

## 【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24年12月14日                    |
| 【計算期間】     | 第6期（自 平成23年10月1日 至 平成24年10月1日） |
| 【ファンド名】    | DCマイセレクションS75                  |
| 【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**

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

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

**ファンドの特色**

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

・原則として、為替ヘッジは行いません。

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

| 資 産     | インデックス                                                  |
|---------|---------------------------------------------------------|
| 国 内 株 式 | 東証株価指数(TOPIX) <sup>※1</sup>                             |
| 国 内 債 券 | ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合) <sup>※2</sup> |
| 外 国 株 式 | MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース) <sup>※3</sup>               |
| 外 国 債 券 | シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) <sup>※4</sup>              |

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

※1「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額で加重平均し、指数化したものです。具体的には、1968年1月4日の東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化しています。当該指数は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、下記の点をご認識ください。

- ①TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。
- ②(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。
- ⑥本ファンドおよび「国内株式インデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑦(株)東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者または

公衆に対し、本ファンドおよび「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

⑧(株)東京証券取引所は、委託者または「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑨前記の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンドおよび「国内株式インデックス マザーファンド」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI総合）」とは、野村證券株式会社（野村證券(株)）が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI総合は、野村證券(株)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、野村證券(株)が有しています。なお、野村證券(株)は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

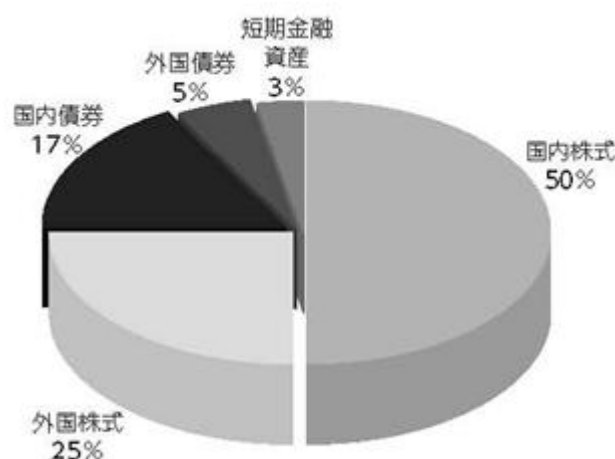
※3「MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）」とは、MSCI社が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国の株式指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。またMSCI社は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

※4「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インク（CGMI社）が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、CGMI社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%を基準アセットミックスとして運用します。

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

基準アセットミックス  
(2012年10月末現在)



#### 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および売買益等の全額とします。
- ・原則として、毎年9月30日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。
- ・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対

象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### ！ 主な投資制限

- ・ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において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、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

### [ファンドの商品分類]

本ファンドは、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、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<br>(収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
| 単位型投信   | 国内     | 株式                |
| 追加型投信   | 海外     | 債券                |
|         | 内外     | 不動産投信             |
|         |        | その他資産             |
|         |        | ( )               |
|         |        | 資産複合              |

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### [分類における定義]

| 分類項目              | 該当分類  | 分類の定義                                                                       |
|-------------------|-------|-----------------------------------------------------------------------------|
| 単位型・追加型           | 追加型投信 | 一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。                       |
| 投資対象地域            | 内外    | 目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。                |
| 投資対象資産<br>(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<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br><br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>( )<br><br>不動産投信<br><br>その他資産<br>（投資信託証券（資産<br>複合（株式、債券、短期<br>金融資産）資産配分固<br>定型））<br><br>資産複合<br>( )<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回          | グローバル<br>（日本を含む） | ファミリーファンド    | あり<br>（ ） |
|                                                                                                                                                                                                      | 年2回          | 日本               |              |           |
|                                                                                                                                                                                                      | 年4回          | 北米               |              |           |
|                                                                                                                                                                                                      | 年6回<br>（隔月）  | 欧州               |              |           |
|                                                                                                                                                                                                      | 年12回<br>（毎月） | アジア              |              |           |
|                                                                                                                                                                                                      | 日々           | オセアニア            |              |           |
|                                                                                                                                                                                                      | その他<br>（ ）   | 中南米              |              |           |
| 資産複合<br>（ ）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型                                                                                                                                                                    | 日々           | アフリカ             | ファンド・オブ・ファンズ | なし        |
|                                                                                                                                                                                                      | その他<br>（ ）   | 中近東<br>（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<br>（投資信託証券（資産<br>複合（株式、債券、短期<br>金融資産）資産配分固<br>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<br>ド・オブ・ファンズのものをいいます。）、実質的に複数資産（本<br>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<br>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。<br>当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<br>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<br>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<br>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<br>対象資産は「その他資産（投資信託証券）」となっています。 |
| 決算頻度   | 年1回                                                      | 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があ<br>るものをいいます。                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投資対象地域 | グローバル<br>（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<br>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<br>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<br>・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<br>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<br>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<br>います。                |

**(2) 【ファンドの沿革】**

平成18年10月30日

本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

平成24年 4月 1日

本ファンドの名称を「すみしん DCマイセクションS75」から「DCマイセクションS75」に変更

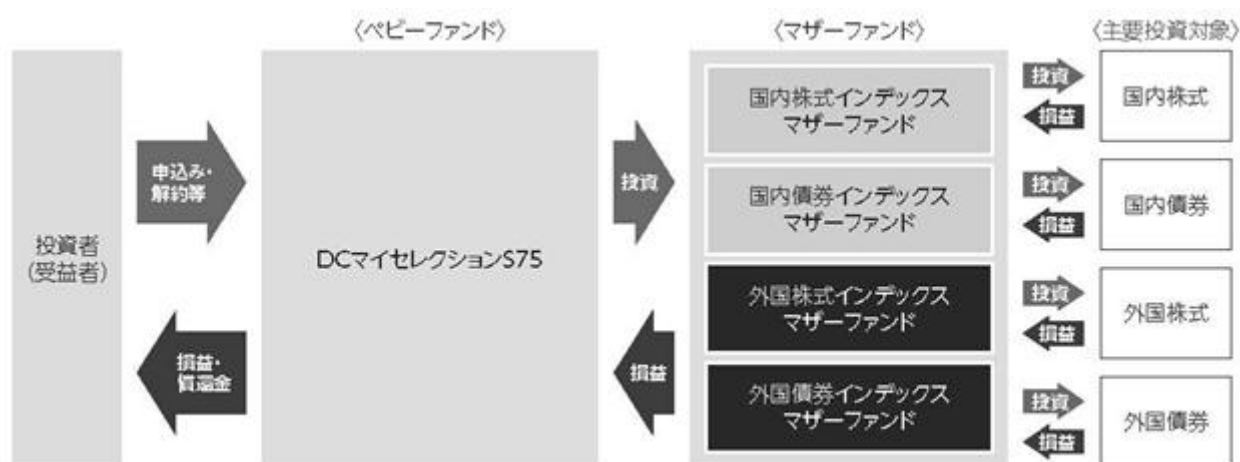
本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

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

ファミリーファンド方式（※）で運用します。

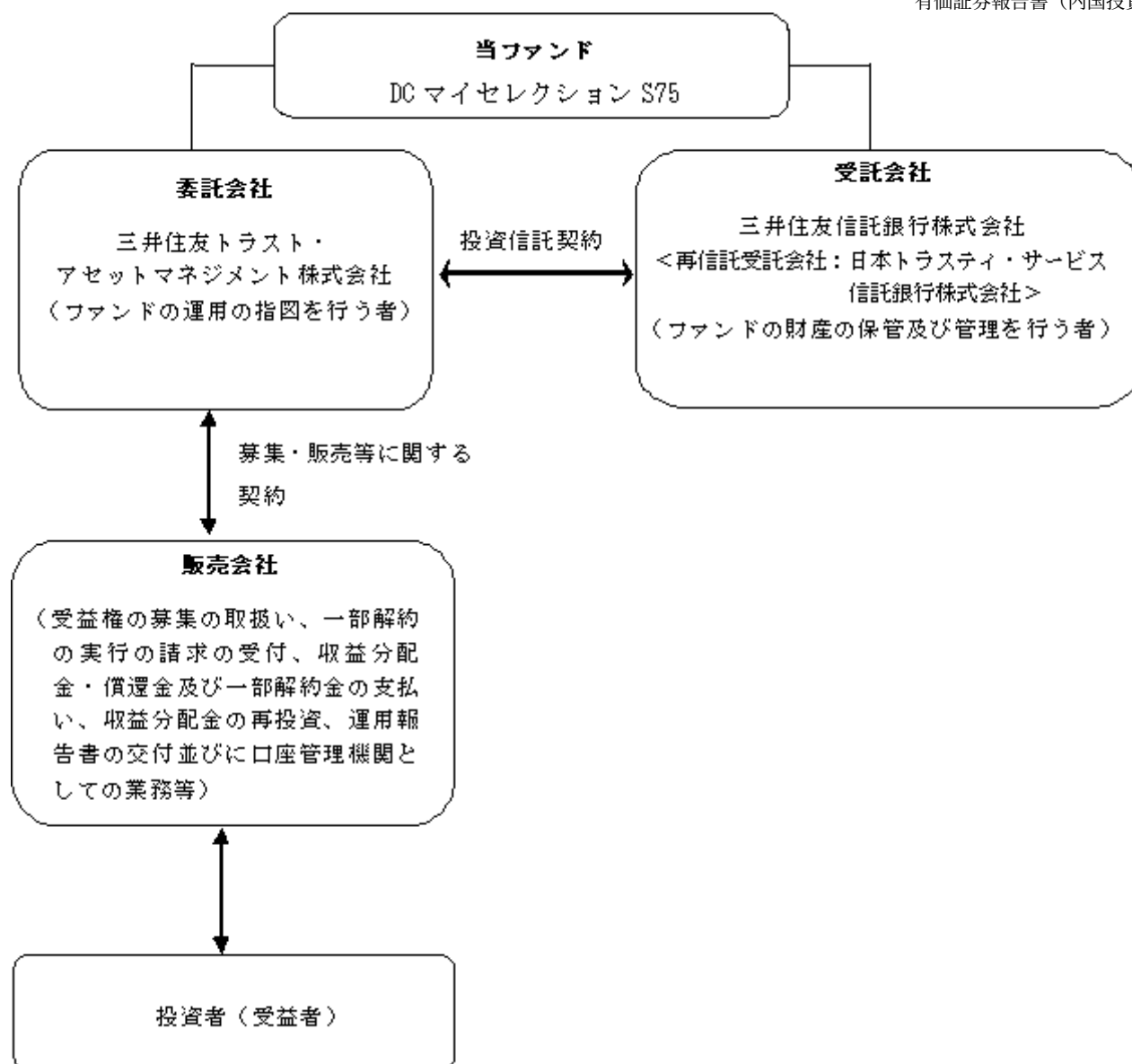
※ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンド

（DCマイセクションS75）とし、その資金をマザーファンド（国内株式インデックス マザーファンド、国内債券インデックス マザーファンド、外国株式インデックス マザーファンド及び外国債券インデックス マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



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

**(ロ) 当ファンドの関係法人図**



#### (ハ) 委託会社等の概況

##### ①資本金

平成24年10月31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24年10月31日現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### (イ) 基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ) 運用方法

##### ①投資対象

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

##### ②投資態度

- 1) 主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2) 基準ポートフォリオは、国内株式50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%の比率で基準配分します。
- 3) 各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産ごとの比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4) 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5) 投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 7) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

#### (参考)「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

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

## (2)投資態度

- 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株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- ③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑤国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

## 3.運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに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。
- 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。

## （参考）「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

- ①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 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。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

### 3.運用制限

- ①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。
- 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は、行いません。

## （参考）「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

- ①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 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外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ④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。
- ⑤有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑥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。
- ⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3.運用制限

- 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割合には制限を設けません。
- 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。
- 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。

## （参考）「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1.基本方針

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

### 2.運用方法

#### （1）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### （2）投資態度

- ①シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑥投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

### 3.運用制限

- ①同一銘柄の転換社債ならびに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。
- 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。

## （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25条、第26条および第27条に定めるものに限り。）

## ハ. 金銭債権

## ニ. 約束手形

## 2.次に掲げる特定資産以外の資産

## イ. 為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として、マザーファンド受益証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券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、第1号から第11号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。）
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。）
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第21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。

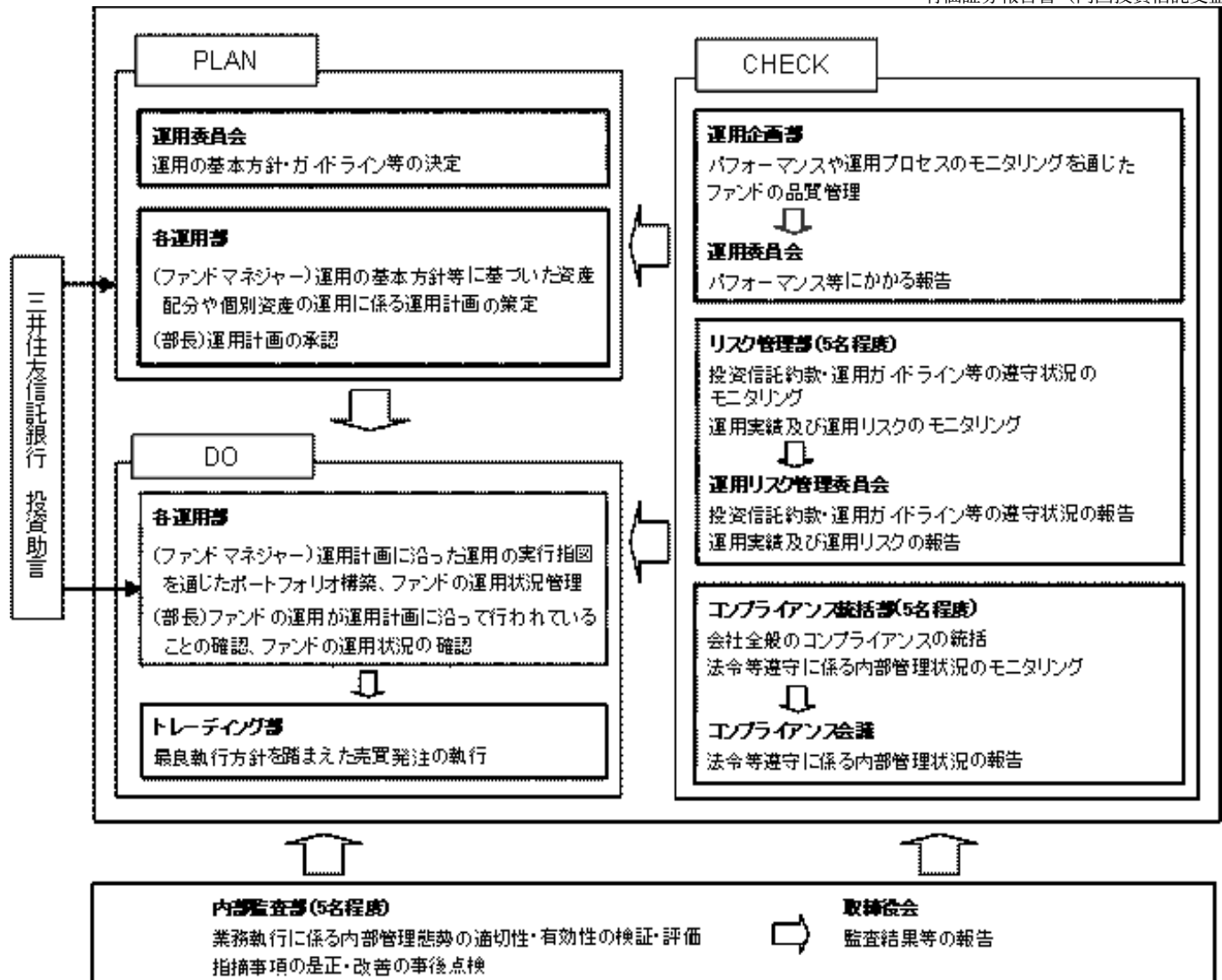
（ハ）委託者は、信託金を、前記（ロ）に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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24年12月14日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### ② 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

##### 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) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - 2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ②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、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 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、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マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- ⑦外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）
- 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、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21条）
- ⑨委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売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、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第24条）
  1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券

## 5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約

権の行使により取得可能な株券

## 6.投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権

（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

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。）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先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、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25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。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第26条）

⑫委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第27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28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の指図を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29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ます。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30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。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額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り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に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⑪、⑫および⑬における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

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

＜同一の法人の発行する株式への投資制限＞（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

＜デリバティブ取引に係る投資制限＞（金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

### 3【投資リスク】

#### (イ)ファンドのリスク

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ①株価変動リスク

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

##### ②為替変動リスク

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

##### ③金利変動リスク

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

##### ④信用リスク

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

##### ⑤カントリーリスク

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

##### ⑥流動性リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

- ①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
- ②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。  
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。  
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻し

に相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

- ③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。
- ④確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

#### (ロ) リスクの管理体制

##### 委託会社におけるリスク管理体制

- ①運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。
- ②内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

**4【手数料等及び税金】****(1)【申込手数料】**

ありません。

**(2)【換金（解約）手数料】**

ありません。

**(3)【信託報酬等】**

| 信託報酬総額                                            | 配分                                                |                                                   |                                                   |
|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
|                                                   | 委託者                                               | 指定販売会社                                            | 受託者                                               |
| 純資産総額に対して<br>年率0.2100%<br>(税抜 <sup>※</sup> 0.20%) | 純資産総額に対して<br>年率0.1155%<br>(税抜 <sup>※</sup> 0.11%) | 純資産総額に対して<br>年率0.0630%<br>(税抜 <sup>※</sup> 0.06%) | 純資産総額に対して<br>年率0.0315%<br>(税抜 <sup>※</sup> 0.03%) |

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。上記により日々計算された信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁するものとします。マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

**(4)【その他の手数料等】**

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

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

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

**(5)【課税上の取扱い】**

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の運用段階における課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

※上記は、平成24年10月31日現在のものですので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

（平成24年10月31日現在）

| 資産の種類               | 国／地域 | 時価合計(円)       | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券           | 日本   | 3,747,758,661 | 96.69   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 128,475,887   | 3.31    |
| 合計(純資産総額)           |      | 3,876,234,548 | 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

（平成24年10月31日現在）

| 国／地域 | 種類        | 銘柄名                | 数量            | 帳簿価額(円) |               | 評価額(円) |               | 投資比率(%) |
|------|-----------|--------------------|---------------|---------|---------------|--------|---------------|---------|
|      |           |                    |               | 単価      | 金額            | 単価     | 金額            |         |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内株式インデックス マザーファンド | 3,204,605,594 | 0.5878  | 1,883,832,295 | 0.5960 | 1,909,944,934 | 49.27   |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス マザーファンド | 1,029,981,457 | 0.9539  | 982,544,761   | 0.9715 | 1,000,626,985 | 25.81   |
| 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券インデックス マザーファンド | 515,476,084   | 1.2518  | 645,322,822   | 1.2514 | 645,066,771   | 16.64   |
| 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 | 104,589,238   | 1.7899  | 187,210,278   | 1.8369 | 192,119,971   | 4.96    |

(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 | 96.69   |
| 合計        | 96.69   |

(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期計算期間末<br>(平成19年10月 1日) | 122,675,926 | 122,675,926 | 10,512         | 10,512 |
| 第2期計算期間末<br>(平成20年 9月30日) | 450,728,488 | 450,728,488 | 7,918          | 7,918  |
| 第3期計算期間末<br>(平成21年 9月30日) | 909,333,431 | 909,333,431 | 7,212          | 7,212  |

|                           |               |               |       |       |
|---------------------------|---------------|---------------|-------|-------|
| 第4期計算期間末<br>(平成22年 9月30日) | 1,497,358,132 | 1,497,358,132 | 7,009 | 7,009 |
| 第5期計算期間末<br>(平成23年 9月30日) | 2,768,901,066 | 2,768,901,066 | 6,610 | 6,610 |
| 第6期計算期間末<br>(平成24年10月 1日) | 3,769,519,802 | 3,769,519,802 | 6,966 | 6,966 |
| 平成23年10月末日                | 2,885,445,898 | —             | 6,848 | —     |
| 11月末日                     | 2,774,408,665 | —             | 6,530 | —     |
| 12月末日                     | 2,914,578,085 | —             | 6,599 | —     |
| 平成24年 1月末日                | 3,005,663,073 | —             | 6,774 | —     |
| 2月末日                      | 3,307,189,543 | —             | 7,355 | —     |
| 3月末日                      | 3,560,893,819 | —             | 7,525 | —     |
| 4月末日                      | 3,437,670,085 | —             | 7,267 | —     |
| 5月末日                      | 3,364,133,045 | —             | 6,672 | —     |
| 6月末日                      | 3,561,406,131 | —             | 6,941 | —     |
| 7月末日                      | 3,580,830,003 | —             | 6,856 | —     |
| 8月末日                      | 3,655,094,252 | —             | 6,877 | —     |
| 9月末日                      | 3,747,745,787 | —             | 6,998 | —     |
| 10月末日                     | 3,876,234,548 | —             | 7,054 | —     |

## ②【分配の推移】

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

## ③【収益率の推移】

| 期 間                              | 収益率(%) |
|----------------------------------|--------|
| 第1期計算期間(平成18年10月30日～平成19年10月 1日) | 5.1    |
| 第2期計算期間(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日) | △24.7  |
| 第3期計算期間(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日) | △8.9   |
| 第4期計算期間(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日) | △2.8   |
| 第5期計算期間(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日) | △5.7   |
| 第6期計算期間(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日) | 5.4    |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4)【設定及び解約の実績】

| 期 間                                  | 設定口数（口）       | 解約口数（口）     | 発行済み口数（口）     |
|--------------------------------------|---------------|-------------|---------------|
| 第1期計算期間<br>(平成18年10月30日～平成19年10月 1日) | 116,879,519   | 175,216     | 116,704,303   |
| 第2期計算期間<br>(平成19年10月 2日～平成20年 9月30日) | 459,502,929   | 6,991,384   | 569,215,848   |
| 第3期計算期間<br>(平成20年10月 1日～平成21年 9月30日) | 714,353,337   | 22,778,730  | 1,260,790,455 |
| 第4期計算期間<br>(平成21年10月 1日～平成22年 9月30日) | 904,445,273   | 28,986,725  | 2,136,249,003 |
| 第5期計算期間<br>(平成22年10月 1日～平成23年 9月30日) | 2,137,703,455 | 84,707,249  | 4,189,245,209 |
| 第6期計算期間<br>(平成23年10月 1日～平成24年10月 1日) | 1,385,607,444 | 163,894,992 | 5,410,957,661 |

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

(参考情報)

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年10月31日現在)

| 資産の種類               | 国／地域 | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                  | 日本   | 113,748,861,795 | 97.29   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 3,166,886,329   | 2.71    |
| 合計(純資産総額)           |      | 116,915,748,124 | 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

(平成24年10月31日現在)

| 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  | 1,429,500  | 3,078.56   | 4,400,801,520 | 3,065.00   | 4,381,417,500 | 3.75    |
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 8,315,700  | 349.12     | 2,903,177,184 | 361.00     | 3,001,967,700 | 2.57    |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 938,700    | 2,554.19   | 2,397,618,153 | 2,390.00   | 2,243,493,000 | 1.92    |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 830,500    | 2,332.67   | 1,937,282,435 | 2,444.00   | 2,029,742,000 | 1.74    |
| 日本   | 株式 | キヤノン              | 電気機器   | 691,200    | 3,271.16   | 2,261,025,792 | 2,578.00   | 1,781,913,600 | 1.52    |
| 日本   | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 14,128,900 | 118.08     | 1,668,340,512 | 125.00     | 1,766,112,500 | 1.51    |
| 日本   | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 462,300    | 3,421.20   | 1,581,620,760 | 3,635.00   | 1,680,460,500 | 1.44    |
| 日本   | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 436,500    | 3,269.84   | 1,427,285,160 | 3,710.00   | 1,619,415,000 | 1.39    |
| 日本   | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 115,800    | 13,851.15  | 1,603,963,170 | 12,710.00  | 1,471,818,000 | 1.26    |
| 日本   | 株式 | ソフトバンク            | 情報・通信業 | 500,500    | 2,350.60   | 1,176,475,300 | 2,527.00   | 1,264,763,500 | 1.08    |
| 日本   | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 856,900    | 1,557.68   | 1,334,780,386 | 1,425.00   | 1,221,082,500 | 1.04    |
| 日本   | 株式 | 日本たばこ産業           | 食料品    | 552,800    | 2,237.78   | 1,237,044,784 | 2,206.00   | 1,219,476,800 | 1.04    |
| 日本   | 株式 | 三菱地所              | 不動産業   | 769,000    | 1,253.47   | 963,918,430   | 1,579.00   | 1,214,251,000 | 1.04    |
| 日本   | 株式 | 東日本旅客鉄道           | 陸運業    | 207,300    | 4,648.67   | 963,670,744   | 5,480.00   | 1,136,004,000 | 0.97    |
| 日本   | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 459,400    | 2,373.03   | 1,090,169,982 | 2,462.00   | 1,131,042,800 | 0.97    |
| 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 2,604,000  | 458.44     | 1,193,796,520 | 423.00     | 1,101,492,000 | 0.94    |
| 日本   | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 947,900    | 1,125.81   | 1,067,155,299 | 1,125.00   | 1,066,387,500 | 0.91    |
| 日本   | 株式 | エス・ティ・ティ・ドコモ      | 情報・通信業 | 9,049      | 125,192.97 | 1,132,871,185 | 117,300.00 | 1,061,447,700 | 0.91    |
| 日本   | 株式 | アステラス製薬           | 医薬品    | 258,700    | 3,086.02   | 798,353,374   | 3,965.00   | 1,025,745,500 | 0.88    |
| 日本   | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 155,000    | 4,937.40   | 765,297,000   | 6,200.00   | 961,000,000   | 0.82    |
| 日本   | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 209,000    | 4,074.86   | 851,645,740   | 4,500.00   | 940,500,000   | 0.80    |
| 日本   | 株式 | 日産自動車             | 輸送用機器  | 1,405,700  | 756.78     | 1,063,805,646 | 668.00     | 939,007,600   | 0.80    |
| 日本   | 株式 | 小松製作所             | 機械     | 543,500    | 1,947.85   | 1,058,656,475 | 1,672.00   | 908,732,000   | 0.78    |
| 日本   | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 425,400    | 1,786.04   | 759,783,708   | 2,113.00   | 898,870,200   | 0.77    |
| 日本   | 株式 | 新日鐵住金             | 鉄鋼     | 4,925,000  | 174.83     | 861,070,100   | 176.00     | 866,800,000   | 0.74    |
| 日本   | 株式 | 三井不動産             | 不動産業   | 518,000    | 1,354.71   | 701,743,000   | 1,613.00   | 835,534,000   | 0.71    |
| 日本   | 株式 | 住友商事              | 卸売業    | 648,100    | 1,074.74   | 696,538,994   | 1,088.00   | 705,132,800   | 0.60    |
| 日本   | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 876,100    | 880.26     | 771,195,786   | 799.00     | 700,003,900   | 0.60    |
| 日本   | 株式 | 花王                | 化学     | 309,100    | 2,039.98   | 630,557,818   | 2,242.00   | 693,002,200   | 0.59    |
| 日本   | 株式 | 国際石油開発帝石          | 鉱業     | 1,516      | 463,263.60 | 702,307,617   | 455,000.00 | 689,780,000   | 0.59    |

(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、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 | 97.29   |
| 合計 | 97.29   |

(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     | 0.09    |
|    |       | 鉱業         | 0.67    |
|    |       | 建設業        | 2.62    |
|    |       | 食料品        | 4.09    |
|    |       | 繊維製品       | 0.84    |
|    |       | パルプ・紙      | 0.26    |
|    |       | 化学         | 5.62    |
|    |       | 医薬品        | 5.35    |
|    |       | 石油・石炭製品    | 0.76    |
|    |       | ゴム製品       | 0.79    |
|    |       | ガラス・土石製品   | 0.94    |
|    |       | 鉄鋼         | 1.52    |
|    |       | 非鉄金属       | 1.05    |
|    |       | 金属製品       | 0.69    |
|    |       | 機械         | 4.74    |
|    |       | 電気機器       | 11.60   |
|    |       | 輸送用機器      | 9.87    |
|    |       | 精密機器       | 1.42    |
|    |       | その他製品      | 1.50    |
|    |       | 電気・ガス業     | 2.25    |
|    |       | 陸運業        | 4.34    |
|    |       | 海運業        | 0.27    |
|    |       | 空運業        | 0.62    |
|    |       | 倉庫・運輸関連業   | 0.23    |
|    |       | 情報・通信業     | 6.32    |
|    |       | 卸売業        | 5.28    |
|    |       | 小売業        | 4.43    |
|    |       | 銀行業        | 9.65    |
|    |       | 証券、商品先物取引業 | 1.09    |
|    |       | 保険業        | 2.32    |
|    |       | その他金融業     | 0.94    |
|    |       | 不動産業       | 2.98    |
|    |       | サービス業      | 2.13    |
| 合計 |       |            | 97.29   |

(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<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|---------|---------|-------|----|-----|----------------|----------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | TOPIX先物 | 東京証券取引所 | 買建    | 円  | 423 | 3,108,306,775  | 3,134,430,000  | 3,134,430,000 | 2.68            |

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### (1)投資状況

（平成24年10月31日現在）

| 資産の種類               | 国／地域    | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|---------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券                | 日本      | 164,204,828,400 | 76.95   |
|                     | ポーランド   | 103,080,000     | 0.05    |
|                     | 小計      | 164,307,908,400 | 76.99   |
| 地方債証券               | 日本      | 13,943,535,746  | 6.53    |
| 特殊債券                | 日本      | 19,826,971,260  | 9.29    |
|                     | アメリカ    | 207,368,000     | 0.10    |
|                     | 韓国      | 100,853,000     | 0.05    |
|                     | スウェーデン  | 99,317,000      | 0.05    |
|                     | 小計      | 20,234,509,260  | 9.48    |
| 社債券                 | 日本      | 12,957,112,840  | 6.07    |
|                     | オランダ    | 403,512,000     | 0.19    |
|                     | オーストラリア | 304,962,000     | 0.14    |
|                     | アメリカ    | 205,582,000     | 0.10    |
|                     | スウェーデン  | 100,534,000     | 0.05    |
|                     | イギリス    | 99,940,000      | 0.05    |
|                     | 小計      | 14,071,642,840  | 6.59    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 846,587,510     | 0.40    |
| 合計(純資産総額)           |         | 213,404,183,756 | 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

（平成24年10月31日現在）

| 国／地域 | 種類   | 銘柄名            | 数量            | 帳簿価額(円) |               | 評価額(円) |               | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|----------------|---------------|---------|---------------|--------|---------------|-----------|------------|-----------------|
|      |      |                |               | 単価      | 金額            | 単価     | 金額            |           |            |                 |
| 日本   | 国債証券 | 第285回利付国債（10年） | 2,490,000,000 | 107.05  | 2,665,630,500 | 106.69 | 2,656,705,500 | 1.7       | 2017/03/20 | 1.24            |
| 日本   | 国債証券 | 第288回利付国債（10年） | 2,290,000,000 | 107.46  | 2,460,921,100 | 107.33 | 2,457,857,000 | 1.7       | 2017/09/20 | 1.15            |
| 日本   | 国債証券 | 第296回利付国債（10年） | 2,130,000,000 | 106.94  | 2,277,999,300 | 107.12 | 2,281,677,300 | 1.5       | 2018/09/20 | 1.07            |
| 日本   | 国債証券 | 第105回利付国債（5年）  | 2,210,000,000 | 99.98   | 2,209,626,600 | 100.09 | 2,212,011,100 | 0.2       | 2017/06/20 | 1.04            |
| 日本   | 国債証券 | 第87回利付国債（5年）   | 2,140,000,000 | 101.00  | 2,161,568,000 | 100.86 | 2,158,425,400 | 0.5       | 2014/12/20 | 1.01            |
| 日本   | 国債証券 | 第99回利付国債（5年）   | 2,020,000,000 | 100.94  | 2,038,988,000 | 101.00 | 2,040,260,600 | 0.4       | 2016/09/20 | 0.96            |
| 日本   | 国債証券 | 第320回利付国債（10年） | 1,980,000,000 | 101.64  | 2,012,472,000 | 102.79 | 2,035,341,000 | 1.0       | 2021/12/20 | 0.95            |
| 日本   | 国債証券 | 第256回利付国債（10年） | 1,930,000,000 | 101.95  | 1,967,741,300 | 101.47 | 1,958,467,500 | 1.4       | 2013/12/20 | 0.92            |
| 日本   | 国債証券 | 第88回利付国債（5年）   | 1,840,000,000 | 101.09  | 1,860,232,300 | 100.96 | 1,857,664,000 | 0.5       | 2015/03/20 | 0.87            |
| 日本   | 国債証券 | 第101回利付国債（5年）  | 1,820,000,000 | 100.90  | 1,836,434,600 | 101.02 | 1,838,673,200 | 0.4       | 2016/12/20 | 0.86            |
| 日本   | 国債証券 | 第289回利付国債（10年） | 1,710,000,000 | 106.61  | 1,823,133,600 | 106.57 | 1,822,449,600 | 1.5       | 2017/12/20 | 0.85            |
| 日本   | 国債証券 | 第264回利付国債（10年） | 1,750,000,000 | 103.22  | 1,806,350,000 | 102.63 | 1,796,182,500 | 1.5       | 2014/09/20 | 0.84            |
| 日本   | 国債証券 | 第280回利付国債（10年） | 1,680,000,000 | 106.81  | 1,794,522,000 | 106.41 | 1,787,755,200 | 1.9       | 2016/06/20 | 0.84            |
| 日本   | 国債証券 | 第305回利付国債（10年） | 1,660,000,000 | 105.59  | 1,752,860,400 | 106.09 | 1,761,143,800 | 1.3       | 2019/12/20 | 0.83            |
| 日本   | 国債証券 | 第325回利付国債（10年） | 1,740,000,000 | 100.25  | 1,744,368,400 | 100.27 | 1,744,785,000 | 0.8       | 2022/09/20 | 0.82            |
| 日本   | 国債証券 | 第318回利付国債（10年） | 1,650,000,000 | 101.86  | 1,680,756,000 | 102.98 | 1,699,203,000 | 1.0       | 2021/09/20 | 0.80            |
| 日本   | 国債証券 | 第84回利付国債（5年）   | 1,650,000,000 | 101.23  | 1,670,295,000 | 100.98 | 1,666,236,000 | 0.7       | 2014/06/20 | 0.78            |
| 日本   | 国債証券 | 第324回利付国債（10年） | 1,650,000,000 | 100.05  | 1,650,914,800 | 100.53 | 1,658,893,500 | 0.8       | 2022/06/20 | 0.78            |
| 日本   | 国債証券 | 第273回利付国債（10年） | 1,590,000,000 | 104.44  | 1,660,717,300 | 104.02 | 1,653,965,700 | 1.5       | 2015/09/20 | 0.78            |
| 日本   | 国債証券 | 第89回利付国債（5年）   | 1,610,000,000 | 100.89  | 1,624,388,300 | 100.80 | 1,622,880,000 | 0.4       | 2015/06/20 | 0.76            |
| 日本   | 国債証券 | 第103回利付国債（5年）  | 1,600,000,000 | 100.39  | 1,606,356,000 | 100.58 | 1,609,376,000 | 0.3       | 2017/03/20 | 0.75            |
| 日本   | 国債証券 | 第82回利付国債（5年）   | 1,590,000,000 | 101.43  | 1,612,872,100 | 101.10 | 1,607,601,300 | 0.9       | 2014/03/20 | 0.75            |
| 日本   | 国債証券 | 第306回利付国債（10年） | 1,480,000,000 | 106.27  | 1,572,929,200 | 106.78 | 1,580,388,400 | 1.4       | 2020/03/20 | 0.74            |
| 日本   | 国債証券 | 第321回利付国債（10年） | 1,500,000,000 | 101.40  | 1,521,045,000 | 102.59 | 1,538,910,000 | 1.0       | 2022/03/20 | 0.72            |
| 日本   | 国債証券 | 第312回利付国債（10年） | 1,410,000,000 | 104.24  | 1,469,784,000 | 105.05 | 1,481,331,900 | 1.2       | 2020/12/20 | 0.69            |

|    |      |                |               |        |               |        |               |     |            |      |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-----|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第93回利付国債（5年）   | 1,440,000,000 | 101.31 | 1,458,999,400 | 101.24 | 1,457,971,200 | 0.5 | 2015/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第284回利付国債（10年） | 1,360,000,000 | 106.79 | 1,452,425,600 | 106.38 | 1,446,849,600 | 1.7 | 2016/12/20 | 0.68 |
| 日本 | 国債証券 | 第309回利付国債（10年） | 1,350,000,000 | 103.93 | 1,403,116,500 | 104.52 | 1,411,087,500 | 1.1 | 2020/06/20 | 0.66 |
| 日本 | 国債証券 | 第85回利付国債（5年）   | 1,380,000,000 | 101.38 | 1,399,044,000 | 101.13 | 1,395,676,800 | 0.7 | 2014/09/20 | 0.65 |
| 日本 | 国債証券 | 第269回利付国債（10年） | 1,350,000,000 | 103.35 | 1,395,265,500 | 102.85 | 1,388,596,500 | 1.3 | 2015/03/20 | 0.65 |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 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  | 76.99   |
| 地方債証券 | 6.53    |
| 特殊債券  | 9.48    |
| 社債券   | 6.59    |
| 合計    | 99.60   |

(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<br>／<br>売建 | 通貨 | 数量 | 簿価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|--------|---------|---------------|----|----|----------------|----------------|-------------|-----------------|
| 債券先物取引 | 長期国債先物 | 東京証券取引所 | 買建            | 円  | 1  | 144,260,315    | 144,250,000    | 144,250,000 | 0.07            |

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

### 外国株式インデックス マザーファンド

#### (1)投資状況

(平成24年10月31日現在)

| 資産の種類 | 国／地域    | 時価合計(円)        | 投資比率(%) |
|-------|---------|----------------|---------|
| 株式    | アメリカ    | 71,519,685,323 | 53.16   |
|       | イギリス    | 13,408,734,167 | 9.97    |
|       | カナダ     | 7,149,117,620  | 5.31    |
|       | スイス     | 5,717,171,492  | 4.25    |
|       | フランス    | 5,152,298,356  | 3.83    |
|       | ドイツ     | 5,137,059,871  | 3.82    |
|       | オーストラリア | 4,880,680,514  | 3.63    |
|       | スウェーデン  | 1,848,888,722  | 1.37    |
|       | オランダ    | 1,828,132,551  | 1.36    |
|       | スペイン    | 1,707,150,059  | 1.27    |
|       | 香港      | 1,534,180,879  | 1.14    |
|       | イタリア    | 1,270,213,379  | 0.94    |
|       | シンガポール  | 1,032,451,753  | 0.77    |
|       | アイルランド  | 874,759,871    | 0.65    |
|       | デンマーク   | 702,000,153    | 0.52    |
|       | ベルギー    | 681,530,390    | 0.51    |
|       | バミューダ   | 574,035,846    | 0.43    |
|       | アンティル   | 535,711,381    | 0.40    |
|       | ジャージー   | 528,081,253    | 0.39    |

|                     |          |                 |        |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
|                     | ノルウェー    | 456,033,241     | 0.34   |
|                     | フィンランド   | 451,323,827     | 0.34   |
|                     | イスラエル    | 354,859,169     | 0.26   |
|                     | ルクセンブルク  | 252,280,184     | 0.19   |
|                     | オーストリア   | 163,511,406     | 0.12   |
|                     | ケイマン     | 143,220,528     | 0.11   |
|                     | パナマ      | 98,145,529      | 0.07   |
|                     | ポルトガル    | 88,469,985      | 0.07   |
|                     | ニュージーランド | 74,170,024      | 0.06   |
|                     | マン島      | 38,208,218      | 0.03   |
|                     | ギリシャ     | 28,597,323      | 0.02   |
|                     | リベリア     | 27,485,605      | 0.02   |
|                     | ガーンジー    | 27,448,019      | 0.02   |
|                     | モーリシャス   | 20,123,086      | 0.01   |
|                     | 小計       | 128,305,759,724 | 95.36  |
| 投資信託受益証券            | オーストラリア  | 54,458,690      | 0.04   |
|                     | シンガポール   | 23,398,133      | 0.02   |
|                     | 小計       | 77,856,823      | 0.06   |
| 投資証券                | アメリカ     | 1,963,359,487   | 1.46   |
|                     | オーストラリア  | 405,911,071     | 0.30   |
|                     | フランス     | 177,809,997     | 0.13   |
|                     | イギリス     | 165,956,425     | 0.12   |
|                     | 香港       | 65,274,916      | 0.05   |
|                     | シンガポール   | 43,478,542      | 0.03   |
|                     | カナダ      | 32,017,630      | 0.02   |
|                     | オランダ     | 16,274,652      | 0.01   |
|                     | 小計       | 2,870,082,720   | 2.13   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |          | 3,293,405,027   | 2.45   |
| 合計(純資産総額)           |          | 134,547,104,294 | 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

(平成24年10月31日現在)

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                     | 数量        | 帳簿価額(円)   |               | 評価額(円)    |               | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|----|-----------------------------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------------|
|      |    |                             |                        |           | 単価        | 金額            | 単価        | 金額            |                 |
| アメリカ | 株式 | APPLE INC                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 67,300    | 44,950.54 | 3,025,171,665 | 48,114.64 | 3,238,115,272 | 2.41            |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL                 | エネルギー                  | 336,371   | 6,536.89  | 2,198,823,455 | 7,218.78  | 2,428,191,341 | 1.80            |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO         | 資本財                    | 762,159   | 1,530.26  | 1,166,307,985 | 1,681.62  | 1,281,663,799 | 0.95            |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP                | エネルギー                  | 141,850   | 7,887.13  | 1,118,790,326 | 8,856.59  | 1,256,308,539 | 0.93            |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア・サービス            | 543,891   | 2,315.71  | 1,259,497,199 | 2,247.20  | 1,222,236,532 | 0.91            |
| アメリカ | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | ソフトウェア・サービス            | 78,802    | 15,469.17 | 1,219,001,959 | 15,395.88 | 1,213,226,781 | 0.90            |
| スイス  | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED      | 食品・飲料・タバコ              | 237,375   | 4,694.01  | 1,114,241,193 | 5,098.28  | 1,210,205,520 | 0.90            |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC                    | 電気通信サービス               | 424,819   | 2,686.13  | 1,141,121,269 | 2,758.62  | 1,171,916,653 | 0.87            |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 197,498   | 4,990.69  | 985,653,071   | 5,647.89  | 1,115,447,769 | 0.83            |
| アメリカ | 株式 | PFIZER                      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 538,647   | 1,765.26  | 950,855,019   | 2,025.75  | 1,091,166,207 | 0.81            |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO         | 家庭用品・パーソナル用品           | 197,052   | 4,980.34  | 981,386,588   | 5,531.59  | 1,090,010,951 | 0.81            |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC (GB)      | 銀行                     | 1,315,273 | 653.46    | 859,485,009   | 783.15    | 1,030,061,046 | 0.77            |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A             | ソフトウェア・サービス            | 18,716    | 47,140.42 | 882,280,232   | 53,782.44 | 1,006,592,315 | 0.75            |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO            | 銀行                     | 363,156   | 2,540.35  | 922,546,031   | 2,706.05  | 982,718,366   | 0.73            |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 各種金融                   | 273,850   | 2,668.60  | 730,798,848   | 3,278.80  | 897,900,913   | 0.67            |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 食品・飲料・タバコ              | 122,734   | 6,804.55  | 835,150,523   | 7,032.38  | 863,112,716   | 0.64            |

|         |    |                             |                        |           |           |             |           |             |      |
|---------|----|-----------------------------|------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| アメリカ    | 株式 | COCA-COLA CO                | 食品・飲料・タバコ              | 292,136   | 2,997.60  | 875,708,567 | 2,950.60  | 861,978,351 | 0.64 |
| アメリカ    | 株式 | MERCK & CO                  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 218,783   | 3,001.58  | 656,696,602 | 3,676.30  | 804,313,911 | 0.60 |
| アメリカ    | 株式 | WAL-MART STORES             | 食品・生活必需品小売り            | 133,842   | 5,217.72  | 698,351,418 | 5,983.26  | 800,811,832 | 0.60 |
| スイス     | 株式 | NOVARTIS                    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 165,462   | 4,282.90  | 708,657,481 | 4,824.78  | 798,317,996 | 0.59 |
| スイス     | 株式 | ROCHE HOLDING GENUSS        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 50,537    | 13,058.96 | 659,960,727 | 15,410.24 | 778,787,349 | 0.58 |
| イギリス    | 株式 | VODAFONE GROUP PLC          | 電気通信サービス               | 3,549,749 | 220.24    | 781,818,018 | 219.02    | 777,499,836 | 0.58 |
| イギリス    | 株式 | BP PLC                      | エネルギー                  | 1,368,628 | 512.19    | 701,011,261 | 567.06    | 776,107,091 | 0.58 |
| アメリカ    | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS      | 電気通信サービス               | 205,901   | 3,306.68  | 680,850,077 | 3,563.19  | 733,664,754 | 0.55 |
| イギリス    | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | エネルギー                  | 265,864   | 2,578.92  | 685,643,847 | 2,740.91  | 728,709,362 | 0.54 |
| アメリカ    | 株式 | ORACLE CORP                 | ソフトウェア・サービス            | 286,324   | 2,089.48  | 598,268,786 | 2,468.66  | 706,837,579 | 0.53 |
| イギリス    | 株式 | GLAXOSMITHKLINE             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 360,823   | 1,832.39  | 661,170,441 | 1,818.30  | 656,088,069 | 0.49 |
| オーストラリア | 株式 | BHP BILLITON LTD            | 素材                     | 231,943   | 2,650.29  | 614,717,465 | 2,811.69  | 652,153,414 | 0.48 |
| アメリカ    | 株式 | INTEL CORP                  | 半導体・半導体製造装置            | 361,849   | 2,049.65  | 741,664,454 | 1,748.53  | 632,706,364 | 0.47 |
| アメリカ    | 株式 | PEPSICO INC                 | 食品・飲料・タバコ              | 112,529   | 5,466.26  | 615,113,806 | 5,494.94  | 618,340,868 | 0.46 |

