,200	9,000.00	91,800,000	
JXホールディングス	954,900	528.00	504,187,200	
横浜ゴム	96,000	982.00	94,272,000	
東洋ゴム工業	71,000	583.00	41,393,000	
ブリヂストン	269,600	3,675.00	990,780,000	
住友ゴム工業	67,100	1,336.00	89,645,600	
藤倉ゴム工業	5,400	481.00	2,597,400	
オカモト	30,000	321.00	9,630,000	
フコク	3,600	880.00	3,168,000	
ニッタ	8,500	2,163.00	18,385,500	
東海ゴム工業	15,900	937.00	14,898,300	
三ツ星ベルト	22,000	559.00	12,298,000	
バンドー化学	31,000	395.00	12,245,000	
日東紡績	63,000	506.00	31,878,000	
旭硝子	424,000	629.00	266,696,000	
日本板硝子	415,000	125.00	51,875,000	
石塚硝子	11,000	363.00	3,993,000	
日本山村硝子	34,000	179.00	6,086,000	
日本電気硝子	178,000	529.00	94,162,000	
オハラ	3,300	612.00	2,019,600	
住友大阪セメント	164,000	394.00	64,616,000	
太平洋セメント	505,000	425.00	214,625,000	
デイ・シイ	9,600	717.00	6,883,200	
日本ヒューム	8,000	911.00	7,288,000	
日本コンクリート工業	15,000	538.00	8,070,000	
三谷セキサン	4,300	1,491.00	6,411,300	
ジャパンパイル	7,300	1,062.00	7,752,600	
東海カーボン	80,000	338.00	27,040,000	
日本カーボン	45,000	193.00	8,685,000	
東洋炭素	4,800	1,873.00	8,990,400	
ノリタケカンパニーリミテド	49,000	264.00	12,936,000	
TOTO	126,000	1,455.00	183,330,000	
日本碍子	109,000	1,752.00	190,968,000	
日本特殊陶業	74,000	2,318.00	171,532,000	
MARUWA	2,200	2,996.00	6,591,200	
品川リフラクトリーズ	22,000	219.00	4,818,000	
黒崎播磨	20,000	271.00	5,420,000	
ヨータイ	5,000	299.00	1,495,000	
イソライト工業	5,100	181.00	923,100	

東京窯業	11,000	256.00	2,816,000	
ニッカトー	3,000	411.00	1,233,000	
フジミインコーポレーテッド	7,800	1,241.00	9,679,800	
ニチアス	41,000	678.00	27,798,000	
ニチハ	10,500	1,548.00	16,254,000	
新日鐵住金	3,636,000	341.00	1,239,876,000	
神戸製鋼所	1,193,000	178.00	212,354,000	
合同製鐵	44,000	181.00	7,964,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	219,400	2,361.00	518,003,400	
日新製鋼ホールディングス	37,100	1,390.00	51,569,000	
東京製鐵	47,900	566.00	27,111,400	
共英製鋼	8,000	1,998.00	15,984,000	
大和工業	17,800	3,450.00	61,410,000	
東京鐵鋼	18,000	422.00	7,596,000	
大阪製鐵	4,300	1,919.00	8,251,700	
淀川製鋼所	61,000	442.00	26,962,000	
東洋鋼鈑	21,000	481.00	10,101,000	
丸一鋼管	28,800	2,510.00	72,288,000	
モリ工業	13,000	420.00	5,460,000	
大同特殊鋼	144,000	545.00	78,480,000	
日本高周波鋼業	39,000	109.00	4,251,000	
日本冶金工業	70,500	355.00	25,027,500	
山陽特殊製鋼	47,000	484.00	22,748,000	
愛知製鋼	46,000	483.00	22,218,000	
日立金属	77,000	1,328.00	102,256,000	
日本金属	22,000	136.00	2,992,000	
大太平洋金属	60,000	391.00	23,460,000	
日本電工	37,000	290.00	10,730,000	
栗本鐵工所	44,000	259.00	11,396,000	
虹技	11,000	201.00	2,211,000	
日本鑄鉄管	10,000	243.00	2,430,000	
三菱製鋼	54,000	280.00	15,120,000	
日亜鋼業	12,000	365.00	4,380,000	
日本精線	7,000	436.00	3,052,000	
シンニッタン	8,200	380.00	3,116,000	
新家工業	19,000	171.00	3,249,000	
大紀アルミニウム工業所	16,000	272.00	4,352,000	
日本軽金属ホールディングス	195,000	137.00	26,715,000	
三井金属鉱業	219,000	278.00	60,882,000	
東邦亜鉛	49,000	317.00	15,533,000	
三菱マテリアル	537,000	373.00	200,301,000	
住友金属鉱山	223,000	1,395.00	311,085,000	
DOWAホールディングス	95,000	1,003.00	95,285,000	
古河機械金属	145,000	212.00	30,740,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,400	2,064.00	19,401,600	
東邦チタニウム	14,500	787.00	11,411,500	
UACJ	110,000	336.00	36,960,000	
古河電気工業	271,000	227.00	61,517,000	

住友電気工業	324,100	1,543.00	500,086,300	
フジクラ	138,000	460.00	63,480,000	
昭和電線ホールディングス	110,000	105.00	11,550,000	
タツタ電線	13,400	552.00	7,396,800	
沖電線	12,000	178.00	2,136,000	
カナレ電気	1,400	1,519.00	2,126,600	
平河ヒューテック	2,100	757.00	1,589,700	
リョービ	53,000	450.00	23,850,000	
アサヒホールディングス	13,000	1,726.00	22,438,000	
稲葉製作所	3,800	1,298.00	4,932,400	
トーカロ	5,300	1,675.00	8,877,500	
アルファＣｏ	4,000	1,063.00	4,252,000	
SUMCO	54,100	883.00	47,770,300	
川田テクノロジーズ	2,300	2,787.00	6,410,100	
東洋製罐グループホールディングス	61,200	2,132.00	130,478,400	
ホッカンホールディングス	25,000	328.00	8,200,000	
コロナ	4,500	1,125.00	5,062,500	
横河ブリッジホールディングス	17,000	1,452.00	24,684,000	
日本橋梁	18,800	202.00	3,797,600	
駒井ハルテック	21,000	347.00	7,287,000	
高田機工	12,000	230.00	2,760,000	
三和ホールディングス	73,000	649.00	47,377,000	
文化シャッター	22,000	575.00	12,650,000	
三協立山	11,800	2,188.00	25,818,400	
東洋シャッター	4,400	597.00	2,626,800	
LIXILグループ	119,800	2,528.00	302,854,400	
日本ファイルコン	8,300	458.00	3,801,400	
ノーリツ	16,900	2,276.00	38,464,400	
長府製作所	9,200	2,329.00	21,426,800	
リンナイ	13,300	7,710.00	102,543,000	
ダイニチ工業	4,500	806.00	3,627,000	
日東精工	15,000	345.00	5,175,000	
三洋工業	17,000	187.00	3,179,000	
岡部	17,700	1,285.00	22,744,500	
東プレ	17,000	1,426.00	24,242,000	
高周波熱錬	13,300	895.00	11,903,500	
サンコール	6,000	619.00	3,714,000	
モリテック スチール	7,700	279.00	2,148,300	
パイオラックス	4,100	3,395.00	13,919,500	
日本発條	68,500	1,155.00	79,117,500	
中央発條	11,000	306.00	3,366,000	
三益半導体工業	7,300	896.00	6,540,800	
アタカ大機	7,000	427.00	2,989,000	
日本製鋼所	123,000	552.00	67,896,000	
三浦工業	12,800	2,726.00	34,892,800	
タクマ	27,000	904.00	24,408,000	
ツガミ	27,000	567.00	15,309,000	
オークマ	56,000	977.00	54,712,000	

東芝機械	47,000	557.00	26,179,000	
アマダ	132,000	905.00	119,460,000	
アイダエンジニアリング	20,200	1,017.00	20,543,400	
滝澤鉄工所	26,000	147.00	3,822,000	
富士機械製造	26,300	853.00	22,433,900	
牧野フライス製作所	43,000	799.00	34,357,000	
オーエスジー	35,400	1,565.00	55,401,000	
ダイジェット工業	13,000	158.00	2,054,000	
旭ダイヤモンド工業	22,100	896.00	19,801,600	
DMG森精機	45,400	1,687.00	76,589,800	
ディスコ	9,600	6,310.00	60,576,000	
日東工器	5,000	1,849.00	9,245,000	
豊和工業	5,200	891.00	4,633,200	
大阪機工	33,000	144.00	4,752,000	
東洋機械金属	8,400	442.00	3,712,800	
津田駒工業	21,000	169.00	3,549,000	
島精機製作所	11,200	2,034.00	22,780,800	
日阪製作所	11,000	888.00	9,768,000	
やまびこ	3,500	3,005.00	10,517,500	
ペガサスミシン製造	10,100	376.00	3,797,600	
ナブテスコ	39,300	2,429.00	95,459,700	
三井海洋開発	7,100	2,964.00	21,044,400	
レオン自動機	8,000	604.00	4,832,000	
SMC	24,600	23,070.00	567,522,000	
新川	7,700	628.00	4,835,600	
ホソカワミクロン	14,000	664.00	9,296,000	
ユニオンツール	3,700	2,296.00	8,495,200	
オイレス工業	8,200	2,172.00	17,810,400	
日精エー・エス・ビー機械	2,700	1,937.00	5,229,900	
サトーホールディングス	9,000	2,114.00	19,026,000	
日本エアーテック	3,600	509.00	1,832,400	
日精樹脂工業	6,500	625.00	4,062,500	
ワイエイシイ	4,700	555.00	2,608,500	
小松製作所	401,300	2,126.00	853,163,800	
住友重機械工業	235,000	468.00	109,980,000	
日立建機	43,900	2,164.00	94,999,600	
日工	13,000	479.00	6,227,000	
巴工業	3,000	1,547.00	4,641,000	
井関農機	88,000	328.00	28,864,000	
TOWA	7,700	481.00	3,703,700	
丸山製作所	19,000	279.00	5,301,000	
北川鉄工所	42,000	207.00	8,694,000	
クボタ	449,000	1,671.00	750,279,000	
荏原実業	2,200	1,346.00	2,961,200	
三菱化工機	28,000	178.00	4,984,000	
月島機械	14,000	1,082.00	15,148,000	
帝国電機製作所	3,200	2,285.00	7,312,000	
新東工業	20,200	782.00	15,796,400	