(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       | 95.36   |
| 投資信託受益証券 | 0.06    |
| 投資証券     | 2.13    |
| 合計       | 97.55   |

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

#### c. 投資株式の業種別投資比率

| 種類 | 国内／外国 | 業種                     | 投資比率(%) |
|----|-------|------------------------|---------|
| 株式 | 外国    | エネルギー                  | 11.30   |
|    |       | 素材                     | 6.76    |
|    |       | 資本財                    | 7.01    |
|    |       | 商業・専門サービス              | 0.91    |
|    |       | 運輸                     | 1.67    |
|    |       | 自動車・自動車部品              | 1.25    |
|    |       | 耐久消費財・アパレル             | 1.25    |
|    |       | 消費者サービス                | 1.59    |
|    |       | メディア                   | 2.73    |
|    |       | 小売                     | 2.91    |
|    |       | 食品・生活必需品小売り            | 2.31    |
|    |       | 食品・飲料・タバコ              | 6.79    |
|    |       | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.84    |
|    |       | ヘルスケア機器・サービス           | 2.62    |
|    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8.21    |
|    |       | 銀行                     | 7.50    |
|    |       | 各種金融                   | 4.62    |
|    |       | 保険                     | 4.17    |
|    |       | 不動産                    | 0.75    |
|    |       | ソフトウェア・サービス            | 5.91    |
|    |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.48    |
|    |       | 電気通信サービス               | 3.82    |
|    |       | 公益事業                   | 3.55    |
|    |       | 半導体・半導体製造装置            | 1.40    |
| 合計 |       |                        | 95.36   |

(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<br>／<br>売建 | 通貨            | 数量  | 簿価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(円)   | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------------|---------------|------------------------|---------------|---------------|-----|----------------|----------------|---------------|-----------------|
| 株価指数<br>先物取引 | S&P 500 FUTU  | シカゴ商業取引所               | 買建            | アメリカドル        | 67  | 24,093,176.50  | 23,577,300     | 1,878,167,718 | 1.40            |
|              | S&P/TSE 60    | モントリオール取引所             | 買建            | カナダドル         | 16  | 2,260,316      | 2,273,280      | 181,157,683   | 0.13            |
|              | SWISS MKT IX  | ユーレックス・ドイツ<br>金融先物取引所  | 買建            | スイスフラン        | 38  | 2,526,226      | 2,525,100      | 215,820,297   | 0.16            |
|              | DJ EURO STOXX | ユーレックス・ドイツ<br>金融先物取引所  | 買建            | ユーロ           | 143 | 3,617,703.50   | 3,587,870      | 370,591,092   | 0.28            |
|              | SPI 200 FUTU  | シドニー先物取引所              | 買建            | オーストラリア<br>ドル | 23  | 2,569,761      | 2,578,300      | 213,405,891   | 0.16            |
|              | FTSE 100      | ロンドン国際金融先物<br>オプション取引所 | 買建            | イギリスポンド       | 58  | 3,390,287.50   | 3,374,440      | 432,097,042   | 0.32            |

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年10月31日現在)

| 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    | 84,958,968,332  | 40.89   |
|                     | フランス    | 20,071,223,300  | 9.66    |
|                     | イタリア    | 18,482,700,831  | 8.89    |
|                     | ドイツ     | 18,343,582,902  | 8.83    |
|                     | イギリス    | 16,524,995,216  | 7.95    |
|                     | スペイン    | 8,521,337,966   | 4.10    |
|                     | カナダ     | 5,743,024,718   | 2.76    |
|                     | オランダ    | 5,438,224,432   | 2.62    |
|                     | ベルギー    | 5,272,092,122   | 2.54    |
|                     | オーストリア  | 3,649,160,601   | 1.76    |
|                     | オーストラリア | 3,225,459,983   | 1.55    |
|                     | メキシコ    | 1,982,456,114   | 0.95    |
|                     | デンマーク   | 1,785,316,788   | 0.86    |
|                     | アイルランド  | 1,592,687,950   | 0.77    |
|                     | ポーランド   | 1,575,688,829   | 0.76    |
|                     | 南アフリカ   | 1,264,110,575   | 0.61    |
|                     | スウェーデン  | 1,257,087,230   | 0.60    |
|                     | フィンランド  | 1,247,250,348   | 0.60    |
|                     | マレーシア   | 1,098,070,953   | 0.53    |
|                     | シンガポール  | 824,495,564     | 0.40    |
|                     | スイス     | 813,146,151     | 0.39    |
|                     | ノルウェー   | 508,436,113     | 0.24    |
|                     | 小計      | 204,179,517,018 | 98.26   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 3,615,782,996   | 1.74    |
| 合計(純資産総額)           |         | 207,795,300,014 | 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

（平成24年10月31日現在）

| 国／地域 | 種類   | 銘柄名                 | 数量         | 帳簿価額(円)   |               | 評価額(円)    |               | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|---------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-----------|------------|-----------------|
|      |      |                     |            | 単価        | 金額            | 単価        | 金額            |           |            |                 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 07/31/14   | 37,400,000 | 8,362.74  | 3,127,667,239 | 8,290.86  | 3,100,782,180 | 2.625     | 2014/07/31 | 1.49            |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 02/28/17   | 22,900,000 | 8,023.88  | 1,837,468,738 | 8,050.94  | 1,843,667,418 | 0.875     | 2017/02/28 | 0.89            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 01/31/14    | 22,600,000 | 8,159.86  | 1,844,128,490 | 8,117.53  | 1,834,563,411 | 1.750     | 2014/01/31 | 0.88            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.5% 03/31/15     | 21,700,000 | 8,413.71  | 1,825,775,176 | 8,376.75  | 1,817,754,936 | 2.500     | 2015/03/31 | 0.87            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 03/31/14    | 22,000,000 | 8,179.46  | 1,799,482,278 | 8,135.27  | 1,789,761,050 | 1.750     | 2014/03/31 | 0.86            |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.625% 02/15/21   | 18,000,000 | 9,345.73  | 1,682,232,317 | 9,349.47  | 1,682,904,807 | 3.625     | 2021/02/15 | 0.81            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.5% 07/31/16     | 20,000,000 | 8,298.10  | 1,659,620,508 | 8,255.69  | 1,651,139,904 | 1.500     | 2016/07/31 | 0.79            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 02/28/15   | 19,200,000 | 8,393.24  | 1,611,502,171 | 8,340.95  | 1,601,464,247 | 2.375     | 2015/02/28 | 0.77            |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 06/30/17    | 19,400,000 | 8,027.89  | 1,557,411,789 | 7,987.15  | 1,549,508,593 | 0.750     | 2017/06/30 | 0.75            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 06/30/14   | 16,000,000 | 8,346.54  | 1,335,447,426 | 8,276.85  | 1,324,297,154 | 2.625     | 2014/06/30 | 0.64            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 07/31/15    | 15,000,000 | 8,288.62  | 1,243,293,450 | 8,263.79  | 1,239,568,946 | 1.750     | 2015/07/31 | 0.60            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 04/30/14   | 15,100,000 | 8,204.98  | 1,238,951,980 | 8,158.92  | 1,231,998,211 | 1.875     | 2014/04/30 | 0.59            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 11/30/13       | 15,000,000 | 8,171.37  | 1,225,705,716 | 8,120.65  | 1,218,097,788 | 2.000     | 2013/11/30 | 0.59            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 11/30/16    | 14,000,000 | 8,690.41  | 1,216,657,695 | 8,665.82  | 1,213,216,064 | 2.750     | 2016/11/30 | 0.58            |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 12/15/13    | 15,000,000 | 8,023.57  | 1,203,535,542 | 8,014.23  | 1,202,135,119 | 0.750     | 2013/12/15 | 0.58            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 08/15/20   | 13,500,000 | 8,706.03  | 1,175,314,155 | 8,730.86  | 1,178,666,566 | 2.625     | 2020/08/15 | 0.57            |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 05/15/19   | 12,800,000 | 9,060.76  | 1,159,777,826 | 8,995.66  | 1,151,445,661 | 3.125     | 2019/05/15 | 0.55            |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 07/15/15    | 14,000,000 | 7,958.43  | 1,114,180,522 | 7,937.99  | 1,111,319,262 | 0.250     | 2015/07/15 | 0.53            |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.25% 08/15/15    | 12,500,000 | 8,925.96  | 1,115,745,841 | 8,820.17  | 1,102,521,285 | 4.250     | 2015/08/15 | 0.53            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 06/30/15   | 13,100,000 | 8,314.11  | 1,089,148,960 | 8,282.46  | 1,085,002,951 | 1.875     | 2015/06/30 | 0.52            |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.875% 08/15/40   | 10,900,000 | 9,675.57  | 1,054,637,707 | 9,666.24  | 1,053,620,934 | 3.875     | 2040/08/15 | 0.51            |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 4.25% 08/01/14 | 9,800,000  | 10,336.74 | 1,013,001,181 | 10,663.14 | 1,044,988,028 | 4.250     | 2014/08/01 | 0.50            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.125% 11/30/14   | 12,600,000 | 8,320.24  | 1,048,351,250 | 8,263.17  | 1,041,159,625 | 2.125     | 2014/11/30 | 0.50            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 08/31/14   | 12,500,000 | 8,328.82  | 1,041,103,425 | 8,268.15  | 1,033,518,797 | 2.375     | 2014/08/31 | 0.50            |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.25% 11/15/40    | 10,000,000 | 10,287.29 | 1,028,729,240 | 10,272.40 | 1,027,240,394 | 4.250     | 2040/11/15 | 0.49            |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.25% 08/15/14    | 12,000,000 | 8,652.13  | 1,038,256,257 | 8,528.90  | 1,023,469,130 | 4.250     | 2014/08/15 | 0.49            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 11/15/20   | 11,500,000 | 8,695.68  | 1,000,003,844 | 8,724.94  | 1,003,368,642 | 2.625     | 2020/11/15 | 0.48            |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.75% 05/15/22    | 12,500,000 | 8,065.29  | 1,008,161,458 | 8,007.07  | 1,000,884,087 | 1.750     | 2022/05/15 | 0.48            |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.5% 10/15/13     | 12,200,000 | 7,991.49  | 974,961,926   | 7,989.34  | 974,699,526   | 0.500     | 2013/10/15 | 0.47            |
| アメリカ | 国債証券 | T 2% 01/31/16       | 11,500,000 | 8,411.29  | 967,299,431   | 8,366.16  | 962,108,865   | 2.000     | 2016/01/31 | 0.46            |

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## b. 投資有価証券の種類別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.26   |
| 合計   | 98.26   |

(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<br>種類 | 資産の名称       | 取引所      | 買建<br>／<br>売建 | 通貨     | 数量 | 簿価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(現地通貨) | 評価金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|-----------|-------------|----------|---------------|--------|----|----------------|----------------|-------------|-----------------|
| 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 | 12 | 1,495,048.05   | 1,488,000      | 118,534,080 | 0.06            |

|              |                   |    |        |    |            |            |             |      |
|--------------|-------------------|----|--------|----|------------|------------|-------------|------|
| US 10YR NOTE | シカゴ商品取引所          | 買建 | アメリカドル | 7  | 934,090.53 | 928,703.16 | 73,980,493  | 0.04 |
| US LONG BOND | シカゴ商品取引所          | 買建 | アメリカドル | 5  | 747,332.50 | 743,125    | 59,197,337  | 0.03 |
| EURO-SCHATZ  | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | 買建 | ユーロ    | 7  | 774,963    | 774,900    | 80,039,421  | 0.04 |
| EURO-BOBL FU | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | 買建 | ユーロ    | 7  | 879,488    | 880,530    | 90,949,943  | 0.04 |
| EURO-BUND    | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | 買建 | ユーロ    | 12 | 1,699,298  | 1,698,480  | 175,435,999 | 0.08 |

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

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2006年10月30日

作成基準日：2012年10月31日

### 基準価額・純資産の推移



|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 7.054円 |
| 純資産総額 | 39億円   |

### 〈基準価額の騰落率〉

|     |         |
|-----|---------|
| 1ヶ月 | 0.80%   |
| 3ヶ月 | 2.89%   |
| 6ヶ月 | -2.93%  |
| 1年  | 3.01%   |
| 3年  | -1.93%  |
| 5年  | -33.42% |
| 設定来 | -29.46% |

※上記は作成基準日からの期間です。

### 分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

| 決算期 | 2008年9月 | 2009年9月 | 2010年9月 | 2011年9月 | 2012年10月 |
|-----|---------|---------|---------|---------|----------|
| 分配金 | 0円      | 0円      | 0円      | 0円      | 0円       |

※分配金額は株価、金利、為替などの変動の影響を受けて変動し、分配対象額が少額の場合、分配を行わないことがあります。

### 主要な資産の状況

| マザーファンド                   | 投資比率  | 上位紹介銘柄              | 国/地域 | 種類   | 業種                   | 利率     | 償還期限       | 実質投資比率 |
|---------------------------|-------|---------------------|------|------|----------------------|--------|------------|--------|
| 国内株式<br>インデックス<br>マザーファンド | 49.3% | トヨタ自動車              | 日本   | 株式   | 輸送用機器                | —      | —          | 1.8%   |
|                           |       | 三菱UFJフィナンシャルグループ    | 日本   | 株式   | 銀行業                  | —      | —          | 1.3%   |
|                           |       | 本田技研工業              | 日本   | 株式   | 輸送用機器                | —      | —          | 0.9%   |
| 外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | 25.8% | APPLE INC           | アメリカ | 株式   | テクノロジー/ハードウェア/ソフトウェア | —      | —          | 0.6%   |
|                           |       | EXXON MOBIL         | アメリカ | 株式   | エネルギー                | —      | —          | 0.5%   |
|                           |       | GENERAL ELECTRIC CO | アメリカ | 株式   | 資本財                  | —      | —          | 0.2%   |
| 国内債券<br>インデックス<br>マザーファンド | 16.6% | 第285回利付国債(10年)      | 日本   | 国債証券 | —                    | 1.7%   | 2017/03/20 | 0.2%   |
|                           |       | 第288回利付国債(10年)      | 日本   | 国債証券 | —                    | 1.7%   | 2017/09/20 | 0.2%   |
|                           |       | 第296回利付国債(10年)      | 日本   | 国債証券 | —                    | 1.5%   | 2018/09/20 | 0.2%   |
| 外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド | 5.0%  | T 2.625% 07/31/14   | アメリカ | 国債証券 | —                    | 2.625% | 2014/07/31 | 0.1%   |
|                           |       | T 0.875% 02/28/17   | アメリカ | 国債証券 | —                    | 0.875% | 2017/02/28 | 0.0%   |
|                           |       | T 1.75% 01/31/14    | アメリカ | 国債証券 | —                    | 1.750% | 2014/01/31 | 0.0%   |

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### （イ）申込手続

- 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。
- 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ます。
- ⑥本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」（以下、「分配金再投資コース」と読み替えるものとします。）専用ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金再投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金再投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。
- ⑦取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### （ロ）申込単位

1円以上1円単位

#### （ハ）申込手数料

ありません。

## 2【換金（解約）手続等】

### （イ）受益権の買取請求

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

### （ロ）受益権のご解約の請求

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

- ①受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。
- 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（解約価額）とします。信託財産留保金<sup>※</sup>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確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドは、ご解約による換金時および償還時の差益が非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。
- 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。なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。
- 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解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

＜お問い合わせ先＞

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### （ハ）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（ロ）受益権のご解約の請求⑨」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)株式

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

###### 2)公社債

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

(a)日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

(b)価格情報会社の提供する価額

(c)金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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

##### （ロ）基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

##### （ハ）基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「2 換金（解約）手続等（ロ）受益権のご解約の請求⑨」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18年10月30日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

#### (4)【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるもの

とします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

### (イ) 信託の終了

- 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5億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知られたる受益者に対して交付します。ただし、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、その命令に従い、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委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ) 投資信託約款の変更①(d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託者と受託者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知られたる受益者に対して交付します。ただし、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従います。

(ハ) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続  
指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

## (ニ) 運用報告書

委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

## (ホ) 信託事務処理の再信託

受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。

## (ヘ) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## 4【受益者の権利等】

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

### (イ) 収益分配金請求権

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

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

### (ロ) 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

### (ハ) 換金（解約）請求権

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

す。

(ニ) 反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(平成23年10月1日から平成24年10月1日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1 【財務諸表】  
DCマイセレクションS75  
(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第5期<br>(平成23年 9月30日現在) | 第6期<br>(平成24年10月 1日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部            |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 85,926,980             | 133,018,809            |
| 親投資信託受益証券       | 2,686,287,688          | 3,642,134,360          |
| 未収利息            | 106                    | 241                    |
| 流動資産合計          | 2,772,214,774          | 3,775,153,410          |
| 資産合計            | 2,772,214,774          | 3,775,153,410          |
| 負債の部            |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払解約金           | 521,282                | 1,737,005              |
| 未払受託者報酬         | 402,096                | 558,763                |
| 未払委託者報酬         | 2,278,488              | 3,166,249              |
| その他未払費用         | 111,842                | 171,591                |
| 流動負債合計          | 3,313,708              | 5,633,608              |
| 負債合計            | 3,313,708              | 5,633,608              |
| 純資産の部           |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 4,189,245,209          | 5,410,957,661          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | △1,420,344,143         | △1,641,437,859         |
| （分配準備積立金）       | —                      | 55,190                 |
| 元本等合計           | 2,768,901,066          | 3,769,519,802          |
| 純資産合計           | 2,768,901,066          | 3,769,519,802          |
| 負債純資産合計         | 2,772,214,774          | 3,775,153,410          |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                                           | 第5期<br>(自 平成22年10月1日<br>至 平成23年9月30日) | 第6期<br>(自 平成23年10月1日<br>至 平成24年10月1日) |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | 36,041                                | 58,025                                |
| 有価証券売買等損益                                 | △204,854,570                          | 151,726,672                           |
| 営業収益合計                                    | △204,818,529                          | 151,784,697                           |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 受託者報酬                                     | 671,770                               | 1,030,305                             |
| 委託者報酬                                     | 3,806,631                             | 5,838,258                             |
| その他費用                                     | 111,842                               | 171,591                               |
| 営業費用合計                                    | 4,590,243                             | 7,040,154                             |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △209,408,772                          | 144,744,543                           |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △209,408,772                          | 144,744,543                           |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △209,408,772                          | 144,744,543                           |
| 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（△） | 799,386                               | 3,729,372                             |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | △638,890,871                          | △1,420,344,143                        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 24,591,712                            | 54,963,507                            |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 24,591,712                            | 54,963,507                            |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 595,836,826                           | 417,072,394                           |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 595,836,826                           | 417,072,394                           |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | △1,420,344,143                        | △1,641,437,859                        |

## (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<br>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<br>第6期（自 平成23年 10月1日 至 平成24年 10月1日）<br>当ファンドの計算期間は、原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は平成23年 10月1日から平成24年 10月1日までとなっております。 |

## (追加情報)

|                                                                                                                                                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 当該計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)」を適用しております。 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## (貸借対照表に関する注記)

|                                                      | 第5期<br>(平成23年 9月30日現在)  | 第6期<br>(平成24年10月 1日現在)  |
|------------------------------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1. 期首元本額                                             | 2,136,249,003円          | 4,189,245,209円          |
| 期中追加設定元本額                                            | 2,137,703,455円          | 1,385,607,444円          |
| 期中一部解約元本額                                            | 84,707,249円             | 163,894,992円            |
| 2. 当該計算期間の末日における受益権総数                                | 4,189,245,209口          | 5,410,957,661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<br>1,420,344,143円 | 元本の欠損<br>1,641,437,859円 |
| 4. 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額)                         | 0.6610円<br>(6,610円)     | 0.6966円<br>(6,966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5期<br>自 平成22年10月 1日<br>至 平成23年 9月30日 | 第6期<br>自 平成23年10月 1日<br>至 平成24年10月 1日 |
|---------------------------|-----------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              | A         | －円<br>(48,803,686円)                   | 55,190円<br>(77,666,279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         | 49,742円                               | 64,612円                               |
| 分配準備積立金額                  | D         | －円                                    | －円                                    |
| 当ファンドの分配対象収益額             | E=A+B+C+D | 49,742円                               | 119,802円                              |
| 当ファンドの期末残存口数              | F         | 4,189,245,209口                        | 5,410,957,661口                        |

|                   |                |       |       |
|-------------------|----------------|-------|-------|
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F*10,000$ | 0.11円 | 0.22円 |
| 10,000口当たり分配金額    | H              | －円    | －円    |
| 収益分配金金額           | $I=F*H/10,000$ | －円    | －円    |

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

## (金融商品に関する注記)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

|                        |                                                                                                                                                                                               |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針        | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                         |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>これらは、市場リスク（株価変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。                                                                              |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制      | 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。<br>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<br>「（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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。            |
| 4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額  | 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。                                                                                                           |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第5期<br>(平成23年 9月30日現在)                          | 第6期<br>(平成24年10月 1日現在)                           |
|-----------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
|           | 計算期間(自 平成22年10月1日 至 平成23年 9月30日)の損益に含まれた評価差額(円) | 計算期間(自 平成23年10月 1日 至 平成24年10月 1日)の損益に含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | △206,271,138                                    | 145,077,361                                      |
| 合計        | △206,271,138                                    | 145,077,361                                      |

## (デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4)【附属明細表】

## ① 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

| 種類           | 銘柄                 | 券面総額(口)       | 評価額(円)        | 備考 |
|--------------|--------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 国内株式インデックス マザーファンド | 3,150,618,530 | 1,852,248,633 |    |
|              | 国内債券インデックス マザーファンド | 507,207,229   | 635,023,450   |    |
|              | 外国株式インデックス マザーファンド | 1,017,828,467 | 970,703,008   |    |
|              | 外国債券インデックス マザーファンド | 102,928,275   | 184,159,269   |    |
| 親投資信託受益証券 小計 |                    | 4,778,582,501 | 3,642,134,360 |    |
| 合計           |                    | 4,778,582,501 | 3,642,134,360 |    |

## ② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## ③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

## ⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

## ⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## ⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## ＜参考＞

「DCマイセレーションS75」は、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成24年10月1日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

| 項目          | 平成24年10月 1日現在<br>金額(円) |
|-------------|------------------------|
| 資産の部        |                        |
| 流動資産        |                        |
| コール・ローン     | 2,076,314,531          |
| 株式          | 115,700,829,489        |
| 派生商品評価勘定    | 21,393,275             |
| 未収入金        | 4,670,000              |
| 未収配当金       | 1,230,293,832          |
| 未収利息        | 3,761                  |
| 差入委託証拠金     | 90,720,000             |
| 流動資産合計      | 119,124,224,888        |
| 資産合計        | 119,124,224,888        |
| 負債の部        |                        |
| 流動負債        |                        |
| 派生商品評価勘定    | 34,451,750             |
| 前受金         | 4,202,000              |
| 未払金         | 14,911,400             |
| 未払解約金       | 147,233,560            |
| 流動負債合計      | 200,798,710            |
| 負債合計        | 200,798,710            |
| 純資産の部       |                        |
| 元本等         |                        |
| 元本          | 202,283,825,678        |
| 剰余金         |                        |
| 剰余金又は欠損金（△） | △83,360,399,500        |
| 元本等合計       | 118,923,426,178        |
| 純資産合計       | 118,923,426,178        |
| 負債純資産合計     | 119,124,224,888        |

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|  |               |
|--|---------------|
|  | 平成24年10月 1日現在 |
|--|---------------|

|                      |                                                                                                                              |
|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法   | 株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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の清算値段によっております。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益の計上基準<br>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24年10月 1日現在    |
|-----------------------|------------------|
| 1. 計算期間の期首元本額         | 200,026,741,191円 |
| 計算期間中の追加設定元本額         | 35,407,851,601円  |
| 計算期間中の一部解約元本額         | 33,150,767,114円  |
| 計算日の元本額               | 202,283,825,678円 |
| 計算日の元本額の内訳            |                  |
| グローバル・インカム&プラス（毎月決算型） | 3,519,002,153円   |
| SBI資産設計オープン（資産成長型）    | 1,282,627,133円   |
| SBI資産設計オープン（分配型）      | 32,750,994円      |
| SMT TOPIXインデックス・オープン  | 6,786,449,657円   |
| 世界経済インデックスファンド        | 170,967,437円     |
| マイセレクション25            | 118,269,195円     |
| マイセレクション50            | 270,716,494円     |
| マイセレクション75            | 264,600,738円     |
| 日本株式インデックス・オープン       | 17,461,072,592円  |
| DCマイセレクション25          | 6,401,504,960円   |
| DCマイセレクション50          | 19,396,606,316円  |
| DCマイセレクション75          | 16,255,372,125円  |
| DC日本株式インデックス・オープン     | 3,571,627,353円   |
| DCマイセレクションS25         | 1,822,859,001円   |
| DCマイセレクションS50         | 5,362,033,520円   |
| DCマイセレクションS75         | 3,150,618,530円   |
| DC日本株式インデックス・オープンS    | 1,111,529,448円   |
| DCターゲット・イヤー ファンド2015  | 25,635,848円      |

|                                                          |                          |
|----------------------------------------------------------|--------------------------|
| DCターゲット・イヤー ファンド2025                                     | 431,241,903円             |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035                                     | 400,843,942円             |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045                                     | 163,998,782円             |
| DC世界経済インデックスファンド                                         | 49,034,579円              |
| 日本株式インデックス・オープン（SMA専用）                                   | 6,077,661,903円           |
| 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）                                   | 399,224,439円             |
| マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）                                  | 909,572,336円             |
| マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）                                  | 392,286,850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）                            | 3,228,376,349円           |
| 国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）                                   | 20,034,220円              |
| 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）                                   | 80,749,171円              |
| マイセクション50VA2（適格機関投資家専用）                                  | 4,344,825円               |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用）                                     | 2,065,976,291円           |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用）                                     | 7,730,092,869円           |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用）                                     | 19,424,677,309円          |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用）                                     | 5,992,266,459円           |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）                                  | 13,376,319,774円          |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）                                | 2,574,275,485円           |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）                                  | 13,637,744,404円          |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）                                     | 6,310,448,884円           |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）                                     | 4,772,601,376円           |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）                                  | 3,131,594,762円           |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）                             | 6,015,342,738円           |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）                                  | 1,898,321,762円           |
| バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）                                  | 2,611,765,156円           |
| 国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）                                   | 205,464,046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）                          | 8,920,696,657円           |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1                                     | 2,741,706,855円           |
| 日本株式ファンド・シリーズ2                                           | 1,712,918,058円           |
| 2. 計算日における受益権総数                                          | 202,283,825,678口         |
| 3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」<br>第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損<br>83,360,399,500円 |
| 4. 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額)                             | 0.5879円<br>(5,879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24年10月 1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 | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、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。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制      | <p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>                |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

|                        | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額     | <p>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。</p>                                                                                                                                                                          |
| 2. 時価の算定方法             | <p>(1)株式<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>                                              |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 4. 金銭債権の計算日後の償還予定額     | <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>                                                                                                                                                                                                       |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 平成24年10月 1日現在      |
|----|--------------------|
|    | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 817,703,602        |
| 合計 | 817,703,602        |

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年10月1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24年10月 1日現在 |       |               |             |
|------|-----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                 | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |                 |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買 建 | 3,244,078,475 | —     | 3,231,020,000 | △13,058,475 |
|      | 合計              | 3,244,078,475 | —     | 3,231,020,000 | △13,058,475 |

(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24年10月 1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24年10月 1日現在 |
|---------------|
| 該当事項はありません。   |

[次へ](#)

## (3)附属明細表(平成24年10月1日現在)

## ① 有価証券明細表

## A. 株式

| 銘 柄             | 株式数<br>(株) | 評価額        |             | 備考 |
|-----------------|------------|------------|-------------|----|
|                 |            | 単価(円)      | 金額(円)       |    |
| 極洋              | 51,000     | 174.00     | 8,874,000   |    |
| 日本水産            | 149,300    | 166.00     | 24,783,800  |    |
| マルハニチロホールディングス  | 256,000    | 125.00     | 32,000,000  |    |
| サカタのタネ          | 19,100     | 1,041.00   | 19,883,100  |    |
| ホクト             | 13,200     | 1,637.00   | 21,608,400  |    |
| 住石ホールディングス      | 38,000     | 68.00      | 2,584,000   |    |
| 日鉄鉱業            | 33,000     | 312.00     | 10,296,000  |    |
| 三井松島産業          | 85,000     | 106.00     | 9,010,000   |    |
| 国際石油開発帝石        | 1,575      | 470,500.00 | 741,037,500 |    |
| 日本海洋掘削          | 3,200      | 2,186.00   | 6,995,200   |    |
| 関東天然瓦斯開発        | 13,000     | 422.00     | 5,486,000   |    |
| 石油資源開発          | 18,500     | 3,145.00   | 58,182,500  |    |
| ショーボンドホールディングス  | 11,500     | 2,675.00   | 30,762,500  |    |
| ミライト・ホールディングス   | 36,800     | 622.00     | 22,889,600  |    |
| ダイセキ環境ソリューション   | 20         | 118,200.00 | 2,364,000   |    |
| 間組              | 46,700     | 159.00     | 7,425,300   |    |
| 東急建設            | 56,300     | 144.00     | 8,107,200   |    |
| コムシスホールディングス    | 62,900     | 1,073.00   | 67,491,700  |    |
| ミサワホーム          | 14,500     | 1,141.00   | 16,544,500  |    |
| 高松コンストラクショングループ | 10,100     | 1,420.00   | 14,342,000  |    |
| 東建コーポレーション      | 5,150      | 3,320.00   | 17,098,000  |    |
| ヤマウラ            | 11,500     | 244.00     | 2,806,000   |    |
| 大成建設            | 657,000    | 222.00     | 145,854,000 |    |
| 大林組             | 390,000    | 354.00     | 138,060,000 |    |
| 清水建設            | 398,000    | 261.00     | 103,878,000 |    |
| 長谷工コーポレーション     | 810,000    | 51.00      | 41,310,000  |    |
| 松井建設            | 18,000     | 325.00     | 5,850,000   |    |
| 鹿島建設            | 611,000    | 212.00     | 129,532,000 |    |
| 鉄建建設            | 73,000     | 105.00     | 7,665,000   |    |
| 安藤建設            | 43,000     | 82.00      | 3,526,000   |    |
| 太平工業            | 25,000     | 310.00     | 7,750,000   |    |
| 西松建設            | 190,000    | 115.00     | 21,850,000  |    |
| 三井住友建設          | 97,400     | 50.00      | 4,870,000   |    |
| 前田建設工業          | 83,000     | 364.00     | 30,212,000  |    |
| ナカノフドー建設        | 21,500     | 137.00     | 2,945,500   |    |
| 奥村組             | 125,000    | 245.00     | 30,625,000  |    |
| 大和小田急建設         | 6,000      | 169.00     | 1,014,000   |    |
| 東鉄工業            | 17,000     | 990.00     | 16,830,000  |    |
| イチケン            | 32,000     | 137.00     | 4,384,000   |    |
| 戸田建設            | 141,000    | 233.00     | 32,853,000  |    |
| 熊谷組             | 94,000     | 68.00      | 6,392,000   |    |
| 青木あすなろ建設        | 10,000     | 402.00     | 4,020,000   |    |
| 北野建設            | 27,000     | 181.00     | 4,887,000   |    |

|           |         |          |             |  |
|-----------|---------|----------|-------------|--|
| 植木組       | 30,000  | 143.00   | 4,290,000   |  |
| 三井ホーム     | 18,000  | 401.00   | 7,218,000   |  |
| 矢作建設工業    | 20,900  | 311.00   | 6,499,900   |  |
| ピーエス三菱    | 8,200   | 327.00   | 2,681,400   |  |
| 大東建託      | 49,300  | 7,720.00 | 380,596,000 |  |
| 新日本建設     | 27,900  | 181.00   | 5,049,900   |  |
| N I P P O | 30,000  | 893.00   | 26,790,000  |  |
| 東亜道路工業    | 33,000  | 185.00   | 6,105,000   |  |
| 前田道路      | 37,000  | 1,001.00 | 37,037,000  |  |
| 日本道路      | 43,000  | 270.00   | 11,610,000  |  |
| 東亜建設工業    | 123,000 | 122.00   | 15,006,000  |  |
| 五洋建設      | 174,000 | 187.00   | 32,538,000  |  |
| 大林道路      | 21,000  | 177.00   | 3,717,000   |  |
| 福田組       | 22,000  | 316.00   | 6,952,000   |  |
| 住友林業      | 89,900  | 677.00   | 60,862,300  |  |
| 日本基礎技術    | 18,900  | 246.00   | 4,649,400   |  |
| 日成ビルド工業   | 64,000  | 150.00   | 9,600,000   |  |
| 巴コーポレーション | 16,100  | 264.00   | 4,250,400   |  |
| パナホーム     | 49,000  | 446.00   | 21,854,000  |  |
| 大和ハウス工業   | 324,000 | 1,123.00 | 363,852,000 |  |
| ライト工業     | 30,600  | 342.00   | 10,465,200  |  |
| 積水ハウス     | 365,000 | 772.00   | 281,780,000 |  |
| 日特建設      | 16,250  | 236.00   | 3,835,000   |  |
| 北陸電気工事    | 7,000   | 225.00   | 1,575,000   |  |
| ユアテック     | 17,000  | 249.00   | 4,233,000   |  |
| 西部電気工業    | 11,000  | 354.00   | 3,894,000   |  |
| 四電工       | 11,000  | 296.00   | 3,256,000   |  |
| 中電工       | 18,700  | 740.00   | 13,838,000  |  |
| 関電工       | 60,000  | 367.00   | 22,020,000  |  |
| きんでん      | 86,000  | 492.00   | 42,312,000  |  |
| 東京エネシス    | 17,000  | 386.00   | 6,562,000   |  |
| トーエネック    | 20,000  | 418.00   | 8,360,000   |  |
| 住友電設      | 10,100  | 680.00   | 6,868,000   |  |
| 日本電設工業    | 23,000  | 755.00   | 17,365,000  |  |
| 協和エクシオ    | 42,300  | 899.00   | 38,027,700  |  |
| 新日本空調     | 12,300  | 448.00   | 5,510,400   |  |
| N D S     | 21,000  | 246.00   | 5,166,000   |  |
| 九電工       | 24,000  | 394.00   | 9,456,000   |  |
| 三機工業      | 31,000  | 362.00   | 11,222,000  |  |
| 日揮        | 121,000 | 2,539.00 | 307,219,000 |  |
| 中外炉工業     | 48,000  | 217.00   | 10,416,000  |  |
| ヤマト       | 18,000  | 310.00   | 5,580,000   |  |
| 太平電業      | 17,000  | 536.00   | 9,112,000   |  |
| 高砂熱学工業    | 37,700  | 627.00   | 23,637,900  |  |
| 三晃金属工業    | 24,000  | 202.00   | 4,848,000   |  |
| 朝日工業社     | 15,000  | 277.00   | 4,155,000   |  |
| 大気社       | 20,100  | 1,601.00 | 32,180,100  |  |
| ダイダン      | 19,000  | 505.00   | 9,595,000   |  |

|                   |         |          |             |  |
|-------------------|---------|----------|-------------|--|
| 日比谷総合設備           | 15,900  | 1,007.00 | 16,011,300  |  |
| 東芝プラントシステム        | 22,000  | 1,031.00 | 22,682,000  |  |
| 東洋エンジニアリング        | 71,000  | 351.00   | 24,921,000  |  |
| 千代田化工建設           | 103,000 | 1,182.00 | 121,746,000 |  |
| 新興プランテック          | 26,600  | 620.00   | 16,492,000  |  |
| 日本製粉              | 79,000  | 343.00   | 27,097,000  |  |
| 日清製粉グループ本社        | 117,500 | 947.00   | 111,272,500 |  |
| 日東富士製粉            | 10,000  | 292.00   | 2,920,000   |  |
| 昭和産業              | 53,000  | 267.00   | 14,151,000  |  |
| 鳥越製粉              | 10,300  | 619.00   | 6,375,700   |  |
| 協同飼料              | 45,000  | 94.00    | 4,230,000   |  |
| 中部飼料              | 11,700  | 533.00   | 6,236,100   |  |
| 日本配合飼料            | 40,000  | 101.00   | 4,040,000   |  |
| 東洋精糖              | 24,000  | 82.00    | 1,968,000   |  |
| 日本甜菜製糖            | 72,000  | 152.00   | 10,944,000  |  |
| 三井製糖              | 46,000  | 258.00   | 11,868,000  |  |
| 森永製菓              | 127,000 | 177.00   | 22,479,000  |  |
| 中村屋               | 30,000  | 411.00   | 12,330,000  |  |
| 江崎グリコ             | 47,000  | 955.00   | 44,885,000  |  |
| 名糖産業              | 5,700   | 1,068.00 | 6,087,600   |  |
| 不二家               | 74,000  | 196.00   | 14,504,000  |  |
| 山崎製パン             | 95,000  | 1,030.00 | 97,850,000  |  |
| モロゾフ              | 20,000  | 278.00   | 5,560,000   |  |
| 亀田製菓              | 7,200   | 1,936.00 | 13,939,200  |  |
| カルビー              | 9,400   | 6,740.00 | 63,356,000  |  |
| 森永乳業              | 111,000 | 268.00   | 29,748,000  |  |
| ヤクルト本社            | 69,500  | 3,640.00 | 252,980,000 |  |
| 明治ホールディングス        | 38,400  | 3,815.00 | 146,496,000 |  |
| 雪印メグミルク           | 27,900  | 1,370.00 | 38,223,000  |  |
| プリマハム             | 75,000  | 140.00   | 10,500,000  |  |
| 日本ハム              | 98,000  | 990.00   | 97,020,000  |  |
| 伊藤ハム              | 71,000  | 335.00   | 23,785,000  |  |
| 丸大食品              | 62,000  | 282.00   | 17,484,000  |  |
| 米久                | 11,400  | 684.00   | 7,797,600   |  |
| S Foods           | 8,000   | 729.00   | 5,832,000   |  |
| サッポロホールディングス      | 215,000 | 220.00   | 47,300,000  |  |
| アサヒグループホールディングス   | 260,400 | 1,925.00 | 501,270,000 |  |
| キリンホールディングス       | 554,000 | 1,040.00 | 576,160,000 |  |
| 宝ホールディングス         | 109,000 | 572.00   | 62,348,000  |  |
| オエノンホールディングス      | 35,000  | 194.00   | 6,790,000   |  |
| 養命酒製造             | 10,000  | 718.00   | 7,180,000   |  |
| 三国コカ・コーラボトリング     | 13,500  | 681.00   | 9,193,500   |  |
| コカ・コーラウエスト        | 43,900  | 1,287.00 | 56,499,300  |  |
| コカ・コーラ セントラル ジャパン | 16,200  | 1,007.00 | 16,313,400  |  |
| ダイドードリンコ          | 6,000   | 3,545.00 | 21,270,000  |  |
| 伊藤園               | 36,000  | 1,550.00 | 55,800,000  |  |
| キーコーヒー            | 11,300  | 1,530.00 | 17,289,000  |  |
| ユニカフェ             | 3,000   | 400.00   | 1,200,000   |  |

|              |         |          |               |  |
|--------------|---------|----------|---------------|--|
| ジャパンフーズ      | 2,000   | 902.00   | 1,804,000     |  |
| 日清オイリオグループ   | 50,000  | 305.00   | 15,250,000    |  |
| 不二製油         | 31,400  | 1,071.00 | 33,629,400    |  |
| J-オイルミルズ     | 48,000  | 218.00   | 10,464,000    |  |
| キッコーマン       | 106,000 | 1,049.00 | 111,194,000   |  |
| 味の素          | 341,000 | 1,216.00 | 414,656,000   |  |
| キューピー        | 65,900  | 1,308.00 | 86,197,200    |  |
| ハウス食品        | 46,000  | 1,304.00 | 59,984,000    |  |
| カゴメ          | 50,100  | 1,770.00 | 88,677,000    |  |
| 焼津水産化学工業     | 6,100   | 754.00   | 4,599,400     |  |
| アリアケジャパン     | 11,800  | 1,750.00 | 20,650,000    |  |
| ニチレイ         | 145,000 | 423.00   | 61,335,000    |  |
| 東洋水産         | 56,000  | 1,966.00 | 110,096,000   |  |
| 日清食品ホールディングス | 50,600  | 3,030.00 | 153,318,000   |  |
| 永谷園          | 12,000  | 788.00   | 9,456,000     |  |
| フジッコ         | 14,000  | 1,025.00 | 14,350,000    |  |
| ロック・フィールド    | 6,700   | 1,474.00 | 9,875,800     |  |
| 日本たばこ産業      | 574,500 | 2,288.00 | 1,314,456,000 |  |
| ケンコーマヨネーズ    | 4,300   | 749.00   | 3,220,700     |  |
| わらべや日洋       | 7,400   | 1,329.00 | 9,834,600     |  |
| なとり          | 5,900   | 844.00   | 4,979,600     |  |
| ミヨシ油脂        | 44,000  | 97.00    | 4,268,000     |  |
| 片倉工業         | 15,200  | 708.00   | 10,761,600    |  |
| グンゼ          | 91,000  | 196.00   | 17,836,000    |  |
| 東洋紡          | 512,000 | 89.00    | 45,568,000    |  |
| ユニチカ         | 270,000 | 38.00    | 10,260,000    |  |
| 富士紡ホールディングス  | 51,000  | 290.00   | 14,790,000    |  |
| 日清紡ホールディングス  | 77,000  | 503.00   | 38,731,000    |  |
| 倉敷紡績         | 124,000 | 126.00   | 15,624,000    |  |
| シキボウ         | 78,000  | 90.00    | 7,020,000     |  |
| 日本毛織         | 38,000  | 592.00   | 22,496,000    |  |
| トーア紡コーポレーション | 55,000  | 54.00    | 2,970,000     |  |
| ダイドーリミテッド    | 15,200  | 481.00   | 7,311,200     |  |
| 帝国繊維         | 13,000  | 602.00   | 7,826,000     |  |
| 帝人           | 495,000 | 185.00   | 91,575,000    |  |
| 東レ           | 879,000 | 443.00   | 389,397,000   |  |
| サカイオーベックス    | 36,000  | 109.00   | 3,924,000     |  |
| 住江織物         | 30,000  | 147.00   | 4,410,000     |  |
| 日本フェルト       | 6,800   | 405.00   | 2,754,000     |  |
| イチカワ         | 9,000   | 152.00   | 1,368,000     |  |
| 日本バイリーン      | 15,000  | 346.00   | 5,190,000     |  |
| 芦森工業         | 34,000  | 98.00    | 3,332,000     |  |
| アツギ          | 95,000  | 92.00    | 8,740,000     |  |
| ダイニック        | 23,000  | 147.00   | 3,381,000     |  |
| セーレン         | 30,200  | 531.00   | 16,036,200    |  |
| 東海染工         | 17,000  | 79.00    | 1,343,000     |  |
| 小松精練         | 19,000  | 379.00   | 7,201,000     |  |
| ワコールホールディングス | 72,000  | 931.00   | 67,032,000    |  |

|                |         |          |             |  |
|----------------|---------|----------|-------------|--|
| ホギメディカル        | 7,600   | 4,220.00 | 32,072,000  |  |
| レナウン           | 26,200  | 112.00   | 2,934,400   |  |
| クラウドシア         | 1,700   | 998.00   | 1,696,600   |  |
| T S I ホールディングス | 54,700  | 514.00   | 28,115,800  |  |
| 三陽商会           | 64,000  | 241.00   | 15,424,000  |  |
| オンワードホールディングス  | 75,000  | 618.00   | 46,350,000  |  |
| ルック            | 20,000  | 483.00   | 9,660,000   |  |
| ゴールドウイン        | 29,000  | 457.00   | 13,253,000  |  |
| デサント           | 30,000  | 464.00   | 13,920,000  |  |
| ヤマトインターナショナル   | 7,300   | 365.00   | 2,664,500   |  |
| 特種東海製紙         | 76,000  | 195.00   | 14,820,000  |  |
| 王子ホールディングス     | 535,000 | 240.00   | 128,400,000 |  |
| 三菱製紙           | 172,000 | 67.00    | 11,524,000  |  |
| 北越紀州製紙         | 75,000  | 418.00   | 31,350,000  |  |
| 中越パルプ工業        | 46,000  | 135.00   | 6,210,000   |  |
| 巴川製紙所          | 21,000  | 144.00   | 3,024,000   |  |
| 大王製紙           | 47,000  | 484.00   | 22,748,000  |  |
| 日本製紙グループ本社     | 58,400  | 907.00   | 52,968,800  |  |
| レンゴー           | 96,000  | 355.00   | 34,080,000  |  |
| トーモク           | 38,000  | 209.00   | 7,942,000   |  |
| ザ・バック          | 8,600   | 1,396.00 | 12,005,600  |  |
| クラレ            | 192,500 | 866.00   | 166,705,000 |  |
| 旭化成            | 705,000 | 402.00   | 283,410,000 |  |
| 共和レザー          | 7,000   | 271.00   | 1,897,000   |  |
| コープケミカル        | 18,000  | 89.00    | 1,602,000   |  |
| 昭和電工           | 753,000 | 122.00   | 91,866,000  |  |
| 住友化学           | 832,000 | 197.00   | 163,904,000 |  |
| 日本化成           | 23,000  | 97.00    | 2,231,000   |  |
| 住友精化           | 23,000  | 268.00   | 6,164,000   |  |
| 日産化学工業         | 92,100  | 844.00   | 77,732,400  |  |
| ラサ工業           | 48,000  | 69.00    | 3,312,000   |  |
| クレハ            | 78,000  | 302.00   | 23,556,000  |  |
| テイカ            | 20,000  | 228.00   | 4,560,000   |  |
| 石原産業           | 203,000 | 60.00    | 12,180,000  |  |
| 片倉チッカリン        | 9,000   | 190.00   | 1,710,000   |  |
| 日本曹達           | 72,000  | 332.00   | 23,904,000  |  |
| 東ソー            | 324,000 | 149.00   | 48,276,000  |  |
| トクヤマ           | 188,000 | 160.00   | 30,080,000  |  |
| セントラル硝子        | 116,000 | 234.00   | 27,144,000  |  |
| 東亜合成           | 142,000 | 314.00   | 44,588,000  |  |
| ダイソー           | 48,000  | 215.00   | 10,320,000  |  |
| 関東電化工業         | 27,000  | 128.00   | 3,456,000   |  |
| 電気化学工業         | 242,000 | 235.00   | 56,870,000  |  |
| 信越化学工業         | 217,200 | 4,345.00 | 943,734,000 |  |
| 日本カーバイド工業      | 38,000  | 103.00   | 3,914,000   |  |
| 堺化学工業          | 38,000  | 221.00   | 8,398,000   |  |
| エア・ウォーター       | 100,000 | 953.00   | 95,300,000  |  |
| 大陽日酸           | 158,000 | 367.00   | 57,986,000  |  |

|                |         |          |             |  |
|----------------|---------|----------|-------------|--|
| 日本化学工業         | 48,000  | 96.00    | 4,608,000   |  |
| 日本パーカライジング     | 29,000  | 1,175.00 | 34,075,000  |  |
| 高压ガス工業         | 18,000  | 440.00   | 7,920,000   |  |
| チタン工業          | 13,000  | 232.00   | 3,016,000   |  |
| 四国化成工業         | 17,000  | 466.00   | 7,922,000   |  |
| 戸田工業           | 16,000  | 267.00   | 4,272,000   |  |
| ステラ ケミファ       | 5,700   | 1,436.00 | 8,185,200   |  |
| 保土谷化学工業        | 24,000  | 157.00   | 3,768,000   |  |
| 日本触媒           | 88,000  | 757.00   | 66,616,000  |  |
| 大日精化工業         | 43,000  | 341.00   | 14,663,000  |  |
| カネカ            | 151,000 | 375.00   | 56,625,000  |  |
| 三菱瓦斯化学         | 208,000 | 382.00   | 79,456,000  |  |
| 三井化学           | 514,000 | 154.00   | 79,156,000  |  |
| J S R          | 110,300 | 1,253.00 | 138,205,900 |  |
| 東京応化工業         | 21,800  | 1,625.00 | 35,425,000  |  |
| 大阪有機化学工業       | 8,000   | 359.00   | 2,872,000   |  |
| 三菱ケミカルホールディングス | 757,000 | 295.00   | 223,315,000 |  |
| 日本合成化学工業       | 25,000  | 499.00   | 12,475,000  |  |
| ダイセル           | 157,000 | 462.00   | 72,534,000  |  |
| 住友ベークライト       | 104,000 | 270.00   | 28,080,000  |  |
| 積水化学工業         | 249,000 | 625.00   | 155,625,000 |  |
| 日本ゼオン          | 113,000 | 527.00   | 59,551,000  |  |
| アイカ工業          | 31,500  | 1,322.00 | 41,643,000  |  |
| 宇部興産           | 507,000 | 168.00   | 85,176,000  |  |
| 積水樹脂           | 17,000  | 826.00   | 14,042,000  |  |
| タキロン           | 28,000  | 285.00   | 7,980,000   |  |
| 旭有機材工業         | 43,000  | 190.00   | 8,170,000   |  |
| 日立化成工業         | 52,400  | 1,028.00 | 53,867,200  |  |
| ニチバン           | 12,000  | 258.00   | 3,096,000   |  |
| リケンテクノス        | 20,000  | 204.00   | 4,080,000   |  |
| 大倉工業           | 29,000  | 194.00   | 5,626,000   |  |
| 積水化成品工業        | 31,000  | 188.00   | 5,828,000   |  |
| 群栄化学工業         | 30,000  | 202.00   | 6,060,000   |  |
| タイガースポリマー      | 6,000   | 291.00   | 1,746,000   |  |
| 日本カーリット        | 9,600   | 390.00   | 3,744,000   |  |
| 日本化薬           | 85,000  | 829.00   | 70,465,000  |  |
| 日本精化           | 10,000  | 537.00   | 5,370,000   |  |
| A D E K A      | 52,100  | 571.00   | 29,749,100  |  |
| 日油             | 94,000  | 364.00   | 34,216,000  |  |
| ハリマ化成グループ      | 10,300  | 362.00   | 3,728,600   |  |
| 花王             | 321,200 | 2,291.00 | 735,869,200 |  |
| 第一工業製薬         | 22,000  | 205.00   | 4,510,000   |  |
| 三洋化成工業         | 38,000  | 431.00   | 16,378,000  |  |
| 大日本塗料          | 69,000  | 84.00    | 5,796,000   |  |
| 日本ペイント         | 114,000 | 635.00   | 72,390,000  |  |
| 関西ペイント         | 137,000 | 867.00   | 118,779,000 |  |
| 中国塗料           | 37,000  | 374.00   | 13,838,000  |  |
| 日本特殊塗料         | 9,400   | 337.00   | 3,167,800   |  |

|                  |         |            |               |  |
|------------------|---------|------------|---------------|--|
| 藤倉化成             | 15,300  | 329.00     | 5,033,700     |  |
| 太陽ホールディングス       | 9,900   | 2,171.00   | 21,492,900    |  |
| D I C            | 462,000 | 125.00     | 57,750,000    |  |
| サカタインクス          | 23,000  | 370.00     | 8,510,000     |  |
| 東洋インキＳＣホールディングス  | 109,000 | 274.00     | 29,866,000    |  |
| 富士フイルムホールディングス   | 258,700 | 1,324.00   | 342,518,800   |  |
| 資生堂              | 201,100 | 1,010.00   | 203,111,000   |  |
| ライオン             | 140,000 | 453.00     | 63,420,000    |  |
| 高砂香料工業           | 40,000  | 392.00     | 15,680,000    |  |
| マンダム             | 12,100  | 2,049.00   | 24,792,900    |  |
| ミルボン             | 5,900   | 2,633.00   | 15,534,700    |  |
| ファンケル            | 30,400  | 907.00     | 27,572,800    |  |
| コーセー             | 19,600  | 1,799.00   | 35,260,400    |  |
| ドクターシーラボ         | 82      | 260,000.00 | 21,320,000    |  |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 14,400  | 2,543.00   | 36,619,200    |  |
| ノエビアホールディングス     | 7,100   | 1,121.00   | 7,959,100     |  |
| エステー             | 7,400   | 890.00     | 6,586,000     |  |
| コニシ              | 8,800   | 1,190.00   | 10,472,000    |  |
| 長谷川香料            | 15,300  | 1,009.00   | 15,437,700    |  |
| 星光PMC            | 5,000   | 301.00     | 1,505,000     |  |
| 小林製薬             | 16,800  | 4,200.00   | 70,560,000    |  |
| 荒川化学工業           | 9,400   | 633.00     | 5,950,200     |  |
| メック              | 8,600   | 229.00     | 1,969,400     |  |
| 日本高純度化学          | 34      | 186,000.00 | 6,324,000     |  |
| J C U            | 1,600   | 2,586.00   | 4,137,600     |  |
| アース製薬            | 8,700   | 2,948.00   | 25,647,600    |  |
| イハラケミカル工業        | 20,000  | 391.00     | 7,820,000     |  |
| 北興化学工業           | 12,000  | 228.00     | 2,736,000     |  |
| 大成ラミック           | 3,400   | 2,320.00   | 7,888,000     |  |
| クミアイ化学工業         | 25,000  | 385.00     | 9,625,000     |  |
| 日本農薬             | 28,000  | 365.00     | 10,220,000    |  |
| アキレス             | 98,000  | 106.00     | 10,388,000    |  |
| 有沢製作所            | 20,200  | 183.00     | 3,696,600     |  |
| 日東電工             | 99,800  | 3,635.00   | 362,773,000   |  |
| レック              | 3,600   | 1,023.00   | 3,682,800     |  |
| きもと              | 9,800   | 416.00     | 4,076,800     |  |
| 藤森工業             | 8,700   | 1,729.00   | 15,042,300    |  |
| 前澤化成工業           | 8,500   | 867.00     | 7,369,500     |  |
| J S P            | 7,900   | 1,115.00   | 8,808,500     |  |
| エフピコ             | 5,400   | 6,050.00   | 32,670,000    |  |
| 天馬               | 9,600   | 818.00     | 7,852,800     |  |
| 信越ポリマー           | 23,800  | 298.00     | 7,092,400     |  |
| 東リ               | 31,000  | 174.00     | 5,394,000     |  |
| ニフコ              | 27,000  | 1,762.00   | 47,574,000    |  |
| 日本バルカー工業         | 47,000  | 215.00     | 10,105,000    |  |
| ユニ・チャーム          | 66,900  | 4,435.00   | 296,701,500   |  |
| 協和発酵キリン          | 145,000 | 945.00     | 137,025,000   |  |
| 武田薬品工業           | 453,600 | 3,575.00   | 1,621,620,000 |  |

|                 |           |          |               |  |
|-----------------|-----------|----------|---------------|--|
| アステラス製薬         | 268,800   | 3,960.00 | 1,064,448,000 |  |
| 大日本住友製薬         | 85,700    | 852.00   | 73,016,400    |  |
| 塩野義製薬           | 189,100   | 1,186.00 | 224,272,600   |  |
| 田辺三菱製薬          | 120,500   | 1,159.00 | 139,659,500   |  |
| わかもと製薬          | 14,000    | 211.00   | 2,954,000     |  |
| あすか製薬           | 14,000    | 415.00   | 5,810,000     |  |
| 日本新薬            | 25,000    | 995.00   | 24,875,000    |  |
| 中外製薬            | 140,700   | 1,614.00 | 227,089,800   |  |
| 科研製薬            | 48,000    | 1,168.00 | 56,064,000    |  |
| エーザイ            | 149,100   | 3,490.00 | 520,359,000   |  |
| ロート製薬           | 51,000    | 1,169.00 | 59,619,000    |  |
| 小野薬品工業          | 59,200    | 4,670.00 | 276,464,000   |  |
| 久光製薬            | 37,600    | 4,290.00 | 161,304,000   |  |
| 有機合成薬品工業        | 9,000     | 204.00   | 1,836,000     |  |
| 持田製薬            | 41,000    | 963.00   | 39,483,000    |  |
| 参天製薬            | 40,700    | 3,490.00 | 142,043,000   |  |
| 扶桑薬品工業          | 41,000    | 262.00   | 10,742,000    |  |
| 日本ケミファ          | 18,000    | 488.00   | 8,784,000     |  |
| ツムラ             | 33,000    | 2,408.00 | 79,464,000    |  |
| 日医工             | 19,000    | 1,812.00 | 34,428,000    |  |
| キッセイ薬品工業        | 22,500    | 1,390.00 | 31,275,000    |  |
| 生化学工業           | 23,100    | 886.00   | 20,466,600    |  |
| 栄研化学            | 9,400     | 1,057.00 | 9,935,800     |  |
| 日水製薬            | 4,900     | 785.00   | 3,846,500     |  |
| 鳥居薬品            | 8,300     | 1,701.00 | 14,118,300    |  |
| 東和薬品            | 6,200     | 5,120.00 | 31,744,000    |  |
| 富士製薬工業          | 3,000     | 1,263.00 | 3,789,000     |  |
| 沢井製薬            | 8,000     | 8,940.00 | 71,520,000    |  |
| ゼリア新薬工業         | 17,000    | 1,394.00 | 23,698,000    |  |
| 第一三共            | 407,300   | 1,273.00 | 518,492,900   |  |
| キョーリン製薬ホールディングス | 29,600    | 1,848.00 | 54,700,800    |  |
| 大幸薬品            | 5,600     | 705.00   | 3,948,000     |  |
| ダイト             | 3,400     | 1,377.00 | 4,681,800     |  |
| 大塚ホールディングス      | 240,300   | 2,439.00 | 586,091,700   |  |
| 大正製薬ホールディングス    | 29,100    | 6,380.00 | 185,658,000   |  |
| 日本コークス工業        | 97,500    | 98.00    | 9,555,000     |  |
| 昭和シェル石油         | 108,200   | 421.00   | 45,552,200    |  |
| コスモ石油           | 335,000   | 142.00   | 47,570,000    |  |
| ニチレキ            | 16,000    | 397.00   | 6,352,000     |  |
| 東燃ゼネラル石油        | 183,000   | 678.00   | 124,074,000   |  |
| ユシロ化学工業         | 6,500     | 777.00   | 5,050,500     |  |
| ビーピー・カストロール     | 4,900     | 342.00   | 1,675,800     |  |
| AOCホールディングス     | 28,100    | 233.00   | 6,547,300     |  |
| MORESCO         | 2,500     | 717.00   | 1,792,500     |  |
| 出光興産            | 14,400    | 6,410.00 | 92,304,000    |  |
| JXホールディングス      | 1,344,000 | 432.00   | 580,608,000   |  |
| 横浜ゴム            | 135,000   | 563.00   | 76,005,000    |  |
| 東洋ゴム工業          | 91,000    | 195.00   | 17,745,000    |  |

|                    |           |          |             |  |
|--------------------|-----------|----------|-------------|--|
| ブリヂストン             | 379,500   | 1,760.00 | 667,920,000 |  |
| 住友ゴム工業             | 94,400    | 899.00   | 84,865,600  |  |
| 藤倉ゴム工業             | 7,600     | 266.00   | 2,021,600   |  |
| オカモト               | 43,000    | 320.00   | 13,760,000  |  |
| フコク                | 5,100     | 719.00   | 3,666,900   |  |
| ニッタ                | 12,000    | 1,229.00 | 14,748,000  |  |
| 東海ゴム工業             | 22,400    | 716.00   | 16,038,400  |  |
| 三ツ星ベルト             | 32,000    | 442.00   | 14,144,000  |  |
| バンドー化学             | 42,000    | 268.00   | 11,256,000  |  |
| 日東紡績               | 90,000    | 258.00   | 23,220,000  |  |
| 旭硝子                | 597,000   | 514.00   | 306,858,000 |  |
| 日本板硝子              | 519,000   | 56.00    | 29,064,000  |  |
| 石塚硝子               | 16,000    | 138.00   | 2,208,000   |  |
| 日本山村硝子             | 48,000    | 185.00   | 8,880,000   |  |
| 日本電気硝子             | 232,000   | 434.00   | 100,688,000 |  |
| オハラ                | 4,700     | 640.00   | 3,008,000   |  |
| 住友大阪セメント           | 246,000   | 281.00   | 69,126,000  |  |
| 太平洋セメント            | 713,000   | 167.00   | 119,071,000 |  |
| デイ・シイ              | 12,900    | 220.00   | 2,838,000   |  |
| 日本ヒューム             | 12,000    | 360.00   | 4,320,000   |  |
| 日本コンクリート工業         | 20,000    | 239.00   | 4,780,000   |  |
| 東海カーボン             | 105,000   | 237.00   | 24,885,000  |  |
| 日本カーボン             | 64,000    | 140.00   | 8,960,000   |  |
| 東洋炭素               | 6,000     | 1,805.00 | 10,830,000  |  |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 63,000    | 194.00   | 12,222,000  |  |
| TOTO               | 187,000   | 565.00   | 105,655,000 |  |
| 日本碍子               | 158,000   | 838.00   | 132,404,000 |  |
| 日本特殊陶業             | 104,000   | 813.00   | 84,552,000  |  |
| MARUWA             | 3,600     | 2,380.00 | 8,568,000   |  |
| 品川リフラクトリーズ         | 32,000    | 167.00   | 5,344,000   |  |
| 黒崎播磨               | 29,000    | 199.00   | 5,771,000   |  |
| 東京窯業               | 15,000    | 155.00   | 2,325,000   |  |
| ニッカトー              | 4,300     | 494.00   | 2,124,200   |  |
| フジミインコーポレーテッド      | 11,000    | 1,117.00 | 12,287,000  |  |
| ニチアス               | 54,000    | 424.00   | 22,896,000  |  |
| ニチハ                | 13,500    | 921.00   | 12,433,500  |  |
| 新日鐵住金              | 4,825,605 | 158.00   | 762,445,590 |  |
| 神戸製鋼所              | 1,682,000 | 62.00    | 104,284,000 |  |
| 合同製鐵               | 68,000    | 115.00   | 7,820,000   |  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 307,628   | 1,004.00 | 308,858,512 |  |
| 日新製鋼ホールディングス       | 48,408    | 849.00   | 41,098,392  |  |
| 東京製鐵               | 61,500    | 257.00   | 15,805,500  |  |
| 共英製鋼               | 12,900    | 1,267.00 | 16,344,300  |  |
| 大和工業               | 27,600    | 2,254.00 | 62,210,400  |  |
| 東京鐵鋼               | 24,000    | 262.00   | 6,288,000   |  |
| 大阪製鐵               | 7,600     | 1,286.00 | 9,773,600   |  |
| 淀川製鋼所              | 86,000    | 263.00   | 22,618,000  |  |
| 東洋鋼鈑               | 29,000    | 217.00   | 6,293,000   |  |

|                |         |          |             |  |
|----------------|---------|----------|-------------|--|
| 住友鋼管           | 7,100   | 621.00   | 4,409,100   |  |
| 丸一鋼管           | 37,100  | 1,648.00 | 61,140,800  |  |
| モリ工業           | 18,000  | 230.00   | 4,140,000   |  |
| 大同特殊鋼          | 203,000 | 342.00   | 69,426,000  |  |
| 日本高周波鋼業        | 48,000  | 77.00    | 3,696,000   |  |
| 日本冶金工業         | 93,000  | 68.00    | 6,324,000   |  |
| 山陽特殊製鋼         | 60,000  | 231.00   | 13,860,000  |  |
| 愛知製鋼           | 64,000  | 318.00   | 20,352,000  |  |
| 日立金属           | 79,000  | 673.00   | 53,167,000  |  |
| 日本金属           | 29,000  | 108.00   | 3,132,000   |  |
| 大太平洋金属         | 84,000  | 267.00   | 22,428,000  |  |
| 日本電工           | 48,000  | 195.00   | 9,360,000   |  |
| 栗本鐵工所          | 58,000  | 254.00   | 14,732,000  |  |
| 日本鑄鉄管          | 13,000  | 160.00   | 2,080,000   |  |
| 三菱製鋼           | 75,000  | 140.00   | 10,500,000  |  |
| 日亜鋼業           | 19,000  | 189.00   | 3,591,000   |  |
| 日本精線           | 8,000   | 316.00   | 2,528,000   |  |
| シンニッタン         | 10,500  | 315.00   | 3,307,500   |  |
| 新家工業           | 26,000  | 114.00   | 2,964,000   |  |
| 大紀アルミニウム工業所    | 19,000  | 203.00   | 3,857,000   |  |
| 日本軽金属ホールディングス  | 275,000 | 79.00    | 21,725,000  |  |
| 三井金属鉱業         | 329,000 | 164.00   | 53,956,000  |  |
| 東邦亜鉛           | 68,000  | 269.00   | 18,292,000  |  |
| 三菱マテリアル        | 756,000 | 241.00   | 182,196,000 |  |
| 住友金属鉱山         | 313,000 | 995.00   | 311,435,000 |  |
| DOWAホールディングス   | 141,000 | 541.00   | 76,281,000  |  |
| 古河機械金属         | 203,000 | 70.00    | 14,210,000  |  |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 11,900  | 1,575.00 | 18,742,500  |  |
| 東邦チタニウム        | 19,700  | 709.00   | 13,967,300  |  |
| 住友軽金属工業        | 293,000 | 66.00    | 19,338,000  |  |
| 古河スカイ          | 49,000  | 194.00   | 9,506,000   |  |
| 古河電気工業         | 381,000 | 143.00   | 54,483,000  |  |
| 住友電気工業         | 427,600 | 809.00   | 345,928,400 |  |
| フジクラ           | 182,000 | 231.00   | 42,042,000  |  |
| 昭和電線ホールディングス   | 155,000 | 61.00    | 9,455,000   |  |
| タツタ電線          | 23,000  | 689.00   | 15,847,000  |  |
| 日立電線           | 94,000  | 103.00   | 9,682,000   |  |
| 沖電線            | 13,000  | 127.00   | 1,651,000   |  |
| カナレ電気          | 1,800   | 1,256.00 | 2,260,800   |  |
| 平河ヒューテック       | 2,400   | 650.00   | 1,560,000   |  |
| リョービ           | 68,000  | 157.00   | 10,676,000  |  |
| アサヒホールディングス    | 17,000  | 1,337.00 | 22,729,000  |  |
| 稲葉製作所          | 5,100   | 990.00   | 5,049,000   |  |
| 三協・立山ホールディングス  | 164,000 | 137.00   | 22,468,000  |  |
| トーカロ           | 7,300   | 1,143.00 | 8,343,900   |  |
| アルファC o        | 4,700   | 830.00   | 3,901,000   |  |
| SUMCO          | 75,100  | 524.00   | 39,352,400  |  |
| 川田テクノロジーズ      | 3,300   | 1,125.00 | 3,712,500   |  |

|                |         |          |             |  |
|----------------|---------|----------|-------------|--|
| 東洋製罐           | 85,500  | 822.00   | 70,281,000  |  |
| ホッカンホールディングス   | 32,000  | 234.00   | 7,488,000   |  |
| コロナ            | 5,500   | 1,001.00 | 5,505,500   |  |
| 横河ブリッジホールディングス | 25,000  | 560.00   | 14,000,000  |  |
| 駒井ハルテック        | 26,000  | 199.00   | 5,174,000   |  |
| 高田機工           | 16,000  | 157.00   | 2,512,000   |  |
| 三和ホールディングス     | 120,000 | 303.00   | 36,360,000  |  |
| 文化シャッター        | 32,000  | 345.00   | 11,040,000  |  |
| 東洋シャッター        | 4,900   | 441.00   | 2,160,900   |  |
| L I X I Lグループ  | 157,400 | 1,848.00 | 290,875,200 |  |
| 日本ファイルコン       | 9,200   | 384.00   | 3,532,800   |  |
| ノーリツ           | 23,700  | 1,342.00 | 31,805,400  |  |
| 長府製作所          | 11,600  | 1,854.00 | 21,506,400  |  |
| リンナイ           | 19,500  | 5,760.00 | 112,320,000 |  |
| ダイニチ工業         | 7,000   | 793.00   | 5,551,000   |  |
| 日東精工           | 19,000  | 209.00   | 3,971,000   |  |
| 三洋工業           | 20,000  | 133.00   | 2,660,000   |  |
| 岡部             | 23,900  | 490.00   | 11,711,000  |  |
| 東プレ            | 23,700  | 655.00   | 15,523,500  |  |
| 高周波熱錬          | 16,900  | 497.00   | 8,399,300   |  |
| 東京製綱           | 83,000  | 91.00    | 7,553,000   |  |
| パイオラックス        | 5,200   | 1,686.00 | 8,767,200   |  |
| 日本発條           | 87,600  | 672.00   | 58,867,200  |  |
| 中央発條           | 17,000  | 273.00   | 4,641,000   |  |
| 三益半導体工業        | 10,400  | 597.00   | 6,208,800   |  |
| アタカ大機          | 9,000   | 371.00   | 3,339,000   |  |
| 日本製鋼所          | 187,000 | 432.00   | 80,784,000  |  |
| 日立ツール          | 7,000   | 675.00   | 4,725,000   |  |
| 三浦工業           | 18,000  | 1,864.00 | 33,552,000  |  |
| タクマ            | 41,000  | 393.00   | 16,113,000  |  |
| ツガミ            | 32,000  | 475.00   | 15,200,000  |  |
| オークマ           | 73,000  | 454.00   | 33,142,000  |  |
| 東芝機械           | 66,000  | 306.00   | 20,196,000  |  |
| アマダ            | 171,000 | 341.00   | 58,311,000  |  |
| アイダエンジニアリング    | 31,300  | 518.00   | 16,213,400  |  |
| 牧野フライス製作所      | 61,000  | 341.00   | 20,801,000  |  |
| オーエスジー         | 49,800  | 1,036.00 | 51,592,800  |  |
| ダイジェット工業       | 16,000  | 148.00   | 2,368,000   |  |
| 旭ダイヤモンド工業      | 29,800  | 836.00   | 24,912,800  |  |
| 森精機製作所         | 63,900  | 500.00   | 31,950,000  |  |
| ディスコ           | 12,200  | 3,700.00 | 45,140,000  |  |
| 日東工器           | 7,100   | 1,820.00 | 12,922,000  |  |
| 豊和工業           | 68,000  | 73.00    | 4,964,000   |  |
| 大阪機工           | 47,000  | 87.00    | 4,089,000   |  |
| 東洋機械金属         | 12,100  | 188.00   | 2,274,800   |  |
| 津田駒工業          | 29,000  | 115.00   | 3,335,000   |  |
| 島精機製作所         | 15,800  | 1,082.00 | 17,095,600  |  |
| 日阪製作所          | 15,000  | 538.00   | 8,070,000   |  |

|              |         |           |             |  |
|--------------|---------|-----------|-------------|--|
| やまびこ         | 5,600   | 989.00    | 5,538,400   |  |
| ペガサスミシン製造    | 16,300  | 182.00    | 2,966,600   |  |
| ナブテスコ        | 50,400  | 1,414.00  | 71,265,600  |  |
| 三井海洋開発       | 10,000  | 1,522.00  | 15,220,000  |  |
| レオン自動機       | 11,000  | 190.00    | 2,090,000   |  |
| SMC          | 36,100  | 12,550.00 | 453,055,000 |  |
| 新川           | 10,000  | 359.00    | 3,590,000   |  |
| ホソカワミクロン     | 21,000  | 402.00    | 8,442,000   |  |
| ユニオンツール      | 6,700   | 1,231.00  | 8,247,700   |  |
| オイレス工業       | 12,600  | 1,613.00  | 20,323,800  |  |
| サトーホールディングス  | 12,700  | 1,187.00  | 15,074,900  |  |
| 日本エアーテック     | 4,400   | 345.00    | 1,518,000   |  |
| 日精樹脂工業       | 10,700  | 311.00    | 3,327,700   |  |
| ワイエイシイ       | 6,500   | 468.00    | 3,042,000   |  |
| 小松製作所        | 564,800 | 1,521.00  | 859,060,800 |  |
| 住友重機械工業      | 309,000 | 265.00    | 81,885,000  |  |
| 日立建機         | 61,800  | 1,241.00  | 76,693,800  |  |
| 日工           | 17,000  | 300.00    | 5,100,000   |  |
| 巴工業          | 4,600   | 1,367.00  | 6,288,200   |  |
| 井関農機         | 124,000 | 186.00    | 23,064,000  |  |
| TOWA         | 12,300  | 449.00    | 5,522,700   |  |
| 丸山製作所        | 27,000  | 149.00    | 4,023,000   |  |
| 北川鉄工所        | 58,000  | 128.00    | 7,424,000   |  |
| クボタ          | 554,000 | 776.00    | 429,904,000 |  |
| 荏原実業         | 2,900   | 1,197.00  | 3,471,300   |  |
| 三菱化工機        | 37,000  | 127.00    | 4,699,000   |  |
| 月島機械         | 18,000  | 684.00    | 12,312,000  |  |
| 帝国電機製作所      | 4,300   | 1,069.00  | 4,596,700   |  |
| 新東工業         | 26,500  | 548.00    | 14,522,000  |  |
| 澁谷工業         | 7,600   | 872.00    | 6,627,200   |  |
| アイチ コーポレーション | 20,100  | 344.00    | 6,914,400   |  |
| 小森コーポレーション   | 34,400  | 387.00    | 13,312,800  |  |
| 鶴見製作所        | 9,000   | 561.00    | 5,049,000   |  |
| 住友精密工業       | 18,000  | 313.00    | 5,634,000   |  |
| 酒井重工業        | 24,000  | 218.00    | 5,232,000   |  |
| 荏原製作所        | 198,000 | 320.00    | 63,360,000  |  |
| 石井鐵工所        | 20,000  | 123.00    | 2,460,000   |  |
| 西島製作所        | 14,000  | 537.00    | 7,518,000   |  |
| ダイキン工業       | 147,400 | 1,998.00  | 294,505,200 |  |
| オルガノ         | 23,000  | 473.00    | 10,879,000  |  |
| トーヨーカネツ      | 65,000  | 155.00    | 10,075,000  |  |
| 栗田工業         | 66,800  | 1,698.00  | 113,426,400 |  |
| 椿本チエイン       | 62,000  | 436.00    | 27,032,000  |  |
| 大同工業         | 26,000  | 133.00    | 3,458,000   |  |
| 日本コンベヤ       | 37,000  | 70.00     | 2,590,000   |  |
| 木村化工機        | 11,300  | 265.00    | 2,994,500   |  |
| アネスト岩田       | 19,000  | 317.00    | 6,023,000   |  |
| ダイフク         | 53,000  | 386.00    | 20,458,000  |  |

|                 |           |           |               |  |
|-----------------|-----------|-----------|---------------|--|
| 加藤製作所           | 29,000    | 198.00    | 5,742,000     |  |
| 油研工業            | 21,000    | 140.00    | 2,940,000     |  |
| タダノ             | 56,000    | 571.00    | 31,976,000    |  |
| フジテック           | 34,000    | 462.00    | 15,708,000    |  |
| CKD             | 32,500    | 425.00    | 13,812,500    |  |
| キトー             | 54        | 62,300.00 | 3,364,200     |  |
| 平和              | 24,200    | 1,310.00  | 31,702,000    |  |
| 理想科学工業          | 8,300     | 1,344.00  | 11,155,200    |  |
| SANKYO          | 35,100    | 3,625.00  | 127,237,500   |  |
| 日本金銭機械          | 10,700    | 715.00    | 7,650,500     |  |
| マースエンジニアリング     | 6,500     | 2,063.00  | 13,409,500    |  |
| 福島工業            | 3,200     | 1,301.00  | 4,163,200     |  |
| オーイズミ           | 7,100     | 296.00    | 2,101,600     |  |
| ダイコク電機          | 5,500     | 2,037.00  | 11,203,500    |  |
| アマノ             | 35,100    | 663.00    | 23,271,300    |  |
| サンデン            | 64,000    | 224.00    | 14,336,000    |  |
| マックス            | 18,000    | 904.00    | 16,272,000    |  |
| グローリー           | 34,500    | 1,808.00  | 62,376,000    |  |
| 大和冷機工業          | 19,000    | 360.00    | 6,840,000     |  |
| セガサミーホールディングス   | 124,300   | 1,449.00  | 180,110,700   |  |
| 日本ピストンリング       | 42,000    | 127.00    | 5,334,000     |  |
| リケン             | 42,000    | 277.00    | 11,634,000    |  |
| TPR             | 13,200    | 892.00    | 11,774,400    |  |
| ホシザキ電機          | 25,300    | 2,224.00  | 56,267,200    |  |
| 大豊工業            | 8,900     | 771.00    | 6,861,900     |  |
| 日本精工            | 255,000   | 448.00    | 114,240,000   |  |
| NTN             | 269,000   | 154.00    | 41,426,000    |  |
| ジェイテクト          | 109,700   | 613.00    | 67,246,100    |  |
| 不二越             | 111,000   | 225.00    | 24,975,000    |  |
| 日本トムソン          | 39,000    | 256.00    | 9,984,000     |  |
| THK             | 76,900    | 1,184.00  | 91,049,600    |  |
| ユーシン精機          | 5,800     | 1,374.00  | 7,969,200     |  |
| 前澤給装工業          | 4,400     | 1,095.00  | 4,818,000     |  |
| イーグル工業          | 16,000    | 482.00    | 7,712,000     |  |
| 前澤工業            | 12,900    | 175.00    | 2,257,500     |  |
| 日本ピラー工業         | 12,000    | 527.00    | 6,324,000     |  |
| キッツ             | 48,200    | 329.00    | 15,857,800    |  |
| 日立工機            | 31,000    | 588.00    | 18,228,000    |  |
| マキタ             | 75,400    | 3,020.00  | 227,708,000   |  |
| 日立造船            | 458,000   | 88.00     | 40,304,000    |  |
| 三菱重工業           | 1,938,000 | 337.00    | 653,106,000   |  |
| IHI             | 790,000   | 171.00    | 135,090,000   |  |
| イビデン            | 75,900    | 1,100.00  | 83,490,000    |  |
| コニカミノルタホールディングス | 305,500   | 596.00    | 182,078,000   |  |
| ブラザー工業          | 149,500   | 725.00    | 108,387,500   |  |
| ミネベア            | 172,000   | 265.00    | 45,580,000    |  |
| 日立製作所           | 2,664,000 | 434.00    | 1,156,176,000 |  |
| 東芝              | 2,434,000 | 247.00    | 601,198,000   |  |

|                   |           |            |             |  |
|-------------------|-----------|------------|-------------|--|
| 三菱電機              | 1,156,000 | 580.00     | 670,480,000 |  |
| 富士電機              | 349,000   | 156.00     | 54,444,000  |  |
| 東洋電機製造            | 23,000    | 236.00     | 5,428,000   |  |
| 安川電機              | 136,000   | 524.00     | 71,264,000  |  |
| シンフォニアテクノロジー      | 70,000    | 143.00     | 10,010,000  |  |
| 明電舎               | 115,000   | 270.00     | 31,050,000  |  |
| オリジン電気            | 17,000    | 285.00     | 4,845,000   |  |
| デンヨー              | 10,500    | 862.00     | 9,051,000   |  |
| 東芝テック             | 73,000    | 343.00     | 25,039,000  |  |
| 芝浦メカトロニクス         | 21,000    | 126.00     | 2,646,000   |  |
| マブチモーター           | 17,200    | 3,625.00   | 62,350,000  |  |
| 日本電産              | 64,404    | 5,570.00   | 358,730,280 |  |
| 東光高岳ホールディングス      | 5,965     | 1,243.00   | 7,414,495   |  |
| ダイヘン              | 68,000    | 200.00     | 13,600,000  |  |
| ヤーマン              | 1,000     | 1,189.00   | 1,189,000   |  |
| JVCケンウッド          | 70,000    | 278.00     | 19,460,000  |  |
| 第一精工              | 3,600     | 1,011.00   | 3,639,600   |  |
| 日新電機              | 23,000    | 442.00     | 10,166,000  |  |
| 大崎電気工業            | 17,000    | 446.00     | 7,582,000   |  |
| オムロン              | 128,800   | 1,515.00   | 195,132,000 |  |
| 日東工業              | 17,000    | 1,193.00   | 20,281,000  |  |
| I D E C           | 15,100    | 664.00     | 10,026,400  |  |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 223,000   | 322.00     | 71,806,000  |  |
| サクサホールディングス       | 29,000    | 129.00     | 3,741,000   |  |
| メルコホールディングス       | 6,400     | 1,512.00   | 9,676,800   |  |
| テクノメディカ           | 9         | 395,000.00 | 3,555,000   |  |
| 日本電気              | 1,590,000 | 129.00     | 205,110,000 |  |
| 富士通               | 1,115,000 | 292.00     | 325,580,000 |  |
| 沖電気工業             | 446,000   | 85.00      | 37,910,000  |  |
| 岩崎通信機             | 51,000    | 56.00      | 2,856,000   |  |
| 電気興業              | 35,000    | 345.00     | 12,075,000  |  |
| サンケン電気            | 59,000    | 242.00     | 14,278,000  |  |
| ナカヨ通信機            | 11,000    | 258.00     | 2,838,000   |  |
| アイホン              | 6,700     | 1,620.00   | 10,854,000  |  |
| ルネサスエレクトロニクス      | 29,400    | 293.00     | 8,614,200   |  |
| セイコーエプソン          | 79,000    | 478.00     | 37,762,000  |  |
| ワコム               | 228       | 180,400.00 | 41,131,200  |  |
| アルバック             | 21,000    | 568.00     | 11,928,000  |  |
| アクセル              | 5,400     | 1,886.00   | 10,184,400  |  |
| ナナオ               | 9,800     | 1,363.00   | 13,357,400  |  |
| 日本信号              | 27,000    | 484.00     | 13,068,000  |  |
| 京三製作所             | 25,000    | 270.00     | 6,750,000   |  |
| 能美防災              | 15,000    | 503.00     | 7,545,000   |  |
| ホーチキ              | 11,000    | 400.00     | 4,400,000   |  |
| 日本無線              | 25,000    | 194.00     | 4,850,000   |  |
| パナソニック            | 1,321,200 | 516.00     | 681,739,200 |  |
| シャープ              | 558,000   | 193.00     | 107,694,000 |  |
| アンリツ              | 60,000    | 998.00     | 59,880,000  |  |

|                     |         |           |             |  |
|---------------------|---------|-----------|-------------|--|
| 富士通ゼネラル             | 28,000  | 668.00    | 18,704,000  |  |
| 日立国際電気              | 26,000  | 514.00    | 13,364,000  |  |
| ソニー                 | 721,400 | 917.00    | 661,523,800 |  |
| TDK                 | 60,500  | 2,948.00  | 178,354,000 |  |
| 帝国通信工業              | 28,000  | 128.00    | 3,584,000   |  |
| ミツミ電機               | 40,900  | 411.00    | 16,809,900  |  |
| タムラ製作所              | 39,000  | 181.00    | 7,059,000   |  |
| アルプス電気              | 91,400  | 402.00    | 36,742,800  |  |
| パイオニア               | 164,100 | 188.00    | 30,850,800  |  |
| 日本電波工業              | 9,000   | 847.00    | 7,623,000   |  |
| 日本トリム               | 1,350   | 2,052.00  | 2,770,200   |  |
| ローランド ディー. ジー.      | 5,200   | 925.00    | 4,810,000   |  |
| フォスター電機             | 11,000  | 1,165.00  | 12,815,000  |  |
| クラリオン               | 71,000  | 126.00    | 8,946,000   |  |
| SMK                 | 37,000  | 220.00    | 8,140,000   |  |
| ヨコオ                 | 9,100   | 415.00    | 3,776,500   |  |
| 東光                  | 58,000  | 193.00    | 11,194,000  |  |
| ホシデン                | 31,400  | 448.00    | 14,067,200  |  |
| ヒロセ電機               | 20,100  | 8,710.00  | 175,071,000 |  |
| 日本航空電子工業            | 27,000  | 635.00    | 17,145,000  |  |
| TOA                 | 13,000  | 577.00    | 7,501,000   |  |
| ユニデン                | 34,000  | 170.00    | 5,780,000   |  |
| アルパイン               | 22,600  | 707.00    | 15,978,200  |  |
| スミダコーポレーション         | 7,300   | 370.00    | 2,701,000   |  |
| アイコム                | 6,400   | 1,885.00  | 12,064,000  |  |
| リオン                 | 2,600   | 550.00    | 1,430,000   |  |
| 船井電機                | 10,400  | 1,068.00  | 11,107,200  |  |
| 横河電機                | 125,400 | 893.00    | 111,982,200 |  |
| 新電元工業               | 41,000  | 163.00    | 6,683,000   |  |
| アズビル                | 29,700  | 1,548.00  | 45,975,600  |  |
| 日本光電工業              | 23,000  | 2,667.00  | 61,341,000  |  |
| チノー                 | 21,000  | 203.00    | 4,263,000   |  |
| 共和電業                | 13,000  | 249.00    | 3,237,000   |  |
| 日本電子材料              | 4,600   | 374.00    | 1,720,400   |  |
| 堀場製作所               | 22,900  | 2,237.00  | 51,227,300  |  |
| アドバンテスト             | 86,000  | 978.00    | 84,108,000  |  |
| 小野測器                | 14,000  | 355.00    | 4,970,000   |  |
| エスベック               | 12,000  | 665.00    | 7,980,000   |  |
| パナソニック デバイス S U N X | 10,300  | 342.00    | 3,522,600   |  |
| キーエンス               | 28,400  | 20,240.00 | 574,816,000 |  |
| 日置電機                | 6,100   | 1,340.00  | 8,174,000   |  |
| シスメックス              | 40,700  | 3,705.00  | 150,793,500 |  |
| メガチップス              | 9,500   | 1,712.00  | 16,264,000  |  |
| OBARA GROUP         | 8,300   | 925.00    | 7,677,500   |  |
| 日本電産コパル電子           | 12,000  | 418.00    | 5,016,000   |  |
| ミヤチテクノス             | 5,300   | 504.00    | 2,671,200   |  |
| 東京電波                | 3,600   | 478.00    | 1,720,800   |  |
| 澤藤電機                | 6,000   | 187.00    | 1,122,000   |  |