澁谷工業	5,500	1,731.00	9,520,500	
アイチ コーポレーション	12,200	493.00	6,014,600	
小森コーポレーション	20,900	1,645.00	34,380,500	
鶴見製作所	6,000	988.00	5,928,000	
住友精密工業	14,000	419.00	5,866,000	
酒井重工業	17,000	407.00	6,919,000	
荏原製作所	190,000	608.00	115,520,000	
石井鐵工所	15,000	318.00	4,770,000	
西島製作所	9,200	1,033.00	9,503,600	
ダイキン工業	112,200	6,190.00	694,518,000	
オルガノ	13,000	469.00	6,097,000	
トーヨーカネツ	46,000	294.00	13,524,000	
栗田工業	51,700	2,159.00	111,620,300	
椿本チエイン	44,000	745.00	32,780,000	
大同工業	20,000	279.00	5,580,000	
日本コンベヤ	27,000	145.00	3,915,000	
木村化工機	9,500	505.00	4,797,500	
アネスト岩田	14,000	516.00	7,224,000	
ダイフク	35,000	1,354.00	47,390,000	
加藤製作所	20,000	607.00	12,140,000	
油研工業	19,000	222.00	4,218,000	
タダノ	36,000	1,337.00	48,132,000	
フジテック	24,000	1,231.00	29,544,000	
CKD	23,100	992.00	22,915,200	
キトー	4,900	1,622.00	7,947,800	
平和	18,100	1,665.00	30,136,500	
理想科学工業	6,400	2,238.00	14,323,200	
SANKYO	24,900	4,650.00	115,785,000	
日本金銭機械	7,900	2,104.00	16,621,600	
マースエンジニアリング	4,700	1,959.00	9,207,300	
福島工業	4,500	1,559.00	7,015,500	
オーイズミ	3,800	1,205.00	4,579,000	
ダイコク電機	3,400	2,114.00	7,187,600	
アマノ	23,500	979.00	23,006,500	
サンデン	49,000	413.00	20,237,000	
マックス	13,000	1,092.00	14,196,000	
グローリー	24,500	2,597.00	63,626,500	
新晃工業	5,800	807.00	4,680,600	
大和冷機工業	13,000	702.00	9,126,000	
セガサミーホールディングス	88,300	2,584.00	228,167,200	
日本ピストンリング	32,000	181.00	5,792,000	
リケン	33,000	433.00	14,289,000	
TPR	9,500	1,754.00	16,663,000	
ホシザキ電機	18,000	3,585.00	64,530,000	
大豊工業	5,900	1,224.00	7,221,600	
日本精工	183,000	1,125.00	205,875,000	
NTN	192,000	448.00	86,016,000	
ジェイテクト	87,300	1,356.00	118,378,800	

不二越	78,000	519.00	40,482,000	
日本トムソン	28,000	505.00	14,140,000	
THK	51,200	2,363.00	120,985,600	
ユーシン精機	3,700	2,064.00	7,636,800	
前澤給装工業	3,200	1,254.00	4,012,800	
イーグル工業	10,000	1,654.00	16,540,000	
前澤工業	7,700	365.00	2,810,500	
日本ピラー工業	9,000	689.00	6,201,000	
キッツ	37,000	424.00	15,688,000	
日立工機	22,100	717.00	15,845,700	
マキタ	53,600	5,200.00	278,720,000	
日立造船	61,000	786.00	47,946,000	
三菱重工業	1,463,000	624.00	912,912,000	
I H I	561,000	408.00	228,888,000	
イビデン	50,000	1,712.00	85,600,000	
コニカミノルタ	217,000	978.00	212,226,000	
ブラザー工業	106,200	1,183.00	125,634,600	
ミネベア	112,000	682.00	76,384,000	
日立製作所	1,973,000	695.00	1,371,235,000	
東芝	1,622,000	418.00	677,996,000	
三菱電機	822,000	1,141.00	937,902,000	
富士電機	229,000	440.00	100,760,000	
東洋電機製造	16,000	319.00	5,104,000	
安川電機	90,000	1,319.00	118,710,000	
シンフォニアテクノロジー	50,000	174.00	8,700,000	
明電舎	76,000	373.00	28,348,000	
オリジン電気	12,000	321.00	3,852,000	
山洋電気	12,000	638.00	7,656,000	
デンヨー	8,100	1,267.00	10,262,700	
東芝テック	52,000	625.00	32,500,000	
芝浦メカトロニクス	16,000	242.00	3,872,000	
マブチモーター	11,600	5,630.00	65,308,000	
日本電産	44,400	9,120.00	404,928,000	
東光高岳ホールディングス	4,700	2,092.00	9,832,400	
ダイヘン	48,000	454.00	21,792,000	
ヤーマン	1,000	1,236.00	1,236,000	
J V C ケンウッド	58,900	168.00	9,895,200	
第一精工	3,400	1,289.00	4,382,600	
日新電機	17,000	600.00	10,200,000	
大崎電気工業	13,000	539.00	7,007,000	
オムロン	92,700	4,010.00	371,727,000	
日東工業	12,100	1,561.00	18,888,100	
I D E C	10,800	870.00	9,396,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	158,000	608.00	96,064,000	
サクサホールディングス	21,000	156.00	3,276,000	
メルコホールディングス	4,000	1,289.00	5,156,000	
テクノメディカ	1,800	2,173.00	3,911,400	
日本電気	1,130,000	229.00	258,770,000	

富士通	792,000	463.00	366,696,000	
沖電気工業	317,000	219.00	69,423,000	
岩崎通信機	39,000	101.00	3,939,000	
電気興業	23,000	688.00	15,824,000	
サンケン電気	45,000	596.00	26,820,000	
ナカヨ通信機	8,000	344.00	2,752,000	
アイホン	4,800	1,651.00	7,924,800	
ルネサスエレクトロニクス	42,500	586.00	24,905,000	
セイコーエプソン	56,100	2,279.00	127,851,900	
ワコム	64,700	706.00	45,678,200	
アルバック	13,800	1,323.00	18,257,400	
アクセル	4,100	1,820.00	7,462,000	
E I Z O	7,600	2,567.00	19,509,200	
日本信号	20,800	727.00	15,121,600	
京三製作所	19,000	323.00	6,137,000	
能美防災	11,000	1,008.00	11,088,000	
ホーチキ	6,000	524.00	3,144,000	
エレコム	3,000	1,366.00	4,098,000	
日本無線	21,000	352.00	7,392,000	
パナソニック	938,700	1,042.00	978,125,400	
シャープ	593,000	278.00	164,854,000	
アンリツ	47,800	1,193.00	57,025,400	
富士通ゼネラル	20,000	1,179.00	23,580,000	
日立国際電気	16,000	1,235.00	19,760,000	
ソニー	450,400	1,886.00	849,454,400	
TDK	49,600	4,290.00	212,784,000	
帝国通信工業	19,000	176.00	3,344,000	
ミツミ電機	31,300	757.00	23,694,100	
タムラ製作所	32,000	262.00	8,384,000	
アルプス電気	60,200	1,003.00	60,380,600	
パイオニア	114,200	195.00	22,269,000	
日本電波工業	7,800	870.00	6,786,000	
日本トリム	1,800	8,510.00	15,318,000	
ローランド ディー. ジー.	3,600	3,155.00	11,358,000	
フォスター電機	8,400	1,985.00	16,674,000	
クラリオン	50,000	129.00	6,450,000	
SMK	24,000	470.00	11,280,000	
ヨコオ	6,900	516.00	3,560,400	
東光	39,000	342.00	13,338,000	
ホシデン	24,100	530.00	12,773,000	
ヒロセ電機	14,300	14,830.00	212,069,000	
日本航空電子工業	21,000	1,117.00	23,457,000	
TOA	8,900	836.00	7,440,400	
古野電気	7,900	641.00	5,063,900	
ユニデン	26,000	243.00	6,318,000	
アルパイン	17,800	1,322.00	23,531,600	
スミダコーポレーション	7,500	459.00	3,442,500	
アイコム	4,600	2,270.00	10,442,000	