|                  |         |           |               |  |
|------------------|---------|-----------|---------------|--|
| コーセル             | 16,900  | 1,034.00  | 17,474,600    |  |
| 日立メディコ           | 9,000   | 907.00    | 8,163,000     |  |
| 新日本無線            | 7,000   | 166.00    | 1,162,000     |  |
| オプテックス           | 7,400   | 875.00    | 6,475,000     |  |
| 千代田インテグレ         | 5,600   | 835.00    | 4,676,000     |  |
| スタンレー電気          | 77,200  | 1,139.00  | 87,930,800    |  |
| 岩崎電気             | 42,000  | 116.00    | 4,872,000     |  |
| ウシオ電機            | 70,200  | 923.00    | 64,794,600    |  |
| 岡谷電機産業           | 6,300   | 311.00    | 1,959,300     |  |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 10,200  | 144.00    | 1,468,800     |  |
| 日本セラミック          | 7,600   | 998.00    | 7,584,800     |  |
| 日本デジタル研究所        | 9,800   | 848.00    | 8,310,400     |  |
| 古河電池             | 8,000   | 350.00    | 2,800,000     |  |
| 双信電機             | 5,800   | 313.00    | 1,815,400     |  |
| 山一電機             | 11,700  | 126.00    | 1,474,200     |  |
| 図研               | 7,600   | 533.00    | 4,050,800     |  |
| 日本電子             | 43,000  | 170.00    | 7,310,000     |  |
| カシオ計算機           | 110,200 | 555.00    | 61,161,000    |  |
| ファナック            | 120,400 | 12,570.00 | 1,513,428,000 |  |
| 日本シイエムケイ         | 25,100  | 262.00    | 6,576,200     |  |
| エンプラス            | 5,800   | 2,663.00  | 15,445,400    |  |
| ローム              | 57,000  | 2,604.00  | 148,428,000   |  |
| 浜松ホトニクス          | 45,100  | 2,684.00  | 121,048,400   |  |
| 三井ハイテック          | 15,400  | 546.00    | 8,408,400     |  |
| 新光電気工業           | 38,900  | 480.00    | 18,672,000    |  |
| 京セラ              | 96,200  | 6,730.00  | 647,426,000   |  |
| 太陽誘電             | 52,000  | 641.00    | 33,332,000    |  |
| 村田製作所            | 121,300 | 4,090.00  | 496,117,000   |  |
| ユーシン             | 16,200  | 392.00    | 6,350,400     |  |
| 双葉電子工業           | 19,800  | 1,004.00  | 19,879,200    |  |
| 北陸電気工業           | 46,000  | 85.00     | 3,910,000     |  |
| ニチコン             | 36,500  | 555.00    | 20,257,500    |  |
| 日本ケミコン           | 67,000  | 125.00    | 8,375,000     |  |
| KOA              | 14,600  | 667.00    | 9,738,200     |  |
| 市光工業             | 28,000  | 121.00    | 3,388,000     |  |
| 小糸製作所            | 56,000  | 892.00    | 49,952,000    |  |
| ミツバ              | 21,000  | 495.00    | 10,395,000    |  |
| スター精密            | 18,600  | 724.00    | 13,466,400    |  |
| 大日本スクリーン製造       | 109,000 | 385.00    | 41,965,000    |  |
| キヤノン電子           | 10,600  | 1,718.00  | 18,210,800    |  |
| キヤノン             | 718,300 | 2,544.00  | 1,827,355,200 |  |
| リコー              | 348,000 | 675.00    | 234,900,000   |  |
| MUTOHホールディングス    | 12,000  | 178.00    | 2,136,000     |  |
| 東京エレクトロン         | 97,300  | 3,305.00  | 321,576,500   |  |
| トヨタ紡織            | 40,400  | 808.00    | 32,643,200    |  |
| 鬼怒川ゴム工業          | 27,000  | 398.00    | 10,746,000    |  |
| ユニプレス            | 18,600  | 1,660.00  | 30,876,000    |  |
| 豊田自動織機           | 105,300 | 2,159.00  | 227,342,700   |  |

|             |           |          |               |  |
|-------------|-----------|----------|---------------|--|
| モリタホールディングス | 19,000    | 595.00   | 11,305,000    |  |
| 三櫻工業        | 14,700    | 495.00   | 7,276,500     |  |
| デンソー        | 285,700   | 2,420.00 | 691,394,000   |  |
| 東海理化電機製作所   | 27,100    | 1,083.00 | 29,349,300    |  |
| 三井造船        | 448,000   | 88.00    | 39,424,000    |  |
| 佐世保重工業      | 76,000    | 68.00    | 5,168,000     |  |
| 川崎重工業       | 840,000   | 155.00   | 130,200,000   |  |
| 日本車輛製造      | 42,000    | 269.00   | 11,298,000    |  |
| 日本輸送機       | 15,000    | 217.00   | 3,255,000     |  |
| 近畿車輛        | 17,000    | 252.00   | 4,284,000     |  |
| 日産自動車       | 1,471,200 | 655.00   | 963,636,000   |  |
| いすゞ自動車      | 731,000   | 373.00   | 272,663,000   |  |
| トヨタ自動車      | 1,499,400 | 2,989.00 | 4,481,706,600 |  |
| 日野自動車       | 165,000   | 511.00   | 84,315,000    |  |
| 三菱自動車工業     | 2,585,000 | 72.00    | 186,120,000   |  |
| エフテック       | 4,000     | 1,264.00 | 5,056,000     |  |
| 武蔵精密工業      | 11,200    | 1,406.00 | 15,747,200    |  |
| 日産車体        | 34,000    | 860.00   | 29,240,000    |  |
| 新明和工業       | 52,000    | 395.00   | 20,540,000    |  |
| 極東開発工業      | 19,900    | 646.00   | 12,855,400    |  |
| 日信工業        | 21,100    | 1,004.00 | 21,184,400    |  |
| トピー工業       | 86,000    | 150.00   | 12,900,000    |  |
| ティラド        | 42,000    | 167.00   | 7,014,000     |  |
| 曙ブレーキ工業     | 58,600    | 334.00   | 19,572,400    |  |
| タチエス        | 15,100    | 1,309.00 | 19,765,900    |  |
| NOK         | 55,900    | 1,178.00 | 65,850,200    |  |
| フタバ産業       | 32,700    | 307.00   | 10,038,900    |  |
| カヤバ工業       | 80,000    | 273.00   | 21,840,000    |  |
| シロキ工業       | 26,000    | 174.00   | 4,524,000     |  |
| 大同メタル工業     | 18,000    | 538.00   | 9,684,000     |  |
| プレス工業       | 53,000    | 305.00   | 16,165,000    |  |
| カルソニックカンセイ  | 69,000    | 296.00   | 20,424,000    |  |
| 太平洋工業       | 23,500    | 432.00   | 10,152,000    |  |
| ケーヒン        | 23,900    | 900.00   | 21,510,000    |  |
| 河西工業        | 14,000    | 322.00   | 4,508,000     |  |
| アイシン精機      | 95,200    | 2,196.00 | 209,059,200   |  |
| 富士機工        | 13,000    | 210.00   | 2,730,000     |  |
| マツダ         | 1,551,000 | 89.00    | 138,039,000   |  |
| ダイハツ工業      | 107,000   | 1,281.00 | 137,067,000   |  |
| 今仙電機製作所     | 8,500     | 977.00   | 8,304,500     |  |
| 本田技研工業      | 975,600   | 2,382.00 | 2,323,879,200 |  |
| スズキ         | 241,700   | 1,567.00 | 378,743,900   |  |
| 富士重工業       | 365,000   | 641.00   | 233,965,000   |  |
| ヤマハ発動機      | 175,800   | 672.00   | 118,137,600   |  |
| ショーワ        | 24,600    | 688.00   | 16,924,800    |  |
| T B K       | 12,000    | 346.00   | 4,152,000     |  |
| エクセディ       | 15,700    | 1,503.00 | 23,597,100    |  |
| 豊田合成        | 32,700    | 1,553.00 | 50,783,100    |  |

|                   |         |            |             |  |
|-------------------|---------|------------|-------------|--|
| 愛三工業              | 12,000  | 601.00     | 7,212,000   |  |
| ヨロズ               | 6,900   | 1,185.00   | 8,176,500   |  |
| エフ・シー・シー          | 18,900  | 1,239.00   | 23,417,100  |  |
| シマノ               | 46,600  | 5,510.00   | 256,766,000 |  |
| タカタ               | 20,900  | 1,371.00   | 28,653,900  |  |
| テイ・エス テック         | 24,400  | 1,179.00   | 28,767,600  |  |
| 日本電産トーソク          | 5,500   | 608.00     | 3,344,000   |  |
| テルモ               | 81,800  | 3,360.00   | 274,848,000 |  |
| クリエートメディック        | 3,500   | 800.00     | 2,800,000   |  |
| 日機装               | 37,000  | 928.00     | 34,336,000  |  |
| 島津製作所             | 138,000 | 539.00     | 74,382,000  |  |
| JMS               | 17,000  | 256.00     | 4,352,000   |  |
| クボテック             | 25      | 14,720.00  | 368,000     |  |
| モリテックス            | 2,500   | 210.00     | 525,000     |  |
| 長野計器              | 8,100   | 713.00     | 5,775,300   |  |
| ブイ・テクノロジー         | 20      | 156,900.00 | 3,138,000   |  |
| 東京計器              | 40,000  | 123.00     | 4,920,000   |  |
| 愛知時計電機            | 13,000  | 290.00     | 3,770,000   |  |
| 東京精密              | 20,700  | 1,025.00   | 21,217,500  |  |
| ニコン               | 201,500 | 2,117.00   | 426,575,500 |  |
| トプコン              | 26,600  | 392.00     | 10,427,200  |  |
| オリンパス             | 136,400 | 1,540.00   | 210,056,000 |  |
| 理研計器              | 9,300   | 502.00     | 4,668,600   |  |
| タムロン              | 8,900   | 2,357.00   | 20,977,300  |  |
| HOYA              | 281,100 | 1,724.00   | 484,616,400 |  |
| ノーリツ銅機            | 10,400  | 348.00     | 3,619,200   |  |
| エー・アンド・デイ         | 11,300  | 260.00     | 2,938,000   |  |
| 日本電産コパル           | 9,000   | 622.00     | 5,598,000   |  |
| シチズンホールディングス      | 138,400 | 388.00     | 53,699,200  |  |
| リズム時計工業           | 52,000  | 153.00     | 7,956,000   |  |
| 大研医器              | 1,400   | 1,212.00   | 1,696,800   |  |
| 松風                | 5,600   | 827.00     | 4,631,200   |  |
| セイコーホールディングス      | 67,000  | 209.00     | 14,003,000  |  |
| ニプロ               | 59,900  | 521.00     | 31,207,900  |  |
| パラマウントベッドホールディングス | 9,900   | 2,532.00   | 25,066,800  |  |
| SHO-BI            | 3,500   | 408.00     | 1,428,000   |  |
| 永大産業              | 15,000  | 343.00     | 5,145,000   |  |
| ダンロップスポーツ         | 6,300   | 992.00     | 6,249,600   |  |
| バンダイナムコホールディングス   | 119,200 | 1,308.00   | 155,913,600 |  |
| 共立印刷              | 17,000  | 248.00     | 4,216,000   |  |
| フランスベッドホールディングス   | 73,000  | 162.00     | 11,826,000  |  |
| パイロットコーポレーション     | 101     | 147,800.00 | 14,927,800  |  |
| トッパン・フォームズ        | 24,800  | 749.00     | 18,575,200  |  |
| フジシールインターナショナル    | 13,000  | 1,584.00   | 20,592,000  |  |
| タカラトミー            | 39,400  | 431.00     | 16,981,400  |  |
| 廣済堂               | 9,800   | 263.00     | 2,577,400   |  |
| タカノ               | 4,600   | 396.00     | 1,821,600   |  |
| プロネクサス            | 12,100  | 470.00     | 5,687,000   |  |

|             |           |           |             |  |
|-------------|-----------|-----------|-------------|--|
| ホクシン        | 8,100     | 198.00    | 1,603,800   |  |
| ウッドワン       | 24,000    | 237.00    | 5,688,000   |  |
| 大建工業        | 49,000    | 185.00    | 9,065,000   |  |
| 凸版印刷        | 352,000   | 447.00    | 157,344,000 |  |
| 大日本印刷       | 352,000   | 536.00    | 188,672,000 |  |
| 図書印刷        | 22,000    | 127.00    | 2,794,000   |  |
| 共同印刷        | 41,000    | 178.00    | 7,298,000   |  |
| 日本写真印刷      | 20,100    | 706.00    | 14,190,600  |  |
| 光村印刷        | 11,000    | 240.00    | 2,640,000   |  |
| 宝印刷         | 6,600     | 575.00    | 3,795,000   |  |
| アシックス       | 107,700   | 1,041.00  | 112,115,700 |  |
| ツツミ         | 5,800     | 1,933.00  | 11,211,400  |  |
| ローランド       | 12,200    | 532.00    | 6,490,400   |  |
| 小松ウオール工業    | 4,300     | 1,008.00  | 4,334,400   |  |
| ヤマハ         | 85,000    | 715.00    | 60,775,000  |  |
| 河合楽器製作所     | 47,000    | 176.00    | 8,272,000   |  |
| クリナップ       | 14,400    | 520.00    | 7,488,000   |  |
| ビジョン        | 10,200    | 3,520.00  | 35,904,000  |  |
| 兼松日産農林      | 18,000    | 123.00    | 2,214,000   |  |
| キングジム       | 9,700     | 613.00    | 5,946,100   |  |
| リンテック       | 22,000    | 1,412.00  | 31,064,000  |  |
| イトーキ        | 26,300    | 454.00    | 11,940,200  |  |
| 任天堂         | 66,100    | 10,020.00 | 662,322,000 |  |
| 三菱鉛筆        | 9,500     | 1,429.00  | 13,575,500  |  |
| タカラスタANDARD | 53,000    | 608.00    | 32,224,000  |  |
| コクヨ         | 60,100    | 630.00    | 37,863,000  |  |
| ナカバヤシ       | 26,000    | 178.00    | 4,628,000   |  |
| グローブライド     | 56,000    | 88.00     | 4,928,000   |  |
| 岡村製作所       | 40,000    | 605.00    | 24,200,000  |  |
| 美津濃         | 57,000    | 390.00    | 22,230,000  |  |
| アデランス       | 14,500    | 1,085.00  | 15,732,500  |  |
| 東京電力        | 907,700   | 130.00    | 118,001,000 |  |
| 中部電力        | 381,000   | 1,037.00  | 395,097,000 |  |
| 関西電力        | 471,900   | 641.00    | 302,487,900 |  |
| 中国電力        | 159,900   | 1,084.00  | 173,331,600 |  |
| 北陸電力        | 113,300   | 999.00    | 113,186,700 |  |
| 東北電力        | 288,900   | 669.00    | 193,274,100 |  |
| 四国電力        | 104,100   | 936.00    | 97,437,600  |  |
| 九州電力        | 255,400   | 674.00    | 172,139,600 |  |
| 北海道電力       | 108,200   | 671.00    | 72,602,200  |  |
| 沖縄電力        | 6,900     | 2,645.00  | 18,250,500  |  |
| 電源開発        | 71,800    | 2,176.00  | 156,236,800 |  |
| 東京瓦斯        | 1,388,000 | 428.00    | 594,064,000 |  |
| 大阪瓦斯        | 1,122,000 | 346.00    | 388,212,000 |  |
| 東邦瓦斯        | 294,000   | 523.00    | 153,762,000 |  |
| 北海道瓦斯       | 21,000    | 237.00    | 4,977,000   |  |
| 西部瓦斯        | 130,000   | 225.00    | 29,250,000  |  |
| 静岡瓦斯        | 30,000    | 559.00    | 16,770,000  |  |

|              |           |          |               |  |
|--------------|-----------|----------|---------------|--|
| 東武鉄道         | 656,000   | 418.00   | 274,208,000   |  |
| 相鉄ホールディングス   | 185,000   | 259.00   | 47,915,000    |  |
| 東京急行電鉄       | 680,000   | 370.00   | 251,600,000   |  |
| 京浜急行電鉄       | 297,000   | 725.00   | 215,325,000   |  |
| 小田急電鉄        | 370,000   | 813.00   | 300,810,000   |  |
| 京王電鉄         | 323,000   | 581.00   | 187,663,000   |  |
| 京成電鉄         | 186,000   | 691.00   | 128,526,000   |  |
| 富士急行         | 32,000    | 494.00   | 15,808,000    |  |
| 新京成電鉄        | 15,000    | 352.00   | 5,280,000     |  |
| 東日本旅客鉄道      | 201,100   | 5,180.00 | 1,041,698,000 |  |
| 西日本旅客鉄道      | 100,500   | 3,305.00 | 332,152,500   |  |
| 東海旅客鉄道       | 96,100    | 6,930.00 | 665,973,000   |  |
| 西日本鉄道        | 150,000   | 337.00   | 50,550,000    |  |
| ハマキョウレックス    | 3,300     | 2,453.00 | 8,094,900     |  |
| サカイ引越センター    | 2,100     | 1,670.00 | 3,507,000     |  |
| 近畿日本鉄道       | 1,044,000 | 303.00   | 316,332,000   |  |
| 阪急阪神ホールディングス | 776,000   | 417.00   | 323,592,000   |  |
| 南海電気鉄道       | 241,000   | 349.00   | 84,109,000    |  |
| 京阪電気鉄道       | 259,000   | 373.00   | 96,607,000    |  |
| 名糖運輸         | 4,700     | 605.00   | 2,843,500     |  |
| 名古屋鉄道        | 404,000   | 212.00   | 85,648,000    |  |
| 日本通運         | 458,000   | 292.00   | 133,736,000   |  |
| ヤマトホールディングス  | 235,300   | 1,219.00 | 286,830,700   |  |
| 山九           | 140,000   | 291.00   | 40,740,000    |  |
| 丸運           | 6,200     | 189.00   | 1,171,800     |  |
| 丸全昭和運輸       | 39,000    | 250.00   | 9,750,000     |  |
| センコー         | 46,000    | 331.00   | 15,226,000    |  |
| トナミホールディングス  | 24,000    | 189.00   | 4,536,000     |  |
| 日本梱包運輸倉庫     | 34,700    | 994.00   | 34,491,800    |  |
| 日本石油輸送       | 13,000    | 183.00   | 2,379,000     |  |
| 福山通運         | 70,000    | 433.00   | 30,310,000    |  |
| セイノーホールディングス | 89,000    | 490.00   | 43,610,000    |  |
| 神奈川中央交通      | 14,000    | 476.00   | 6,664,000     |  |
| 日立物流         | 24,100    | 1,305.00 | 31,450,500    |  |
| 日本郵船         | 919,000   | 137.00   | 125,903,000   |  |
| 商船三井         | 607,000   | 179.00   | 108,653,000   |  |
| 川崎汽船         | 442,000   | 97.00    | 42,874,000    |  |
| N S ユナイテッド海運 | 50,000    | 82.00    | 4,100,000     |  |
| 乾汽船          | 13,200    | 190.00   | 2,508,000     |  |
| 飯野海運         | 58,400    | 257.00   | 15,008,800    |  |
| 共栄タンカー       | 15,000    | 156.00   | 2,340,000     |  |
| 全日本空輸        | 2,099,000 | 162.00   | 340,038,000   |  |
| パスコ          | 11,000    | 216.00   | 2,376,000     |  |
| 日新           | 44,000    | 201.00   | 8,844,000     |  |
| 三菱倉庫         | 82,000    | 921.00   | 75,522,000    |  |
| 三井倉庫         | 54,000    | 256.00   | 13,824,000    |  |
| 住友倉庫         | 84,000    | 347.00   | 29,148,000    |  |
| 澁澤倉庫         | 27,000    | 228.00   | 6,156,000     |  |

|                      |         |            |             |  |
|----------------------|---------|------------|-------------|--|
| 東陽倉庫                 | 18,000  | 180.00     | 3,240,000   |  |
| 日本トランスシティ            | 24,000  | 284.00     | 6,816,000   |  |
| ケイヒン                 | 21,000  | 91.00      | 1,911,000   |  |
| 安田倉庫                 | 9,000   | 518.00     | 4,662,000   |  |
| 東洋埠頭                 | 33,000  | 120.00     | 3,960,000   |  |
| 宇徳                   | 7,800   | 218.00     | 1,700,400   |  |
| 上組                   | 128,000 | 641.00     | 82,048,000  |  |
| サンリツ                 | 3,000   | 524.00     | 1,572,000   |  |
| キムラユニティー             | 2,600   | 732.00     | 1,903,200   |  |
| キューソー流通システム          | 3,200   | 880.00     | 2,816,000   |  |
| 郵船ロジスティクス            | 9,100   | 689.00     | 6,269,900   |  |
| 近鉄エクスプレス             | 10,300  | 2,389.00   | 24,606,700  |  |
| 東海運                  | 7,300   | 217.00     | 1,584,100   |  |
| エーアイティー              | 900     | 1,068.00   | 961,200     |  |
| NECネットエスアイ           | 10,700  | 1,312.00   | 14,038,400  |  |
| システナ                 | 122     | 63,700.00  | 7,771,400   |  |
| 新日鉄住金ソリューションズ        | 7,600   | 1,634.00   | 12,418,400  |  |
| コア                   | 4,300   | 725.00     | 3,117,500   |  |
| ソフトクリエイティブホールディングス   | 1,200   | 1,271.00   | 1,525,200   |  |
| デジタルハーツ              | 2,600   | 723.00     | 1,879,800   |  |
| ITホールディングス           | 34,700  | 960.00     | 33,312,000  |  |
| ネオス                  | 26      | 46,400.00  | 1,206,400   |  |
| グリー                  | 58,800  | 1,408.00   | 82,790,400  |  |
| コーエーテクモホールディングス      | 22,600  | 634.00     | 14,328,400  |  |
| 三菱総合研究所              | 4,400   | 1,649.00   | 7,255,600   |  |
| ボルテージ                | 1,800   | 1,085.00   | 1,953,000   |  |
| KLab                 | 3,500   | 619.00     | 2,166,500   |  |
| ネクソン                 | 93,500  | 1,037.00   | 96,959,500  |  |
| ドワンゴ                 | 59      | 118,000.00 | 6,962,000   |  |
| ベリサーブ                | 7       | 124,100.00 | 868,700     |  |
| マクロミル                | 11,100  | 998.00     | 11,077,800  |  |
| ティーガイア               | 11,400  | 744.00     | 8,481,600   |  |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 3,700   | 1,370.00   | 5,069,000   |  |
| ザッパラス                | 63      | 69,100.00  | 4,353,300   |  |
| インターネットイニシアティブ       | 13,400  | 2,114.00   | 28,327,600  |  |
| ソネットエンタテインメント        | 13      | 563,000.00 | 7,319,000   |  |
| SRAホールディングス          | 6,100   | 884.00     | 5,392,400   |  |
| 朝日ネット                | 9,000   | 391.00     | 3,519,000   |  |
| パナソニック インフォメーションシステム | 2,700   | 1,858.00   | 5,016,600   |  |
| フェイス                 | 390     | 8,600.00   | 3,354,000   |  |
| 野村総合研究所              | 64,600  | 1,616.00   | 104,393,600 |  |
| サイバネットシステム           | 95      | 21,800.00  | 2,071,000   |  |
| インテージ                | 3,400   | 1,668.00   | 5,671,200   |  |
| シンプレクス・ホールディングス      | 192     | 25,810.00  | 4,955,520   |  |
| クレスコ                 | 2,600   | 534.00     | 1,388,400   |  |
| フジ・メディア・ホールディングス     | 1,189   | 126,600.00 | 150,527,400 |  |
| オービック                | 3,580   | 16,260.00  | 58,210,800  |  |
| TDCソフトウェアエンジニアリング    | 2,300   | 780.00     | 1,794,000   |  |

|                      |         |            |               |  |
|----------------------|---------|------------|---------------|--|
| ヤフー                  | 8,359   | 29,410.00  | 245,838,190   |  |
| トレンドマイクロ             | 45,300  | 2,185.00   | 98,980,500    |  |
| 日本オラクル               | 22,800  | 3,955.00   | 90,174,000    |  |
| アルファシステムズ            | 3,800   | 1,010.00   | 3,838,000     |  |
| フューチャーアーキテクト         | 138     | 29,910.00  | 4,127,580     |  |
| シーエーシー               | 7,000   | 672.00     | 4,704,000     |  |
| ソフトバンク・テクノロジー        | 2,700   | 705.00     | 1,903,500     |  |
| トーセ                  | 2,800   | 506.00     | 1,416,800     |  |
| オービックビジネスコンサルタント     | 2,900   | 4,340.00   | 12,586,000    |  |
| 伊藤忠テクノソリューションズ       | 13,500  | 3,945.00   | 53,257,500    |  |
| アイティフォー              | 12,800  | 284.00     | 3,635,200     |  |
| 東計電算                 | 2,000   | 1,104.00   | 2,208,000     |  |
| エクスネット               | 11      | 116,300.00 | 1,279,300     |  |
| 大塚商会                 | 10,200  | 6,910.00   | 70,482,000    |  |
| サイボウズ                | 210     | 25,150.00  | 5,281,500     |  |
| ソフトブレーン              | 171     | 8,190.00   | 1,400,490     |  |
| アグレックス               | 3,100   | 756.00     | 2,343,600     |  |
| 電通国際情報サービス           | 7,100   | 773.00     | 5,488,300     |  |
| ウェザーニューズ             | 3,000   | 2,881.00   | 8,643,000     |  |
| C I J                | 11,400  | 320.00     | 3,648,000     |  |
| WOWOW                | 35      | 182,300.00 | 6,380,500     |  |
| ネットワンシステムズ           | 51,600  | 915.00     | 47,214,000    |  |
| アルゴグラフィックス           | 4,200   | 1,006.00   | 4,225,200     |  |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 21,600  | 1,550.00   | 33,480,000    |  |
| 日本ユニシス               | 27,600  | 551.00     | 15,207,600    |  |
| 兼松エレクトロニクス           | 7,200   | 866.00     | 6,235,200     |  |
| 東京放送ホールディングス         | 68,400  | 811.00     | 55,472,400    |  |
| 日本テレビホールディングス        | 100,200 | 1,121.00   | 112,324,200   |  |
| テレビ朝日                | 28,900  | 1,141.00   | 32,974,900    |  |
| スカパーJ S A Tホールディングス  | 867     | 35,000.00  | 30,345,000    |  |
| テレビ東京ホールディングス        | 7,300   | 890.00     | 6,497,000     |  |
| アイ・ティー・シーネットワーク      | 9,700   | 597.00     | 5,790,900     |  |
| イー・アクセス              | 873     | 19,000.00  | 16,587,000    |  |
| NECモバイリング            | 4,200   | 3,100.00   | 13,020,000    |  |
| 日本電信電話               | 525,600 | 3,785.00   | 1,989,396,000 |  |
| K D D I              | 177,100 | 5,990.00   | 1,060,829,000 |  |
| 光通信                  | 10,500  | 4,065.00   | 42,682,500    |  |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ         | 9,403   | 126,600.00 | 1,190,419,800 |  |
| GMOインターネット           | 38,100  | 543.00     | 20,688,300    |  |
| 学研ホールディングス           | 34,000  | 200.00     | 6,800,000     |  |
| ゼンリン                 | 16,500  | 1,042.00   | 17,193,000    |  |
| 昭文社                  | 6,300   | 530.00     | 3,339,000     |  |
| 角川グループホールディングス       | 10,800  | 2,305.00   | 24,894,000    |  |
| インプレスホールディングス        | 9,400   | 118.00     | 1,109,200     |  |
| アイネット                | 5,000   | 587.00     | 2,935,000     |  |
| 松竹                   | 75,000  | 772.00     | 57,900,000    |  |
| 東宝                   | 81,400  | 1,414.00   | 115,099,600   |  |
| 東映                   | 48,000  | 438.00     | 21,024,000    |  |

|                      |         |            |               |  |
|----------------------|---------|------------|---------------|--|
| AOI Pro.             | 5,500   | 572.00     | 3,146,000     |  |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 705     | 244,600.00 | 172,443,000   |  |
| DTS                  | 11,800  | 1,086.00   | 12,814,800    |  |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 37,300  | 1,197.00   | 44,648,100    |  |
| シーイーシー               | 6,800   | 454.00     | 3,087,200     |  |
| カプコン                 | 21,900  | 1,637.00   | 35,850,300    |  |
| ジャステック               | 6,600   | 536.00     | 3,537,600     |  |
| SCSK                 | 23,300  | 1,335.00   | 31,105,500    |  |
| 日本システムウェア            | 3,800   | 310.00     | 1,178,000     |  |
| アイネス                 | 13,900  | 482.00     | 6,699,800     |  |
| TKC                  | 10,600  | 1,577.00   | 16,716,200    |  |
| 富士ソフト                | 15,000  | 1,565.00   | 23,475,000    |  |
| NSD                  | 20,800  | 756.00     | 15,724,800    |  |
| コナミ                  | 51,500  | 1,817.00   | 93,575,500    |  |
| 福井コンピュータホールディングス     | 1,600   | 411.00     | 657,600       |  |
| JBCCホールディングス         | 9,000   | 543.00     | 4,887,000     |  |
| ソフトバンク               | 517,000 | 3,105.00   | 1,605,285,000 |  |
| ハウスイ                 | 9,000   | 99.00      | 891,000       |  |
| 高千穂交易                | 4,800   | 873.00     | 4,190,400     |  |
| 伊藤忠食品                | 2,800   | 2,896.00   | 8,108,800     |  |
| エレマテック               | 7,600   | 1,076.00   | 8,177,600     |  |
| JALUX                | 3,200   | 849.00     | 2,716,800     |  |
| あらた                  | 26,000  | 368.00     | 9,568,000     |  |
| トーメンデバイス             | 1,700   | 1,788.00   | 3,039,600     |  |
| 東京エレクトロン デバイス        | 23      | 133,400.00 | 3,068,200     |  |
| 双日                   | 763,900 | 100.00     | 76,390,000    |  |
| アルフレッサ ホールディングス      | 30,700  | 3,780.00   | 116,046,000   |  |
| 横浜冷凍                 | 28,300  | 573.00     | 16,215,900    |  |
| 神栄                   | 14,000  | 105.00     | 1,470,000     |  |
| 山下医科器械               | 900     | 1,015.00   | 913,500       |  |
| ラサ商事                 | 5,000   | 357.00     | 1,785,000     |  |
| アルコニックス              | 3,000   | 1,357.00   | 4,071,000     |  |
| あい ホールディングス          | 18,300  | 503.00     | 9,204,900     |  |
| ダイワボウホールディングス        | 111,000 | 146.00     | 16,206,000    |  |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス  | 21,500  | 795.00     | 17,092,500    |  |
| 八洲電機                 | 7,600   | 340.00     | 2,584,000     |  |
| UKCホールディングス          | 6,800   | 1,373.00   | 9,336,400     |  |
| TOKAIホールディングス        | 55,800  | 362.00     | 20,199,600    |  |
| ミタチ産業                | 2,700   | 364.00     | 982,800       |  |
| シップヘルスケアホールディングス     | 14,800  | 2,405.00   | 35,594,000    |  |
| 富士興産                 | 4,100   | 447.00     | 1,832,700     |  |
| 協栄産業                 | 14,000  | 136.00     | 1,904,000     |  |
| 小野建                  | 10,000  | 626.00     | 6,260,000     |  |
| 佐島電機                 | 8,400   | 426.00     | 3,578,400     |  |
| エコートレーディング           | 2,800   | 683.00     | 1,912,400     |  |
| 伯東                   | 7,000   | 716.00     | 5,012,000     |  |
| コンドーテック              | 8,100   | 487.00     | 3,944,700     |  |
| 中山福                  | 6,600   | 624.00     | 4,118,400     |  |

|                   |         |          |               |  |
|-------------------|---------|----------|---------------|--|
| ナガイレーベン           | 15,100  | 1,221.00 | 18,437,100    |  |
| 三菱食品              | 10,400  | 2,087.00 | 21,704,800    |  |
| 松田産業              | 8,300   | 1,098.00 | 9,113,400     |  |
| メディパルホールディングス     | 122,900 | 1,053.00 | 129,413,700   |  |
| アドヴァン             | 6,800   | 807.00   | 5,487,600     |  |
| S P K             | 2,700   | 1,323.00 | 3,572,100     |  |
| アズワン              | 7,400   | 1,772.00 | 13,112,800    |  |
| スズデン              | 3,700   | 450.00   | 1,665,000     |  |
| 尾家産業              | 3,700   | 823.00   | 3,045,100     |  |
| シモジマ              | 7,000   | 1,029.00 | 7,203,000     |  |
| ドウシシャ             | 5,400   | 2,275.00 | 12,285,000    |  |
| 高速                | 6,800   | 680.00   | 4,624,000     |  |
| 黒田電気              | 14,100  | 920.00   | 12,972,000    |  |
| 丸文                | 9,100   | 327.00   | 2,975,700     |  |
| ハピネット             | 6,100   | 659.00   | 4,019,900     |  |
| トーメンエレクトロニクス      | 5,200   | 938.00   | 4,877,600     |  |
| エクセル              | 5,300   | 691.00   | 3,662,300     |  |
| マルカキカイ            | 3,700   | 943.00   | 3,489,100     |  |
| ガリバーインターナショナル     | 3,460   | 2,189.00 | 7,573,940     |  |
| 日本エム・ディ・エム        | 9,600   | 245.00   | 2,352,000     |  |
| 進和                | 6,800   | 898.00   | 6,106,400     |  |
| エスケイジャパン          | 2,800   | 253.00   | 708,400       |  |
| ダイトエレクトロン         | 5,300   | 347.00   | 1,839,100     |  |
| シークス              | 7,300   | 1,135.00 | 8,285,500     |  |
| 田中商事              | 3,500   | 416.00   | 1,456,000     |  |
| オーハシテクニカ          | 6,400   | 548.00   | 3,507,200     |  |
| マクニカ              | 5,900   | 1,621.00 | 9,563,900     |  |
| 白銅                | 3,700   | 741.00   | 2,741,700     |  |
| 伊藤忠商事             | 910,500 | 781.00   | 711,100,500   |  |
| 丸紅                | 998,000 | 497.00   | 496,006,000   |  |
| 高島                | 20,000  | 267.00   | 5,340,000     |  |
| F & A アクアホールディングス | 8,700   | 805.00   | 7,003,500     |  |
| 長瀬産業              | 64,600  | 853.00   | 55,103,800    |  |
| 蝶理                | 7,200   | 866.00   | 6,235,200     |  |
| 豊田通商              | 127,100 | 1,655.00 | 210,350,500   |  |
| 三共生興              | 19,500  | 263.00   | 5,128,500     |  |
| 兼松                | 243,000 | 91.00    | 22,113,000    |  |
| ツカモトコーポレーション      | 20,000  | 125.00   | 2,500,000     |  |
| 三井物産              | 985,100 | 1,099.00 | 1,082,624,900 |  |
| 日本紙パルプ商事          | 59,000  | 259.00   | 15,281,000    |  |
| 日立ハイテクノロジーズ       | 34,600  | 1,844.00 | 63,802,400    |  |
| カメイ               | 15,000  | 748.00   | 11,220,000    |  |
| 東都水産              | 19,000  | 118.00   | 2,242,000     |  |
| スターゼン             | 38,000  | 229.00   | 8,702,000     |  |
| 山善                | 43,800  | 473.00   | 20,717,400    |  |
| 椿本興業              | 12,000  | 227.00   | 2,724,000     |  |
| 住友商事              | 673,500 | 1,047.00 | 705,154,500   |  |
| 内田洋行              | 24,000  | 221.00   | 5,304,000     |  |

|                   |         |          |               |  |
|-------------------|---------|----------|---------------|--|
| 三菱商事              | 831,100 | 1,414.00 | 1,175,175,400 |  |
| 第一実業              | 24,000  | 337.00   | 8,088,000     |  |
| キヤノンマーケティングジャパン   | 38,000  | 1,065.00 | 40,470,000    |  |
| 西華産業              | 41,000  | 225.00   | 9,225,000     |  |
| 佐藤商事              | 10,200  | 506.00   | 5,161,200     |  |
| 菱洋エレクトロ           | 12,400  | 825.00   | 10,230,000    |  |
| 東京産業              | 11,500  | 251.00   | 2,886,500     |  |
| ユアサ商事             | 117,000 | 132.00   | 15,444,000    |  |
| 神鋼商事              | 29,000  | 140.00   | 4,060,000     |  |
| 阪和興業              | 114,000 | 271.00   | 30,894,000    |  |
| カナデン              | 11,000  | 495.00   | 5,445,000     |  |
| 菱電商事              | 16,000  | 458.00   | 7,328,000     |  |
| フルサト工業            | 6,700   | 736.00   | 4,931,200     |  |
| 岩谷産業              | 125,000 | 281.00   | 35,125,000    |  |
| すてきナイスグループ        | 50,000  | 174.00   | 8,700,000     |  |
| 昭光通商              | 41,000  | 117.00   | 4,797,000     |  |
| ニチモウ              | 16,000  | 157.00   | 2,512,000     |  |
| 極東貿易              | 13,000  | 121.00   | 1,573,000     |  |
| イワキ               | 17,000  | 169.00   | 2,873,000     |  |
| 三愛石油              | 27,000  | 359.00   | 9,693,000     |  |
| 稲畑産業              | 30,500  | 513.00   | 15,646,500    |  |
| G S I クレオス        | 28,000  | 101.00   | 2,828,000     |  |
| 明和産業              | 9,000   | 333.00   | 2,997,000     |  |
| 東邦ホールディングス        | 36,500  | 1,579.00 | 57,633,500    |  |
| サンゲツ              | 20,200  | 2,140.00 | 43,228,000    |  |
| ミツウロコグループホールディングス | 18,400  | 569.00   | 10,469,600    |  |
| シナネン              | 25,000  | 349.00   | 8,725,000     |  |
| 伊藤忠エネクス           | 25,200  | 411.00   | 10,357,200    |  |
| サンリオ              | 28,800  | 2,781.00 | 80,092,800    |  |
| サンワテクノス           | 5,600   | 639.00   | 3,578,400     |  |
| リョーサン             | 18,600  | 1,388.00 | 25,816,800    |  |
| 新光商事              | 12,500  | 693.00   | 8,662,500     |  |
| トーヨー              | 24,000  | 303.00   | 7,272,000     |  |
| 三信電気              | 16,300  | 578.00   | 9,421,400     |  |
| 東陽テクニカ            | 16,500  | 854.00   | 14,091,000    |  |
| モスフードサービス         | 15,000  | 1,546.00 | 23,190,000    |  |
| 加賀電子              | 12,400  | 770.00   | 9,548,000     |  |
| ソーダニッカ            | 12,000  | 338.00   | 4,056,000     |  |
| 立花エレテック           | 6,900   | 644.00   | 4,443,600     |  |
| P a l t a c       | 12,100  | 1,127.00 | 13,636,700    |  |
| ヤマタネ              | 57,000  | 102.00   | 5,814,000     |  |
| 丸紅建材リース           | 11,000  | 122.00   | 1,342,000     |  |
| 日鐵商事              | 26,000  | 188.00   | 4,888,000     |  |
| トラスコ中山            | 14,200  | 1,383.00 | 19,638,600    |  |
| オートバックスセブン        | 12,900  | 3,495.00 | 45,085,500    |  |
| 加藤産業              | 16,500  | 1,495.00 | 24,667,500    |  |
| イノテック             | 9,200   | 334.00   | 3,072,800     |  |
| イエローハット           | 10,800  | 1,032.00 | 11,145,600    |  |

|                  |         |            |             |  |
|------------------|---------|------------|-------------|--|
| 富士エレクトロニクス       | 5,900   | 1,089.00   | 6,425,100   |  |
| J Kホールディングス      | 9,600   | 446.00     | 4,281,600   |  |
| 日伝               | 4,700   | 2,148.00   | 10,095,600  |  |
| 北沢産業             | 9,500   | 154.00     | 1,463,000   |  |
| 杉本商事             | 6,200   | 762.00     | 4,724,400   |  |
| 因幡電機産業           | 13,500  | 2,174.00   | 29,349,000  |  |
| 住金物産             | 53,000  | 189.00     | 10,017,000  |  |
| ミスミグループ本社        | 42,300  | 1,895.00   | 80,158,500  |  |
| 江守商事             | 2,300   | 796.00     | 1,830,800   |  |
| アルテック            | 5,600   | 171.00     | 957,600     |  |
| タキヒヨー            | 17,000  | 444.00     | 7,548,000   |  |
| スズケン             | 43,900  | 2,539.00   | 111,462,100 |  |
| ジェコス             | 7,900   | 472.00     | 3,728,800   |  |
| ローソン             | 36,000  | 5,960.00   | 214,560,000 |  |
| サンエー             | 3,900   | 3,095.00   | 12,070,500  |  |
| 麒麟堂              | 4,900   | 534.00     | 2,616,600   |  |
| ダイユーエイト          | 2,100   | 578.00     | 1,213,800   |  |
| カワチ薬品            | 8,000   | 1,575.00   | 12,600,000  |  |
| エービーシー・マート       | 16,200  | 3,415.00   | 55,323,000  |  |
| ハードオフコーポレーション    | 5,500   | 529.00     | 2,909,500   |  |
| アスクル             | 7,900   | 1,256.00   | 9,922,400   |  |
| ゲオホールディングス       | 176     | 89,300.00  | 15,716,800  |  |
| ポイント             | 9,640   | 2,948.00   | 28,418,720  |  |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア   | 14,000  | 88.00      | 1,232,000   |  |
| くらコーポレーション       | 6,700   | 1,117.00   | 7,483,900   |  |
| キャンドゥ            | 60      | 104,800.00 | 6,288,000   |  |
| パル               | 3,350   | 4,405.00   | 14,756,750  |  |
| エディオン            | 42,400  | 348.00     | 14,755,200  |  |
| サーラコーポレーション      | 10,000  | 556.00     | 5,560,000   |  |
| あみやき亭            | 17      | 196,800.00 | 3,345,600   |  |
| ひらまつ             | 40      | 73,600.00  | 2,944,000   |  |
| ゲンキー             | 1,100   | 1,720.00   | 1,892,000   |  |
| 大黒天物産            | 1,900   | 2,444.00   | 4,643,600   |  |
| ハニーズ             | 10,030  | 1,172.00   | 11,755,160  |  |
| アルペン             | 8,700   | 1,445.00   | 12,571,500  |  |
| ビックカメラ           | 434     | 39,400.00  | 17,099,600  |  |
| DCMホールディングス      | 59,100  | 516.00     | 30,495,600  |  |
| Monotaro         | 7,600   | 2,095.00   | 15,922,000  |  |
| J. フロント リテイリング   | 270,000 | 438.00     | 118,260,000 |  |
| ドトール・日レスホールディングス | 18,200  | 968.00     | 17,617,600  |  |
| マツモトキヨシホールディングス  | 21,200  | 1,913.00   | 40,555,600  |  |
| ブロンコビリー          | 700     | 2,079.00   | 1,455,300   |  |
| スタートトゥデイ         | 20,700  | 1,098.00   | 22,728,600  |  |
| 物語コーポレーション       | 1,500   | 1,621.00   | 2,431,500   |  |
| ココカラファイン         | 11,900  | 2,704.00   | 32,177,600  |  |
| 三越伊勢丹ホールディングス    | 226,800 | 808.00     | 183,254,400 |  |
| ウエルシアホールディングス    | 4,000   | 2,416.00   | 9,664,000   |  |
| クリエイトSDホールディングス  | 4,800   | 2,205.00   | 10,584,000  |  |

|                   |         |          |               |  |
|-------------------|---------|----------|---------------|--|
| 丸善CHIホールディングス     | 3,300   | 230.00   | 759,000       |  |
| ブックオフコーポレーション     | 6,300   | 666.00   | 4,195,800     |  |
| あさひ               | 6,600   | 1,326.00 | 8,751,600     |  |
| 日本調剤              | 1,450   | 2,049.00 | 2,971,050     |  |
| コスモス薬品            | 5,000   | 7,130.00 | 35,650,000    |  |
| セブン&アイ・ホールディングス   | 477,400 | 2,392.00 | 1,141,940,800 |  |
| ツルハホールディングス       | 9,400   | 5,930.00 | 55,742,000    |  |
| サンマルクホールディングス     | 3,300   | 2,911.00 | 9,606,300     |  |
| フェリシモ             | 3,300   | 1,041.00 | 3,435,300     |  |
| トリドール             | 9,900   | 1,224.00 | 12,117,600    |  |
| クスリのアオキ           | 1,700   | 3,675.00 | 6,247,500     |  |
| メディカルシステムネットワーク   | 7,000   | 589.00   | 4,123,000     |  |
| 総合メディカル           | 2,800   | 2,769.00 | 7,753,200     |  |
| はるやま商事            | 4,800   | 401.00   | 1,924,800     |  |
| カップ・クリエイトホールディングス | 8,400   | 1,782.00 | 14,968,800    |  |
| ライトオン             | 8,500   | 693.00   | 5,890,500     |  |
| 良品計画              | 12,100  | 4,905.00 | 59,350,500    |  |
| 三城ホールディングス        | 14,100  | 458.00   | 6,457,800     |  |
| コナカ               | 13,400  | 704.00   | 9,433,600     |  |
| ハウス オブ ローゼ        | 1,300   | 1,265.00 | 1,644,500     |  |
| G-7ホールディングス       | 3,400   | 402.00   | 1,366,800     |  |
| イオン北海道            | 7,100   | 367.00   | 2,605,700     |  |
| コジマ               | 15,400  | 208.00   | 3,203,200     |  |
| ヒマラヤ              | 3,300   | 660.00   | 2,178,000     |  |
| コーナン商事            | 12,500  | 915.00   | 11,437,500    |  |
| エコス               | 3,900   | 509.00   | 1,985,100     |  |
| ワタミ               | 13,500  | 1,759.00 | 23,746,500    |  |
| マルシェ              | 2,800   | 722.00   | 2,021,600     |  |
| ドン・キホーテ           | 30,500  | 2,990.00 | 91,195,000    |  |
| メガネトップ            | 16,400  | 880.00   | 14,432,000    |  |
| 西松屋チェーン           | 25,000  | 641.00   | 16,025,000    |  |
| ゼンショーホールディングス     | 43,500  | 992.00   | 43,152,000    |  |
| 幸楽苑               | 7,000   | 1,190.00 | 8,330,000     |  |
| ハークスレイ            | 2,800   | 601.00   | 1,682,800     |  |
| サイゼリヤ             | 16,900  | 1,166.00 | 19,705,400    |  |
| ポプラ               | 4,000   | 517.00   | 2,068,000     |  |
| ユナイテッドアローズ        | 12,300  | 2,031.00 | 24,981,300    |  |
| ハイデイ日高            | 6,000   | 1,262.00 | 7,572,000     |  |
| 京都きもの友禅           | 7,600   | 964.00   | 7,326,400     |  |
| コロワイド             | 38,000  | 676.00   | 25,688,000    |  |
| 壺番屋               | 4,600   | 2,473.00 | 11,375,800    |  |
| トップカルチャー          | 4,200   | 379.00   | 1,591,800     |  |
| スギホールディングス        | 20,500  | 2,759.00 | 56,559,500    |  |
| スクロール             | 14,900  | 277.00   | 4,127,300     |  |
| ファミリーマート          | 35,100  | 3,845.00 | 134,959,500   |  |
| 木曽路               | 13,000  | 1,629.00 | 21,177,000    |  |
| 千趣会               | 20,600  | 515.00   | 10,609,000    |  |
| タカキュー             | 9,000   | 260.00   | 2,340,000     |  |

|                  |         |          |             |  |
|------------------|---------|----------|-------------|--|
| ケーヨー             | 21,400  | 450.00   | 9,630,000   |  |
| 上新電機             | 25,000  | 909.00   | 22,725,000  |  |
| 日本瓦斯             | 10,900  | 1,207.00 | 13,156,300  |  |
| ベスト電器            | 35,500  | 136.00   | 4,828,000   |  |
| マルエツ             | 23,000  | 271.00   | 6,233,000   |  |
| ロイヤルホールディングス     | 19,100  | 969.00   | 18,507,900  |  |
| 東天紅              | 8,000   | 202.00   | 1,616,000   |  |
| いなげや             | 12,700  | 978.00   | 12,420,600  |  |
| 島忠               | 25,800  | 1,606.00 | 41,434,800  |  |
| チヨダ              | 14,900  | 2,126.00 | 31,677,400  |  |
| ライフコーポレーション      | 7,800   | 1,269.00 | 9,898,200   |  |
| カスミ              | 23,400  | 522.00   | 12,214,800  |  |
| リンガーハット          | 10,300  | 1,040.00 | 10,712,000  |  |
| MrMax            | 11,400  | 320.00   | 3,648,000   |  |
| テンアライド           | 8,600   | 274.00   | 2,356,400   |  |
| AOKIホールディングス     | 10,100  | 1,634.00 | 16,503,400  |  |
| オークワ             | 16,000  | 1,164.00 | 18,624,000  |  |
| コメリ              | 15,600  | 1,985.00 | 30,966,000  |  |
| 青山商事             | 31,500  | 1,459.00 | 45,958,500  |  |
| しまむら             | 13,300  | 8,800.00 | 117,040,000 |  |
| CFSコーポレーション      | 7,600   | 359.00   | 2,728,400   |  |
| 高島屋              | 154,000 | 526.00   | 81,004,000  |  |
| 松屋               | 24,000  | 845.00   | 20,280,000  |  |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 59,000  | 893.00   | 52,687,000  |  |
| ニッセンホールディングス     | 20,600  | 314.00   | 6,468,400   |  |
| パルコ              | 19,300  | 810.00   | 15,633,000  |  |
| 丸井グループ           | 148,700 | 547.00   | 81,338,900  |  |
| 原信ナルスホールディングス    | 6,300   | 1,452.00 | 9,147,600   |  |
| ダイエー             | 70,450  | 162.00   | 11,412,900  |  |
| イズミヤ             | 41,000  | 402.00   | 16,482,000  |  |
| イオン              | 402,400 | 889.00   | 357,733,600 |  |
| ユニー              | 99,600  | 607.00   | 60,457,200  |  |
| イズミ              | 29,400  | 1,662.00 | 48,862,800  |  |
| 東武ストア            | 15,000  | 260.00   | 3,900,000   |  |
| 平和堂              | 21,000  | 1,132.00 | 23,772,000  |  |
| フジ               | 12,700  | 1,757.00 | 22,313,900  |  |
| ヤオコー             | 5,000   | 3,010.00 | 15,050,000  |  |
| ゼビオ              | 13,800  | 1,590.00 | 21,942,000  |  |
| ケーズホールディングス      | 28,500  | 1,893.00 | 53,950,500  |  |
| Olympic          | 7,600   | 758.00   | 5,760,800   |  |
| 日産東京販売ホールディングス   | 17,000  | 338.00   | 5,746,000   |  |
| アインファーマシーズ       | 6,300   | 5,610.00 | 35,343,000  |  |
| 元気寿司             | 3,500   | 1,011.00 | 3,538,500   |  |
| ヤマダ電機            | 55,530  | 3,385.00 | 187,969,050 |  |
| アークランドサカモト       | 7,400   | 1,145.00 | 8,473,000   |  |
| ニトリホールディングス      | 22,600  | 7,120.00 | 160,912,000 |  |
| グルメ杵屋            | 8,000   | 517.00   | 4,136,000   |  |
| 愛眼               | 9,100   | 300.00   | 2,730,000   |  |

|                   |           |            |               |  |
|-------------------|-----------|------------|---------------|--|
| 吉野家ホールディングス       | 309       | 100,100.00 | 30,930,900    |  |
| 松屋フーズ             | 5,500     | 1,466.00   | 8,063,000     |  |
| サガミチェーン           | 13,000    | 611.00     | 7,943,000     |  |
| プレナス              | 12,800    | 1,310.00   | 16,768,000    |  |
| ミニストップ            | 8,400     | 1,309.00   | 10,995,600    |  |
| アークス              | 15,700    | 1,791.00   | 28,118,700    |  |
| バロー               | 22,700    | 1,286.00   | 29,192,200    |  |
| ベルク               | 5,600     | 1,178.00   | 6,596,800     |  |
| 大庄                | 5,300     | 1,003.00   | 5,315,900     |  |
| ファーストリテイリング       | 22,900    | 17,790.00  | 407,391,000   |  |
| サンドラッグ            | 21,700    | 2,840.00   | 61,628,000    |  |
| 東京デリカ             | 3,800     | 1,130.00   | 4,294,000     |  |
| ヤマザワ              | 3,000     | 1,448.00   | 4,344,000     |  |
| やまや               | 2,000     | 1,152.00   | 2,304,000     |  |
| ベルーナ              | 14,250    | 630.00     | 8,977,500     |  |
| 島根銀行              | 2,600     | 1,089.00   | 2,831,400     |  |
| 新生銀行              | 889,000   | 99.00      | 88,011,000    |  |
| あおぞら銀行            | 355,000   | 250.00     | 88,750,000    |  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 8,640,600 | 363.00     | 3,136,537,800 |  |
| りそなホールディングス       | 993,300   | 322.00     | 319,842,600   |  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,236,000 | 227.00     | 507,572,000   |  |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 866,500   | 2,402.00   | 2,081,333,000 |  |
| 第四銀行              | 147,000   | 256.00     | 37,632,000    |  |
| 北越銀行              | 117,000   | 160.00     | 18,720,000    |  |
| 西日本シティ銀行          | 400,000   | 182.00     | 72,800,000    |  |
| 千葉銀行              | 440,000   | 458.00     | 201,520,000   |  |
| 横浜銀行              | 726,000   | 373.00     | 270,798,000   |  |
| 常陽銀行              | 436,000   | 382.00     | 166,552,000   |  |
| 群馬銀行              | 258,000   | 397.00     | 102,426,000   |  |
| 武蔵野銀行             | 18,400    | 2,419.00   | 44,509,600    |  |
| 千葉興業銀行            | 21,900    | 423.00     | 9,263,700     |  |
| 筑波銀行              | 47,400    | 275.00     | 13,035,000    |  |
| 東京都民銀行            | 21,600    | 715.00     | 15,444,000    |  |
| 七十七銀行             | 179,000   | 324.00     | 57,996,000    |  |
| 青森銀行              | 85,000    | 251.00     | 21,335,000    |  |
| 秋田銀行              | 78,000    | 236.00     | 18,408,000    |  |
| 山形銀行              | 69,000    | 361.00     | 24,909,000    |  |
| 岩手銀行              | 7,700     | 3,765.00   | 28,990,500    |  |
| 東邦銀行              | 96,000    | 269.00     | 25,824,000    |  |
| 東北銀行              | 61,000    | 115.00     | 7,015,000     |  |
| みちのく銀行            | 57,000    | 157.00     | 8,949,000     |  |
| ふくおかフィナンシャルグループ   | 463,000   | 315.00     | 145,845,000   |  |
| 静岡銀行              | 334,000   | 808.00     | 269,872,000   |  |
| 十六銀行              | 143,000   | 272.00     | 38,896,000    |  |
| スルガ銀行             | 111,000   | 883.00     | 98,013,000    |  |
| 八十二銀行             | 210,000   | 432.00     | 90,720,000    |  |
| 山梨中央銀行            | 70,000    | 325.00     | 22,750,000    |  |
| 大垣共立銀行            | 152,000   | 278.00     | 42,256,000    |  |

|                 |            |          |               |  |
|-----------------|------------|----------|---------------|--|
| 福井銀行            | 98,000     | 195.00   | 19,110,000    |  |
| 北國銀行            | 132,000    | 297.00   | 39,204,000    |  |
| 清水銀行            | 3,900      | 2,432.00 | 9,484,800     |  |
| 滋賀銀行            | 107,000    | 496.00   | 53,072,000    |  |
| 南都銀行            | 106,000    | 397.00   | 42,082,000    |  |
| 百五銀行            | 103,000    | 354.00   | 36,462,000    |  |
| 京都銀行            | 204,000    | 656.00   | 133,824,000   |  |
| 三重銀行            | 47,000     | 180.00   | 8,460,000     |  |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 799,000    | 123.00   | 98,277,000    |  |
| 広島銀行            | 337,000    | 266.00   | 89,642,000    |  |
| 山陰合同銀行          | 67,000     | 552.00   | 36,984,000    |  |
| 中国銀行            | 88,000     | 1,091.00 | 96,008,000    |  |
| 鳥取銀行            | 36,000     | 164.00   | 5,904,000     |  |
| 伊予銀行            | 122,000    | 639.00   | 77,958,000    |  |
| 百十四銀行           | 125,000    | 316.00   | 39,500,000    |  |
| 四国銀行            | 82,000     | 202.00   | 16,564,000    |  |
| 阿波銀行            | 100,000    | 505.00   | 50,500,000    |  |
| 鹿児島銀行           | 74,000     | 519.00   | 38,406,000    |  |
| 大分銀行            | 74,000     | 263.00   | 19,462,000    |  |
| 宮崎銀行            | 76,000     | 208.00   | 15,808,000    |  |
| 肥後銀行            | 88,000     | 476.00   | 41,888,000    |  |
| 佐賀銀行            | 69,000     | 189.00   | 13,041,000    |  |
| 十八銀行            | 73,000     | 207.00   | 15,111,000    |  |
| 沖縄銀行            | 8,600      | 3,450.00 | 29,670,000    |  |
| 琉球銀行            | 24,000     | 1,017.00 | 24,408,000    |  |
| 八千代銀行           | 5,900      | 1,475.00 | 8,702,500     |  |
| セブン銀行           | 427,600    | 239.00   | 102,196,400   |  |
| みずほフィナンシャルグループ  | 14,680,000 | 125.00   | 1,835,000,000 |  |
| 紀陽ホールディングス      | 455,000    | 115.00   | 52,325,000    |  |
| 山口フィナンシャルグループ   | 114,000    | 636.00   | 72,504,000    |  |
| 長野銀行            | 37,000     | 154.00   | 5,698,000     |  |
| 名古屋銀行           | 103,000    | 272.00   | 28,016,000    |  |
| 北洋銀行            | 172,100    | 227.00   | 39,066,700    |  |
| 愛知銀行            | 4,100      | 4,495.00 | 18,429,500    |  |
| 第三銀行            | 65,000     | 142.00   | 9,230,000     |  |
| 中京銀行            | 47,000     | 173.00   | 8,131,000     |  |
| 東日本銀行           | 55,000     | 169.00   | 9,295,000     |  |
| 大光銀行            | 40,000     | 224.00   | 8,960,000     |  |
| 愛媛銀行            | 72,000     | 211.00   | 15,192,000    |  |
| トマト銀行           | 44,000     | 152.00   | 6,688,000     |  |
| みなと銀行           | 103,000    | 153.00   | 15,759,000    |  |
| 京葉銀行            | 94,000     | 358.00   | 33,652,000    |  |
| 関西アーバン銀行        | 159,000    | 104.00   | 16,536,000    |  |
| 栃木銀行            | 57,000     | 285.00   | 16,245,000    |  |
| 北日本銀行           | 3,600      | 2,310.00 | 8,316,000     |  |
| 東和銀行            | 115,000    | 79.00    | 9,085,000     |  |
| 福島銀行            | 132,000    | 50.00    | 6,600,000     |  |
| 大東銀行            | 73,000     | 67.00    | 4,891,000     |  |

|                              |           |           |             |  |
|------------------------------|-----------|-----------|-------------|--|
| トモニホールディングス                  | 87,600    | 348.00    | 30,484,800  |  |
| フィデアホールディングス                 | 65,700    | 164.00    | 10,774,800  |  |
| 池田泉州ホールディングス                 | 94,200    | 479.00    | 45,121,800  |  |
| S B I ホールディングス               | 122,590   | 491.00    | 60,191,690  |  |
| ジャフコ                         | 14,600    | 1,525.00  | 22,265,000  |  |
| 大和証券グループ本社                   | 1,131,000 | 293.00    | 331,383,000 |  |
| 野村ホールディングス                   | 2,472,900 | 275.00    | 680,047,500 |  |
| 岡三証券グループ                     | 97,000    | 291.00    | 28,227,000  |  |
| 丸三証券                         | 38,900    | 231.00    | 8,985,900   |  |
| 東洋証券                         | 49,000    | 131.00    | 6,419,000   |  |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス         | 131,000   | 256.00    | 33,536,000  |  |
| 水戸証券                         | 40,000    | 139.00    | 5,560,000   |  |
| いちよし証券                       | 27,300    | 382.00    | 10,428,600  |  |
| 松井証券                         | 67,700    | 488.00    | 33,037,600  |  |
| だいこう証券ビジネス                   | 6,400     | 288.00    | 1,843,200   |  |
| マネックスグループ                    | 870       | 12,400.00 | 10,788,000  |  |
| カブドットコム証券                    | 46,500    | 224.00    | 10,416,000  |  |
| 極東証券                         | 15,300    | 560.00    | 8,568,000   |  |
| 岩井コスモホールディングス                | 13,600    | 280.00    | 3,808,000   |  |
| NK S J ホールディングス              | 238,600   | 1,512.00  | 360,763,200 |  |
| MS & AD インシュアランスグループホールディングス | 341,100   | 1,363.00  | 464,919,300 |  |
| ソニーフィナンシャルホールディングス           | 109,300   | 1,331.00  | 145,478,300 |  |
| 第一生命保険                       | 6,104     | 88,600.00 | 540,814,400 |  |
| 東京海上ホールディングス                 | 414,400   | 1,999.00  | 828,385,600 |  |
| T & D ホールディングス               | 415,900   | 844.00    | 351,019,600 |  |
| クレディセゾン                      | 93,400    | 1,889.00  | 176,432,600 |  |
| 芙蓉総合リース                      | 11,100    | 2,228.00  | 24,730,800  |  |
| 興銀リース                        | 16,200    | 1,901.00  | 30,796,200  |  |
| 東京センチュリーリース                  | 30,900    | 1,454.00  | 44,928,600  |  |
| 日本証券金融                       | 51,200    | 351.00    | 17,971,200  |  |
| 大阪証券金融                       | 29,900    | 155.00    | 4,634,500   |  |
| ポケットカード                      | 16,800    | 325.00    | 5,460,000   |  |
| リコーリース                       | 8,100     | 1,920.00  | 15,552,000  |  |
| イオンクレジットサービス                 | 47,100    | 1,710.00  | 80,541,000  |  |
| アコム                          | 23,270    | 1,957.00  | 45,539,390  |  |
| ジャックス                        | 75,000    | 288.00    | 21,600,000  |  |
| オリエントコーポレーション                | 235,500   | 118.00    | 27,789,000  |  |
| 日立キャピタル                      | 23,100    | 1,431.00  | 33,056,100  |  |
| オリックス                        | 59,400    | 7,730.00  | 459,162,000 |  |
| 三菱UFJリース                     | 29,070    | 3,275.00  | 95,204,250  |  |
| アサックス                        | 16        | 76,600.00 | 1,225,600   |  |
| NECキャピタルソリューション              | 5,400     | 1,058.00  | 5,713,200   |  |
| 日本駐車場開発                      | 1,257     | 4,270.00  | 5,367,390   |  |
| ヒューリック                       | 134,500   | 486.00    | 65,367,000  |  |
| 東京建物不動産販売                    | 5,900     | 251.00    | 1,480,900   |  |
| 三栄建築設計                       | 2,900     | 776.00    | 2,250,400   |  |
| 野村不動産ホールディングス                | 55,400    | 1,341.00  | 74,291,400  |  |
| 常和ホールディングス                   | 2,900     | 1,398.00  | 4,054,200   |  |

|                |         |            |               |  |
|----------------|---------|------------|---------------|--|
| パーク２４          | 59,400  | 1,282.00   | 76,150,800    |  |
| 三井不動産          | 507,000 | 1,531.00   | 776,217,000   |  |
| 三菱地所           | 799,000 | 1,454.00   | 1,161,746,000 |  |
| 平和不動産          | 23,600  | 879.00     | 20,744,400    |  |
| 東京建物           | 226,000 | 303.00     | 68,478,000    |  |
| ダイビル           | 35,300  | 590.00     | 20,827,000    |  |
| 東急不動産          | 234,000 | 410.00     | 95,940,000    |  |
| 京阪神ビルディング      | 17,100  | 356.00     | 6,087,600     |  |
| 住友不動産          | 274,000 | 2,033.00   | 557,042,000   |  |
| 東宝不動産          | 12,200  | 435.00     | 5,307,000     |  |
| 大京             | 179,000 | 189.00     | 33,831,000    |  |
| テーオーシー         | 44,400  | 406.00     | 18,026,400    |  |
| 東京楽天地          | 19,000  | 293.00     | 5,567,000     |  |
| フジ住宅           | 16,100  | 425.00     | 6,842,500     |  |
| 空港施設           | 12,000  | 358.00     | 4,296,000     |  |
| 明和地所           | 5,800   | 357.00     | 2,070,600     |  |
| 住友不動産販売        | 4,130   | 3,815.00   | 15,755,950    |  |
| ゴールドクレスト       | 10,340  | 1,213.00   | 12,542,420    |  |
| 東栄住宅           | 7,800   | 829.00     | 6,466,200     |  |
| 日本エスリード        | 4,600   | 646.00     | 2,971,600     |  |
| 東急リバブル         | 10,400  | 1,023.00   | 10,639,200    |  |
| 飯田産業           | 10,900  | 709.00     | 7,728,100     |  |
| 日神不動産          | 8,300   | 443.00     | 3,676,900     |  |
| アーネストワン        | 18,900  | 1,166.00   | 22,037,400    |  |
| タカラレーベン        | 14,100  | 829.00     | 11,688,900    |  |
| サンヨーハウジング名古屋   | 59      | 79,500.00  | 4,690,500     |  |
| イオンモール         | 52,300  | 1,881.00   | 98,376,300    |  |
| フージャースコーポレーション | 198     | 51,000.00  | 10,098,000    |  |
| タクトホーム         | 61      | 95,100.00  | 5,801,100     |  |
| トーセイ           | 211     | 26,890.00  | 5,673,790     |  |
| エヌ・ティ・ティ都市開発   | 732     | 61,800.00  | 45,237,600    |  |
| サンフロンティア不動産    | 166     | 17,220.00  | 2,858,520     |  |
| ランドビジネス        | 77      | 14,900.00  | 1,147,300     |  |
| グランディハウス       | 2,600   | 574.00     | 1,492,400     |  |
| 日本空港ビルデング      | 36,500  | 899.00     | 32,813,500    |  |
| 日本工営           | 41,000  | 278.00     | 11,398,000    |  |
| ネクスト           | 4,800   | 587.00     | 2,817,600     |  |
| 日本M&Aセンター      | 4,800   | 2,269.00   | 10,891,200    |  |
| ノバレーゼ          | 31      | 53,600.00  | 1,661,600     |  |
| アコーディア・ゴルフ     | 461     | 49,750.00  | 22,934,750    |  |
| タケエイ           | 1,200   | 1,579.00   | 1,894,800     |  |
| パソナグループ        | 120     | 51,000.00  | 6,120,000     |  |
| リンクアンドモチベーション  | 61      | 32,200.00  | 1,964,200     |  |
| エス・エム・エス       | 26      | 170,300.00 | 4,427,800     |  |
| テンプホールディングス    | 16,500  | 972.00     | 16,038,000    |  |
| クックパッド         | 2,400   | 2,286.00   | 5,486,400     |  |
| 学情             | 5,300   | 273.00     | 1,446,900     |  |
| スタジオアリス        | 5,600   | 1,242.00   | 6,955,200     |  |

|                  |         |            |             |  |
|------------------|---------|------------|-------------|--|
| シミックホールディングス     | 4,600   | 1,299.00   | 5,975,400   |  |
| NECフィールディング      | 9,800   | 946.00     | 9,270,800   |  |
| 総合警備保障           | 44,000  | 1,082.00   | 47,608,000  |  |
| カカクコム            | 18,800  | 2,902.00   | 54,557,600  |  |
| ルネサンス            | 6,000   | 528.00     | 3,168,000   |  |
| ツクイ              | 4,200   | 1,573.00   | 6,606,600   |  |
| エムスリー            | 285     | 145,700.00 | 41,524,500  |  |
| ベストブライダル         | 35      | 89,300.00  | 3,125,500   |  |
| ディー・エヌ・エー        | 53,300  | 2,614.00   | 139,326,200 |  |
| 博報堂DYホールディングス    | 15,350  | 5,170.00   | 79,359,500  |  |
| ぐるなび             | 8,400   | 880.00     | 7,392,000   |  |
| 一休               | 86      | 35,850.00  | 3,083,100   |  |
| ジャパンベストレスキューシステム | 15      | 78,200.00  | 1,173,000   |  |
| ジェイコムホールディングス    | 2,100   | 705.00     | 1,480,500   |  |
| PGMホールディングス      | 175     | 59,800.00  | 10,465,000  |  |
| JPホールディングス       | 3,600   | 996.00     | 3,585,600   |  |
| イーピーエス           | 72      | 214,300.00 | 15,429,600  |  |
| アミューズ            | 3,400   | 1,255.00   | 4,267,000   |  |
| ドリームインキュベータ      | 46      | 63,400.00  | 2,916,400   |  |
| ケネディクス           | 1,152   | 9,010.00   | 10,379,520  |  |
| 電通               | 109,900 | 1,977.00   | 217,272,300 |  |
| テイクアンドギヴ・ニーズ     | 646     | 6,720.00   | 4,341,120   |  |
| びあ               | 3,500   | 998.00     | 3,493,000   |  |
| イオンファンタジー        | 3,900   | 1,068.00   | 4,165,200   |  |
| みらかホールディングス      | 31,500  | 3,480.00   | 109,620,000 |  |
| アルプス技研           | 4,900   | 629.00     | 3,082,100   |  |
| サニックス            | 17,600  | 244.00     | 4,294,400   |  |
| ダイオーズ            | 2,200   | 501.00     | 1,102,200   |  |
| 日本空調サービス         | 3,000   | 722.00     | 2,166,000   |  |
| オリエンタルランド        | 32,600  | 10,320.00  | 336,432,000 |  |
| ダスキン             | 35,700  | 1,563.00   | 55,799,100  |  |
| 明光ネットワークジャパン     | 11,000  | 805.00     | 8,855,000   |  |
| ファルコSDホールディングス   | 6,600   | 933.00     | 6,157,800   |  |
| 秀英予備校            | 4,400   | 300.00     | 1,320,000   |  |
| 田谷               | 1,900   | 685.00     | 1,301,500   |  |
| ラウンドワン           | 39,700  | 374.00     | 14,847,800  |  |
| リゾートトラスト         | 18,700  | 1,430.00   | 26,741,000  |  |
| ビー・エム・エル         | 7,900   | 1,994.00   | 15,752,600  |  |
| ワタベウェディング        | 3,600   | 661.00     | 2,379,600   |  |
| もしもしホットライン       | 20,000  | 1,149.00   | 22,980,000  |  |
| 東急コミュニティー        | 3,100   | 2,811.00   | 8,714,100   |  |
| リソー教育            | 1,230   | 6,090.00   | 7,490,700   |  |
| ウェアハウス           | 4,200   | 223.00     | 936,600     |  |
| ユー・エス・エス         | 15,750  | 8,040.00   | 126,630,000 |  |
| 東京個別指導学院         | 6,000   | 146.00     | 876,000     |  |
| テー・オー・ダブリュー      | 4,000   | 507.00     | 2,028,000   |  |
| セントラルスポーツ        | 3,700   | 1,162.00   | 4,299,400   |  |
| フルキャストホールディングス   | 114     | 13,620.00  | 1,552,680   |  |

|              |             |          |                 |  |
|--------------|-------------|----------|-----------------|--|
| リゾートソリューション  | 13,000      | 161.00   | 2,093,000       |  |
| リロ・ホールディング   | 3,700       | 2,713.00 | 10,038,100      |  |
| エイチ・アイ・エス    | 9,900       | 2,409.00 | 23,849,100      |  |
| 共立メンテナンス     | 6,300       | 1,707.00 | 10,754,100      |  |
| イチネンホールディングス | 14,100      | 432.00   | 6,091,200       |  |
| 建設技術研究所      | 6,700       | 477.00   | 3,195,900       |  |
| 燦ホールディングス    | 2,600       | 1,366.00 | 3,551,600       |  |
| スバル興業        | 9,000       | 246.00   | 2,214,000       |  |
| 東京テアトル       | 46,000      | 102.00   | 4,692,000       |  |
| よみうりランド      | 24,000      | 252.00   | 6,048,000       |  |
| 東京都競馬        | 93,000      | 115.00   | 10,695,000      |  |
| カナモト         | 15,000      | 881.00   | 13,215,000      |  |
| 東京ドーム        | 100,000     | 253.00   | 25,300,000      |  |
| トランス・コスモス    | 15,800      | 970.00   | 15,326,000      |  |
| 乃村工藝社        | 24,000      | 256.00   | 6,144,000       |  |
| 藤田観光         | 31,000      | 260.00   | 8,060,000       |  |
| 日本管財         | 4,500       | 1,515.00 | 6,817,500       |  |
| トーカイ         | 4,900       | 1,974.00 | 9,672,600       |  |
| 白洋舎          | 14,000      | 210.00   | 2,940,000       |  |
| セコム          | 117,300     | 4,065.00 | 476,824,500     |  |
| セントラル警備保障    | 5,400       | 786.00   | 4,244,400       |  |
| 丹青社          | 14,000      | 249.00   | 3,486,000       |  |
| メイテック        | 18,700      | 1,777.00 | 33,229,900      |  |
| アサツー ディ・ケイ   | 19,900      | 1,967.00 | 39,143,300      |  |
| 応用地質         | 12,700      | 946.00   | 12,014,200      |  |
| 船井総合研究所      | 12,400      | 525.00   | 6,510,000       |  |
| 進学会          | 5,800       | 296.00   | 1,716,800       |  |
| ベネッセホールディングス | 36,800      | 3,800.00 | 139,840,000     |  |
| イオンディライト     | 13,600      | 1,724.00 | 23,446,400      |  |
| ナック          | 3,000       | 1,840.00 | 5,520,000       |  |
| ニチイ学館        | 23,600      | 730.00   | 17,228,000      |  |
| ダイセキ         | 19,500      | 1,209.00 | 23,575,500      |  |
| 合計           | 176,111,841 | —        | 115,700,829,489 |  |

## 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。

[次へ](#)

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

| 項目          | 平成24年10月 1日現在<br>金額(円) |
|-------------|------------------------|
| 資産の部        |                        |
| 流動資産        |                        |
| コール・ローン     | 1,376,076,820          |
| 国債証券        | 154,622,424,400        |
| 地方債証券       | 13,310,852,954         |
| 特殊債券        | 18,963,893,178         |
| 社債券         | 13,550,672,890         |
| 派生商品評価勘定    | 109,370                |
| 未収入金        | 1,111,319,200          |
| 未収利息        | 398,170,425            |
| 前払費用        | 9,721,034              |
| 差入委託証拠金     | 390,000                |
| 流動資産合計      | 203,343,630,271        |
| 資産合計        | 203,343,630,271        |
| 負債の部        |                        |
| 流動負債        |                        |
| 未払金         | 2,008,824,900          |
| 未払解約金       | 24,209,025             |
| 流動負債合計      | 2,033,033,925          |
| 負債合計        | 2,033,033,925          |
| 純資産の部       |                        |
| 元本等         |                        |
| 元本          | 160,787,231,334        |
| 剰余金         |                        |
| 剰余金又は欠損金（△） | 40,523,365,012         |
| 元本等合計       | 201,310,596,346        |
| 純資産合計       | 201,310,596,346        |
| 負債純資産合計     | 203,343,630,271        |

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                      | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                                            |
|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法   | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br/>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>債券先物取引<br/>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p>                                                                  |

|                |                                                                                       |
|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> <p>派生商品取引等損益の計上基準<br/>約定日基準で計上しております。</p> |
|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------|

## (貸借対照表に関する注記)

|                          | 平成24年10月 1日現在    |
|--------------------------|------------------|
| 1. 計算期間の期首元本額            | 146,902,519,359円 |
| 計算期間中の追加設定元本額            | 35,875,312,086円  |
| 計算期間中の一部解約元本額            | 21,990,600,111円  |
| 計算日の元本額                  | 160,787,231,334円 |
| 計算日の元本額の内訳               |                  |
| エマージング株式オープン             | 10,940,920円      |
| SBI資産設計オープン（資産成長型）       | 572,422,315円     |
| SBI資産設計オープン（分配型）         | 15,484,954円      |
| SMT 国内債券インデックス・オープン      | 2,278,098,995円   |
| 世界経済インデックスファンド           | 73,612,756円      |
| マイセレクション25               | 173,001,781円     |
| マイセレクション50               | 146,016,383円     |
| マイセレクション75               | 42,948,944円      |
| DCマイセレクション25             | 8,941,040,977円   |
| DCマイセレクション50             | 10,465,674,303円  |
| DCマイセレクション75             | 2,702,980,850円   |
| DC日本債券インデックス・オープン        | 374,356,445円     |
| DC日本債券インデックス・オープンS       | 38,988,549,983円  |
| DC日本債券インデックス・オープンP       | 12,633,530,617円  |
| DCマイセレクションS25            | 2,528,265,379円   |
| DCマイセレクションS50            | 2,909,930,028円   |
| DCマイセレクションS75            | 507,207,229円     |
| DCターゲット・イヤー ファンド2015     | 37,333,782円      |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025     | 505,252,358円     |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035     | 238,817,959円     |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045     | 47,216,808円      |
| DC世界経済インデックスファンド         | 18,546,368円      |
| 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）   | 10,281,365,013円  |
| 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）   | 64,411,133円      |
| マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用） | 495,448,104円     |
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用） | 62,070,187円      |
| 国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）   | 12,040,806円      |
| 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）   | 12,810,583円      |
| マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用） | 2,442,714円       |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用）     | 1,955,991,732円   |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用）     | 3,001,414,823円   |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用）     | 8,923,599,040円   |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用）     | 802,883,201円     |

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)    | 14,700,851,636円  |
| バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)  | 1,551,266,840円   |
| バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)    | 5,310,704,908円   |
| 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)         | 3,623,529,796円   |
| 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)         | 5,024,361,048円   |
| バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)    | 2,248,710,603円   |
| グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用) | 1,977,864,988円   |
| バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)    | 2,702,397,850円   |
| バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)    | 3,618,230,299円   |
| 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)       | 288,592,867円     |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1          | 1,570,904,455円   |
| 日本債券ファンド・シリーズ1                | 6,114,308,059円   |
| コア投資戦略ファンド (安定型)              | 1,937,541,382円   |
| コア投資戦略ファンド (成長型)              | 292,259,133円     |
| 2. 計算日における受益権総数               | 160,787,231,334口 |
| 3. 1口当たり純資産額                  | 1.2520円          |
| (1万口当たり純資産額)                  | (12,520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24年10月 1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。<br>これらは、市場リスク（金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。<br>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制      | 運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。<br>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24年10月 1日現在 |
|--|---------------|
|--|---------------|

|                        |                                                                                                                                                                                                                                     |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額     | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                                                                                                                 |
| 2. 時価の算定方法             | <p>(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>                            |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 4. 金銭債権の計算日後の償還予定額     | 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。                                                                                                                                                                                                              |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種類    | 平成24年10月 1日現在      |
|-------|--------------------|
|       | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券  | 283,906,500        |
| 地方債証券 | 17,267,572         |
| 特殊債券  | 53,698,946         |
| 社債券   | 75,054,940         |
| 合計    | 429,927,958        |

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年10月1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24年10月 1日現在 |       |             |             |
|------|---------------|---------------|-------|-------------|-------------|
|      |               | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|      |               |               | うち1年超 |             |             |
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買 建 | 288,430,630   | —     | 288,540,000 | 109,370     |
|      | 合計            | 288,430,630   | —     | 288,540,000 | 109,370     |

## (注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しており

ます。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

## II. ヘッジ会計が適用されているもの

| 平成24年10月 1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24年10月 1日現在 |
|---------------|
| 該当事項はありません。   |

[次へ](#)