リオン	2,500	1,721.00	4,302,500	
船井電機	8,300	1,101.00	9,138,300	
横河電機	89,100	1,419.00	126,432,900	
新電元工業	26,000	608.00	15,808,000	
アズビル	24,900	2,355.00	58,639,500	
日本光電工業	17,500	3,930.00	68,775,000	
チノー	15,000	218.00	3,270,000	
共和電業	9,000	414.00	3,726,000	
日本電子材料	3,600	369.00	1,328,400	
堀場製作所	15,200	3,585.00	54,492,000	
アドバンテスト	56,000	1,234.00	69,104,000	
小野測器	9,000	435.00	3,915,000	
エスベック	8,500	772.00	6,562,000	
パナソニック デバイス SUNX	7,200	470.00	3,384,000	
キーエンス	18,600	40,050.00	744,930,000	
日置電機	4,300	1,394.00	5,994,200	
シスメックス	34,400	6,570.00	226,008,000	
メガチップス	7,400	1,511.00	11,181,400	
OBARA GROUP	5,300	2,991.00	15,852,300	
日本電産コパル電子	8,500	596.00	5,066,000	
澤藤電機	6,000	225.00	1,350,000	
コーセル	11,900	1,197.00	14,244,300	
日立メディコ	6,000	1,796.00	10,776,000	
新日本無線	6,000	393.00	2,358,000	
オプテックス	5,200	1,629.00	8,470,800	
千代田インテグレ	3,600	1,897.00	6,829,200	
レーザーテック	5,900	982.00	5,793,800	
スタンレー電気	59,400	2,263.00	134,422,200	
岩崎電気	32,000	223.00	7,136,000	
ウシオ電機	49,900	1,226.00	61,177,400	
岡谷電機産業	4,400	360.00	1,584,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	7,000	349.00	2,443,000	
日本セラミック	4,700	1,518.00	7,134,600	
遠藤照明	3,400	2,076.00	7,058,400	
日本デジタル研究所	6,100	1,283.00	7,826,300	
古河電池	7,000	558.00	3,906,000	
双信電機	4,000	375.00	1,500,000	
図研	5,400	826.00	4,460,400	
日本電子	29,000	493.00	14,297,000	
カシオ計算機	85,500	1,004.00	85,842,000	
ファナック	91,600	16,850.00	1,543,460,000	
日本シイエムケイ	19,300	280.00	5,404,000	
エンプラス	3,100	6,110.00	18,941,000	
大真空	11,000	369.00	4,059,000	
ローム	43,400	4,325.00	187,705,000	
浜松ホトニクス	32,100	3,975.00	127,597,500	
三井ハイテック	10,800	696.00	7,516,800	
新光電気工業	27,600	839.00	23,156,400	

京セラ	146,400	5,140.00	752,496,000	
太陽誘電	40,000	1,174.00	46,960,000	
村田製作所	86,200	8,070.00	695,634,000	
ユーシン	12,100	729.00	8,820,900	
双葉電子工業	15,200	1,287.00	19,562,400	
北陸電気工業	33,000	135.00	4,455,000	
ニチコン	25,900	936.00	24,242,400	
日本ケミコン	52,000	400.00	20,800,000	
K O A	10,300	950.00	9,785,000	
市光工業	22,000	170.00	3,740,000	
小糸製作所	45,000	1,875.00	84,375,000	
ミツバ	15,300	1,590.00	24,327,000	
スター精密	15,600	1,168.00	18,220,800	
大日本スクリーン製造	78,000	519.00	40,482,000	
キャノン電子	7,500	1,854.00	13,905,000	
キャノン	476,300	3,235.00	1,540,830,500	
リコー	247,000	1,106.00	273,182,000	
MUTOHホールディングス	12,000	483.00	5,796,000	
東京エレクトロン	73,700	5,310.00	391,347,000	
トヨタ紡織	28,700	1,301.00	37,338,700	
鬼怒川ゴム工業	15,000	542.00	8,130,000	
ユニプレス	13,300	1,735.00	23,075,500	
豊田自動織機	74,800	4,325.00	323,510,000	
モリタホールディングス	14,000	857.00	11,998,000	
三櫻工業	10,400	694.00	7,217,600	
デンソー	203,000	4,865.00	987,595,000	
東海理化電機製作所	21,600	2,020.00	43,632,000	
三井造船	318,000	198.00	62,964,000	
佐世保重工業	58,000	100.00	5,800,000	
川崎重工業	640,000	414.00	264,960,000	
名村造船所	12,000	1,262.00	15,144,000	
サノヤスホールディングス	7,500	177.00	1,327,500	
日本車輛製造	30,000	531.00	15,930,000	
ニチユ三菱フォークリフト	9,000	608.00	5,472,000	
近畿車輛	14,000	295.00	4,130,000	
日産自動車	1,153,200	926.00	1,067,863,200	
いすゞ自動車	476,000	653.00	310,828,000	
トヨタ自動車	1,143,400	6,300.00	7,203,420,000	
日野自動車	103,000	1,504.00	154,912,000	
三菱自動車工業	190,700	1,092.00	208,244,400	
エフテック	2,800	1,619.00	4,533,200	
GMB	800	1,191.00	952,800	
武蔵精密工業	8,800	2,308.00	20,310,400	
日産車体	40,000	1,554.00	62,160,000	
新明和工業	33,000	751.00	24,783,000	
極東開発工業	14,200	1,266.00	17,977,200	
日信工業	16,700	1,920.00	32,064,000	
トピー工業	68,000	202.00	13,736,000	

ティラド	32,000	277.00	8,864,000	
曙ブレーキ工業	38,200	491.00	18,756,200	
タチエス	12,100	1,483.00	17,944,300	
NOK	39,800	1,621.00	64,515,800	
フタバ産業	25,000	366.00	9,150,000	
カヤバ工業	68,000	604.00	41,072,000	
シロキ工業	18,000	222.00	3,996,000	
大同メタル工業	11,000	1,047.00	11,517,000	
プレス工業	32,000	447.00	14,304,000	
カルソニックカンセイ	56,000	520.00	29,120,000	
太平洋工業	16,700	702.00	11,723,400	
ケーヒン	18,900	1,675.00	31,657,500	
河西工業	11,000	581.00	6,391,000	
アイシン精機	75,200	3,965.00	298,168,000	
富士機工	9,000	329.00	2,961,000	
マツダ	1,224,000	452.00	553,248,000	
ダイハツ工業	87,200	1,823.00	158,965,600	
今仙電機製作所	6,000	1,496.00	8,976,000	
本田技研工業	739,300	4,095.00	3,027,433,500	
スズキ	171,700	2,471.00	424,270,700	
富士重工業	279,600	2,804.00	783,998,400	
ヤマハ発動機	124,900	1,550.00	193,595,000	
ショーワ	19,400	1,487.00	28,847,800	
T B K	9,000	583.00	5,247,000	
エクセディ	9,900	3,065.00	30,343,500	
豊田合成	26,500	2,454.00	65,031,000	
愛三工業	10,000	986.00	9,860,000	
ヨロズ	6,000	1,868.00	11,208,000	
エフ・シー・シー	13,400	2,139.00	28,662,600	
シマノ	35,500	8,960.00	318,080,000	
タカタ	14,800	2,544.00	37,651,200	
テイ・エス テック	17,300	3,615.00	62,539,500	
テルモ	63,000	5,220.00	328,860,000	
クリエートメディック	2,700	947.00	2,556,900	
日機装	27,000	1,285.00	34,695,000	
島津製作所	106,000	981.00	103,986,000	
JMS	15,000	294.00	4,410,000	
ショットモリテックス	1,800	283.00	509,400	
長野計器	5,300	687.00	3,641,100	
ブイ・テクノロジー	17	270,100.00	4,591,700	
東京計器	28,000	307.00	8,596,000	
愛知時計電機	11,000	287.00	3,157,000	
東京精密	14,800	1,983.00	29,348,400	
マニー	2,500	3,740.00	9,350,000	
ニコン	153,400	1,767.00	271,057,800	
トプコン	22,100	1,622.00	35,846,200	
オリンパス	122,400	3,280.00	401,472,000	
理研計器	7,300	777.00	5,672,100	

タムロン	6,300	1,983.00	12,492,900	
HOYA	199,800	2,557.00	510,888,600	
ノーリツ銅機	7,400	647.00	4,787,800	
エー・アンド・デイ	7,500	663.00	4,972,500	
シチズンホールディングス	101,200	763.00	77,215,600	
リズム時計工業	37,000	146.00	5,402,000	
大研医器	2,900	1,768.00	5,127,200	
松風	4,000	892.00	3,568,000	
セイコーホールディングス	53,000	509.00	26,977,000	
ニプロ	43,800	955.00	41,829,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,900	3,450.00	27,255,000	
SHO-BI	2,800	418.00	1,170,400	
前田工繊	6,600	1,218.00	8,038,800	
永大産業	11,000	541.00	5,951,000	
ダンロップスポーツ	4,500	1,247.00	5,611,500	
バンダイナムコホールディングス	90,600	2,034.00	184,280,400	
共立印刷	16,400	271.00	4,444,400	
フランスベッドホールディングス	52,000	199.00	10,348,000	
パイロットコーポレーション	7,200	3,630.00	26,136,000	
トッパン・フォームズ	14,700	931.00	13,685,700	
フジシールインターナショナル	10,000	3,310.00	33,100,000	
タカラトミー	27,800	485.00	13,483,000	
廣済堂	7,600	555.00	4,218,000	
タカノ	3,700	489.00	1,809,300	
プロネクサス	8,700	639.00	5,559,300	
ホクシン	8,900	159.00	1,415,100	
ウッドワン	15,000	290.00	4,350,000	
大建工業	34,000	258.00	8,772,000	
凸版印刷	232,000	804.00	186,528,000	
大日本印刷	250,000	1,056.00	264,000,000	
図書印刷	16,000	301.00	4,816,000	
共同印刷	27,000	273.00	7,371,000	
日本写真印刷	14,000	1,605.00	22,470,000	
光村印刷	8,000	263.00	2,104,000	
宝印刷	4,900	686.00	3,361,400	
アシックス	81,600	1,707.00	139,291,200	
ツツミ	4,100	2,352.00	9,643,200	
ローランド	8,200	1,321.00	10,832,200	
小松ウオール工業	2,900	2,046.00	5,933,400	
ヤマハ	60,400	1,532.00	92,532,800	
河合楽器製作所	31,000	188.00	5,828,000	
クリナップ	8,400	837.00	7,030,800	
ピジョン	13,500	5,130.00	69,255,000	
兼松日産農林	13,000	171.00	2,223,000	
キングジム	6,900	691.00	4,767,900	
リンテック	19,600	1,983.00	38,866,800	
イトーキ	18,200	555.00	10,101,000	
任天堂	50,600	13,030.00	659,318,000	