## (3)附属明細表(平成24年10月1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   | 銘柄            | 券面総額(円)       | 評価額(円)        | 備考 |
|------|---------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 第310回利付国債（2年） | 730,000,000   | 730,854,100   |    |
|      | 第311回利付国債（2年） | 780,000,000   | 780,975,000   |    |
|      | 第312回利付国債（2年） | 860,000,000   | 860,051,600   |    |
|      | 第313回利付国債（2年） | 1,000,000,000 | 1,000,060,000 |    |
|      | 第315回利付国債（2年） | 390,000,000   | 390,027,300   |    |
|      | 第316回利付国債（2年） | 700,000,000   | 700,056,000   |    |
|      | 第317回利付国債（2年） | 530,000,000   | 530,042,400   |    |
|      | 第318回利付国債（2年） | 860,000,000   | 860,068,800   |    |
|      | 第319回利付国債（2年） | 700,000,000   | 700,063,000   |    |
|      | 第320回利付国債（2年） | 810,000,000   | 810,072,900   |    |
|      | 第78回利付国債（5年）  | 390,000,000   | 393,802,500   |    |
|      | 第79回利付国債（5年）  | 170,000,000   | 171,246,100   |    |
|      | 第80回利付国債（5年）  | 480,000,000   | 484,099,200   |    |
|      | 第81回利付国債（5年）  | 1,270,000,000 | 1,283,055,600 |    |
|      | 第82回利付国債（5年）  | 1,590,000,000 | 1,608,650,700 |    |
|      | 第83回利付国債（5年）  | 560,000,000   | 567,705,600   |    |
|      | 第84回利付国債（5年）  | 1,650,000,000 | 1,667,061,000 |    |
|      | 第85回利付国債（5年）  | 1,380,000,000 | 1,396,366,800 |    |
|      | 第86回利付国債（5年）  | 300,000,000   | 302,970,000   |    |
|      | 第87回利付国債（5年）  | 2,140,000,000 | 2,159,131,600 |    |
|      | 第88回利付国債（5年）  | 1,640,000,000 | 1,656,301,600 |    |
|      | 第89回利付国債（5年）  | 1,410,000,000 | 1,421,632,500 |    |
|      | 第90回利付国債（5年）  | 220,000,000   | 221,218,800   |    |
|      | 第91回利付国債（5年）  | 200,000,000   | 201,772,000   |    |
|      | 第92回利付国債（5年）  | 1,260,000,000 | 1,267,446,600 |    |
|      | 第93回利付国債（5年）  | 1,040,000,000 | 1,053,156,000 |    |
|      | 第94回利付国債（5年）  | 1,110,000,000 | 1,127,771,100 |    |
|      | 第95回利付国債（5年）  | 620,000,000   | 630,471,800   |    |
|      | 第96回利付国債（5年）  | 900,000,000   | 912,096,000   |    |
|      | 第97回利付国債（5年）  | 1,270,000,000 | 1,282,903,200 |    |
|      | 第99回利付国債（5年）  | 2,020,000,000 | 2,041,088,800 |    |
|      | 第100回利付国債（5年） | 100,000,000   | 100,650,000   |    |
|      | 第101回利付国債（5年） | 1,820,000,000 | 1,839,037,200 |    |
|      | 第102回利付国債（5年） | 730,000,000   | 734,584,400   |    |
|      | 第103回利付国債（5年） | 1,600,000,000 | 1,609,552,000 |    |
|      | 第104回利付国債（5年） | 130,000,000   | 130,200,200   |    |
|      | 第105回利付国債（5年） | 2,210,000,000 | 2,212,055,300 |    |
|      | 第106回利付国債（5年） | 290,000,000   | 290,069,600   |    |
|      | 第1回利付国債（40年）  | 150,000,000   | 165,538,500   |    |
|      | 第2回利付国債（40年）  | 300,000,000   | 314,640,000   |    |
|      | 第3回利付国債（40年）  | 340,000,000   | 354,939,600   |    |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第4回利付国債（40年）   | 490,000,000   | 509,639,200   |  |
| 第5回利付国債（40年）   | 220,000,000   | 215,949,800   |  |
| 第256回利付国債（10年） | 1,720,000,000 | 1,747,210,400 |  |
| 第257回利付国債（10年） | 660,000,000   | 669,636,000   |  |
| 第258回利付国債（10年） | 210,000,000   | 213,689,700   |  |
| 第259回利付国債（10年） | 940,000,000   | 959,251,200   |  |
| 第260回利付国債（10年） | 790,000,000   | 810,318,800   |  |
| 第261回利付国債（10年） | 510,000,000   | 524,861,400   |  |
| 第262回利付国債（10年） | 480,000,000   | 494,808,000   |  |
| 第263回利付国債（10年） | 410,000,000   | 422,095,000   |  |
| 第264回利付国債（10年） | 1,750,000,000 | 1,798,195,000 |  |
| 第265回利付国債（10年） | 530,000,000   | 546,445,900   |  |
| 第266回利付国債（10年） | 470,000,000   | 483,545,400   |  |
| 第267回利付国債（10年） | 590,000,000   | 605,699,900   |  |
| 第268回利付国債（10年） | 760,000,000   | 786,204,800   |  |
| 第269回利付国債（10年） | 1,350,000,000 | 1,389,919,500 |  |
| 第270回利付国債（10年） | 1,180,000,000 | 1,218,456,200 |  |
| 第271回利付国債（10年） | 560,000,000   | 576,738,400   |  |
| 第272回利付国債（10年） | 530,000,000   | 550,362,600   |  |
| 第273回利付国債（10年） | 1,320,000,000 | 1,374,608,400 |  |
| 第274回利付国債（10年） | 530,000,000   | 553,680,400   |  |
| 第275回利付国債（10年） | 280,000,000   | 291,611,600   |  |
| 第276回利付国債（10年） | 480,000,000   | 502,982,400   |  |
| 第277回利付国債（10年） | 410,000,000   | 431,057,600   |  |
| 第278回利付国債（10年） | 720,000,000   | 761,940,000   |  |
| 第279回利付国債（10年） | 440,000,000   | 468,666,000   |  |
| 第280回利付国債（10年） | 1,080,000,000 | 1,151,042,400 |  |
| 第281回利付国債（10年） | 750,000,000   | 802,110,000   |  |
| 第282回利付国債（10年） | 1,260,000,000 | 1,338,019,200 |  |
| 第283回利付国債（10年） | 680,000,000   | 724,784,800   |  |
| 第284回利付国債（10年） | 1,360,000,000 | 1,448,563,200 |  |
| 第285回利付国債（10年） | 2,490,000,000 | 2,659,818,000 |  |
| 第286回利付国債（10年） | 1,140,000,000 | 1,226,571,600 |  |
| 第287回利付国債（10年） | 540,000,000   | 583,534,800   |  |
| 第288回利付国債（10年） | 1,540,000,000 | 1,654,360,400 |  |
| 第289回利付国債（10年） | 1,710,000,000 | 1,824,228,000 |  |
| 第290回利付国債（10年） | 870,000,000   | 925,131,900   |  |
| 第291回利付国債（10年） | 420,000,000   | 444,351,600   |  |
| 第292回利付国債（10年） | 620,000,000   | 669,327,200   |  |
| 第293回利付国債（10年） | 710,000,000   | 772,196,000   |  |
| 第294回利付国債（10年） | 810,000,000   | 876,387,600   |  |
| 第295回利付国債（10年） | 300,000,000   | 321,210,000   |  |
| 第296回利付国債（10年） | 1,830,000,000 | 1,961,540,400 |  |
| 第297回利付国債（10年） | 720,000,000   | 768,074,400   |  |
| 第298回利付国債（10年） | 1,160,000,000 | 1,230,377,200 |  |
| 第299回利付国債（10年） | 970,000,000   | 1,029,189,400 |  |
| 第300回利付国債（10年） | 730,000,000   | 783,771,800   |  |
| 第301回利付国債（10年） | 1,090,000,000 | 1,171,433,900 |  |

|                |               |               |  |
|----------------|---------------|---------------|--|
| 第302回利付国債（10年） | 200,000,000   | 213,632,000   |  |
| 第303回利付国債（10年） | 1,180,000,000 | 1,261,231,200 |  |
| 第304回利付国債（10年） | 550,000,000   | 584,133,000   |  |
| 第305回利付国債（10年） | 1,660,000,000 | 1,763,501,000 |  |
| 第306回利付国債（10年） | 1,480,000,000 | 1,582,623,200 |  |
| 第308回利付国債（10年） | 600,000,000   | 637,062,000   |  |
| 第309回利付国債（10年） | 1,250,000,000 | 1,308,112,500 |  |
| 第310回利付国債（10年） | 1,330,000,000 | 1,379,875,000 |  |
| 第311回利付国債（10年） | 160,000,000   | 163,488,000   |  |
| 第312回利付国債（10年） | 1,410,000,000 | 1,483,179,000 |  |
| 第313回利付国債（10年） | 1,250,000,000 | 1,323,637,500 |  |
| 第314回利付国債（10年） | 680,000,000   | 708,798,000   |  |
| 第315回利付国債（10年） | 1,140,000,000 | 1,196,623,800 |  |
| 第316回利付国債（10年） | 620,000,000   | 645,395,200   |  |
| 第317回利付国債（10年） | 700,000,000   | 727,916,000   |  |
| 第318回利付国債（10年） | 1,650,000,000 | 1,701,067,500 |  |
| 第319回利付国債（10年） | 600,000,000   | 622,926,000   |  |
| 第320回利付国債（10年） | 1,980,000,000 | 2,037,578,400 |  |
| 第321回利付国債（10年） | 1,500,000,000 | 1,539,915,000 |  |
| 第322回利付国債（10年） | 1,050,000,000 | 1,068,627,000 |  |
| 第323回利付国債（10年） | 930,000,000   | 944,331,300   |  |
| 第324回利付国債（10年） | 1,650,000,000 | 1,659,718,500 |  |
| 第325回利付国債（10年） | 240,000,000   | 240,888,000   |  |
| 第1回利付国債（30年）   | 40,000,000    | 47,873,600    |  |
| 第2回利付国債（30年）   | 160,000,000   | 181,355,200   |  |
| 第3回利付国債（30年）   | 120,000,000   | 134,036,400   |  |
| 第4回利付国債（30年）   | 110,000,000   | 133,090,100   |  |
| 第5回利付国債（30年）   | 50,000,000    | 54,895,500    |  |
| 第6回利付国債（30年）   | 190,000,000   | 214,462,500   |  |
| 第7回利付国債（30年）   | 180,000,000   | 200,014,200   |  |
| 第8回利付国債（30年）   | 50,000,000    | 51,249,500    |  |
| 第9回利付国債（30年）   | 150,000,000   | 143,337,000   |  |
| 第10回利付国債（30年）  | 120,000,000   | 108,166,800   |  |
| 第11回利付国債（30年）  | 90,000,000    | 90,345,600    |  |
| 第12回利付国債（30年）  | 120,000,000   | 128,611,200   |  |
| 第13回利付国債（30年）  | 190,000,000   | 200,134,600   |  |
| 第14回利付国債（30年）  | 300,000,000   | 336,993,000   |  |
| 第15回利付国債（30年）  | 280,000,000   | 319,578,000   |  |
| 第16回利付国債（30年）  | 220,000,000   | 251,158,600   |  |
| 第17回利付国債（30年）  | 210,000,000   | 235,985,400   |  |
| 第18回利付国債（30年）  | 300,000,000   | 331,410,000   |  |
| 第19回利付国債（30年）  | 180,000,000   | 198,835,200   |  |
| 第20回利付国債（30年）  | 200,000,000   | 228,310,000   |  |
| 第21回利付国債（30年）  | 220,000,000   | 242,778,800   |  |
| 第22回利付国債（30年）  | 220,000,000   | 251,202,600   |  |
| 第23回利付国債（30年）  | 230,000,000   | 262,648,500   |  |
| 第24回利付国債（30年）  | 190,000,000   | 216,989,500   |  |
| 第25回利付国債（30年）  | 280,000,000   | 308,551,600   |  |

|               |             |               |  |
|---------------|-------------|---------------|--|
| 第26回利付国債（30年） | 440,000,000 | 493,209,200   |  |
| 第27回利付国債（30年） | 450,000,000 | 513,544,500   |  |
| 第28回利付国債（30年） | 370,000,000 | 422,221,800   |  |
| 第29回利付国債（30年） | 570,000,000 | 638,422,800   |  |
| 第30回利付国債（30年） | 440,000,000 | 483,326,800   |  |
| 第31回利付国債（30年） | 560,000,000 | 602,851,200   |  |
| 第32回利付国債（30年） | 680,000,000 | 745,905,600   |  |
| 第33回利付国債（30年） | 680,000,000 | 700,733,200   |  |
| 第34回利付国債（30年） | 780,000,000 | 837,135,000   |  |
| 第35回利付国債（30年） | 840,000,000 | 862,940,400   |  |
| 第36回利付国債（30年） | 980,000,000 | 1,005,146,800 |  |
| 第37回利付国債（30年） | 170,000,000 | 170,324,700   |  |
| 第24回利付国債（20年） | 20,000,000  | 21,343,000    |  |
| 第25回利付国債（20年） | 60,000,000  | 63,504,000    |  |
| 第26回利付国債（20年） | 20,000,000  | 21,730,000    |  |
| 第27回利付国債（20年） | 50,000,000  | 54,816,500    |  |
| 第28回利付国債（20年） | 20,000,000  | 22,407,800    |  |
| 第29回利付国債（20年） | 60,000,000  | 67,287,000    |  |
| 第30回利付国債（20年） | 80,000,000  | 88,532,800    |  |
| 第31回利付国債（20年） | 80,000,000  | 89,340,000    |  |
| 第32回利付国債（20年） | 50,000,000  | 56,182,500    |  |
| 第33回利付国債（20年） | 140,000,000 | 160,295,800   |  |
| 第34回利付国債（20年） | 50,000,000  | 57,395,500    |  |
| 第35回利付国債（20年） | 10,000,000  | 11,390,600    |  |
| 第36回利付国債（20年） | 70,000,000  | 79,692,900    |  |
| 第37回利付国債（20年） | 70,000,000  | 80,037,300    |  |
| 第38回利付国債（20年） | 20,000,000  | 22,688,200    |  |
| 第39回利付国債（20年） | 500,000,000 | 564,510,000   |  |
| 第40回利付国債（20年） | 100,000,000 | 111,915,000   |  |
| 第41回利付国債（20年） | 330,000,000 | 354,195,600   |  |
| 第42回利付国債（20年） | 80,000,000  | 91,515,200    |  |
| 第43回利付国債（20年） | 140,000,000 | 164,047,800   |  |
| 第44回利付国債（20年） | 170,000,000 | 195,576,500   |  |
| 第45回利付国債（20年） | 290,000,000 | 331,533,800   |  |
| 第46回利付国債（20年） | 170,000,000 | 192,045,600   |  |
| 第47回利付国債（20年） | 90,000,000  | 101,917,800   |  |
| 第48回利付国債（20年） | 130,000,000 | 150,400,900   |  |
| 第49回利付国債（20年） | 140,000,000 | 157,553,200   |  |
| 第50回利付国債（20年） | 220,000,000 | 243,925,000   |  |
| 第51回利付国債（20年） | 100,000,000 | 111,687,000   |  |
| 第52回利付国債（20年） | 110,000,000 | 123,986,500   |  |
| 第53回利付国債（20年） | 80,000,000  | 90,240,800    |  |
| 第54回利付国債（20年） | 200,000,000 | 227,342,000   |  |
| 第55回利付国債（20年） | 140,000,000 | 156,569,000   |  |
| 第56回利付国債（20年） | 150,000,000 | 167,809,500   |  |
| 第57回利付国債（20年） | 240,000,000 | 266,311,200   |  |
| 第58回利付国債（20年） | 300,000,000 | 332,910,000   |  |
| 第59回利付国債（20年） | 200,000,000 | 217,920,000   |  |

|                    |             |             |  |
|--------------------|-------------|-------------|--|
| 第 6 0 回利付国債（20年）   | 350,000,000 | 371,052,500 |  |
| 第 6 1 回利付国債（20年）   | 240,000,000 | 244,514,400 |  |
| 第 6 2 回利付国債（20年）   | 250,000,000 | 249,015,000 |  |
| 第 6 3 回利付国債（20年）   | 200,000,000 | 219,732,000 |  |
| 第 6 4 回利付国債（20年）   | 320,000,000 | 354,585,600 |  |
| 第 6 5 回利付国債（20年）   | 300,000,000 | 332,247,000 |  |
| 第 6 6 回利付国債（20年）   | 230,000,000 | 252,238,700 |  |
| 第 6 7 回利付国債（20年）   | 130,000,000 | 143,803,400 |  |
| 第 6 8 回利付国債（20年）   | 140,000,000 | 159,486,600 |  |
| 第 6 9 回利付国債（20年）   | 350,000,000 | 394,863,000 |  |
| 第 7 0 回利付国債（20年）   | 380,000,000 | 441,092,600 |  |
| 第 7 1 回利付国債（20年）   | 180,000,000 | 204,901,200 |  |
| 第 7 2 回利付国債（20年）   | 560,000,000 | 630,879,200 |  |
| 第 7 3 回利付国債（20年）   | 250,000,000 | 278,575,000 |  |
| 第 7 4 回利付国債（20年）   | 150,000,000 | 168,877,500 |  |
| 第 7 5 回利付国債（20年）   | 130,000,000 | 146,248,700 |  |
| 第 7 6 回利付国債（20年）   | 240,000,000 | 264,369,600 |  |
| 第 7 7 回利付国債（20年）   | 160,000,000 | 178,121,600 |  |
| 第 7 8 回利付国債（20年）   | 140,000,000 | 154,036,400 |  |
| 第 7 9 回利付国債（20年）   | 210,000,000 | 233,551,500 |  |
| 第 8 0 回利付国債（20年）   | 220,000,000 | 247,293,200 |  |
| 第 8 1 回利付国債（20年）   | 160,000,000 | 177,750,400 |  |
| 第 8 2 回利付国債（20年）   | 540,000,000 | 606,425,400 |  |
| 第 8 3 回利付国債（20年）   | 290,000,000 | 325,142,200 |  |
| 第 8 4 回利付国債（20年）   | 460,000,000 | 510,112,400 |  |
| 第 8 5 回利付国債（20年）   | 240,000,000 | 268,766,400 |  |
| 第 8 6 回利付国債（20年）   | 210,000,000 | 240,389,100 |  |
| 第 8 7 回利付国債（20年）   | 310,000,000 | 351,006,800 |  |
| 第 8 8 回利付国債（20年）   | 470,000,000 | 537,520,200 |  |
| 第 8 9 回利付国債（20年）   | 320,000,000 | 361,939,200 |  |
| 第 9 0 回利付国債（20年）   | 560,000,000 | 632,648,800 |  |
| 第 9 1 回利付国債（20年）   | 290,000,000 | 331,322,100 |  |
| 第 9 2 回利付国債（20年）   | 760,000,000 | 847,164,400 |  |
| 第 9 3 回利付国債（20年）   | 280,000,000 | 307,790,000 |  |
| 第 9 4 回利付国債（20年）   | 500,000,000 | 556,130,000 |  |
| 第 9 5 回利付国債（20年）   | 460,000,000 | 523,273,000 |  |
| 第 9 6 回利付国債（20年）   | 280,000,000 | 310,926,000 |  |
| 第 9 7 回利付国債（20年）   | 420,000,000 | 471,189,600 |  |
| 第 9 8 回利付国債（20年）   | 320,000,000 | 354,512,000 |  |
| 第 9 9 回利付国債（20年）   | 700,000,000 | 774,571,000 |  |
| 第 1 0 0 回利付国債（20年） | 400,000,000 | 447,492,000 |  |
| 第 1 0 1 回利付国債（20年） | 160,000,000 | 183,481,600 |  |
| 第 1 0 2 回利付国債（20年） | 280,000,000 | 320,602,800 |  |
| 第 1 0 3 回利付国債（20年） | 180,000,000 | 203,617,800 |  |
| 第 1 0 4 回利付国債（20年） | 260,000,000 | 286,761,800 |  |
| 第 1 0 5 回利付国債（20年） | 540,000,000 | 594,361,800 |  |
| 第 1 0 6 回利付国債（20年） | 270,000,000 | 301,128,300 |  |
| 第 1 0 7 回利付国債（20年） | 190,000,000 | 208,815,700 |  |

|       |                  |                 |                 |  |
|-------|------------------|-----------------|-----------------|--|
|       | 第108回利付国債（20年）   | 520,000,000     | 556,561,200     |  |
|       | 第109回利付国債（20年）   | 200,000,000     | 213,520,000     |  |
|       | 第110回利付国債（20年）   | 620,000,000     | 680,332,200     |  |
|       | 第111回利付国債（20年）   | 200,000,000     | 221,970,000     |  |
|       | 第112回利付国債（20年）   | 500,000,000     | 547,400,000     |  |
|       | 第113回利付国債（20年）   | 1,000,000,000   | 1,092,960,000   |  |
|       | 第114回利付国債（20年）   | 410,000,000     | 447,326,400     |  |
|       | 第115回利付国債（20年）   | 550,000,000     | 608,498,000     |  |
|       | 第116回利付国債（20年）   | 380,000,000     | 419,706,200     |  |
|       | 第117回利付国債（20年）   | 600,000,000     | 653,424,000     |  |
|       | 第118回利付国債（20年）   | 900,000,000     | 964,323,000     |  |
|       | 第119回利付国債（20年）   | 180,000,000     | 187,293,600     |  |
|       | 第121回利付国債（20年）   | 960,000,000     | 1,011,475,200   |  |
|       | 第122回利付国債（20年）   | 160,000,000     | 166,086,400     |  |
|       | 第123回利付国債（20年）   | 610,000,000     | 660,465,300     |  |
|       | 第124回利付国債（20年）   | 280,000,000     | 298,743,200     |  |
|       | 第125回利付国債（20年）   | 380,000,000     | 416,947,400     |  |
|       | 第126回利付国債（20年）   | 300,000,000     | 319,605,000     |  |
|       | 第127回利付国債（20年）   | 260,000,000     | 272,864,800     |  |
|       | 第128回利付国債（20年）   | 470,000,000     | 492,428,400     |  |
|       | 第129回利付国債（20年）   | 570,000,000     | 588,108,900     |  |
|       | 第130回利付国債（20年）   | 420,000,000     | 432,532,800     |  |
|       | 第131回利付国債（20年）   | 450,000,000     | 456,214,500     |  |
|       | 第132回利付国債（20年）   | 330,000,000     | 333,867,600     |  |
|       | 第133回利付国債（20年）   | 650,000,000     | 668,609,500     |  |
|       | 第134回利付国債（20年）   | 330,000,000     | 339,038,700     |  |
|       | 第135回利付国債（20年）   | 180,000,000     | 181,994,400     |  |
|       | 第136回利付国債（20年）   | 530,000,000     | 526,867,700     |  |
|       | 第137回利付国債（20年）   | 290,000,000     | 292,807,200     |  |
|       | 第138回利付国債（20年）   | 810,000,000     | 790,746,300     |  |
|       | 第139回利付国債（20年）   | 20,000,000      | 19,866,000      |  |
|       | 第140回利付国債（20年）   | 320,000,000     | 322,886,400     |  |
|       | 第9回ポーランド共和国円貨債券  | 100,000,000     | 102,955,000     |  |
|       | 国債証券 小計          | 147,070,000,000 | 154,622,424,400 |  |
| 地方債証券 | 第3回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 113,599,000     |  |
|       | 第6回東京都公募公債（20年）  | 100,000,000     | 110,288,000     |  |
|       | 第9回東京都公募公債（30年）  | 100,000,000     | 107,424,000     |  |
|       | 第11回東京都公募公債（30年） | 100,000,000     | 103,222,000     |  |
|       | 第17回東京都公募公債（20年） | 100,000,000     | 108,471,000     |  |
|       | 第19回東京都公募公債（20年） | 100,000,000     | 108,635,000     |  |
|       | 第23回東京都公募公債（20年） | 100,000,000     | 107,260,000     |  |
|       | 第611回東京都公募公債     | 40,000,000      | 41,154,800      |  |
|       | 第618回東京都公募公債     | 100,000,000     | 102,871,000     |  |
|       | 第622回東京都公募公債     | 100,000,000     | 103,069,000     |  |
|       | 第633回東京都公募公債     | 129,000,000     | 137,035,410     |  |
|       | 第639回東京都公募公債     | 50,000,000      | 53,251,500      |  |
|       | 第649回東京都公募公債     | 102,000,000     | 109,463,340     |  |
|       | 第650回東京都公募公債     | 140,000,000     | 151,069,800     |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第674回東京都公募公債          | 100,000,000 | 106,356,000 |  |
| 第678回東京都公募公債          | 100,000,000 | 106,427,000 |  |
| 第683回東京都公募公債          | 100,000,000 | 105,745,000 |  |
| 第691回東京都公募公債          | 100,000,000 | 105,133,000 |  |
| 平成18年度第1回北海道公募公債      | 100,000,000 | 105,545,000 |  |
| 平成19年度第9回北海道公募公債      | 110,000,000 | 117,681,300 |  |
| 平成20年度第14回北海道公募公債     | 100,000,000 | 108,067,000 |  |
| 平成21年度第1回北海道公募公債（5年）  | 100,000,000 | 101,494,000 |  |
| 第4回神奈川県公募公債（30年）      | 100,000,000 | 112,452,000 |  |
| 第16回神奈川県公募公債（20年）     | 100,000,000 | 106,563,000 |  |
| 第124回神奈川県公募公債         | 10,000,000  | 10,166,000  |  |
| 第144回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 106,819,000 |  |
| 第150回神奈川県公募公債         | 100,000,000 | 107,232,000 |  |
| 第167回神奈川県公募公債         | 140,000,000 | 150,172,400 |  |
| 第172回神奈川県公募公債         | 200,000,000 | 212,164,000 |  |
| 第47回大阪府公募公債（5年）       | 100,000,000 | 101,490,000 |  |
| 第53回大阪府公募公債（5年）       | 200,000,000 | 202,304,000 |  |
| 第72回大阪府公募公債（5年）       | 100,000,000 | 101,346,000 |  |
| 第262回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 101,596,000 |  |
| 第271回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 102,902,000 |  |
| 第284回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 104,341,000 |  |
| 第291回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 106,567,000 |  |
| 第307回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 107,678,000 |  |
| 第311回大阪府公募公債（10年）     | 100,000,000 | 107,171,000 |  |
| 平成18年度第1回京都府公募公債      | 100,000,000 | 106,283,000 |  |
| 平成15年度第6回兵庫県公募公債      | 10,000,000  | 10,151,600  |  |
| 平成16年度第4回兵庫県公募公債      | 200,000,000 | 204,660,000 |  |
| 平成17年度第13回兵庫県公募公債     | 200,000,000 | 210,278,000 |  |
| 平成19年度第9回兵庫県公募公債      | 100,000,000 | 107,682,000 |  |
| 平成19年度第2回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 107,970,000 |  |
| 平成20年度第4回静岡県公募公債      | 100,000,000 | 107,678,000 |  |
| 平成23年度第3回静岡県公募公債      | 103,290,000 | 107,881,240 |  |
| 平成20年度第6回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 108,198,000 |  |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債（20年） | 100,000,000 | 110,717,000 |  |
| 平成21年度第8回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 106,380,000 |  |
| 平成23年度第1回愛知県公募公債（10年） | 100,000,000 | 106,056,000 |  |
| 平成16年度第1回広島県公募公債      | 100,000,000 | 102,740,000 |  |
| 平成20年度第1回広島県公募公債（20年） | 100,000,000 | 111,973,000 |  |
| 平成22年度第1回広島県公募公債      | 100,000,000 | 106,215,000 |  |
| 平成16年度第4回埼玉県公募公債      | 100,000,000 | 102,684,000 |  |
| 平成17年度第3回埼玉県公募公債      | 100,000,000 | 103,217,000 |  |
| 平成18年度第2回埼玉県公募公債      | 100,000,000 | 106,637,000 |  |
| 平成22年度第11回埼玉県公募公債     | 193,000,000 | 203,254,090 |  |
| 平成21年度第3回福岡県公募公債      | 100,000,000 | 107,474,000 |  |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債（20年） | 100,000,000 | 105,028,000 |  |
| 平成18年度第7回千葉県公募公債      | 100,000,000 | 106,908,000 |  |
| 平成21年度第12回千葉県公募公債     | 100,000,000 | 106,785,000 |  |
| 平成21年度第2回千葉県公募公債      | 100,000,000 | 107,541,000 |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 平成21年度第9回千葉県公募公債      | 100,000,000 | 105,805,000 |  |
| 平成22年度第8回千葉県公募公債      | 120,000,000 | 123,826,800 |  |
| 平成16年度第1回新潟県公募公債      | 100,000,000 | 102,864,000 |  |
| 平成17年度第2回新潟県公募公債      | 100,000,000 | 104,461,000 |  |
| 第14回共同発行市場公募地方債       | 100,200,000 | 102,414,420 |  |
| 第15回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 102,504,000 |  |
| 第19回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 102,971,000 |  |
| 第21回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 102,770,000 |  |
| 第29回共同発行市場公募地方債       | 200,000,000 | 207,184,000 |  |
| 第33回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 104,614,000 |  |
| 第35回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 104,856,000 |  |
| 第38回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 106,613,000 |  |
| 第40回共同発行市場公募地方債       | 120,000,000 | 128,726,400 |  |
| 第41回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 107,025,000 |  |
| 第46回共同発行市場公募地方債       | 136,500,000 | 145,786,095 |  |
| 第52回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 107,925,000 |  |
| 第55回共同発行市場公募地方債       | 158,400,000 | 171,033,984 |  |
| 第56回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 107,416,000 |  |
| 第67回共同発行市場公募地方債       | 165,700,000 | 177,068,677 |  |
| 第75回共同発行市場公募地方債       | 200,000,000 | 216,054,000 |  |
| 第77回共同発行市場公募地方債       | 110,000,000 | 118,135,600 |  |
| 第78回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 106,366,000 |  |
| 第85回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 106,809,000 |  |
| 第87回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 105,644,000 |  |
| 第89回共同発行市場公募地方債       | 150,300,000 | 155,757,393 |  |
| 第93回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 105,140,000 |  |
| 第94回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 105,028,000 |  |
| 第95回共同発行市場公募地方債       | 100,000,000 | 105,313,000 |  |
| 第97回共同発行市場公募地方債       | 200,000,000 | 212,094,000 |  |
| 平成22年度第1回静岡市公募公債      | 100,000,000 | 103,130,000 |  |
| 平成16年度第8回大阪市公募公債      | 100,000,000 | 102,763,000 |  |
| 平成17年度第10回大阪市公募公債     | 100,000,000 | 104,185,000 |  |
| 平成19年度第7回大阪市公募公債      | 100,000,000 | 107,390,000 |  |
| 平成22年度第5回大阪市公募公債      | 100,000,000 | 104,321,000 |  |
| 第5回名古屋市長市公募公債（30年）    | 100,000,000 | 109,712,000 |  |
| 第9回名古屋市長市公募公債（20年）    | 100,000,000 | 107,996,000 |  |
| 第12回す号名古屋市長市公募公債      | 100,000,000 | 105,274,000 |  |
| 平成22年度第2回京都市公募公債      | 102,000,000 | 106,085,100 |  |
| 平成17年度第13回神戸市公募公債     | 100,000,000 | 104,795,000 |  |
| 第5回横浜市公募公債（20年）       | 100,000,000 | 112,063,000 |  |
| 平成17年度第1回横浜市公募公債      | 100,000,000 | 102,825,000 |  |
| 平成21年度第1回横浜市公募公債      | 200,000,000 | 215,212,000 |  |
| 平成21年度第5回横浜市公募公債      | 100,000,000 | 107,621,000 |  |
| 平成15年度第5回札幌市公募公債      | 72,580,000  | 73,708,619  |  |
| 平成17年度第6回札幌市公募公債      | 100,000,000 | 104,282,000 |  |
| 第81回川崎市公募公債           | 100,000,000 | 107,407,000 |  |
| 第82回川崎市公募公債           | 100,000,000 | 107,230,000 |  |
| 平成23年度第1回北九州市公募公債（5年） | 100,000,000 | 100,613,000 |  |

|      |                            |                |                |  |
|------|----------------------------|----------------|----------------|--|
|      | 平成15年度第6回福岡市公募公債           | 124,600,000    | 126,582,386    |  |
|      | 平成21年度第4回福岡市公募公債（5年）       | 100,000,000    | 101,073,000    |  |
|      | 平成22年度第6回広島市公募公債           | 100,000,000    | 104,379,000    |  |
|      | 平成23年度第2回千葉市公募公債           | 100,000,000    | 102,830,000    |  |
|      | 平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）     | 100,000,000    | 106,861,000    |  |
|      | 第113回福岡北九州高速道路債券           | 100,000,000    | 111,693,000    |  |
|      | 地方債証券 小計                   | 12,587,570,000 | 13,310,852,954 |  |
| 特殊債券 | 第11回日本政策投資銀行債券             | 100,000,000    | 108,337,000    |  |
|      | 第13回政府保証日本政策投資銀行債券         | 106,000,000    | 113,512,220    |  |
|      | 第14回政府保証日本政策投資銀行債券         | 100,000,000    | 112,210,000    |  |
|      | 第22回政府保証日本政策投資銀行債券         | 100,000,000    | 113,367,000    |  |
|      | 第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000    | 104,360,000    |  |
|      | 第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000    | 104,931,000    |  |
|      | 第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000    | 110,488,000    |  |
|      | 第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 100,000,000    | 105,034,000    |  |
|      | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 100,000,000    | 113,764,000    |  |
|      | 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 200,000,000    | 220,980,000    |  |
|      | 第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 107,138,000    |  |
|      | 第21回道路債券                   | 100,000,000    | 112,636,000    |  |
|      | 第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 106,375,000    |  |
|      | 第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 106,671,000    |  |
|      | 第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 106,885,000    |  |
|      | 第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 111,661,000    |  |
|      | 第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 215,000,000    | 231,972,100    |  |
|      | 第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 105,696,000    |  |
|      | 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 111,913,000    |  |
|      | 第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 107,300,000    |  |
|      | 第42回道路債券                   | 100,000,000    | 111,487,000    |  |
|      | 第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 107,447,000    |  |
|      | 第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 107,110,000    |  |
|      | 第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 107,529,000    |  |
|      | 第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 106,465,000    |  |
|      | 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 111,182,000    |  |
|      | 第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000    | 107,780,000    |  |
|      | 第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 30,000,000     | 31,845,900     |  |
|      | 第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 111,000,000    | 117,859,800    |  |
|      | 第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 108,589,000    |  |
|      | 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 181,000,000    | 195,574,120    |  |
|      | 第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 100,000,000    | 105,674,000    |  |
|      | 第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 300,000,000    | 317,874,000    |  |
|      | 第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 105,885,000    |  |
|      | 第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 103,491,000    |  |
|      | 第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000    | 206,894,000    |  |
|      | 第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 102,575,000    |  |
|      | 第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000    | 209,834,000    |  |
|      | 第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 107,362,000    |  |
|      | 第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 105,538,000    |  |
|      | 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000    | 101,620,000    |  |

|                            |             |             |  |
|----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 202,808,000 |  |
| 第327回政府保証道路債券              | 100,000,000 | 102,130,000 |  |
| 第328回政府保証道路債券              | 114,000,000 | 116,568,420 |  |
| 第331回政府保証道路債券              | 102,000,000 | 105,224,220 |  |
| 第333回政府保証道路債券              | 48,000,000  | 49,449,120  |  |
| 第346回政府保証道路債券              | 143,000,000 | 148,205,200 |  |
| 第347回政府保証道路債券              | 181,000,000 | 187,220,970 |  |
| 第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券       | 202,000,000 | 217,321,700 |  |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 100,000,000 | 107,219,000 |  |
| 第2回政府保証地方公共団体金融機構債券        | 100,000,000 | 106,568,000 |  |
| 第3回政府保証公営企業債券（15年）         | 300,000,000 | 339,120,000 |  |
| 第3回公営企業債券（20年）             | 10,000,000  | 10,094,800  |  |
| 第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券       | 100,000,000 | 105,865,000 |  |
| 第6回地方公共団体金融機構債券（5年）        | 100,000,000 | 100,814,000 |  |
| 第7回公営企業債券（20年）             | 100,000,000 | 112,464,000 |  |
| 第7回公営企業債券（30年）             | 100,000,000 | 113,206,000 |  |
| 第7回地方公共団体金融機構債券（20年）       | 100,000,000 | 108,377,000 |  |
| 第8回公営企業債券（20年）             | 40,000,000  | 45,214,800  |  |
| 第8回地方公共団体金融機構債券            | 100,000,000 | 106,658,000 |  |
| 第10回地方公共団体金融機構債券           | 100,000,000 | 106,435,000 |  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券           | 200,000,000 | 213,456,000 |  |
| 第15回地方公共団体金融機構債券           | 100,000,000 | 103,761,000 |  |
| 第17回公営企業債券                 | 100,000,000 | 104,090,000 |  |
| 第18回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 101,000,000 | 103,589,640 |  |
| 第19回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000 | 104,936,000 |  |
| 第28回公営企業債券                 | 100,000,000 | 108,014,000 |  |
| 第30回公営企業債券                 | 100,000,000 | 109,172,000 |  |
| 第32回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 100,000,000 | 101,662,000 |  |
| 第836回政府保証公営企業債券            | 10,000,000  | 10,164,100  |  |
| 第838回政府保証公営企業債券            | 100,000,000 | 102,130,000 |  |
| 第840回政府保証公営企業債券            | 13,000,000  | 13,326,300  |  |
| 第848回政府保証公営企業債券            | 100,000,000 | 102,799,000 |  |
| 第855回政府保証公営企業債券            | 140,000,000 | 144,793,600 |  |
| 第859回政府保証公営企業債券            | 131,000,000 | 136,860,940 |  |
| 第862回政府保証公営企業債券            | 200,000,000 | 211,656,000 |  |
| 第866回政府保証公営企業債券            | 100,000,000 | 107,073,000 |  |
| 第867回政府保証公営企業債券            | 100,000,000 | 106,431,000 |  |
| 第872回政府保証公営企業債券            | 200,000,000 | 214,014,000 |  |
| 第874回政府保証公営企業債券            | 100,000,000 | 106,760,000 |  |
| 第875回政府保証公営企業債券            | 112,000,000 | 119,665,280 |  |
| 第876回政府保証公営企業債券            | 122,000,000 | 131,630,680 |  |
| 第3回政府保証首都高速道路株式会社債券        | 103,000,000 | 109,867,010 |  |
| 第5回政府保証首都高速道路株式会社債券        | 80,000,000  | 84,884,000  |  |
| 第7回首都高速道路株式会社社債            | 100,000,000 | 101,223,000 |  |
| 第190回政府保証首都高速道路債券          | 100,000,000 | 101,829,000 |  |
| 第193回政府保証首都高速道路債券          | 104,000,000 | 106,800,720 |  |
| 第200回政府保証首都高速道路債券          | 100,000,000 | 103,431,000 |  |
| 第145回政府保証阪神高速道路債券          | 100,000,000 | 103,215,000 |  |

|                        |             |             |  |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第1回政府保証日本政策金融公庫債券      | 100,000,000 | 102,346,000 |  |
| 第18回株式会社日本政策金融公庫社債     | 100,000,000 | 106,609,000 |  |
| 第182回政府保証中小企業債券        | 10,000,000  | 10,268,600  |  |
| 第5回本州四国連絡橋債券           | 100,000,000 | 111,631,000 |  |
| 第322回東京交通債券            | 10,000,000  | 10,932,000  |  |
| 第344回東京交通債券            | 100,000,000 | 106,949,000 |  |
| 第346回東京交通債券            | 20,000,000  | 20,331,000  |  |
| 第8回独立行政法人福祉医療機構債券      | 100,000,000 | 104,269,000 |  |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 56,691,000  | 60,447,912  |  |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券  | 39,850,000  | 42,396,415  |  |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券  | 41,345,000  | 44,315,638  |  |
| 第3回一般担保住宅金融公庫債券        | 100,000,000 | 110,261,000 |  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 56,817,000  | 61,064,638  |  |
| 第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券  | 46,479,000  | 49,260,768  |  |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券    | 34,256,000  | 36,020,869  |  |
| 第5回一般担保住宅金融支援機構債券      | 100,000,000 | 108,107,000 |  |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券    | 71,366,000  | 76,634,238  |  |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券  | 48,190,000  | 50,745,033  |  |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券    | 37,015,000  | 39,671,936  |  |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券  | 54,017,000  | 57,234,792  |  |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券      | 100,000,000 | 106,845,000 |  |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券    | 37,098,000  | 39,701,908  |  |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 59,332,000  | 62,912,686  |  |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 60,192,000  | 63,279,849  |  |
| 第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 60,549,000  | 63,548,597  |  |
| 第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 68,980,000  | 74,166,606  |  |
| 第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 75,918,000  | 80,289,358  |  |
| 第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 77,491,000  | 81,969,204  |  |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 81,088,000  | 85,368,635  |  |
| 第33回一般担保住宅金融支援機構債券     | 100,000,000 | 106,310,000 |  |
| 第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 81,587,000  | 85,879,292  |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 56,191,000  | 59,141,027  |  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 86,464,000  | 90,870,205  |  |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 56,025,000  | 58,821,207  |  |
| 第41回一般担保住宅金融支援機構債券     | 100,000,000 | 106,595,000 |  |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 54,586,000  | 58,859,537  |  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 92,461,000  | 97,326,297  |  |
| 第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 50,736,000  | 54,504,670  |  |
| 第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 92,492,000  | 97,760,344  |  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 93,209,000  | 98,823,910  |  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 56,297,000  | 60,437,644  |  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 189,122,000 | 197,044,320 |  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 95,040,000  | 98,853,955  |  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 55,781,000  | 59,316,957  |  |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 96,816,000  | 98,979,837  |  |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 96,930,000  | 99,122,556  |  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 97,280,000  | 99,677,952  |  |
| 第58回一般担保住宅金融支援機構債券     | 100,000,000 | 102,915,000 |  |

|     |                                |                |                |  |
|-----|--------------------------------|----------------|----------------|--|
|     | 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券           | 196,878,000    | 200,256,426    |  |
|     | 第60回一般担保住宅金融支援機構債券             | 100,000,000    | 105,097,000    |  |
|     | 第63回一般担保住宅金融支援機構債券             | 100,000,000    | 105,315,000    |  |
|     | 第88回一般担保住宅金融支援機構債券             | 100,000,000    | 100,968,000    |  |
|     | 第114回一般担保住宅金融支援機構債券            | 100,000,000    | 100,158,000    |  |
|     | 第12回政府保証国民生活債券                 | 179,000,000    | 182,306,130    |  |
|     | 第12回農林漁業金融公庫債券                 | 100,000,000    | 111,100,000    |  |
|     | 第2回政府保証成田国際空港債券                | 147,000,000    | 154,198,590    |  |
|     | 第5回新東京国際空港債券                   | 100,000,000    | 101,744,000    |  |
|     | い第704号商工債                      | 100,000,000    | 101,524,000    |  |
|     | い第705号商工債                      | 100,000,000    | 101,692,000    |  |
|     | い第718号商工債                      | 100,000,000    | 101,112,000    |  |
|     | い第721号商工債                      | 150,000,000    | 151,426,500    |  |
|     | い第722号商工債                      | 100,000,000    | 100,840,000    |  |
|     | い第726号商工債                      | 100,000,000    | 100,768,000    |  |
|     | い第729号商工債                      | 100,000,000    | 101,640,000    |  |
|     | い第707号農林債                      | 250,000,000    | 254,362,500    |  |
|     | い第710号農林債                      | 100,000,000    | 101,390,000    |  |
|     | い第715号農林債                      | 100,000,000    | 101,034,000    |  |
|     | い第721号農林債                      | 100,000,000    | 100,991,000    |  |
|     | い第722号農林債                      | 100,000,000    | 100,882,000    |  |
|     | い第723号農林債                      | 200,000,000    | 201,816,000    |  |
|     | い第740号農林債                      | 100,000,000    | 100,896,000    |  |
|     | 第228回信金中金債（5年）                 | 100,000,000    | 101,441,000    |  |
|     | 第233回信金中金債（5年）                 | 100,000,000    | 101,793,000    |  |
|     | 第237回信金中金債（5年）                 | 100,000,000    | 101,517,000    |  |
|     | 第243回信金中金債（5年）                 | 100,000,000    | 101,186,000    |  |
|     | 第247回信金中金債（5年）                 | 100,000,000    | 100,937,000    |  |
|     | 第267回信金中金債（5年）                 | 200,000,000    | 201,700,000    |  |
|     | 第139号商工債（3年）                   | 100,000,000    | 100,189,000    |  |
|     | 第5回S B A B銀行A B（p u b l）円貨債券   | 100,000,000    | 99,222,000     |  |
|     | 第10回韓国輸出入銀行円貨債券                | 100,000,000    | 100,458,000    |  |
|     | 第1回政府保証東日本高速道路債券               | 100,000,000    | 104,563,000    |  |
|     | 第22回中日本高速道路株式会社社債              | 200,000,000    | 205,458,000    |  |
|     | 第43回中日本高速道路株式会社社債              | 100,000,000    | 100,058,000    |  |
|     | 第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券           | 100,000,000    | 104,329,000    |  |
|     | 第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券          | 100,000,000    | 107,664,000    |  |
|     | 特殊債券 小計                        | 18,019,569,000 | 18,963,893,178 |  |
| 社債券 | 第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債 | 100,000,000    | 100,435,000    |  |
|     | 第9回J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債  | 100,000,000    | 101,504,000    |  |
|     | 第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債  | 100,000,000    | 102,680,000    |  |
|     | 第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債         | 100,000,000    | 101,917,000    |  |
|     | 第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債  | 100,000,000    | 101,693,000    |  |
|     | 第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債      | 100,000,000    | 101,459,000    |  |
|     | 第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債           | 200,000,000    | 201,290,000    |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第3回エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債   | 100,000,000 | 99,860,000  |  |
| 第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 101,005,000 |  |
| 第13回積水ハウス株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 100,924,000 |  |
| 第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債       | 100,000,000 | 106,916,000 |  |
| 第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債       | 100,000,000 | 107,171,000 |  |
| 第5回日本たばこ産業株式会社社債              | 100,000,000 | 101,469,000 |  |
| 第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債   | 100,000,000 | 108,266,000 |  |
| 第8回旭化成株式会社無担保社債               | 100,000,000 | 106,002,000 |  |
| 第28回住友化学工業株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 102,688,000 |  |
| 第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 101,629,000 |  |
| 第7回エーザイ株式会社無担保社債              | 100,000,000 | 104,179,000 |  |
| 第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債  | 100,000,000 | 103,073,000 |  |
| 第5回株式会社資生堂無担保社債               | 100,000,000 | 100,880,000 |  |
| 第8回昭和シェル石油株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 100,320,000 |  |
| 第55回新日本製鐵株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 105,757,000 |  |
| 第67回住友金属工業株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 100,188,000 |  |
| 第15回JFEホールディングス株式会社無担保社債      | 100,000,000 | 100,761,000 |  |
| 第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 101,601,000 |  |
| 第1回株式会社ジェイテクト無担保社債            | 100,000,000 | 101,248,000 |  |
| 第50回株式会社東芝無担保社債               | 100,000,000 | 101,080,000 |  |
| 第7回パナソニック株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 101,357,000 |  |
| 第11回パナソニック株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 101,226,000 |  |
| 第27回ソニー株式会社無担保社債              | 100,000,000 | 98,734,000  |  |
| 第3回松下電工株式会社無担保社債              | 100,000,000 | 103,155,000 |  |
| 第24回三菱重工業株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 105,891,000 |  |
| 第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債       | 100,000,000 | 100,048,000 |  |
| 第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債   | 100,000,000 | 100,085,000 |  |
| 第51回日産自動車株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 101,134,000 |  |
| 第52回日産自動車株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 103,077,000 |  |
| 第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 101,379,000 |  |
| 第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債           | 100,000,000 | 101,803,000 |  |
| 第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 106,785,000 |  |
| 第75回丸紅株式会社無担保社債               | 100,000,000 | 101,704,000 |  |
| 第53回三井物産株式会社無担保社債             | 100,000,000 | 102,728,000 |  |
| 第69回三菱商事株式会社無担保社債             | 100,000,000 | 108,577,000 |  |
| 第74回三菱商事株式会社無担保社債             | 100,000,000 | 107,165,000 |  |
| 第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 101,554,000 |  |
| 第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 101,506,000 |  |
| 第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 101,638,000 |  |
| 第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 101,179,000 |  |
| 第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 100,524,000 |  |
| 第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 101,714,000 |  |
| 第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債      | 100,000,000 | 100,967,000 |  |
| 第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 113,736,000 |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 102,752,000 |  |
| 第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 104,789,000 |  |
| 第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債        | 100,000,000 | 108,399,000 |  |
| 第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債       | 100,000,000 | 101,742,000 |  |
| 第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）      | 100,000,000 | 106,558,000 |  |
| 第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）     | 100,000,000 | 102,701,000 |  |
| 第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）  | 100,000,000 | 107,314,000 |  |
| 第8回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）     | 100,000,000 | 103,249,000 |  |
| 第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）    | 100,000,000 | 109,379,000 |  |
| 第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）    | 100,000,000 | 103,629,000 |  |
| 第47回株式会社三井住友銀行無担保社債           | 100,000,000 | 101,269,000 |  |
| 第53回株式会社三井住友銀行無担保社債           | 100,000,000 | 101,665,000 |  |
| 第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債    | 100,000,000 | 100,215,000 |  |
| 第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債        | 100,000,000 | 100,677,000 |  |
| 第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債        | 100,000,000 | 106,615,000 |  |
| 第40回日立キャピタル株式会社無担保社債          | 100,000,000 | 101,173,000 |  |
| 第133回オリックス株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 105,025,000 |  |
| 第138回オリックス株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 104,358,000 |  |
| 第9回三菱UFJリース株式会社無担保社債          | 100,000,000 | 100,615,000 |  |
| 第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債       | 100,000,000 | 102,224,000 |  |
| 第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債       | 100,000,000 | 100,486,000 |  |
| 第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債       | 100,000,000 | 100,359,000 |  |
| 第24回三井不動産株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 104,372,000 |  |
| 第31回三菱地所株式会社無担保社債             | 100,000,000 | 113,699,000 |  |
| 第3回株式会社サンケイビル無担保社債            | 100,000,000 | 101,465,000 |  |
| 第70回住友不動産株式会社無担保社債            | 100,000,000 | 102,117,000 |  |
| 第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債   | 100,000,000 | 101,732,000 |  |
| 第30回京浜急行電鉄株式会社無担保社債           | 100,000,000 | 101,842,000 |  |
| 第30回京王電鉄株式会社無担保社債             | 100,000,000 | 105,768,000 |  |
| 第2回東日本旅客鉄道株式会社社債              | 100,000,000 | 111,185,000 |  |
| 第17回東日本旅客鉄道株式会社社債             | 100,000,000 | 112,963,000 |  |
| 第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債          | 100,000,000 | 113,838,000 |  |
| 第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債           | 19,000,000  | 21,486,720  |  |
| 第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債          | 100,000,000 | 112,766,000 |  |
| 第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債          | 20,000,000  | 22,456,600  |  |
| 第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債         | 100,000,000 | 109,149,000 |  |
| 第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債         | 100,000,000 | 104,994,000 |  |
| 第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債         | 100,000,000 | 105,861,000 |  |
| 第9回東京地下鉄株式会社社債                | 100,000,000 | 106,241,000 |  |
| 第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債     | 100,000,000 | 103,645,000 |  |
| 第9回三井倉庫株式会社無担保社債              | 100,000,000 | 103,760,000 |  |
| 第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債     | 100,000,000 | 101,233,000 |  |
| 第50回日本電信電話株式会社電信電話債券          | 100,000,000 | 103,974,000 |  |
| 第51回日本電信電話株式会社電信電話債券          | 100,000,000 | 106,667,000 |  |
| 第59回日本電信電話株式会社電信電話債券          | 100,000,000 | 107,845,000 |  |

|                     |                 |                 |  |
|---------------------|-----------------|-----------------|--|
| 第7回KDDI株式会社無担保社債    | 100,000,000     | 103,941,000     |  |
| 第425回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 102,449,000     |  |
| 第455回東京電力株式会社社債     | 120,000,000     | 105,318,000     |  |
| 第459回東京電力株式会社社債     | 10,000,000      | 9,053,400       |  |
| 第501回東京電力株式会社社債     | 30,000,000      | 29,757,300      |  |
| 第505回東京電力株式会社社債     | 30,000,000      | 29,595,900      |  |
| 第510回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 97,747,000      |  |
| 第518回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 93,686,000      |  |
| 第521回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 93,263,000      |  |
| 第528回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 85,290,000      |  |
| 第536回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 87,496,000      |  |
| 第542回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 86,586,000      |  |
| 第544回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 88,040,000      |  |
| 第554回東京電力株式会社社債     | 100,000,000     | 83,691,000      |  |
| 第405回中部電力株式会社社債     | 50,000,000      | 54,685,000      |  |
| 第408回中部電力株式会社社債     | 50,000,000      | 55,125,000      |  |
| 第451回関西電力株式会社社債     | 100,000,000     | 104,300,000     |  |
| 第471回関西電力株式会社社債     | 100,000,000     | 100,714,000     |  |
| 第473回関西電力株式会社社債     | 100,000,000     | 103,843,000     |  |
| 第474回関西電力株式会社社債     | 100,000,000     | 103,940,000     |  |
| 第362回中国電力株式会社社債     | 100,000,000     | 105,727,000     |  |
| 第371回中国電力株式会社社債     | 100,000,000     | 100,000,000     |  |
| 第248回北陸電力株式会社社債     | 100,000,000     | 112,355,000     |  |
| 第376回東北電力株式会社社債     | 100,000,000     | 109,535,000     |  |
| 第380回東北電力株式会社社債     | 100,000,000     | 111,653,000     |  |
| 第382回東北電力株式会社社債     | 20,000,000      | 22,145,200      |  |
| 第257回四国電力株式会社社債     | 100,000,000     | 102,222,000     |  |
| 第276回四国電力株式会社社債     | 100,000,000     | 100,155,000     |  |
| 第387回九州電力株式会社社債     | 100,000,000     | 103,875,000     |  |
| 第408回九州電力株式会社社債     | 100,000,000     | 105,206,000     |  |
| 第417回九州電力株式会社社債     | 100,000,000     | 99,886,000      |  |
| 第261回北海道電力株式会社社債    | 31,000,000      | 34,306,770      |  |
| 第285回北海道電力株式会社社債    | 100,000,000     | 104,184,000     |  |
| 第286回北海道電力株式会社社債    | 100,000,000     | 102,176,000     |  |
| 第4回電源開発株式会社無担保社債    | 100,000,000     | 101,064,000     |  |
| 第17回電源開発株式会社無担保社債   | 200,000,000     | 211,400,000     |  |
| 第30回東京瓦斯株式会社無担保社債   | 100,000,000     | 103,785,000     |  |
| 第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債    | 100,000,000     | 113,419,000     |  |
| 第27回大阪瓦斯株式会社無担保社債   | 100,000,000     | 101,122,000     |  |
| 第38回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 100,000,000     | 100,023,000     |  |
| 社債券 小計              | 13,180,000,000  | 13,550,672,890  |  |
| 合計                  | 190,857,139,000 | 200,447,843,422 |  |