三菱鉛筆	6,800	2,518.00	17,122,400	
タカラスタANDARD	34,000	784.00	26,656,000	
コクヨ	42,800	758.00	32,442,400	
ナカバヤシ	17,000	210.00	3,570,000	
グローブライド	43,000	161.00	6,923,000	
岡村製作所	32,000	831.00	26,592,000	
美津濃	41,000	551.00	22,591,000	
アデランス	10,500	1,191.00	12,505,500	
東京電力	696,900	548.00	381,901,200	
中部電力	270,700	1,419.00	384,123,300	
関西電力	335,300	1,206.00	404,371,800	
中国電力	113,600	1,471.00	167,105,600	
北陸電力	80,500	1,410.00	113,505,000	
東北電力	205,300	1,192.00	244,717,600	
四国電力	74,000	1,699.00	125,726,000	
九州電力	181,400	1,380.00	250,332,000	
北海道電力	76,900	1,292.00	99,354,800	
沖縄電力	5,400	3,310.00	17,874,000	
電源開発	51,000	3,120.00	159,120,000	
東京瓦斯	963,000	517.00	497,871,000	
大阪瓦斯	850,000	407.00	345,950,000	
東邦瓦斯	209,000	503.00	105,127,000	
北海道瓦斯	16,000	267.00	4,272,000	
西部瓦斯	92,000	245.00	22,540,000	
静岡瓦斯	21,400	663.00	14,188,200	
東武鉄道	466,000	504.00	234,864,000	
相鉄ホールディングス	141,000	368.00	51,888,000	
東京急行電鉄	483,000	695.00	335,685,000	
京浜急行電鉄	211,000	896.00	189,056,000	
小田急電鉄	263,000	943.00	248,009,000	
京王電鉄	230,000	687.00	158,010,000	
京成電鉄	123,000	1,008.00	123,984,000	
富士急行	22,000	890.00	19,580,000	
新京成電鉄	11,000	375.00	4,125,000	
東日本旅客鉄道	151,100	8,420.00	1,272,262,000	
西日本旅客鉄道	75,900	4,485.00	340,411,500	
東海旅客鉄道	73,600	12,580.00	925,888,000	
鴻池運輸	4,400	1,562.00	6,872,800	
西日本鉄道	106,000	387.00	41,022,000	
ハマキョウレックス	2,300	2,748.00	6,320,400	
サカイ引越センター	1,300	3,340.00	4,342,000	
近畿日本鉄道	827,000	362.00	299,374,000	
阪急阪神ホールディングス	551,000	555.00	305,805,000	
南海電気鉄道	171,000	366.00	62,586,000	
京阪電気鉄道	173,000	398.00	68,854,000	
神戸電鉄	20,000	328.00	6,560,000	
名糖運輸	3,400	643.00	2,186,200	
名古屋鉄道	287,000	289.00	82,943,000	

山陽電気鉄道	30,000	415.00	12,450,000	
日本通運	325,000	516.00	167,700,000	
ヤマトホールディングス	153,000	2,175.00	332,775,000	
山九	100,000	344.00	34,400,000	
丸運	5,200	251.00	1,305,200	
丸全昭和運輸	28,000	363.00	10,164,000	
センコー	33,000	534.00	17,622,000	
トナミホールディングス	17,000	213.00	3,621,000	
日本梱包運輸倉庫	25,100	1,748.00	43,874,800	
日本石油輸送	9,000	227.00	2,043,000	
福山通運	50,000	594.00	29,700,000	
セイノーホールディングス	58,000	1,128.00	65,424,000	
神奈川中央交通	10,000	508.00	5,080,000	
日立物流	17,100	1,559.00	26,658,900	
日本郵船	695,000	309.00	214,755,000	
商船三井	464,000	433.00	200,912,000	
川崎汽船	361,000	235.00	84,835,000	
N S ユナイテッド海運	35,000	278.00	9,730,000	
乾汽船	16,200	363.00	5,880,600	
飯野海運	39,900	645.00	25,735,500	
共栄タンカー	17,000	239.00	4,063,000	
日本航空	69,400	5,400.00	374,760,000	
A N A ホールディングス	1,615,000	212.00	342,380,000	
パスコ	8,000	554.00	4,432,000	
トランコム	2,400	3,015.00	7,236,000	
日新	31,000	286.00	8,866,000	
三菱倉庫	54,000	1,506.00	81,324,000	
三井倉庫	41,000	514.00	21,074,000	
住友倉庫	55,000	603.00	33,165,000	
澁澤倉庫	19,000	429.00	8,151,000	
東陽倉庫	14,000	263.00	3,682,000	
日本トランスシティ	17,000	335.00	5,695,000	
ケイヒン	15,000	191.00	2,865,000	
中央倉庫	4,700	932.00	4,380,400	
安田倉庫	6,400	1,231.00	7,878,400	
東洋埠頭	24,000	285.00	6,840,000	
宇徳	6,700	342.00	2,291,400	
上組	98,000	901.00	88,298,000	
サンリツ	2,000	532.00	1,064,000	
キムラユニティー	1,800	1,001.00	1,801,800	
キューソー流通システム	2,600	1,071.00	2,784,600	
郵船ロジスティクス	7,500	1,193.00	8,947,500	
近鉄エクスプレス	7,300	3,900.00	28,470,000	
東海運	4,400	288.00	1,267,200	
エーアイティー	3,000	760.00	2,280,000	
N E C ネットエスアイ	8,900	2,542.00	22,623,800	
システナ	7,900	714.00	5,640,600	
デジタルアーツ	2,200	1,068.00	2,349,600	

新日鉄住金ソリューションズ	6,800	2,318.00	15,762,400	
コア	3,100	737.00	2,284,700	
ソフトクリエイトホールディングス	2,700	900.00	2,430,000	
I Tホールディングス	29,100	1,493.00	43,446,300	
ネオス	1,600	1,446.00	2,313,600	
電算システム	1,900	1,471.00	2,794,900	
グリー	42,100	904.00	38,058,400	
コーエーテクモホールディングス	16,000	1,302.00	20,832,000	
三菱総合研究所	3,200	2,139.00	6,844,800	
ボルテージ	1,200	1,209.00	1,450,800	
電算	600	1,891.00	1,134,600	
ヒト・コミュニケーションズ	900	1,566.00	1,409,400	
ブレインパッド	700	1,819.00	1,273,300	
K L a b	5,400	810.00	4,374,000	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,400	3,020.00	7,248,000	
ネクソン	67,200	944.00	63,436,800	
アイスタイル	2,300	771.00	1,773,300	
エムアップ	1,400	973.00	1,362,200	
エイチーム	700	2,612.00	1,828,400	
ブロードリーフ	8,000	1,879.00	15,032,000	
ハーツユナイテッドグループ	1,800	2,156.00	3,880,800	
ドワンゴ	7,300	2,558.00	18,673,400	
ベリサーブ	500	1,826.00	913,000	
マクロミル	12,900	610.00	7,869,000	
ティーガイア	8,100	1,035.00	8,383,500	
テクマトリックス	2,600	578.00	1,502,800	
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	3,880.00	12,028,000	
ザッパラス	4,500	764.00	3,438,000	
インターネットイニシアティブ	11,900	2,712.00	32,272,800	
ビットアイル	6,100	843.00	5,142,300	
S R Aホールディングス	3,900	1,188.00	4,633,200	
朝日ネット	7,500	490.00	3,675,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,600	3,045.00	4,872,000	
フェイス	2,500	1,105.00	2,762,500	
野村総合研究所	45,900	3,430.00	157,437,000	
サイバネットシステム	6,700	355.00	2,378,500	
インテージホールディングス	4,400	1,271.00	5,592,400	
ソースネクスト	4,000	917.00	3,668,000	
クレスコ	1,900	764.00	1,451,600	
フジ・メディア・ホールディングス	78,400	2,111.00	165,502,400	
オービック	28,000	3,065.00	85,820,000	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,800	813.00	1,463,400	
ヤフー	587,000	495.00	290,565,000	
トレンドマイクロ	35,800	3,920.00	140,336,000	
日本オラクル	16,200	3,995.00	64,719,000	
アルファシステムズ	2,700	1,337.00	3,609,900	
フューチャーアーキテクト	9,800	558.00	5,468,400	
シーエーシー	5,000	890.00	4,450,000	