## 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](#)

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

| 項目          | 平成24年10月 1日現在<br>金額(円) |
|-------------|------------------------|
| 資産の部        |                        |
| 流動資産        |                        |
| 預金          | 3,314,968,472          |
| コール・ローン     | 212,392,019            |
| 株式          | 126,162,476,376        |
| 投資信託受益証券    | 70,615,022             |
| 投資証券        | 2,800,767,973          |
| 派生商品評価勘定    | 1,108,763              |
| 未収入金        | 2,096,658              |
| 未収配当金       | 253,319,994            |
| 未収利息        | 384                    |
| 差入委託証拠金     | 923,837,582            |
| 流動資産合計      | 133,741,583,243        |
| 資産合計        | 133,741,583,243        |
| 負債の部        |                        |
| 流動負債        |                        |
| 派生商品評価勘定    | 76,517,884             |
| 未払解約金       | 315,062,449            |
| 流動負債合計      | 391,580,333            |
| 負債合計        | 391,580,333            |
| 純資産の部       |                        |
| 元本等         |                        |
| 元本          | 139,817,550,104        |
| 剰余金         |                        |
| 剰余金又は欠損金（△） | △6,467,547,194         |
| 元本等合計       | 133,350,002,910        |
| 純資産合計       | 133,350,002,910        |
| 負債純資産合計     | 133,741,583,243        |

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                    | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                                           |
|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> |

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

## (貸借対照表に関する注記)

|                        | 平成24年10月 1日現在    |
|------------------------|------------------|
| 1. 計算期間の期首元本額          | 147,276,730,211円 |
| 計算期間中の追加設定元本額          | 23,783,839,252円  |
| 計算期間中の一部解約元本額          | 31,243,019,359円  |
| 計算日の元本額                | 139,817,550,104円 |
| 計算日の元本額の内訳             |                  |
| SBI資産設計オープン（資産成長型）     | 1,000,723,370円   |
| SBI資産設計オープン（分配型）       | 26,596,669円      |
| SMT グローバル株式インデックス・オープン | 17,679,934,931円  |
| 世界経済インデックスファンド         | 737,839,371円     |

|                                                      |                         |
|------------------------------------------------------|-------------------------|
| マイセレクション25                                           | 19,724,747円             |
| マイセレクション50                                           | 71,257,115円             |
| マイセレクション75                                           | 81,376,399円             |
| 外国株式インデックス・オープン                                      | 1,300,334,587円          |
| DCマイセレクション25                                         | 1,067,098,561円          |
| DCマイセレクション50                                         | 5,438,157,575円          |
| DCマイセレクション75                                         | 5,305,298,420円          |
| DC外国株式インデックス・オープン                                    | 5,329,843,877円          |
| DCマイセレクションS25                                        | 305,851,496円            |
| DCマイセレクションS50                                        | 1,508,398,040円          |
| DCマイセレクションS75                                        | 1,017,828,467円          |
| DCターゲット・イヤー ファンド2015                                 | 8,146,684円              |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025                                 | 137,108,970円            |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035                                 | 127,409,498円            |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045                                 | 52,056,086円             |
| DC世界経済インデックスファンド                                     | 193,677,691円            |
| 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）                               | 10,172,577,535円         |
| マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）                             | 257,061,205円            |
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）                             | 120,858,865円            |
| 外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）                        | 550,567,631円            |
| マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）                             | 1,306,106円              |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用）                                 | 1,366,263,987円          |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用）                                 | 5,016,868,660円          |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用）                                 | 12,245,676,008円         |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用）                                 | 3,777,505,412円          |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）                              | 5,894,127,293円          |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）                            | 1,465,868,369円          |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）                              | 8,735,991,518円          |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）                                 | 19,890,061,887円         |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）                                 | 9,026,177,685円          |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）                              | 1,517,443,041円          |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）                         | 1,472,431,567円          |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）                              | 541,087,302円            |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1                                 | 1,209,349,605円          |
| FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）                      | 7,649,793,604円          |
| 外国株式ファンド・シリーズ1                                       | 6,676,966,950円          |
| コア投資戦略ファンド（安定型）                                      | 511,910,195円            |
| コア投資戦略ファンド（成長型）                                      | 308,993,125円            |
| 2. 計算日における受益権総数                                      | 139,817,550,104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<br>6,467,547,194円 |
| 4. 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額)                         | 0.9537円<br>(9,537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24年10月 1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 | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク（株価変動リスク、為替変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制      | <p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>                                                                                                  |

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

|                        | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                                                                                         |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額     | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                                                                                   |
| 2. 時価の算定方法             | <p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 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24年10月 1日現在      |
|----------|--------------------|
|          | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式       | 10,869,535,679     |
| 投資信託受益証券 | 1,530,435          |
| 投資証券     | 144,407,768        |
| 合計       | 11,015,473,882     |

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年10月1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24年10月 1日現在 |       |               |             |
|------|-----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                 | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |                 |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買 建 | 4,395,073,467 | —     | 4,319,709,197 | △75,364,270 |
|      | 合計              | 4,395,073,467 | —     | 4,319,709,197 | △75,364,270 |

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日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24年10月 1日現在 |       |             |             |
|---------------|---------------|---------------|-------|-------------|-------------|
|               |               | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|               |               |               | うち1年超 |             |             |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約取引<br>買 建 |               |       |             |             |
|               | アメリカドル        | 83,910,829    | —     | 84,175,200  | 264,371     |
|               | カナダドル         | 9,472,680     | —     | 9,507,600   | 34,920      |
|               | オーストラリアドル     | 5,635,210     | —     | 5,652,500   | 17,290      |
|               | イギリスポンド       | 21,362,110    | —     | 21,365,600  | 3,490       |
|               | スイスフラン        | 5,789,280     | —     | 5,784,800   | △4,480      |
|               | ユーロ           | 6,990,942     | —     | 6,990,200   | △742        |
|               | 計             | 133,161,051   | —     | 133,475,900 | 314,849     |
|               | 売 建           |               |       |             |             |
|               | アメリカドル        | 135,796,500   | —     | 136,395,000 | △598,500    |
|               | カナダドル         | 18,991,200    | —     | 19,015,200  | △24,000     |
|               | オーストラリアドル     | 8,107,700     | —     | 8,074,000   | 33,700      |
|               | イギリスポンド       | 25,195,000    | —     | 25,136,000  | 59,000      |
|               | スイスフラン        | 8,285,300     | —     | 8,264,000   | 21,300      |
|               | ユーロ           | 40,092,800    | —     | 39,944,000  | 148,800     |

|    |             |   |             |          |
|----|-------------|---|-------------|----------|
| 計  | 236,468,500 | — | 236,828,200 | △359,700 |
| 合計 | 369,629,551 | — | 370,304,100 | △44,851  |

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ①計算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24年10月 1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24年10月 1日現在 |
| 該当事項はありません。   |

[次へ](#)

## (3)附属明細表(平成24年10月1日現在)

## ① 有価証券明細表

## A. 株式

| 通貨     | 銘柄                           | 株式数<br>(株) | 評価額    |               | 備考 |
|--------|------------------------------|------------|--------|---------------|----|
|        |                              |            | 単価     | 金額            |    |
| アメリカドル | ANADARKO PETROLEUM CORP      | 35,894     | 69.92  | 2,509,708.48  |    |
|        | APACHE CORP                  | 27,878     | 86.47  | 2,410,610.66  |    |
|        | BAKER HUGHES                 | 31,782     | 45.23  | 1,437,499.86  |    |
|        | CABOT OIL & GAS CORP         | 15,273     | 44.90  | 685,757.70    |    |
|        | CAMERON INTERNATIONAL CORP   | 17,894     | 56.07  | 1,003,316.58  |    |
|        | CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 48,078     | 18.87  | 907,231.86    |    |
|        | CHEVRON CORP                 | 141,850    | 116.56 | 16,534,036.00 |    |
|        | CIMAREX ENERGY CO            | 6,241      | 58.55  | 365,410.55    |    |
|        | COBALT INTERNATIONAL ENERGY  | 12,718     | 22.27  | 283,229.86    |    |
|        | CONCHO RESOURCES INC         | 7,186      | 94.75  | 680,873.50    |    |
|        | CONOCOPHILLIPS               | 86,433     | 57.18  | 4,942,238.94  |    |
|        | CONSOL ENERGY INC            | 16,065     | 30.05  | 482,753.25    |    |
|        | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 3,121      | 76.90  | 240,004.90    |    |
|        | CORE LABORATORIES N.V.       | 3,400      | 121.48 | 413,032.00    |    |
|        | DENBURY RESOURCES INC        | 28,336     | 16.16  | 457,909.76    |    |
|        | DEVON ENERGY CORPORATION     | 27,854     | 60.50  | 1,685,167.00  |    |
|        | DIAMOND OFFSHORE DRILLING    | 5,048      | 65.81  | 332,208.88    |    |
|        | ENERGEN CORP                 | 5,220      | 52.41  | 273,580.20    |    |
|        | ENSCO PLC-CL A               | 16,700     | 54.56  | 911,152.00    |    |
|        | EOG RESOURCES INC            | 19,375     | 112.05 | 2,170,968.75  |    |
|        | EQT CORPORATION              | 10,892     | 59.00  | 642,628.00    |    |
|        | EXXON MOBIL                  | 336,371    | 91.45  | 30,761,127.95 |    |
|        | FMC TECHNOLOGIES INC         | 17,331     | 46.30  | 802,425.30    |    |
|        | HALLIBURTON CO               | 66,822     | 33.69  | 2,251,233.18  |    |
|        | HELMERICH & PAYNE            | 7,824      | 47.61  | 372,500.64    |    |
|        | HESS CORP                    | 22,253     | 53.72  | 1,195,431.16  |    |
|        | HOLLYFRONTIER CORP           | 13,989     | 41.27  | 577,326.03    |    |

|                              |        |        |              |  |
|------------------------------|--------|--------|--------------|--|
| KINDER MORGAN INC            | 40,746 | 35.52  | 1,447,297.92 |  |
| KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC | 7,128  | 76.40  | 544,579.20   |  |
| MARATHON OIL CORP            | 51,151 | 29.57  | 1,512,535.07 |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 24,537 | 54.59  | 1,339,474.83 |  |
| MURPHY OIL CORP              | 13,392 | 53.69  | 719,016.48   |  |
| NABORS INDUSTRIES LTD        | 19,925 | 14.03  | 279,547.75   |  |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 30,838 | 80.11  | 2,470,432.18 |  |
| NEWFIELD EXPLORATION CO      | 9,799  | 31.32  | 306,904.68   |  |
| NOBLE CORP                   | 18,267 | 35.78  | 653,593.26   |  |
| NOBLE ENERGY INC             | 12,810 | 92.71  | 1,187,615.10 |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 58,376 | 86.06  | 5,023,838.56 |  |
| PEABODY ENERGY CORP          | 19,769 | 22.29  | 440,651.01   |  |
| PHILLIPS 66                  | 42,766 | 46.37  | 1,983,059.42 |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES    | 8,532  | 104.40 | 890,740.80   |  |
| PLAINS EXPLORATION & PRODUCT | 9,070  | 37.47  | 339,852.90   |  |
| QEP RESOURCES INC            | 12,861 | 31.66  | 407,179.26   |  |
| RANGE RESOURCES CORP         | 11,781 | 69.87  | 823,138.47   |  |
| ROWAN COMPANIES PLC          | 8,660  | 33.77  | 292,448.20   |  |
| SCHLUMBERGER                 | 95,934 | 72.33  | 6,938,906.22 |  |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO       | 25,390 | 34.78  | 883,064.20   |  |
| SPECTRA ENERGY CORP          | 47,282 | 29.36  | 1,388,199.52 |  |
| SUNOCO INC                   | 7,797  | 46.83  | 365,133.51   |  |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 11,100 | 20.52  | 227,772.00   |  |
| ULTRA PETROLEUM CORP         | 11,111 | 21.98  | 244,219.78   |  |
| VALERO ENERGY CORP           | 40,323 | 31.68  | 1,277,432.64 |  |
| WEATHERFORD INTL LTD         | 55,109 | 12.68  | 698,782.12   |  |
| WHITING PETROLEUM CORP       | 8,534  | 47.38  | 404,340.92   |  |
| WILLIAMS COS                 | 45,008 | 34.97  | 1,573,929.76 |  |
| AIR PRODUCTS&CHEMICALS       | 15,272 | 82.70  | 1,262,994.40 |  |
| AIRGAS INC                   | 4,822  | 82.30  | 396,850.60   |  |
| ALBEMARLE CORP               | 6,300  | 52.68  | 331,884.00   |  |
| ALCOA                        | 77,459 | 8.85   | 685,512.15   |  |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC   | 7,356  | 31.90  | 234,656.40   |  |

|                              |        |        |              |  |
|------------------------------|--------|--------|--------------|--|
| BALL CORP                    | 10,706 | 42.31  | 452,970.86   |  |
| CELANESE CORP-SERIES A       | 11,037 | 37.91  | 418,412.67   |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 4,672  | 222.24 | 1,038,305.28 |  |
| CLIFFS NATURAL RESOURCES INC | 10,062 | 39.13  | 393,726.06   |  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 10,807 | 36.75  | 397,157.25   |  |
| DOW CHEMICAL CO              | 86,115 | 28.96  | 2,493,890.40 |  |
| DU PONT (E.I) DE NEMOURS     | 67,673 | 50.27  | 3,401,921.71 |  |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY     | 11,033 | 57.01  | 628,991.33   |  |
| ECOLAB INC                   | 21,169 | 64.81  | 1,371,962.89 |  |
| FMC CORP                     | 10,160 | 55.38  | 562,660.80   |  |
| FREEPORT-MCMOR-B             | 68,277 | 39.58  | 2,702,403.66 |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 5,909  | 59.58  | 352,058.22   |  |
| INT'L PAPER CO               | 30,161 | 36.32  | 1,095,447.52 |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 22,904 | 51.66  | 1,183,220.64 |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 3,355  | 82.87  | 278,028.85   |  |
| MEADWESTVACO CORP            | 12,416 | 30.60  | 379,929.60   |  |
| MONSANTO CO                  | 38,397 | 91.02  | 3,494,894.94 |  |
| MOSAIC CO/THE                | 21,552 | 57.61  | 1,241,610.72 |  |
| NEWMONT MINING CORP          | 35,983 | 56.01  | 2,015,407.83 |  |
| NUCOR CORP                   | 22,975 | 38.26  | 879,023.50   |  |
| OWENS-ILLINOIS INC           | 10,981 | 18.76  | 206,003.56   |  |
| PPG INDUSTRIES INC           | 11,025 | 114.84 | 1,266,111.00 |  |
| PRAXAIR INC                  | 21,442 | 103.88 | 2,227,394.96 |  |
| ROCK-TENN COMPANY -CL A      | 5,115  | 72.18  | 369,200.70   |  |
| SEALED AIR CORP              | 13,274 | 15.46  | 205,216.04   |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 6,297  | 148.91 | 937,686.27   |  |
| SIGMA-ALDRICH                | 8,552  | 71.97  | 615,487.44   |  |
| UNITED STATES STEEL CORP     | 10,928 | 19.07  | 208,396.96   |  |
| VULCAN MATERIALS CO          | 9,355  | 47.30  | 442,491.50   |  |
| WALTER ENERGY INC            | 4,175  | 32.46  | 135,520.50   |  |
| 3 M COMPANY                  | 47,415 | 92.42  | 4,382,094.30 |  |
| AGCO CORP                    | 6,928  | 47.48  | 328,941.44   |  |
| AMETEK INC                   | 17,456 | 35.45  | 618,815.20   |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| BOEING CO                    | 51,408  | 69.62  | 3,579,024.96  |  |
| CATERPILLAR                  | 47,033  | 86.04  | 4,046,719.32  |  |
| COOPER INDUSTRIES PLC-CL A   | 11,471  | 75.06  | 861,013.26    |  |
| CUMMINS INC                  | 13,249  | 92.21  | 1,221,690.29  |  |
| DANAHER CORP                 | 42,505  | 55.15  | 2,344,150.75  |  |
| DEERE&CO                     | 27,175  | 82.49  | 2,241,665.75  |  |
| DOVER CORP                   | 13,294  | 59.49  | 790,860.06    |  |
| EATON CORP                   | 23,127  | 47.26  | 1,092,982.02  |  |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 52,792  | 48.27  | 2,548,269.84  |  |
| FASTENAL CO                  | 20,350  | 42.99  | 874,846.50    |  |
| FLOWSERVE CORP               | 3,850   | 127.74 | 491,799.00    |  |
| FLUOR CORP                   | 11,944  | 56.28  | 672,208.32    |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 22,038  | 66.12  | 1,457,152.56  |  |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 762,159 | 22.71  | 17,308,630.89 |  |
| GRAINGER (WW) INC            | 4,264   | 208.37 | 888,489.68    |  |
| HONEYWELL INTL INC           | 53,530  | 59.75  | 3,198,417.50  |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 30,875  | 59.47  | 1,836,136.25  |  |
| INGERSOLL-RAND PLC           | 21,572  | 44.82  | 966,857.04    |  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 9,367   | 40.43  | 378,707.81    |  |
| JOY GLOBAL INC               | 7,782   | 56.06  | 436,258.92    |  |
| KBR INC                      | 10,314  | 29.82  | 307,563.48    |  |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS  | 7,220   | 71.71  | 517,746.20    |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 20,089  | 93.38  | 1,875,910.82  |  |
| MASCO CORP                   | 26,116  | 15.05  | 393,045.80    |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 17,396  | 66.43  | 1,155,616.28  |  |
| PACCAR INC                   | 24,655  | 40.02  | 986,816.37    |  |
| PALL CORP                    | 8,379   | 63.49  | 531,982.71    |  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 11,001  | 83.58  | 919,463.58    |  |
| PENTAIR INC                  | 6,840   | 44.51  | 304,448.40    |  |
| PRECISION CASTPARTS CORP     | 10,540  | 163.34 | 1,721,603.60  |  |
| QUANTA SERVICES INC          | 15,088  | 24.70  | 372,673.60    |  |
| RAYTHEON COMPANY             | 23,940  | 57.16  | 1,368,410.40  |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 10,389  | 69.55  | 722,554.95    |  |

|                              |        |        |              |  |
|------------------------------|--------|--------|--------------|--|
| ROCKWELL COLLIN              | 9,886  | 53.64  | 530,285.04   |  |
| ROPER INDUSTRIES INC         | 7,050  | 109.89 | 774,724.50   |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 6,200  | 29.77  | 184,574.00   |  |
| SPX CORP                     | 3,711  | 65.41  | 242,736.51   |  |
| STANLEY BLACK&DECKER         | 11,728 | 76.25  | 894,260.00   |  |
| TEXTRON                      | 20,275 | 26.17  | 530,596.75   |  |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 3,400  | 141.87 | 482,358.00   |  |
| TYCO INTERNATIONAL LTD       | 33,488 | 56.26  | 1,884,034.88 |  |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 62,252 | 78.29  | 4,873,709.08 |  |
| URS CORP                     | 5,746  | 35.31  | 202,891.26   |  |
| XYLEM INC                    | 13,023 | 25.15  | 327,528.45   |  |
| AVERY DENNISON CORP          | 7,757  | 31.82  | 246,827.74   |  |
| CINTAS CORP                  | 8,506  | 41.45  | 352,573.70   |  |
| DUN & BRADSTREET CORP        | 3,250  | 79.62  | 258,765.00   |  |
| EQUIFAX INC                  | 8,390  | 46.58  | 390,806.20   |  |
| IHS INC-CLASS A              | 4,025  | 97.35  | 391,833.75   |  |
| IRON MOUNTAIN INC            | 9,646  | 34.11  | 329,025.06   |  |
| MANPOWER GROUP               | 5,455  | 36.80  | 200,744.00   |  |
| NIELSEN HOLDINGS NV          | 8,925  | 29.98  | 267,571.50   |  |
| PITNEY BOWES INC             | 14,548 | 13.82  | 201,053.36   |  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 22,810 | 27.51  | 627,503.10   |  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 9,411  | 26.63  | 250,614.93   |  |
| STERICYCLE INC               | 6,006  | 90.52  | 543,663.12   |  |
| VERISK ANALYTICS INC-CLASS A | 10,132 | 47.61  | 482,384.52   |  |
| WASTE MANAGEMENT INC         | 31,839 | 32.08  | 1,021,395.12 |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 11,877 | 58.55  | 695,398.35   |  |
| CSX CORP                     | 74,699 | 20.75  | 1,550,004.25 |  |
| DELTA AIR LINES INC          | 15,452 | 9.16   | 141,540.32   |  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 15,376 | 36.36  | 559,071.36   |  |
| FEDEX CORP                   | 21,649 | 84.62  | 1,831,938.38 |  |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 18,747 | 13.73  | 257,396.31   |  |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 6,771  | 52.04  | 352,362.84   |  |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 8,011  | 75.78  | 607,073.58   |  |

|                                 |         |        |              |  |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| NORFOLK SOUTHERN CORP           | 23,431  | 63.63  | 1,490,914.53 |  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO           | 12,987  | 8.77   | 113,895.99   |  |
| UNION PACIFIC CORP              | 34,398  | 118.70 | 4,083,042.60 |  |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 5,391   | 19.50  | 105,124.50   |  |
| UNITED PARCEL SERVICE B         | 52,181  | 71.57  | 3,734,594.17 |  |
| AUTOLIV INC                     | 6,506   | 61.97  | 403,176.82   |  |
| BORGWARNER INC                  | 8,264   | 69.11  | 571,125.04   |  |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC           | 22,500  | 31.00  | 697,500.00   |  |
| FORD MOTOR COMPANY              | 257,914 | 9.86   | 2,543,032.04 |  |
| GENERAL MOTORS CO               | 56,968  | 22.75  | 1,296,022.00 |  |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO       | 17,889  | 12.19  | 218,066.91   |  |
| HARLEY-DAVIDSON                 | 16,785  | 42.37  | 711,180.45   |  |
| JOHNSON CONTROLS INC            | 49,533  | 27.40  | 1,357,204.20 |  |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP    | 7,654   | 43.71  | 334,556.34   |  |
| COACH INC                       | 20,973  | 56.02  | 1,174,907.46 |  |
| DR HORTON INC                   | 20,778  | 20.64  | 428,857.92   |  |
| FOSSIL INC                      | 3,699   | 84.70  | 313,305.30   |  |
| GARMIN LTD                      | 8,514   | 41.74  | 355,374.36   |  |
| HASBRO INC                      | 8,070   | 38.17  | 308,031.90   |  |
| LEGGETT & PLATT INC             | 9,883   | 25.05  | 247,569.15   |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC         | 7,282   | 73.94  | 538,431.08   |  |
| MATTEL INC                      | 24,713  | 35.48  | 876,817.24   |  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC           | 4,220   | 80.02  | 337,684.40   |  |
| NEWELL RUBBERMAID               | 21,025  | 19.09  | 401,367.25   |  |
| NIKE B                          | 26,811  | 94.91  | 2,544,632.01 |  |
| PVH CORP                        | 4,900   | 93.72  | 459,228.00   |  |
| RALPH LAUREN CORPORATION        | 4,511   | 151.23 | 682,198.53   |  |
| TOLL BROTHERS INC               | 10,462  | 33.23  | 347,652.26   |  |
| VF CORP                         | 6,422   | 159.36 | 1,023,409.92 |  |
| WHIRLPOOL CORP                  | 5,627   | 82.91  | 466,534.57   |  |
| APOLLO GROUP INC-CLA            | 8,140   | 29.05  | 236,467.00   |  |
| BLOCK H & R INC                 | 20,508  | 17.33  | 355,403.64   |  |
| CARNIVAL CORPORATION            | 32,551  | 36.44  | 1,186,158.44 |  |

|                              |         |        |              |  |
|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 2,299   | 317.54 | 730,024.46   |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 9,164   | 55.75  | 510,893.00   |  |
| INT'L GAME TECHNOLOGY        | 21,660  | 13.09  | 283,529.40   |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 29,372  | 46.37  | 1,361,979.64 |  |
| MARRIOTT INTL A              | 19,482  | 39.10  | 761,746.20   |  |
| MCDONALD'S CORP              | 73,227  | 91.75  | 6,718,577.25 |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 10,272  | 30.21  | 310,317.12   |  |
| STARBUCKS CORP               | 54,894  | 50.75  | 2,785,870.50 |  |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    | 14,301  | 57.96  | 828,885.96   |  |
| WYMDHAM WORLDWIDE CORP       | 10,700  | 52.48  | 561,536.00   |  |
| WYNN RESORTS LTD             | 5,848   | 115.44 | 675,093.12   |  |
| YUM BRANDS INC               | 33,485  | 66.34  | 2,221,394.90 |  |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 13,601  | 15.85  | 215,575.85   |  |
| CBS CORP-CL B                | 44,078  | 36.33  | 1,601,353.74 |  |
| CHARTER COMMUNICATION-A      | 2,800   | 75.07  | 210,196.00   |  |
| COMCAST CORP-CL A            | 152,549 | 35.77  | 5,456,677.73 |  |
| COMCAST CORP-SPECIAL A       | 41,598  | 34.80  | 1,447,610.40 |  |
| DIRECTV                      | 47,223  | 52.46  | 2,477,318.58 |  |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   | 10,066  | 59.63  | 600,235.58   |  |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   | 7,403   | 56.04  | 414,864.12   |  |
| DISH NETWORK CORPORATION-A   | 15,229  | 30.61  | 466,159.69   |  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS     | 32,060  | 11.12  | 356,507.20   |  |
| LIBERTY GLOBAL INC-A         | 10,034  | 60.75  | 609,565.50   |  |
| LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C  | 8,461   | 56.42  | 477,369.62   |  |
| LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A | 7,586   | 104.17 | 790,233.62   |  |
| MCGRAW-HILL COS              | 18,178  | 54.59  | 992,337.02   |  |
| NEWS CORP -CLASS A           | 117,002 | 24.53  | 2,870,059.06 |  |
| NEWS CORP -CLASS B           | 31,956  | 24.80  | 792,508.80   |  |
| OMNICOM GROUP                | 19,903  | 51.56  | 1,026,198.68 |  |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A  | 6,475   | 61.23  | 396,464.25   |  |
| SIRIUS XM RADIO INC          | 265,155 | 2.60   | 689,403.00   |  |
| THE WALT DISNEY CO           | 122,467 | 52.28  | 6,402,574.76 |  |
| TIME WARNER CABLE-A          | 22,503  | 95.06  | 2,139,135.18 |  |

|                                 |         |        |              |  |
|---------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| TIME WARNER INC                 | 69,229  | 45.33  | 3,138,150.57 |  |
| VIACOM INC-CLASS B              | 34,389  | 53.59  | 1,842,906.51 |  |
| VIRGIN MEDIA INC                | 19,009  | 29.44  | 559,624.96   |  |
| WASHINGTON POST -CL B           | 351     | 363.03 | 127,423.53   |  |
| ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A     | 6,225   | 33.92  | 211,152.00   |  |
| ADVANCE AUTO PARTS              | 5,336   | 68.44  | 365,195.84   |  |
| AMAZON.COM                      | 26,000  | 254.32 | 6,612,320.00 |  |
| AUTOZONE INC                    | 2,505   | 369.67 | 926,023.35   |  |
| BED BATH & BEYOND INC           | 16,808  | 63.00  | 1,058,904.00 |  |
| BEST BUY COMPANY INC            | 21,408  | 17.19  | 368,003.52   |  |
| CARMAX INC                      | 16,087  | 28.30  | 455,262.10   |  |
| DICK'S SPORTING GOODS INC       | 6,800   | 51.85  | 352,580.00   |  |
| DOLLAR GENERAL CORP             | 15,736  | 51.54  | 811,033.44   |  |
| DOLLAR TREE INC                 | 16,766  | 48.27  | 809,378.65   |  |
| EXPEDIA INC                     | 6,577   | 57.84  | 380,413.68   |  |
| FAMILY DOLLAR STORES            | 7,337   | 66.30  | 486,443.10   |  |
| GAMESTOP CORP-CLASS A           | 9,282   | 21.00  | 194,922.00   |  |
| GAP                             | 23,065  | 35.78  | 825,265.70   |  |
| GENUINE PARTS CO                | 11,340  | 61.03  | 692,080.20   |  |
| HOME DEPOT                      | 110,393 | 60.37  | 6,664,425.41 |  |
| J.C. PENNEY CO INC              | 11,122  | 24.29  | 270,153.38   |  |
| KOHL'S CORP                     | 16,448  | 51.22  | 842,466.56   |  |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION | 38,140  | 18.50  | 705,590.00   |  |
| LIBERTY VENTURES-RTS            | 663     | 13.54  | 8,977.02     |  |
| LIMITED                         | 18,307  | 49.26  | 901,802.82   |  |
| LOWES COMPANIES                 | 84,843  | 30.24  | 2,565,652.32 |  |
| MACY'S INC                      | 30,110  | 37.62  | 1,132,738.20 |  |
| NETFLIX INC                     | 3,854   | 54.44  | 209,811.76   |  |
| NORDSTROM INC                   | 12,073  | 55.18  | 666,188.14   |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC         | 9,307   | 83.62  | 778,251.34   |  |
| PETSMART INC                    | 7,860   | 68.98  | 542,182.80   |  |
| PRICELINE.COM INC               | 3,639   | 618.73 | 2,251,558.47 |  |
| ROSS STORES INC                 | 16,306  | 64.60  | 1,053,367.60 |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| SEARS HOLDINGS CORPORATION   | 3,037   | 55.49  | 168,523.13    |  |
| STAPLES INC                  | 50,510  | 11.52  | 581,875.20    |  |
| TARGET (DAYTON HUDSON)       | 45,292  | 63.47  | 2,874,683.24  |  |
| TIFFANY & CO                 | 9,010   | 61.88  | 557,538.80    |  |
| TJX COMPANIES INC            | 53,390  | 44.79  | 2,391,338.10  |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 5,100   | 98.89  | 504,339.00    |  |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 4,200   | 96.30  | 404,481.00    |  |
| URBAN OUTFITTERS INC         | 8,259   | 37.56  | 310,208.04    |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 31,175  | 100.12 | 3,121,396.87  |  |
| CVS CAREMARK CORPORATION     | 92,226  | 48.42  | 4,465,582.92  |  |
| KROGER CO                    | 38,329  | 23.54  | 902,264.66    |  |
| SAFEWAY INC                  | 17,252  | 16.09  | 277,584.68    |  |
| SYSCO CORP                   | 42,441  | 31.27  | 1,327,130.07  |  |
| WALGREEN CO                  | 62,093  | 36.44  | 2,262,668.92  |  |
| WAL-MART STORES              | 133,842 | 73.80  | 9,877,539.60  |  |
| WHOLE FOODS MKT INC          | 12,601  | 97.40  | 1,227,337.40  |  |
| ALTRIA GROUP INC             | 146,391 | 33.39  | 4,887,995.49  |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 48,061  | 27.18  | 1,306,297.98  |  |
| BEAM INC                     | 9,955   | 57.54  | 572,810.70    |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 8,652   | 65.25  | 564,543.00    |  |
| BUNGE LIMITED                | 10,331  | 67.05  | 692,693.55    |  |
| CAMPBELL SOUP CO (US)        | 13,847  | 34.82  | 482,152.54    |  |
| COCA-COLA CO                 | 292,136 | 37.93  | 11,080,718.48 |  |
| COCA-COLA ENTERPRISES        | 21,620  | 31.27  | 676,057.40    |  |
| CONAGRA                      | 29,113  | 27.59  | 803,227.67    |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 12,392  | 32.35  | 400,881.20    |  |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC  | 14,855  | 44.53  | 661,493.15    |  |
| GENERAL MILLS INC            | 46,821  | 39.85  | 1,865,816.85  |  |
| GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE | 9,107   | 23.75  | 216,291.25    |  |
| HEINZ (H.J) CO               | 23,211  | 55.95  | 1,298,655.45  |  |
| HERSHEY FOODS CORPORATION    | 10,998  | 70.89  | 779,648.22    |  |
| HORMEL FOODS CORP            | 9,753   | 29.24  | 285,177.72    |  |
| JM SMUCKER CO                | 8,011   | 86.33  | 691,589.63    |  |

|                                |         |        |               |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| KELLOGG CO                     | 17,609  | 51.66  | 909,680.94    |  |
| KRAFT FOODS INC-A              | 121,118 | 41.35  | 5,008,229.30  |  |
| LORILLARD INC                  | 9,427   | 116.45 | 1,097,774.15  |  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS    | 8,331   | 62.04  | 516,855.24    |  |
| MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 14,410  | 73.28  | 1,055,964.80  |  |
| MOLSON COORS BREWING CO -B     | 10,947  | 45.05  | 493,162.35    |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP          | 10,498  | 54.16  | 568,571.68    |  |
| PEPSICO INC                    | 112,529 | 70.77  | 7,963,677.33  |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL    | 122,734 | 89.94  | 11,038,695.96 |  |
| RALCORP HOLDINGS INC           | 3,686   | 73.00  | 269,078.00    |  |
| REYNOLDS AMERICAN INC          | 25,084  | 43.34  | 1,087,140.56  |  |
| TYSON FOODS INC                | 20,771  | 16.02  | 332,751.42    |  |
| AVON PRODUCTS INC              | 30,401  | 15.95  | 484,895.95    |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC         | 9,912   | 53.99  | 535,148.88    |  |
| CLOROX COMPANY                 | 8,819   | 72.05  | 635,408.95    |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO           | 34,360  | 107.22 | 3,684,079.20  |  |
| ENERGIZER HOLDINGS INC         | 4,636   | 74.61  | 345,891.96    |  |
| ESTEE LAUDER CO-CL A           | 17,091  | 61.57  | 1,052,292.87  |  |
| HERBALIFE LTD                  | 8,060   | 47.40  | 382,044.00    |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 28,249  | 85.78  | 2,423,199.22  |  |
| PROCTER & GAMBLE CO            | 197,052 | 69.36  | 13,667,526.72 |  |
| AETNA INC                      | 25,423  | 39.60  | 1,006,750.80  |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP         | 18,173  | 38.71  | 703,476.83    |  |
| BARD C R INC                   | 5,844   | 104.65 | 611,574.60    |  |
| BAXTER INTERNATIONAL           | 40,000  | 60.26  | 2,410,400.00  |  |
| BECTON DICKINSON & CO          | 14,568  | 78.56  | 1,144,462.08  |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 105,353 | 5.74   | 604,726.22    |  |
| CARDINAL HEALTH                | 25,100  | 38.97  | 978,147.00    |  |
| CAREFUSION CORP                | 16,318  | 28.39  | 463,268.02    |  |
| CERNER CORP                    | 10,427  | 77.41  | 807,154.07    |  |
| CIGNA CORP                     | 20,786  | 47.17  | 980,475.62    |  |
| COVENTRY HEALTH CARE INCON     | 9,997   | 41.69  | 416,774.93    |  |
| COVIDIEN PLC                   | 34,655  | 59.42  | 2,059,200.10  |  |

|                             |         |        |              |  |
|-----------------------------|---------|--------|--------------|--|
| DAVITA INC                  | 6,779   | 103.61 | 702,372.19   |  |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC  | 10,064  | 38.14  | 383,840.96   |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 8,327   | 107.37 | 894,069.99   |  |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING     | 58,003  | 62.67  | 3,635,048.01 |  |
| HCA HOLDINGS INC            | 12,675  | 33.25  | 421,443.75   |  |
| HENRY SCHEIN INC            | 6,541   | 79.27  | 518,505.07   |  |
| HOLOGIC INC                 | 19,192  | 20.24  | 388,446.08   |  |
| HUMANA INC                  | 11,932  | 70.15  | 837,029.80   |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC      | 2,807   | 495.63 | 1,391,233.41 |  |
| LABORATORY CRP OF AMER      | 7,026   | 92.47  | 649,694.22   |  |
| MCKESSON CORP               | 16,918  | 86.03  | 1,455,455.54 |  |
| MEDTRONIC                   | 74,602  | 43.12  | 3,216,838.24 |  |
| OMNICARE INC                | 8,245   | 33.97  | 280,082.65   |  |
| PATTERSON COMPANIES INC     | 6,826   | 34.24  | 233,722.24   |  |
| QUEST DIAGNOSTICS           | 11,548  | 63.43  | 732,489.64   |  |
| ST JUDE MEDICAL INC         | 22,527  | 42.13  | 949,062.51   |  |
| STRYKER CORP                | 22,089  | 55.66  | 1,229,473.74 |  |
| UNITED HEALTHCARE CORP      | 74,674  | 55.41  | 4,137,686.34 |  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 8,199   | 60.32  | 494,563.68   |  |
| WELLPOINT INC               | 23,758  | 58.01  | 1,378,201.58 |  |
| ZIMMER HOLDINGS INC         | 12,980  | 67.62  | 877,707.60   |  |
| ABBOTT LABORATORIES         | 113,153 | 68.56  | 7,757,769.68 |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES        | 25,215  | 38.45  | 969,516.75   |  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 13,779  | 114.40 | 1,576,317.60 |  |
| ALLERGAN INC                | 22,094  | 91.58  | 2,023,368.52 |  |
| AMGEN                       | 55,953  | 84.32  | 4,717,956.96 |  |
| BIOGEN IDEC INC             | 16,429  | 149.23 | 2,451,699.67 |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO     | 121,496 | 33.75  | 4,100,490.00 |  |
| CELGENE CORP                | 31,881  | 76.40  | 2,435,708.40 |  |
| FOREST LABORATORIES INC     | 19,262  | 35.61  | 685,919.82   |  |
| GILEAD SCIENCES INC         | 54,521  | 66.33  | 3,616,377.93 |  |
| HOSPIRA INC                 | 12,012  | 32.82  | 394,233.84   |  |
| ILLUMINA INC                | 8,915   | 48.20  | 429,703.00   |  |