ソフトバンク・テクノロジー	1,900	1,732.00	3,290,800	
トーセ	2,000	692.00	1,384,000	
オービックビジネスコンサルタント	4,100	3,410.00	13,981,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,600	4,000.00	38,400,000	
アイティフォー	9,100	419.00	3,812,900	
東計電算	1,400	1,463.00	2,048,200	
エックスネット	800	1,362.00	1,089,600	
大塚商会	7,300	12,740.00	93,002,000	
サイボウズ	122	29,230.00	3,566,060	
ソフトブレーン	11,200	131.00	1,467,200	
アグレックス	1,900	877.00	1,666,300	
電通国際情報サービス	5,000	1,172.00	5,860,000	
EMシステムズ	1,100	1,990.00	2,189,000	
ウェザーニューズ	2,100	2,148.00	4,510,800	
C I J	7,500	408.00	3,060,000	
WOWOW	2,500	3,640.00	9,100,000	
ネットワンシステムズ	31,800	617.00	19,620,600	
アルゴグラフィックス	3,000	1,662.00	4,986,000	
マーベラスAQL	12,300	639.00	7,859,700	
エイベックス・グループ・ホールディングス	14,900	2,398.00	35,730,200	
日本ユニシス	19,600	847.00	16,601,200	
兼松エレクトロニクス	5,100	1,275.00	6,502,500	
東京放送ホールディングス	43,700	1,322.00	57,771,400	
日本テレビホールディングス	80,800	1,862.00	150,449,600	
テレビ朝日	20,500	2,297.00	47,088,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	61,600	542.00	33,387,200	
テレビ東京ホールディングス	6,600	1,726.00	11,391,600	
コネクシオ	7,200	841.00	6,055,200	
日本電信電話	318,600	5,250.00	1,672,650,000	
K D D I	251,700	6,080.00	1,530,336,000	
光通信	7,600	7,470.00	56,772,000	
N T T ドコモ	668,100	1,607.00	1,073,636,700	
GMOインターネット	27,100	1,201.00	32,547,100	
学研ホールディングス	27,000	299.00	8,073,000	
ゼンリン	10,700	1,030.00	11,021,000	
昭文社	4,900	611.00	2,993,900	
KADOKAWA	7,700	3,585.00	27,604,500	
インプレスホールディングス	5,900	145.00	855,500	
アイネット	3,400	720.00	2,448,000	
松竹	53,000	959.00	50,827,000	
東宝	57,900	2,118.00	122,632,200	
東映	34,000	602.00	20,468,000	
A O I P r o.	3,800	652.00	2,477,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	57,200	3,645.00	208,494,000	
D T S	7,700	1,735.00	13,359,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,500	1,805.00	53,247,500	
シーイーシー	4,800	635.00	3,048,000	
カプコン	20,700	1,837.00	38,025,900	

ジャステック	5,200	846.00	4,399,200	
S C S K	19,300	2,559.00	49,388,700	
日本システムウェア	3,100	432.00	1,339,200	
アイネス	11,100	662.00	7,348,200	
TKC	6,800	1,655.00	11,254,000	
富士ソフト	10,300	2,197.00	22,629,100	
NSD	17,200	1,211.00	20,829,200	
コナミ	36,600	2,553.00	93,439,800	
福井コンピュータホールディングス	1,100	807.00	887,700	
J B C Cホールディングス	6,800	828.00	5,630,400	
ミロク情報サービス	5,500	393.00	2,161,500	
ソフトバンク	398,200	7,720.00	3,074,104,000	
ハウスイ	7,000	136.00	952,000	
高千穂交易	3,400	945.00	3,213,000	
伊藤忠食品	2,000	3,230.00	6,460,000	
エレマテック	3,800	1,553.00	5,901,400	
J A L U X	2,300	1,134.00	2,608,200	
あらた	18,000	347.00	6,246,000	
トーメンデバイス	1,200	1,696.00	2,035,200	
東京エレクトロン デバイス	1,700	1,561.00	2,653,700	
双日	542,700	191.00	103,655,700	
アルフレッサ ホールディングス	24,000	5,260.00	126,240,000	
横浜冷凍	20,100	789.00	15,858,900	
山下医科器械	700	1,784.00	1,248,800	
ラサ商事	3,600	455.00	1,638,000	
アルコニックス	2,500	2,122.00	5,305,000	
神戸物産	900	2,228.00	2,005,200	
あい ホールディングス	14,500	1,288.00	18,676,000	
ダイワボウホールディングス	74,000	205.00	15,170,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,300	707.00	10,817,100	
八洲電機	6,400	417.00	2,668,800	
UKCホールディングス	5,200	1,737.00	9,032,400	
T O K A Iホールディングス	39,700	352.00	13,974,400	
ミタチ産業	2,000	423.00	846,000	
シップヘルスケアホールディングス	11,600	4,130.00	47,908,000	
富士興産	3,000	648.00	1,944,000	
協栄産業	10,000	188.00	1,880,000	
小野建	7,100	1,290.00	9,159,000	
佐鳥電機	6,000	598.00	3,588,000	
エコートレーディング	2,100	730.00	1,533,000	
伯東	5,000	955.00	4,775,000	
コンドーテック	6,700	728.00	4,877,600	
中山福	4,700	749.00	3,520,300	
ナガイレーベン	10,800	1,610.00	17,388,000	
三菱食品	8,900	2,549.00	22,686,100	
松田産業	5,900	1,386.00	8,177,400	
メディパルホールディングス	81,100	1,316.00	106,727,600	
アドヴァン	4,200	1,203.00	5,052,600	

S P K	1,900	1,794.00	3,408,600	
アズワン	5,300	2,225.00	11,792,500	
スズデン	3,000	526.00	1,578,000	
尾家産業	2,700	806.00	2,176,200	
シモジマ	5,600	968.00	5,420,800	
ドウシシャ	8,600	1,420.00	12,212,000	
高速	4,900	907.00	4,444,300	
黒田電気	11,700	1,437.00	16,812,900	
丸文	7,300	485.00	3,540,500	
ハピネット	5,000	787.00	3,935,000	
トーメンエレクトロニクス	4,200	1,140.00	4,788,000	
エクセル	3,800	1,149.00	4,366,200	
マルカキカイ	2,700	1,446.00	3,904,200	
ガリバーインターナショナル	27,400	587.00	16,083,800	
日本エム・ディ・エム	6,900	285.00	1,966,500	
進和	4,800	1,136.00	5,452,800	
エスケイジャパン	2,100	277.00	581,700	
ダイトエレクトロン	3,800	389.00	1,478,200	
シークス	5,200	1,193.00	6,203,600	
田中商事	2,600	593.00	1,541,800	
オーハシテクニカ	4,400	939.00	4,131,600	
マクニカ	4,200	2,728.00	11,457,600	
白銅	2,700	833.00	2,249,100	
伊藤忠商事	646,900	1,264.00	817,681,600	
丸紅	709,000	747.00	529,623,000	
高島	15,000	273.00	4,095,000	
長瀬産業	45,900	1,186.00	54,437,400	
蝶理	5,200	1,156.00	6,011,200	
豊田通商	90,300	2,573.00	232,341,900	
三共生興	13,900	339.00	4,712,100	
兼松	172,000	151.00	25,972,000	
ツカモトコーポレーション	15,000	160.00	2,400,000	
三井物産	746,600	1,409.00	1,051,959,400	
日本紙パルプ商事	42,000	311.00	13,062,000	
日立ハイテクノロジーズ	24,600	2,262.00	55,645,200	
カメイ	10,600	777.00	8,236,200	
東都水産	15,000	225.00	3,375,000	
OUGホールディングス	12,000	184.00	2,208,000	
スターゼン	29,000	266.00	7,714,000	
山善	31,200	622.00	19,406,400	
椿本興業	9,000	268.00	2,412,000	
住友商事	478,500	1,274.00	609,609,000	
内田洋行	19,000	288.00	5,472,000	
三菱商事	632,700	2,007.00	1,269,828,900	
第一実業	18,000	445.00	8,010,000	
キヤノンマーケティングジャパン	23,200	1,465.00	33,988,000	
西華産業	28,000	238.00	6,664,000	
佐藤商事	7,300	630.00	4,599,000	

菱洋エレクトロ	9,600	954.00	9,158,400	
東京産業	8,200	337.00	2,763,400	
ユアサ商事	83,000	205.00	17,015,000	
神鋼商事	21,000	212.00	4,452,000	
小林産業	5,500	344.00	1,892,000	
阪和興業	81,000	500.00	40,500,000	
カナデン	8,000	670.00	5,360,000	
菱電商事	12,000	671.00	8,052,000	
フルサト工業	4,500	1,086.00	4,887,000	
岩谷産業	90,000	487.00	43,830,000	
すてきナイスグループ	34,000	258.00	8,772,000	
昭光通商	26,000	158.00	4,108,000	
ニチモウ	13,000	201.00	2,613,000	
極東貿易	9,000	211.00	1,899,000	
イワキ	12,000	215.00	2,580,000	
三愛石油	19,000	442.00	8,398,000	
稲畑産業	20,000	1,093.00	21,860,000	
G S I クレオス	22,000	151.00	3,322,000	
明和産業	7,600	336.00	2,553,600	
ワキタ	12,000	1,243.00	14,916,000	
東邦ホールディングス	26,000	1,712.00	44,512,000	
サンゲツ	14,400	2,582.00	37,180,800	
ミツウロコグループホールディングス	13,100	512.00	6,707,200	
シナネン	18,000	381.00	6,858,000	
伊藤忠エネクス	18,000	543.00	9,774,000	
サンリオ	20,500	4,670.00	95,735,000	
サンワテクノス	4,100	873.00	3,579,300	
リョーサン	12,100	2,043.00	24,720,300	
新光商事	8,900	855.00	7,609,500	
トーヨー	17,000	356.00	6,052,000	
三信電気	10,100	682.00	6,888,200	
東陽テクニカ	11,200	1,124.00	12,588,800	
モスフードサービス	10,600	1,938.00	20,542,800	
加賀電子	7,400	1,090.00	8,066,000	
ソーダニッカ	8,000	416.00	3,328,000	
立花エレテック	5,000	1,172.00	5,860,000	
P a l t a c	11,400	1,320.00	15,048,000	
ヤマタネ	41,000	184.00	7,544,000	
丸紅建材リース	7,000	212.00	1,484,000	
日鉄住金物産	53,000	365.00	19,345,000	
トラスコ中山	9,300	2,107.00	19,595,100	
オートバックスセブン	28,500	1,485.00	42,322,500	
加藤産業	11,700	1,894.00	22,159,800	
イノテック	7,500	481.00	3,607,500	
イエローハット	7,000	1,924.00	13,468,000	
富士エレクトロニクス	4,200	1,312.00	5,510,400	
J Kホールディングス	6,900	622.00	4,291,800	
日伝	3,700	2,321.00	8,587,700	

北沢産業	7,000	184.00	1,288,000	
杉本商事	4,400	923.00	4,061,200	
因幡電機産業	11,100	3,095.00	34,354,500	
バイテック	2,800	871.00	2,438,800	
ミスミグループ本社	32,500	2,909.00	94,542,500	
江守商事	2,600	2,048.00	5,324,800	
アルテック	3,900	283.00	1,103,700	
タキヒヨー	14,000	400.00	5,600,000	
スズケン	33,600	3,455.00	116,088,000	
ジェコス	5,600	763.00	4,272,800	
ローソン	33,300	7,590.00	252,747,000	
サンエー	6,100	2,865.00	17,476,500	
キリン堂	2,900	675.00	1,957,500	
ダイユーエイト	1,600	662.00	1,059,200	
カワチ薬品	5,600	1,852.00	10,371,200	
エービーシー・マート	11,500	4,820.00	55,430,000	
ハードオフコーポレーション	3,900	748.00	2,917,200	
アスクル	6,900	2,860.00	19,734,000	
ゲオホールディングス	13,900	920.00	12,788,000	
アダストリアホールディングス	6,200	4,375.00	27,125,000	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	10,000	235.00	2,350,000	
くらコーポレーション	4,800	1,608.00	7,718,400	
キャンドゥ	3,900	1,613.00	6,290,700	
パル	4,700	2,719.00	12,779,300	
エディオン	37,200	572.00	21,278,400	
サーラコーポレーション	7,000	521.00	3,647,000	
あみやき亭	1,400	3,460.00	4,844,000	
ひらまつ	8,400	632.00	5,308,800	
ゲンキー	700	2,141.00	1,498,700	
大黒天物産	1,700	2,840.00	4,828,000	
ハニーズ	6,420	1,103.00	7,081,260	
アルペン	6,200	1,863.00	11,550,600	
クオール	5,900	603.00	3,557,700	
ジェイアイエヌ	4,100	3,810.00	15,621,000	
ビックカメラ	308	50,400.00	15,523,200	
DCMホールディングス	40,000	709.00	28,360,000	
Monotaro	12,500	2,346.00	29,325,000	
J. フロント リテイリング	192,000	776.00	148,992,000	
ドトール・日レスホールディングス	14,200	1,722.00	24,452,400	
マツモトキヨシホールディングス	16,700	3,085.00	51,519,500	
ブロンコビリー	1,300	1,906.00	2,477,800	
スタートトゥデイ	25,200	3,040.00	76,608,000	
物語コーポレーション	1,100	3,835.00	4,218,500	
ココカラファイン	8,500	2,585.00	21,972,500	
三越伊勢丹ホールディングス	161,200	1,495.00	240,994,000	
ウエルシアホールディングス	2,900	5,700.00	16,530,000	
クリエイトSDホールディングス	3,400	3,665.00	12,461,000	
丸善CH Iホールディングス	7,100	287.00	2,037,700	

エー・ピーカンパニー	700	2,145.00	1,501,500	
ブックオフコーポレーション	4,500	667.00	3,001,500	
あさひ	4,700	1,647.00	7,740,900	
日本調剤	1,030	2,736.00	2,818,080	
コスモス薬品	4,100	11,110.00	45,551,000	
一六堂	1,200	446.00	535,200	
セブン&アイ・ホールディングス	339,200	3,765.00	1,277,088,000	
ツルハホールディングス	8,000	8,650.00	69,200,000	
サンマルクホールディングス	2,600	5,180.00	13,468,000	
フェリシモ	2,300	999.00	2,297,700	
トリドール	7,000	906.00	6,342,000	
クスリのアオキ	1,200	5,640.00	6,768,000	
メディカルシステムネットワーク	6,600	428.00	2,824,800	
総合メディカル	2,000	3,805.00	7,610,000	
はるやま商事	3,400	673.00	2,288,200	
カッパ・クリエイトホールディングス	5,950	1,852.00	11,019,400	
ライトオン	6,100	800.00	4,880,000	
良品計画	8,600	10,460.00	89,956,000	
三城ホールディングス	10,000	476.00	4,760,000	
コナカ	10,300	929.00	9,568,700	
ハウス オブ ローゼ	900	1,326.00	1,193,400	
G-7ホールディングス	2,400	744.00	1,785,600	
イオン北海道	6,800	646.00	4,392,800	
コジマ	12,000	283.00	3,396,000	
ヒマラヤ	1,900	1,296.00	2,462,400	
コーナン商事	10,600	1,041.00	11,034,600	
エコス	2,800	602.00	1,685,600	
ワタミ	9,600	1,414.00	13,574,400	
マルシェ	2,000	813.00	1,626,000	
ドン・キホーテ	23,900	6,130.00	146,507,000	
西松屋チェーン	16,000	753.00	12,048,000	
ゼンショーホールディングス	30,900	1,068.00	33,001,200	
幸楽苑	5,000	1,230.00	6,150,000	
ハークスレイ	2,300	773.00	1,777,900	
サイゼリヤ	12,000	1,192.00	14,304,000	
ポプラ	3,600	541.00	1,947,600	
ユナイテッドアローズ	10,600	4,325.00	45,845,000	
ハイデイ日高	4,300	2,084.00	8,961,200	
京都きもの友禅	5,400	1,051.00	5,675,400	
コロワイド	27,000	1,013.00	27,351,000	
壺番屋	3,300	4,125.00	13,612,500	
トップカルチャー	2,900	452.00	1,310,800	
P L A N T	1,500	930.00	1,395,000	
スギホールディングス	14,500	4,115.00	59,667,500	
スクロール	10,500	286.00	3,003,000	
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,421.00	8,810,200	
ファミリーマート	27,400	4,465.00	122,341,000	
木曽路	9,900	1,809.00	17,909,100	

サトレストランシシステムズ	7,600	673.00	5,114,800	
千趣会	14,600	856.00	12,497,600	
タカキュー	6,500	324.00	2,106,000	
ケーヨー	13,800	461.00	6,361,800	
上新電機	18,000	796.00	14,328,000	
日本瓦斯	12,100	1,067.00	12,910,700	
ベスト電器	26,100	161.00	4,202,100	
マルエツ	17,000	332.00	5,644,000	
ロイヤルホールディングス	13,500	1,590.00	21,465,000	
東天紅	6,000	193.00	1,158,000	
いなげや	9,100	999.00	9,090,900	
島忠	18,400	2,281.00	41,970,400	
チヨダ	9,600	2,176.00	20,889,600	
ライフコーポレーション	6,300	1,601.00	10,086,300	
カスミ	16,700	612.00	10,220,400	
リンガーハット	7,900	1,434.00	11,328,600	
MrMax	8,100	330.00	2,673,000	
テナアライド	6,100	309.00	1,884,900	
AOKIホールディングス	7,000	3,330.00	23,310,000	
オークワ	13,000	913.00	11,869,000	
コメリ	12,500	2,482.00	31,025,000	
青山商事	22,400	2,665.00	59,696,000	
しまむら	9,400	10,840.00	101,896,000	
CFSコーポレーション	5,500	382.00	2,101,000	
はせがわ	2,800	687.00	1,923,600	
高島屋	110,000	992.00	109,120,000	
松屋	17,100	1,173.00	20,058,300	
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,000	833.00	39,984,000	
近鉄百貨店	31,000	348.00	10,788,000	
ニッセンホールディングス	16,200	317.00	5,135,400	
パルコ	7,800	978.00	7,628,400	
丸井グループ	105,700	1,052.00	111,196,400	
アクシアル リテイリング	4,500	1,552.00	6,984,000	
ダイエー	50,050	334.00	16,716,700	
イズミヤ	32,000	464.00	14,848,000	
イオン	318,700	1,355.00	431,838,500	
ユニグループ・ホールディングス	78,600	661.00	51,954,600	
イズミ	18,300	3,145.00	57,553,500	
東武ストア	11,000	261.00	2,871,000	
平和堂	16,500	1,505.00	24,832,500	
フジ	9,000	1,770.00	15,930,000	
ヤオコー	4,100	4,055.00	16,625,500	
ゼビオ	9,800	2,115.00	20,727,000	
ケーズホールディングス	17,100	3,190.00	54,549,000	
Olympicグループ	4,800	734.00	3,523,200	
日産東京販売ホールディングス	12,000	386.00	4,632,000	
アインファーマシーズ	4,900	4,450.00	21,805,000	
元氣寿司	2,500	1,257.00	3,142,500	

ヤマダ電機	320,500	326.00	104,483,000	
アーランドサカモト	5,300	1,561.00	8,273,300	
ニトリホールディングス	16,050	8,970.00	143,968,500	
グルメ杵屋	6,000	672.00	4,032,000	
愛眼	6,500	282.00	1,833,000	
吉野家ホールディングス	22,000	1,173.00	25,806,000	
松屋フーズ	3,900	1,625.00	6,337,500	
サガミチェーン	10,000	879.00	8,790,000	
関西スーパーマーケット	6,100	897.00	5,471,700	
王将フードサービス	4,000	3,340.00	13,360,000	
プレナス	9,100	2,265.00	20,611,500	
ミニストップ	6,000	1,554.00	9,324,000	
アークス	13,800	1,862.00	25,695,600	
パロー	17,500	1,273.00	22,277,500	
藤久	600	1,654.00	992,400	
ベルク	4,000	1,811.00	7,244,000	
大庄	3,800	1,271.00	4,829,800	
ファーストリテイリング	18,900	35,950.00	679,455,000	
サンドラッグ	17,100	4,775.00	81,652,500	
東京デリカ	4,100	1,537.00	6,301,700	
ヤマザワ	1,900	1,543.00	2,931,700	
やまや	1,700	1,395.00	2,371,500	
ベルーナ	20,200	497.00	10,039,400	
島根銀行	1,700	1,303.00	2,215,100	
じもとホールディングス	58,200	212.00	12,338,400	
新生銀行	702,000	241.00	169,182,000	
あおぞら銀行	421,000	298.00	125,458,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,142,300	658.00	4,041,633,400	
りそなホールディングス	770,700	528.00	406,929,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,593,000	499.00	794,907,000	
三井住友フィナンシャルグループ	613,200	5,080.00	3,115,056,000	
第四銀行	103,000	366.00	37,698,000	
北越銀行	88,000	209.00	18,392,000	
西日本シティ銀行	285,000	272.00	77,520,000	
千葉銀行	313,000	729.00	228,177,000	
横浜銀行	535,000	556.00	297,460,000	
常陽銀行	302,000	514.00	155,228,000	
群馬銀行	182,000	592.00	107,744,000	
武蔵野銀行	12,900	3,595.00	46,375,500	
千葉興業銀行	16,800	755.00	12,684,000	
筑波銀行	33,700	355.00	11,963,500	
東京都民銀行	14,300	1,066.00	15,243,800	
七十七銀行	127,000	507.00	64,389,000	
青森銀行	59,000	266.00	15,694,000	
秋田銀行	56,000	255.00	14,280,000	
山形銀行	49,000	432.00	21,168,000	
岩手銀行	5,300	4,785.00	25,360,500	
東邦銀行	72,000	309.00	22,248,000	

東北銀行	41,000	147.00	6,027,000	
みちのく銀行	43,000	204.00	8,772,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	329,000	464.00	152,656,000	
静岡銀行	238,000	1,158.00	275,604,000	
十六銀行	102,000	406.00	41,412,000	
スルガ銀行	79,000	1,674.00	132,246,000	
八十二銀行	150,000	626.00	93,900,000	
山梨中央銀行	52,000	429.00	22,308,000	
大垣共立銀行	101,000	283.00	28,583,000	
福井銀行	69,000	234.00	16,146,000	
北國銀行	91,000	367.00	33,397,000	
清水銀行	2,800	2,846.00	7,968,800	
滋賀銀行	76,000	543.00	41,268,000	
南都銀行	79,000	390.00	30,810,000	
百五銀行	73,000	411.00	30,003,000	
京都銀行	155,000	879.00	136,245,000	
紀陽銀行	31,800	1,326.00	42,166,800	
三重銀行	34,000	206.00	7,004,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	552,000	212.00	117,024,000	
広島銀行	239,000	432.00	103,248,000	
山陰合同銀行	50,000	746.00	37,300,000	
中国銀行	60,300	1,425.00	85,927,500	
鳥取銀行	26,000	189.00	4,914,000	
伊予銀行	86,700	1,054.00	91,381,800	
百十四銀行	89,000	382.00	33,998,000	
四国銀行	59,000	229.00	13,511,000	
阿波銀行	66,000	521.00	34,386,000	
鹿児島銀行	56,000	673.00	37,688,000	
大分銀行	51,000	379.00	19,329,000	
宮崎銀行	54,000	294.00	15,876,000	
肥後銀行	67,000	580.00	38,860,000	
佐賀銀行	49,000	214.00	10,486,000	
十八銀行	50,000	234.00	11,700,000	
沖縄銀行	6,000	4,000.00	24,000,000	
琉球銀行	15,700	1,152.00	18,086,400	
八千代銀行	3,900	2,661.00	10,377,900	
セブン銀行	303,800	361.00	109,671,800	
みずほフィナンシャルグループ	10,494,100	219.00	2,298,207,900	
山口フィナンシャルグループ	81,000	970.00	78,570,000	
長野銀行	27,000	178.00	4,806,000	
名古屋銀行	73,000	348.00	25,404,000	
北洋銀行	122,200	407.00	49,735,400	
愛知銀行	2,900	4,775.00	13,847,500	
第三銀行	46,000	165.00	7,590,000	
中京銀行	33,000	182.00	6,006,000	
東日本銀行	35,000	227.00	7,945,000	
大光銀行	29,000	219.00	6,351,000	
愛媛銀行	48,000	234.00	11,232,000	

トマト銀行	31,000	174.00	5,394,000	
みなと銀行	73,000	176.00	12,848,000	
京葉銀行	67,000	525.00	35,175,000	
関西アーバン銀行	113,000	121.00	13,673,000	
栃木銀行	41,000	412.00	16,892,000	
北日本銀行	2,500	2,533.00	6,332,500	
東和銀行	94,000	93.00	8,742,000	
福島銀行	100,000	86.00	8,600,000	
大東銀行	52,000	102.00	5,304,000	
トモニホールディングス	62,200	404.00	25,128,800	
フィデアホールディングス	46,700	199.00	9,293,300	
池田泉州ホールディングス	60,800	482.00	29,305,600	
F P G	7,000	1,096.00	7,672,000	
S B I ホールディングス	98,700	1,390.00	137,193,000	
ジャフコ	11,400	5,490.00	62,586,000	
大和証券グループ本社	803,000	988.00	793,364,000	
野村ホールディングス	1,657,700	798.00	1,322,844,600	
岡三証券グループ	64,000	960.00	61,440,000	
丸三証券	24,900	861.00	21,438,900	
東洋証券	34,000	369.00	12,546,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,900	874.00	75,076,600	
水戸証券	26,000	509.00	13,234,000	
いちよし証券	16,200	1,512.00	24,494,400	
松井証券	41,200	1,143.00	47,091,600	
だいこう証券ビジネス	4,900	725.00	3,552,500	
マネックスグループ	88,100	421.00	37,090,100	
カブドットコム証券	31,500	574.00	18,081,000	
極東証券	10,000	1,865.00	18,650,000	
岩井コスモホールディングス	8,600	1,443.00	12,409,800	
マネーパートナーズグループ	8,500	292.00	2,482,000	
N K S J ホールディングス	180,100	2,759.00	496,895,900	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	242,300	2,754.00	667,294,200	
ソニーフィナンシャルホールディングス	77,700	1,893.00	147,086,100	
第一生命保険	408,200	1,528.00	623,729,600	
東京海上ホールディングス	314,100	3,430.00	1,077,363,000	
T & D ホールディングス	278,100	1,309.00	364,032,900	
全国保証	10,500	4,600.00	48,300,000	
クレディセゾン	67,500	2,838.00	191,565,000	
芙蓉総合リース	9,000	4,275.00	38,475,000	
興銀リース	14,900	2,973.00	44,297,700	
東京センチュリーリース	19,900	3,555.00	70,744,500	
日本証券金融	41,100	799.00	32,838,900	
ポケットカード	12,000	880.00	10,560,000	
リコーリース	5,800	2,975.00	17,255,000	
イオンフィナンシャルサービス	48,500	2,950.00	143,075,000	
アコム	176,400	379.00	66,855,600	
ジャックス	57,000	474.00	27,018,000	
オリエントコーポレーション	197,900	261.00	51,651,900	

日立キャピタル	17,400	2,848.00	49,555,200	
アプラスフィナンシャル	66,500	155.00	10,307,500	
オリックス	492,900	1,762.00	868,489,800	
三菱UFJリース	211,100	586.00	123,704,600	
日本取引所グループ	121,200	2,785.00	337,542,000	
イー・ギャランティ	4,300	2,379.00	10,229,700	
アサックス	1,400	1,423.00	1,992,200	
NECキャピタルソリューション	4,200	2,581.00	10,840,200	
日本駐車場開発	885	7,580.00	6,708,300	
ヒューリック	136,700	1,681.00	229,792,700	
東京建物不動産販売	4,200	475.00	1,995,000	
三栄建築設計	2,500	840.00	2,100,000	
野村不動産ホールディングス	53,600	2,476.00	132,713,600	
常和ホールディングス	2,900	2,903.00	8,418,700	
フージャースホールディングス	12,100	764.00	9,244,400	
オープンハウス	3,200	2,489.00	7,964,800	
東急不動産ホールディングス	196,600	999.00	196,403,400	
飯田グループホールディングス	35,500	2,096.00	74,408,000	
パーク24	42,300	1,835.00	77,620,500	
パラカ	2,100	830.00	1,743,000	
三井不動産	382,000	3,480.00	1,329,360,000	
三菱地所	568,000	2,876.00	1,633,568,000	
平和不動産	16,400	1,798.00	29,487,200	
東京建物	166,000	977.00	162,182,000	
ダイビル	23,900	1,264.00	30,209,600	
京阪神ビルディング	13,500	554.00	7,479,000	
住友不動産	194,000	4,950.00	960,300,000	
大京	136,000	285.00	38,760,000	
テオーシー	28,000	809.00	22,652,000	
東京楽天地	13,000	491.00	6,383,000	
レオパレス21	77,700	699.00	54,312,300	
フジ住宅	10,400	675.00	7,020,000	
空港施設	9,900	852.00	8,434,800	
明和地所	4,000	460.00	1,840,000	
住友不動産販売	5,900	3,090.00	18,231,000	
ゴールドクレスト	6,400	2,776.00	17,766,400	
日本エスリード	3,200	1,079.00	3,452,800	
日神不動産	5,400	802.00	4,330,800	
タカラレーベン	27,100	379.00	10,270,900	
サンヨーハウジング名古屋	4,200	1,205.00	5,061,000	
イオンモール	52,300	2,893.00	151,303,900	
ファースト住建	2,300	1,505.00	3,461,500	
トーセイ	11,100	827.00	9,179,700	
穴吹興産	6,000	331.00	1,986,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	50,400	1,212.00	61,084,800	
サンフロンティア不動産	7,700	1,374.00	10,579,800	
ランドビジネス	5,500	476.00	2,618,000	
グランディハウス	4,800	352.00	1,689,600	

日本空港ビルデング	28,000	2,233.00	62,524,000	
日本工営	29,000	454.00	13,166,000	
ネクスト	2,600	3,325.00	8,645,000	
日本M&Aセンター	4,400	7,580.00	33,352,000	
ノバレーゼ	2,200	714.00	1,570,800	
アコーディア・ゴルフ	35,300	1,141.00	40,277,300	
タケエイ	5,900	1,532.00	9,038,800	
パソナグループ	89	78,800.00	7,013,200	
リンクアンドモチベーション	55	33,600.00	1,848,000	
GCAサヴィアン	5,100	1,138.00	5,803,800	
エス・エム・エス	4,900	1,901.00	9,314,900	
テンプホールディングス	18,800	2,678.00	50,346,400	
リニカル	2,300	1,169.00	2,688,700	
クックパッド	5,100	3,385.00	17,263,500	
エスクリ	3,800	878.00	3,336,400	
アイ・ケイ・ケイ	2,500	796.00	1,990,000	
学情	3,400	865.00	2,941,000	
スタジオアリス	3,500	1,326.00	4,641,000	
シミックホールディングス	3,300	1,219.00	4,022,700	
NECフィールディング	7,000	1,152.00	8,064,000	
総合警備保障	31,200	1,902.00	59,342,400	
カカクコム	52,100	1,923.00	100,188,300	
ルネサンス	3,800	743.00	2,823,400	
ツクイ	9,800	1,012.00	9,917,600	
総合臨床ホールディングス	2,600	600.00	1,560,000	
キャリアデザインセンター	24	107,700.00	2,584,800	
エムスリー	284	247,700.00	70,346,800	
ベストブライダル	5,000	657.00	3,285,000	
日本ERI	1,600	1,238.00	1,980,800	
アウトソーシング	3,900	975.00	3,802,500	
ディー・エヌ・エー	46,200	1,893.00	87,456,600	
博報堂DYホールディングス	119,000	780.00	92,820,000	
ぐるなび	6,000	2,362.00	14,172,000	
一休	61	146,100.00	8,912,100	
ジャパンベストレスクューシステム	67	66,600.00	4,462,200	
ジェイコムホールディングス	1,500	814.00	1,221,000	
PGMホールディングス	12,400	990.00	12,276,000	
バリューコマース	5,800	1,488.00	8,630,400	
JPホールディングス	15,900	410.00	6,519,000	
イーピーエス	92	117,700.00	10,828,400	
アミューズ	2,400	1,871.00	4,490,400	
ドリームインキュベータ	27	188,900.00	5,100,300	
ケネディクス	103,300	546.00	56,401,800	
電通	80,900	4,035.00	326,431,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	1,889.00	7,933,800	
ぴあ	2,500	1,763.00	4,407,500	
イオンファンタジー	2,800	1,558.00	4,362,400	
ネクシィーズ	4,400	417.00	1,834,800	

みらかホールディングス	22,500	4,710.00	105,975,000	
アルプス技研	3,500	1,039.00	3,636,500	
サニックス	12,500	1,064.00	13,300,000	
ダイオーズ	1,600	736.00	1,177,600	
日本空調サービス	2,100	945.00	1,984,500	
オリエンタルランド	23,200	15,020.00	348,464,000	
ダスキン	23,200	2,002.00	46,446,400	
明光ネットワークジャパン	8,500	1,079.00	9,171,500	
ファルコSDホールディングス	4,400	1,238.00	5,447,200	
秀英予備校	3,400	329.00	1,118,600	
田谷	1,300	769.00	999,700	
ラウンドワン	25,400	746.00	18,948,400	
リゾートトラスト	14,700	3,870.00	56,889,000	
ビー・エム・エル	5,600	3,425.00	19,180,000	
ワタベウェディング	2,800	655.00	1,834,000	
もしもしホットライン	16,000	1,118.00	17,888,000	
リソー教育	9,700	640.00	6,208,000	
早稲田アカデミー	1,300	748.00	972,400	
ユー・エス・エス	103,900	1,387.00	144,109,300	
東京個別指導学院	4,200	244.00	1,024,800	
テー・オー・ダブリュー	2,800	575.00	1,610,000	
セントラルスポーツ	2,600	1,513.00	3,933,800	
フルキャストホールディングス	8,100	274.00	2,219,400	
リゾートソリューション	10,000	231.00	2,310,000	
リブセンス	2,100	4,405.00	9,250,500	
リロ・ホールディング	3,200	4,755.00	15,216,000	
エイチ・アイ・エス	7,000	5,290.00	37,030,000	
共立メンテナンス	4,400	3,970.00	17,468,000	
イチネンホールディングス	10,200	731.00	7,456,200	
建設技術研究所	5,100	914.00	4,661,400	
スペース	4,200	869.00	3,649,800	
燦ホールディングス	1,700	1,385.00	2,354,500	
スバル興業	6,000	372.00	2,232,000	
東京テアトル	33,000	165.00	5,445,000	
よみうりランド	18,000	787.00	14,166,000	
東京都競馬	67,000	441.00	29,547,000	
カナモト	11,000	2,543.00	27,973,000	
東京ドーム	65,000	736.00	47,840,000	
西尾レントオール	4,700	2,493.00	11,717,100	
トランス・コスモス	11,200	1,800.00	20,160,000	
乃村工藝社	16,800	852.00	14,313,600	
藤田観光	22,000	411.00	9,042,000	
日本管財	3,700	1,961.00	7,255,700	
トーカイ	3,800	2,577.00	9,792,600	
白洋舎	12,000	243.00	2,916,000	
セコム	89,300	6,220.00	555,446,000	
セントラル警備保障	3,800	944.00	3,587,200	
丹青社	9,000	620.00	5,580,000	

メイテック	11,800	2,804.00	33,087,200	
アサツー ディ・ケイ	15,200	2,521.00	38,319,200	
応用地質	8,200	1,679.00	13,767,800	
船井総合研究所	8,800	802.00	7,057,600	
進学会	3,600	402.00	1,447,200	
ベネッセホールディングス	28,800	3,795.00	109,296,000	
イオンディライト	8,300	1,899.00	15,761,700	
ナック	4,300	1,585.00	6,815,500	
ニチイ学館	18,600	857.00	15,940,200	
ダイセキ	12,700	1,944.00	24,688,800	
ステップ	2,600	832.00	2,163,200	
合計	130,434,804	—	143,587,432,800	

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。

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】

(1)資本金の額（平成25年12月30日現在）

資本金の額 3億円

発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数 3,000株

最近5年における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

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

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

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役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26年2月19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12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	354	4,603,102
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	354	4,603,102

3【委託会社等の経理状況】

- (1)委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	—
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	—
その他流動負債	—	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	—	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	—	350,000
資本剰余金合計	—	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 9,859	4,998
評価・換算差額等合計	△9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

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

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
建 物	84,592	千円	23,594	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による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

（１株当たり情報）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31銭

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

[次へ](#)

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26年2月19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9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9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
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。
楽天証券株式会社	7,495	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。
立花証券株式会社	6,695	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9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25年5月28日	臨時報告書
平成25年8月20日	有価証券報告書
平成25年8月20日	有価証券届出書の訂正届出書
平成25年8月28日	臨時報告書
平成25年9月26日	有価証券届出書の訂正届出書

中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	73,320
器具備品	※1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		△ 30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	※2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070

(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

中間損益計算書

(単位：千円)

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

中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

重要な会計方針

第28期中間会計期間
(自 平成25年4月1日
至 平成25年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法**有価証券****その他有価証券****時価のあるもの**

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)

2. 固定資産の減価償却の方法**(1) 有形固定資産**

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準**(1) 貸倒引当金**

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項**消費税等の会計処理**

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項**（中間貸借対照表関係）**

第28期中間会計期間末 （平成25年9月30日）		
※1	有形固定資産の減価償却累計額	
	建 物	29,556千円
	器具備品	251,697千円
	計	281,253千円
※2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）		
※1	減価償却実施額	
	有形固定資産	23,080千円
	無形固定資産	33,012千円
※2	営業外収益の主要項目	
	受取利息	4,063千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項**配当金支払額**

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

（リース取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

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

（関連情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,535,927千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成26年1月17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25年5月21日から平成25年11月19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11月19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XBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高 波 博 之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白 川 芳 樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊 藤 浩 之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 白 川 芳 樹 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 浩 之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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