|                               |         |        |               |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| JOHNSON & JOHNSON             | 197,498 | 68.91  | 13,609,587.18 |  |
| LIFE TECHNOLOGIES CORP        | 12,615  | 48.88  | 616,621.20    |  |
| LILLY (ELI) & CO              | 75,167  | 47.41  | 3,563,667.47  |  |
| MERCK & CO                    | 218,783 | 45.10  | 9,867,113.30  |  |
| MYLAN INC                     | 31,016  | 24.40  | 756,790.40    |  |
| PERRIGO CO                    | 6,408   | 116.17 | 744,417.36    |  |
| PFIZER                        | 538,647 | 24.85  | 13,385,377.95 |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 5,400   | 152.66 | 824,364.00    |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  | 26,592  | 58.83  | 1,564,407.36  |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    | 15,245  | 55.95  | 852,957.75    |  |
| WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A   | 12,303  | 13.50  | 166,090.50    |  |
| WATERS CORP                   | 6,509   | 83.33  | 542,394.97    |  |
| WATSON PHARMACEUTICALS INC    | 9,211   | 85.16  | 784,408.76    |  |
| BB&T CORP                     | 50,609  | 33.16  | 1,678,194.44  |  |
| CIT GROUP INC                 | 13,444  | 39.39  | 529,559.16    |  |
| COMERICA INC                  | 14,367  | 31.05  | 446,095.35    |  |
| FIFTH THIRD BANCORP           | 66,796  | 15.51  | 1,036,005.96  |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA        | 6,400   | 34.46  | 220,544.00    |  |
| HUDSON CITY BANCORP INC       | 32,951  | 7.96   | 262,289.96    |  |
| KEY CORP                      | 67,310  | 8.74   | 588,289.40    |  |
| M & T BANK CORP               | 8,259   | 95.16  | 785,926.44    |  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP    | 31,808  | 14.16  | 450,401.28    |  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 24,989  | 12.14  | 303,366.46    |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  | 38,276  | 63.10  | 2,415,215.60  |  |
| REGIONS FINL CORP             | 102,530 | 7.21   | 739,241.30    |  |
| SUNTRUST BANKS                | 38,903  | 28.27  | 1,099,787.81  |  |
| US BANCORP                    | 136,295 | 34.30  | 4,674,918.50  |  |
| WELLS FARGO & CO              | 363,156 | 34.53  | 12,539,776.68 |  |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP     | 3,700   | 123.00 | 455,100.00    |  |
| AMERICAN EXPRESS              | 74,491  | 56.86  | 4,235,558.26  |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 15,727  | 56.69  | 891,563.63    |  |
| BANK NEW YORK CO              | 85,776  | 22.62  | 1,940,253.12  |  |
| BANK OF AMERICA CORP          | 775,179 | 8.83   | 6,844,830.57  |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| BLACKROCK INC                | 9,573   | 178.30 | 1,706,865.90  |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 37,618  | 57.01  | 2,144,602.18  |  |
| CITIGROUP                    | 210,878 | 32.72  | 6,899,928.16  |  |
| CME GROUP INC                | 22,685  | 57.30  | 1,299,850.50  |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 38,448  | 39.73  | 1,527,539.04  |  |
| EATON VANCE CORP             | 7,818   | 28.96  | 226,409.28    |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 10,821  | 125.07 | 1,353,382.47  |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 33,570  | 113.68 | 3,816,237.60  |  |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 5,158   | 133.41 | 688,128.78    |  |
| INVESCO LTD                  | 32,353  | 24.99  | 808,501.47    |  |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 273,850 | 40.48  | 11,085,448.00 |  |
| LEGG MASON INC               | 9,201   | 24.68  | 227,080.68    |  |
| LEUCADIA NATIONAL CORP       | 14,405  | 22.75  | 327,713.75    |  |
| MOODY'S CORP                 | 14,544  | 44.17  | 642,408.48    |  |
| MORGAN STANLEY               | 107,749 | 16.74  | 1,803,718.26  |  |
| NASDAQ OMX GROUP             | 9,473   | 23.29  | 220,673.53    |  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 15,802  | 46.41  | 733,449.83    |  |
| NYSE EURONEXT                | 18,717  | 24.65  | 461,374.05    |  |
| PRICE T ROWE GROUP INC       | 18,391  | 63.30  | 1,164,150.30  |  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 78,474  | 12.79  | 1,003,682.46  |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 10,349  | 21.45  | 221,986.05    |  |
| SLM CORP                     | 35,251  | 15.72  | 554,145.72    |  |
| STATE STREET CORP            | 35,392  | 41.96  | 1,485,048.32  |  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP   | 15,221  | 15.37  | 233,946.77    |  |
| ACE LTD                      | 24,520  | 75.60  | 1,853,712.00  |  |
| AFLAC                        | 33,909  | 47.88  | 1,623,562.92  |  |
| ALLEGHANY CORP               | 880     | 344.94 | 303,547.20    |  |
| ALLSTATE CORP                | 35,288  | 39.61  | 1,397,757.68  |  |
| AMERICAN INT'L GROUP         | 79,672  | 32.79  | 2,612,444.88  |  |
| AON PLC                      | 22,453  | 52.29  | 1,174,067.37  |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 9,772   | 41.68  | 407,296.96    |  |
| ASSURANT INC                 | 6,382   | 37.30  | 238,048.60    |  |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD    | 8,295   | 34.92  | 289,661.40    |  |

|                             |        |        |              |  |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|--|
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 66,151 | 88.20  | 5,834,518.20 |  |
| CHUBB CORPORATION           | 19,392 | 76.28  | 1,479,221.76 |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP   | 11,169 | 37.89  | 423,193.41   |  |
| EVEREST RE GROUP LTD        | 3,922  | 106.96 | 419,497.12   |  |
| FIDELITY NATIONAL FINL-A    | 14,773 | 21.39  | 315,994.47   |  |
| GENWORTH FINANCIAL INC-CL A | 32,823 | 5.23   | 171,664.29   |  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS     | 30,412 | 19.44  | 591,209.28   |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP       | 20,903 | 24.19  | 505,643.57   |  |
| LOEWS CORP                  | 23,011 | 41.26  | 949,433.86   |  |
| MARSH & MCLENNAN COS        | 39,468 | 33.93  | 1,339,149.24 |  |
| METLIFE INC                 | 61,613 | 34.46  | 2,123,183.98 |  |
| PARTNERRE LTD               | 4,703  | 74.28  | 349,338.84   |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP   | 21,845 | 26.94  | 588,504.30   |  |
| PROGRESSIVE CORP            | 42,171 | 20.74  | 874,626.54   |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC    | 33,624 | 54.51  | 1,832,844.24 |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD  | 3,672  | 77.04  | 282,890.88   |  |
| TORCHMARK CORP              | 7,064  | 51.35  | 362,736.40   |  |
| TRAVELERS COS INC/THE       | 27,998 | 68.26  | 1,911,143.48 |  |
| UNUM GROUP                  | 21,059 | 19.22  | 404,753.98   |  |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC   | 12,323 | 36.92  | 454,965.16   |  |
| WR BERKLEY CORP             | 8,075  | 37.49  | 302,731.75   |  |
| XL GROUP PLC                | 22,876 | 24.03  | 549,710.28   |  |
| CBRE GROUP INC-A            | 22,035 | 18.41  | 405,664.35   |  |
| WEYERHAEUSER CO             | 38,964 | 26.14  | 1,018,518.96 |  |
| ACCENTURE PLC-CL A          | 46,351 | 70.03  | 3,245,960.53 |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     | 31,726 | 11.28  | 357,869.28   |  |
| ADOBE SYSTEMS INC           | 35,821 | 32.46  | 1,162,749.66 |  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES, INC    | 12,433 | 38.26  | 475,686.58   |  |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP  | 3,662  | 141.95 | 519,820.90   |  |
| ANSYS INC                   | 6,600  | 73.40  | 484,440.00   |  |
| AUTODESK INC                | 16,451 | 33.37  | 548,969.87   |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESS      | 35,174 | 58.66  | 2,063,306.84 |  |
| BMC SOFTWARE                | 11,793 | 41.49  | 489,291.57   |  |

|                                        |         |        |               |  |
|----------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| CA INC                                 | 23,790  | 25.76  | 612,949.35    |  |
| CITRIX SYSTEMS INC                     | 13,469  | 76.57  | 1,031,321.33  |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A             | 21,999  | 69.92  | 1,538,170.08  |  |
| COMPUTER SCIENCES CORP                 | 11,267  | 32.21  | 362,910.07    |  |
| EBAY                                   | 83,580  | 48.41  | 4,046,107.80  |  |
| ELECTRONIC ARTS INC                    | 24,059  | 12.69  | 305,308.71    |  |
| EQUINIX INC                            | 3,400   | 206.05 | 700,570.00    |  |
| FACEBOOK INC-A                         | 32,300  | 21.65  | 699,295.00    |  |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 16,601  | 31.22  | 518,283.22    |  |
| FISERV INC                             | 9,818   | 74.03  | 726,826.54    |  |
| GOOGLE INC-CL A                        | 18,716  | 754.50 | 14,121,222.00 |  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP            | 78,802  | 207.45 | 16,347,474.90 |  |
| INTUIT INC                             | 20,301  | 58.88  | 1,195,322.88  |  |
| LINKEDIN CORP - A                      | 4,500   | 120.40 | 541,800.00    |  |
| MASTERCARD INC-CLASS A                 | 7,803   | 451.48 | 3,522,898.44  |  |
| MICROSOFT CORP                         | 543,891 | 29.78  | 16,197,073.98 |  |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC              | 17,387  | 24.89  | 432,762.43    |  |
| ORACLE CORP                            | 286,324 | 31.49  | 9,016,342.76  |  |
| PAYCHEX INC                            | 23,706  | 33.29  | 789,172.74    |  |
| RACKSPACE HOSTING INC                  | 7,600   | 66.09  | 502,284.00    |  |
| RED HAT INC                            | 13,993  | 56.94  | 796,761.42    |  |
| SAIC INC                               | 19,851  | 12.04  | 239,006.04    |  |
| SALESFORCE.COM INC                     | 9,338   | 152.69 | 1,425,819.22  |  |
| SYMANTEC CORP                          | 51,886  | 18.00  | 933,948.00    |  |
| SYNOPSYS INC                           | 10,482  | 33.02  | 346,115.64    |  |
| TERADATA CORP                          | 12,192  | 75.41  | 919,398.72    |  |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC              | 11,427  | 23.70  | 270,819.90    |  |
| VERIFONE SYSTEMS INC                   | 7,500   | 27.85  | 208,875.00    |  |
| VERISIGN INC                           | 11,271  | 48.69  | 548,784.99    |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES                | 37,969  | 134.28 | 5,098,477.32  |  |
| VMWARE INC-CLASS A                     | 5,918   | 96.74  | 572,507.32    |  |
| WESTERN UNION CO                       | 45,095  | 18.22  | 821,630.90    |  |
| YAHOO                                  | 83,779  | 15.97  | 1,338,369.52  |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| AMPHENOL CORPORATION         | 11,881  | 58.88  | 699,553.28    |  |
| APPLE INC                    | 67,300  | 667.26 | 44,906,598.00 |  |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 7,742   | 33.71  | 260,982.82    |  |
| AVNET INC                    | 10,281  | 29.09  | 299,074.29    |  |
| CISCO SYSTEMS                | 385,328 | 19.09  | 7,355,911.52  |  |
| CORNING                      | 110,475 | 13.15  | 1,452,746.25  |  |
| DELL INC                     | 106,902 | 9.86   | 1,054,053.72  |  |
| DOLBY LABORATORIES INC-CL A  | 3,573   | 32.75  | 117,015.75    |  |
| EMC CORP                     | 150,991 | 27.27  | 4,117,524.57  |  |
| F5 NETWORKS INC              | 5,614   | 104.70 | 587,785.80    |  |
| FLEXTRONICS INTL LTD         | 49,418  | 6.00   | 296,508.00    |  |
| FLIR SYSTEMS INC             | 10,809  | 19.97  | 215,909.77    |  |
| HARRIS CORP                  | 8,024   | 51.22  | 410,989.28    |  |
| HEWLETT-PACKARD CO           | 142,248 | 17.06  | 2,426,750.88  |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 38,269  | 17.11  | 654,782.59    |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 18,900  | 50.55  | 955,395.00    |  |
| NETAPP INC                   | 26,032  | 32.88  | 855,932.16    |  |
| QUALCOMM                     | 123,290 | 62.49  | 7,704,392.10  |  |
| SANDISK CORP                 | 17,566  | 43.43  | 762,891.38    |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 27,572  | 31.00  | 854,732.00    |  |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 30,979  | 34.01  | 1,053,595.79  |  |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD       | 8,800   | 47.66  | 419,408.00    |  |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 16,631  | 38.73  | 644,118.63    |  |
| XEROX CORP                   | 96,738  | 7.34   | 710,056.92    |  |
| AT&T INC                     | 424,819 | 37.70  | 16,015,676.30 |  |
| CENTURYLINK INC              | 45,311  | 40.40  | 1,830,564.40  |  |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 21,214  | 64.10  | 1,359,817.40  |  |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP | 72,707  | 4.90   | 356,264.30    |  |
| METROPCS COMMUNICATIONS INC  | 21,951  | 11.71  | 257,046.21    |  |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 8,748   | 62.90  | 550,249.20    |  |
| SPRINT NEXTEL CORPORATION    | 219,202 | 5.52   | 1,209,995.04  |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 205,901 | 45.57  | 9,382,908.57  |  |
| WINDSTREAM CORP              | 42,903  | 10.11  | 433,749.33    |  |

|                             |        |       |              |  |
|-----------------------------|--------|-------|--------------|--|
| AES CORP                    | 47,307 | 10.97 | 518,957.79   |  |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION  | 8,020  | 43.39 | 347,987.80   |  |
| AMEREN CORPORATION          | 17,596 | 32.67 | 574,861.32   |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER     | 35,087 | 43.94 | 1,541,722.78 |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 12,762 | 37.06 | 472,959.72   |  |
| CALPINE CORP                | 22,701 | 17.30 | 392,727.30   |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC      | 29,354 | 21.30 | 625,240.20   |  |
| CMS ENERGY CORP             | 18,200 | 23.55 | 428,610.00   |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC     | 21,283 | 59.89 | 1,274,638.87 |  |
| DOMINION RESOURCES          | 41,384 | 52.94 | 2,190,868.96 |  |
| DTE ENERGY COMPANY          | 12,316 | 59.94 | 738,221.04   |  |
| DUKE ENERGY CORP            | 50,669 | 64.80 | 3,283,351.20 |  |
| EDISON INTL                 | 22,494 | 45.69 | 1,027,750.86 |  |
| ENTERGY CORP                | 12,875 | 69.30 | 892,237.50   |  |
| EXELON CORP                 | 61,824 | 35.58 | 2,199,697.92 |  |
| FIRSTENERGY CORP            | 30,362 | 44.10 | 1,338,964.20 |  |
| INTEGRYS ENERGY GROUP INC   | 5,734  | 52.20 | 299,314.80   |  |
| MDU RESOURCES GROUP INC     | 12,623 | 22.04 | 278,210.92   |  |
| NEXTERA ENERGY INC          | 28,738 | 70.33 | 2,021,143.54 |  |
| NISOURCE INC                | 20,479 | 25.48 | 521,804.92   |  |
| NORTHEAST UTILITIES         | 22,753 | 38.23 | 869,847.19   |  |
| NRG ENERGY INC              | 15,935 | 21.39 | 340,849.65   |  |
| ONEOK INC                   | 14,358 | 48.31 | 693,634.98   |  |
| PEPCO HOLDINGS INC          | 16,574 | 18.90 | 313,248.60   |  |
| PG&E CORP                   | 29,937 | 42.67 | 1,277,411.79 |  |
| PINNACLE WEST CAPITAL       | 7,900  | 52.80 | 417,120.00   |  |
| PPL CORPORATION             | 42,065 | 29.05 | 1,221,988.25 |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE   | 36,725 | 32.18 | 1,181,810.50 |  |
| SCANA CORP                  | 8,735  | 48.27 | 421,638.45   |  |
| SEMPRA ENERGY               | 16,532 | 64.49 | 1,066,148.68 |  |
| SOUTHERN CO                 | 62,628 | 46.09 | 2,886,524.52 |  |
| WISCONSIN ENERGY CORP       | 16,762 | 37.67 | 631,424.54   |  |
| XCEL ENERGY INC             | 35,324 | 27.71 | 978,828.04   |  |

|       |                            |            |       |                                    |  |
|-------|----------------------------|------------|-------|------------------------------------|--|
|       | ADVANCED MICRO DEVICES     | 43,107     | 3.37  | 145,270.59                         |  |
|       | ALTERA CORPORATION         | 23,453     | 33.98 | 797,050.20                         |  |
|       | ANALOG DEVICES             | 21,622     | 39.19 | 847,366.18                         |  |
|       | APPLIED MATERIALS          | 93,789     | 11.16 | 1,047,154.18                       |  |
|       | AVAGO TECHNOLOGIES LTD     | 16,810     | 34.86 | 586,080.65                         |  |
|       | BROADCOM CORP-CL A         | 35,694     | 34.58 | 1,234,298.52                       |  |
|       | CREE INC                   | 7,602      | 25.53 | 194,079.06                         |  |
|       | INTEL CORP                 | 361,849    | 22.68 | 8,206,735.32                       |  |
|       | KLA-TENCOR CORP            | 12,143     | 47.70 | 579,281.81                         |  |
|       | LAM RESEARCH CORP          | 14,184     | 31.78 | 450,838.44                         |  |
|       | LINEAR TECHNOLOGY CORP     | 16,628     | 31.85 | 529,601.80                         |  |
|       | LSI CORP                   | 39,045     | 6.91  | 269,800.95                         |  |
|       | MARVELL TECHNOLOGY GROUP   | 36,022     | 9.15  | 329,601.30                         |  |
|       | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS  | 21,204     | 26.62 | 564,450.48                         |  |
|       | MICROCHIP TECHNOLOGY INC   | 13,579     | 32.74 | 444,576.46                         |  |
|       | MICRON TECHNOLOGY          | 69,687     | 5.98  | 417,076.69                         |  |
|       | NVIDIA CORP                | 44,313     | 13.34 | 591,135.42                         |  |
|       | TEXAS INSTRUMENTS          | 82,297     | 27.55 | 2,267,282.35                       |  |
|       | XILINX INC                 | 19,048     | 33.41 | 636,393.68                         |  |
|       | アメリカドル小計                   | 21,759,343 |       | 950,832,385.42<br>(74,117,384,443) |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD          | 20,964     | 23.90 | 501,039.60                         |  |
|       | ATHABASCA OIL CORPORATION  | 22,554     | 13.18 | 297,261.72                         |  |
|       | BAYTEX ENERGY CORP         | 8,644      | 46.72 | 403,847.68                         |  |
|       | BONAVISTA ENERGY CORP      | 10,461     | 17.44 | 182,439.84                         |  |
|       | CAMECO CORP                | 28,691     | 19.15 | 549,432.65                         |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 79,600     | 30.33 | 2,414,268.00                       |  |
|       | CANADIAN OIL SANDS LTD     | 35,193     | 21.05 | 740,812.65                         |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC         | 54,778     | 34.31 | 1,879,433.18                       |  |
|       | CRESCENT POINT ENERGY CORP | 22,815     | 43.53 | 993,136.95                         |  |
|       | ENBRIDGE                   | 53,992     | 38.40 | 2,073,292.80                       |  |
|       | ENCANA CORP                | 53,367     | 21.53 | 1,148,991.51                       |  |
|       | ENERPLUS CORP              | 13,454     | 16.30 | 219,300.20                         |  |

|                              |         |        |              |  |
|------------------------------|---------|--------|--------------|--|
| HUSKY ENERGY INC             | 24,507  | 26.42  | 647,474.94   |  |
| IMPERIAL OIL                 | 21,536  | 45.25  | 974,504.00   |  |
| MEG ENERGY CORP              | 9,188   | 37.39  | 343,539.32   |  |
| NEXEN INC                    | 38,395  | 24.90  | 956,035.50   |  |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP | 21,259  | 23.49  | 499,373.91   |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 20,722  | 27.60  | 571,927.20   |  |
| PENGROWTH ENERGY CORP        | 36,075  | 6.63   | 239,177.25   |  |
| PENN WEST PETROLEUM LTD      | 34,312  | 13.99  | 480,024.88   |  |
| PRECISION DRILLING CORP      | 15,689  | 7.73   | 121,275.97   |  |
| PROGRESS ENERGY RESOURCES CO | 13,474  | 21.90  | 295,080.60   |  |
| SUNCOR ENERGY                | 112,257 | 32.34  | 3,630,391.38 |  |
| TALISMAN ENERGY INC          | 74,847  | 13.14  | 983,489.58   |  |
| TOURMALINE OIL CORP          | 8,840   | 30.69  | 271,299.60   |  |
| TRANSCANADA CORP             | 50,616  | 44.74  | 2,264,559.84 |  |
| VERMILION ENERGY INC         | 6,614   | 46.20  | 305,566.80   |  |
| AGNICO-EAGLE MINES           | 12,112  | 51.00  | 617,712.00   |  |
| AGRIUM INC                   | 11,452  | 102.00 | 1,168,104.00 |  |
| BARRICK GOLD CORP            | 71,966  | 41.08  | 2,956,363.28 |  |
| CENTERRA GOLD INC            | 11,462  | 12.31  | 141,097.22   |  |
| ELDORADO GOLD CORP           | 48,974  | 14.99  | 734,120.26   |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 34,545  | 20.95  | 723,717.75   |  |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 10,027  | 57.95  | 581,064.65   |  |
| GOLDCORP INC                 | 58,238  | 45.14  | 2,628,863.32 |  |
| IAMGOLD CORP                 | 27,343  | 15.59  | 426,277.37   |  |
| INMET MINING CORPORATION     | 3,603   | 46.73  | 168,368.19   |  |
| KINROSS GOLD CORP            | 82,648  | 10.06  | 831,438.88   |  |
| NEW GOLD INC                 | 32,614  | 12.05  | 392,998.70   |  |
| OSISKO MINING CORP           | 27,237  | 9.74   | 265,288.38   |  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     | 10,864  | 21.08  | 229,013.12   |  |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 61,764  | 42.73  | 2,639,175.72 |  |
| SILVER WHEATON CORP          | 25,635  | 39.08  | 1,001,815.80 |  |
| TECK RESOURCES LTD-CL B      | 41,878  | 29.01  | 1,214,880.78 |  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 29,054  | 8.37   | 243,181.98   |  |

|                                       |         |       |              |  |
|---------------------------------------|---------|-------|--------------|--|
| YAMANA GOLD INC                       | 54,154  | 18.78 | 1,017,012.12 |  |
| BOMBARDIER B                          | 101,578 | 3.69  | 374,822.82   |  |
| CAE INC                               | 18,721  | 10.53 | 197,132.13   |  |
| FINNING INTERNATIONAL INC             | 12,488  | 23.84 | 297,713.92   |  |
| SNC-LAVALIN GROUP INC                 | 10,986  | 37.95 | 416,918.70   |  |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS              | 6,399   | 18.91 | 121,005.09   |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO              | 31,542  | 86.99 | 2,743,838.58 |  |
| CP RAILWAY LIMITED                    | 12,345  | 81.59 | 1,007,228.55 |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC               | 16,095  | 42.51 | 684,198.45   |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                 | 8,436   | 31.17 | 262,950.12   |  |
| TIM HORTONS INC                       | 11,422  | 51.16 | 584,349.52   |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B             | 27,332  | 20.12 | 549,919.84   |  |
| THOMSON REUTERS CORP                  | 27,176  | 28.42 | 772,341.92   |  |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A              | 5,533   | 70.76 | 391,515.08   |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B           | 8,661   | 45.18 | 391,303.98   |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'                     | 2,092   | 59.18 | 123,804.56   |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD                  | 8,209   | 34.16 | 280,419.44   |  |
| METRO INC                             | 7,126   | 58.40 | 416,158.40   |  |
| SHOPPERS DRUG MART CORP               | 15,465  | 40.93 | 632,982.45   |  |
| WESTON (GEORGE) LTD                   | 3,577   | 63.25 | 226,245.25   |  |
| SAPUTO INC                            | 9,389   | 42.25 | 396,685.25   |  |
| VITERRA INC                           | 22,351  | 16.11 | 360,074.61   |  |
| CATAMARAN CORPORATION                 | 7,000   | 96.35 | 674,450.00   |  |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 21,132  | 54.26 | 1,146,622.32 |  |
| BANK MONTREAL                         | 46,523  | 58.10 | 2,702,986.30 |  |
| BANK NOVA SCOTIA                      | 79,142  | 53.92 | 4,267,336.64 |  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK                | 29,282  | 76.95 | 2,253,249.90 |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA               | 11,725  | 74.40 | 872,340.00   |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                  | 103,567 | 56.54 | 5,855,678.18 |  |
| TORONTO-DOMINION BANK                 | 65,437  | 81.99 | 5,365,179.63 |  |
| CI FINANCIAL CORP                     | 10,864  | 22.72 | 246,830.08   |  |
| IGM FINANCIAL INC                     | 7,746   | 38.39 | 297,368.94   |  |
| ONEX CORP                             | 6,404   | 38.80 | 248,475.20   |  |

|               |                                          |           |        |                                  |  |
|---------------|------------------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|--|
|               | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD              | 1,428     | 379.73 | 542,254.44                       |  |
|               | GREAT-WEST LIFE CO INC                   | 20,147    | 22.36  | 450,486.92                       |  |
|               | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC             | 6,147     | 28.04  | 172,361.88                       |  |
|               | INTACT FINANCIAL CORP                    | 9,362     | 59.80  | 559,847.60                       |  |
|               | MANULIFE FINANCIAL CORP                  | 130,818   | 11.85  | 1,550,193.30                     |  |
|               | POWER CORP OF CANADA                     | 25,360    | 23.90  | 606,104.00                       |  |
|               | POWER FINANCIAL CORP                     | 17,970    | 25.41  | 456,617.70                       |  |
|               | SUN LIFE FINANCIAL INC                   | 42,674    | 22.82  | 973,820.68                       |  |
|               | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC, CLASS-A | 40,721    | 33.94  | 1,382,070.74                     |  |
|               | BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC         | 19,531    | 16.34  | 319,136.54                       |  |
|               | CGI GROUP INC - CL A                     | 16,349    | 26.40  | 431,613.60                       |  |
|               | OPEN TEXT CORP                           | 3,975     | 54.21  | 215,484.75                       |  |
|               | RESEARCH IN MOTION                       | 33,341    | 7.52   | 250,724.32                       |  |
|               | BCE INC                                  | 18,738    | 43.25  | 810,418.50                       |  |
|               | BELL ALIANT INC                          | 5,225     | 27.29  | 142,590.25                       |  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B              | 28,690    | 39.80  | 1,141,862.00                     |  |
|               | TELUS CORPORATION -NON VOTE              | 10,827    | 61.50  | 665,860.50                       |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD A                 | 4,032     | 68.69  | 276,958.08                       |  |
|               | FORTIS INC                               | 13,703    | 33.53  | 459,461.59                       |  |
|               | TRANSALTA CORP                           | 15,821    | 15.05  | 238,106.05                       |  |
|               | カナダドル小計                                  | 2,769,018 |        | 88,775,570.36<br>(7,034,576,195) |  |
| オーストラリア<br>ドル | CALTEX AUSTRALIA LIMITED                 | 9,865     | 16.53  | 163,068.45                       |  |
|               | ORIGIN ENERGY LIMITED                    | 78,881    | 11.32  | 892,932.92                       |  |
|               | SANTOS                                   | 68,592    | 11.36  | 779,205.12                       |  |
|               | WHITEHAVEN COAL LTD                      | 33,110    | 2.87   | 95,025.70                        |  |
|               | WOODSIDE PETROLEUM LTD                   | 46,807    | 33.14  | 1,551,183.98                     |  |
|               | WORLEYPARSONS LTD                        | 14,513    | 28.29  | 410,572.77                       |  |
|               | ALUMINA LIMITED                          | 163,150   | 0.85   | 138,677.50                       |  |
|               | AMCOR                                    | 87,631    | 7.76   | 680,016.56                       |  |
|               | BHP BILLITON LTD                         | 231,943   | 33.04  | 7,663,396.72                     |  |
|               | BORAL LIMITED                            | 54,086    | 3.84   | 207,690.24                       |  |

|                                  |         |       |              |  |
|----------------------------------|---------|-------|--------------|--|
| FORTESCUE METALS GROUP LTD       | 101,757 | 3.49  | 355,131.93   |  |
| ILUKA RESOURCES LTD              | 29,559  | 9.93  | 293,520.87   |  |
| INCITEC PIVOT LTD                | 118,280 | 2.98  | 352,474.40   |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES NV       | 31,642  | 8.70  | 275,285.40   |  |
| LYNAS CORP LTD                   | 124,409 | 0.79  | 98,283.11    |  |
| NEWCREST MINING LIMITED          | 55,516  | 29.14 | 1,617,736.24 |  |
| ORICA LTD                        | 26,507  | 24.87 | 659,229.09   |  |
| OZ MINERALS LTD                  | 21,913  | 6.75  | 147,912.75   |  |
| RIO TINTO LTD                    | 31,645  | 53.36 | 1,688,577.20 |  |
| SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED    | 11,082  | 9.58  | 106,165.56   |  |
| LEIGHTON HOLDINGS LIMITED        | 10,493  | 16.62 | 174,393.66   |  |
| ALS LTD                          | 24,510  | 8.59  | 210,540.90   |  |
| BRAMBLES LTD                     | 112,884 | 7.02  | 792,445.68   |  |
| ASCIANO GROUP                    | 70,833  | 4.37  | 309,540.21   |  |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED           | 77,149  | 1.22  | 94,121.78    |  |
| QR NATIONAL LTD                  | 124,036 | 3.41  | 422,962.76   |  |
| TOLL HOLDINGS LIMITED            | 47,207  | 4.41  | 208,182.87   |  |
| TRANSURBAN GROUP                 | 95,314  | 6.00  | 571,884.00   |  |
| CROWN LTD                        | 29,093  | 9.10  | 264,746.30   |  |
| ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED | 55,201  | 3.83  | 211,419.83   |  |
| TABCORP HOLDINGS                 | 51,765  | 2.76  | 142,871.40   |  |
| TATTS GROUP LTD                  | 97,367  | 2.71  | 263,864.57   |  |
| FAIRFAX MEDIA LTD                | 155,308 | 0.41  | 64,452.82    |  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD       | 38,812  | 1.94  | 75,295.28    |  |
| METCASH LTD                      | 62,759  | 3.54  | 222,166.86   |  |
| WESFARMERS LIMITED               | 72,400  | 34.26 | 2,480,424.00 |  |
| WOOLWORTHS LTD                   | 89,098  | 28.76 | 2,562,458.48 |  |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED         | 41,370  | 13.56 | 560,977.20   |  |
| COCHLEAR LIMITED                 | 4,134   | 67.15 | 277,598.10   |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD           | 9,539   | 24.02 | 229,126.78   |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD             | 26,904  | 13.55 | 364,549.20   |  |
| CSL LIMITED                      | 36,712  | 46.00 | 1,688,752.00 |  |
| AUST AND NZ BANKING GROUP        | 192,754 | 24.75 | 4,770,661.50 |  |

|         |                             |           |       |                                  |  |
|---------|-----------------------------|-----------|-------|----------------------------------|--|
|         | BENDIGO AND ADELAIDE BANK   | 28,337    | 7.68  | 217,628.16                       |  |
|         | COMMONWEALTH BANK OF AUST   | 114,834   | 55.77 | 6,404,292.18                     |  |
|         | NATIONAL AUSTRALIA BANK     | 161,081   | 25.49 | 4,105,954.69                     |  |
|         | WESTPAC BANKING             | 219,760   | 24.85 | 5,461,036.00                     |  |
|         | ASX LTD                     | 12,364    | 29.57 | 365,603.48                       |  |
|         | MACQUARIE GROUP LIMITED     | 24,049    | 28.46 | 684,434.54                       |  |
|         | AMP LTD                     | 207,309   | 4.33  | 897,647.97                       |  |
|         | INSURANCE AUSTRALIA GRP.    | 150,981   | 4.37  | 659,786.97                       |  |
|         | QBE INSURANCE GROUP         | 84,066    | 12.95 | 1,088,654.70                     |  |
|         | SUNCORP GROUP LIMITED       | 93,434    | 9.24  | 863,330.16                       |  |
|         | COMPUTERSHARE LIMITED       | 32,282    | 8.30  | 267,940.60                       |  |
|         | TELSTRA CORP                | 316,269   | 3.92  | 1,239,774.48                     |  |
|         | AGL ENERGY LTD              | 39,363    | 14.97 | 589,264.11                       |  |
|         | SP AUSNET                   | 117,439   | 1.04  | 122,723.75                       |  |
|         | オーストラリアドル小計                 | 4,468,098 |       | 58,107,594.48<br>(4,692,769,330) |  |
| イギリスポンド | AMEC PLC                    | 24,066    | 11.46 | 275,796.36                       |  |
|         | BG GROUP                    | 244,341   | 12.50 | 3,054,262.50                     |  |
|         | BP PLC                      | 1,368,628 | 4.36  | 5,974,061.22                     |  |
|         | PETROFAC LTD                | 18,310    | 15.95 | 292,044.50                       |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 265,864   | 21.42 | 5,694,806.88                     |  |
|         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 190,199   | 21.98 | 4,180,574.02                     |  |
|         | TULLOW OIL PLC              | 65,722    | 13.70 | 900,391.40                       |  |
|         | ANGLO AMERICAN PLC          | 99,991    | 18.17 | 1,816,836.47                     |  |
|         | ANTOFAGASTA PLC             | 27,839    | 12.62 | 351,328.18                       |  |
|         | BHP BILLITTON PLC           | 151,925   | 19.25 | 2,924,556.25                     |  |
|         | CRODA INTERNATIONAL PLC     | 9,552     | 24.25 | 231,636.00                       |  |
|         | EURASIAN NATURAL RESOURCES  | 17,220    | 3.08  | 53,158.14                        |  |
|         | EVRAZ PLC                   | 23,648    | 2.46  | 58,315.96                        |  |
|         | FRESNILLO PLC               | 12,424    | 18.53 | 230,216.72                       |  |
|         | GLENCORE INTERNATIONAL PLC  | 273,880   | 3.43  | 939,682.28                       |  |
|         | JOHNSON MATTHEY PLC         | 14,466    | 24.13 | 349,064.58                       |  |
|         | KAZAKHMYS PLC               | 14,727    | 6.92  | 101,984.47                       |  |

|                          |         |       |              |
|--------------------------|---------|-------|--------------|
| LONMIN PLC               | 10,840  | 5.57  | 60,433.00    |
| RANDGOLD RESOURCES LTD   | 6,328   | 76.15 | 481,877.20   |
| REXAM                    | 63,694  | 4.34  | 277,005.20   |
| RIO TINTO PLC REG        | 96,419  | 28.85 | 2,781,688.15 |
| VEDANTA RESOURCES PLC    | 7,996   | 10.29 | 82,278.84    |
| XSTRATA PLC              | 150,709 | 9.57  | 1,443,038.67 |
| BAE SYSTEMS PLC          | 235,080 | 3.25  | 764,245.08   |
| BALFOUR BEATTY PLC       | 49,917  | 3.03  | 151,597.92   |
| BUNZL PLC                | 24,018  | 11.09 | 266,359.62   |
| COBHAM PLC               | 74,736  | 2.21  | 165,689.71   |
| IMI PLC                  | 22,666  | 9.00  | 203,994.00   |
| INVENSYS PLC             | 59,010  | 2.34  | 138,142.41   |
| MEGGITT PLC              | 56,555  | 3.94  | 223,335.69   |
| MELROSE PLC              | 84,700  | 2.42  | 205,143.40   |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 135,964 | 8.43  | 1,146,176.52 |
| SMITHS GROUP PLC         | 27,715  | 10.37 | 287,404.55   |
| WEIR GROUP PLC/THE       | 15,348  | 17.68 | 271,352.64   |
| WOLSELEY LTD             | 20,700  | 26.42 | 546,894.00   |
| AGGREKO PLC              | 19,399  | 23.13 | 448,698.87   |
| BABCOCK INTL GROUP PLC   | 26,080  | 9.27  | 241,761.60   |
| CAPITA GROUP PLC         | 46,156  | 7.74  | 357,478.22   |
| EXPERIAN PLC             | 72,983  | 10.29 | 750,995.07   |
| G4S PLC                  | 102,444 | 2.65  | 272,193.70   |
| INTERTEK GROUP PLC       | 11,308  | 27.40 | 309,839.20   |
| SERCO GROUP PLC          | 36,163  | 5.80  | 209,745.40   |
| NEW GKN                  | 112,795 | 2.14  | 242,283.66   |
| BURBERRY GROUP PLC       | 31,861  | 10.01 | 318,928.61   |
| CARNIVAL PLC             | 13,154  | 22.83 | 300,305.82   |
| COMPASS GROUP PLC        | 135,085 | 6.83  | 923,305.97   |
| INTERCONTINENTAL HOTELS  | 20,550  | 16.20 | 332,910.00   |
| TUI TRAVEL PLC           | 34,970  | 2.34  | 81,864.77    |
| WHITBREAD PLC            | 12,920  | 22.68 | 293,025.60   |
| BRITISH SKY BROADCASTING | 78,699  | 7.43  | 585,127.06   |

|                              |           |       |              |
|------------------------------|-----------|-------|--------------|
| ITV PLC                      | 268,310   | 0.88  | 237,186.04   |
| PEARSON                      | 59,257    | 12.10 | 717,009.70   |
| REED ELSEVIER PLC            | 88,399    | 5.92  | 523,322.08   |
| WPP PLC                      | 91,523    | 8.41  | 770,166.04   |
| KINGFISHER PLC               | 172,045   | 2.64  | 454,542.89   |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 116,498   | 3.56  | 415,664.86   |
| NEXT PLC                     | 12,218    | 34.50 | 421,521.00   |
| MORRISON SUPERMARKETS        | 168,207   | 2.85  | 479,726.36   |
| SAINSBURY (J) PLC            | 88,638    | 3.47  | 308,017.05   |
| TESCO                        | 578,329   | 3.32  | 1,920,052.28 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 25,150    | 12.89 | 324,183.50   |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO     | 140,684   | 31.79 | 4,473,047.78 |
| DIAGEO                       | 180,212   | 17.39 | 3,134,787.74 |
| IMPERIAL-TOBACCO GROUP       | 71,604    | 22.92 | 1,641,163.68 |
| SABMILLER PLC                | 68,732    | 27.20 | 1,869,510.40 |
| TATE & LYLE                  | 33,886    | 6.65  | 225,511.33   |
| UNILEVER PLC                 | 92,322    | 22.52 | 2,079,091.44 |
| RECKITT BENCKISER PLC        | 46,801    | 35.65 | 1,668,455.65 |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 65,063    | 6.83  | 444,705.60   |
| ASTRAZENECA                  | 90,879    | 29.55 | 2,685,474.45 |
| GLAXOSMITHKLINE              | 360,823   | 14.27 | 5,150,748.32 |
| SHIRE PLC                    | 40,852    | 18.14 | 741,055.28   |
| BARCLAYS                     | 844,880   | 2.14  | 1,815,224.68 |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB)       | 1,315,273 | 5.73  | 7,540,460.10 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 3,012,047 | 0.38  | 1,169,577.85 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND       | 146,470   | 2.57  | 376,427.90   |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 173,767   | 14.00 | 2,432,738.00 |
| 3I GROUP PLC                 | 70,776    | 2.22  | 157,618.15   |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 60,777    | 3.11  | 189,077.24   |
| ICAP PLC                     | 38,331    | 3.21  | 123,080.84   |
| INVESTEC PLC                 | 37,356    | 3.82  | 142,849.34   |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC    | 12,844    | 9.43  | 121,118.92   |
| MAN GROUP PLC                | 128,501   | 0.82  | 105,820.57   |

|        |                             |            |          |                                    |
|--------|-----------------------------|------------|----------|------------------------------------|
|        | SCHRODERS PLC               | 7,582      | 15.18    | 115,094.76                         |
|        | ADMIRAL GROUP PLC           | 14,803     | 10.53    | 155,875.59                         |
|        | AVIVA PIC                   | 211,805    | 3.18     | 675,022.53                         |
|        | LEGAL & GENERAL GROUP       | 428,034    | 1.31     | 564,576.84                         |
|        | OLD MUTUAL PLC              | 354,739    | 1.69     | 602,701.56                         |
|        | PRUDENTIAL                  | 185,725    | 8.01     | 1,488,585.87                       |
|        | RESOLUTION LTD              | 100,306    | 2.17     | 217,764.32                         |
|        | RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 257,389    | 1.10     | 284,414.84                         |
|        | STANDARD LIFE PLC           | 171,559    | 2.72     | 467,841.39                         |
|        | SAGE GROUP PLC              | 94,761     | 3.13     | 296,980.97                         |
|        | BT GROUP PLC                | 565,095    | 2.30     | 1,303,674.16                       |
|        | INMARSAT PLC                | 31,044     | 5.90     | 183,159.60                         |
|        | VODAFONE GROUP PLC          | 3,549,749  | 1.75     | 6,238,683.86                       |
|        | CENTRICA PLC                | 375,719    | 3.27     | 1,231,606.88                       |
|        | NATIONAL GRID PLC           | 256,757    | 6.83     | 1,753,650.31                       |
|        | SEVERN TRENT PLC            | 16,774     | 16.79    | 281,635.46                         |
|        | SSE PLC                     | 68,149     | 13.92    | 948,634.08                         |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC  | 48,132     | 7.16     | 344,625.12                         |
|        | ARM HOLDINGS PLC            | 99,911     | 5.75     | 574,488.25                         |
|        | イギリスポンド小計                   | 20,259,251 |          | 105,181,789.53<br>(13,220,299,126) |
| スイスフラン | TRANSOCEAN LTD              | 25,448     | 41.95    | 1,067,543.60                       |
|        | GIVAUDAN-REG                | 603        | 892.50   | 538,177.50                         |
|        | HOLCIM LTD                  | 16,627     | 59.90    | 995,957.30                         |
|        | SIKA AG-BR                  | 152        | 1,918.00 | 291,536.00                         |
|        | SYNGENTA AG                 | 6,805      | 351.50   | 2,391,957.50                       |
|        | ABB LTD                     | 158,179    | 17.64    | 2,790,277.56                       |
|        | GEBERIT AG-REG              | 2,749      | 204.50   | 562,170.50                         |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG    | 1,564      | 116.10   | 181,580.40                         |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 3,530      | 115.60   | 408,068.00                         |
|        | SULZER AG-REG               | 1,662      | 137.00   | 227,694.00                         |
|        | ADECCO                      | 9,621      | 44.76    | 430,635.96                         |
|        | SGS SA                      | 398        | 1,932.00 | 768,936.00                         |

|                              |                   |           |           |                                  |
|------------------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------------------------|
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   |                   | 3,922     | 106.20    | 416,516.40                       |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A |                   | 37,548    | 56.40     | 2,117,707.20                     |
| SWATCH GROUP AG(BEARER)      |                   | 2,240     | 375.20    | 840,448.00                       |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      |                   | 3,008     | 65.35     | 196,572.80                       |
| ARYZTA AG                    |                   | 6,334     | 45.10     | 285,663.40                       |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       |                   | 132       | 872.50    | 115,170.00                       |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC      |                   | 65        | 2,976.00  | 193,440.00                       |
| LINDT & SPRUENGLI AG-REG     |                   | 8         | 33,950.00 | 271,600.00                       |
| NESTLE SA - REGISTERED       |                   | 237,375   | 59.30     | 14,076,337.50                    |
| SONOVA HOLDING AG-REG        |                   | 3,568     | 95.05     | 339,138.40                       |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     |                   | 545       | 125.10    | 68,179.50                        |
| ACTELION LTD-REG             |                   | 8,053     | 47.08     | 379,135.24                       |
| LONZA GROUP AG-REG           |                   | 3,843     | 49.19     | 189,037.17                       |
| NOVARTIS                     |                   | 165,462   | 57.55     | 9,522,338.10                     |
| ROCHE HOLDING GENUSS         |                   | 50,537    | 175.70    | 8,879,350.90                     |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG |                   | 213       | 487.50    | 103,837.50                       |
| CREDIT SUISSE GROUP AG       |                   | 88,517    | 19.93     | 1,764,143.81                     |
| GAM HOLDING LTD              |                   | 13,170    | 12.25     | 161,332.50                       |
| JULIUS BAER GROUP LTD        |                   | 15,061    | 32.80     | 494,000.80                       |
| PARGESA HOLDING SA-BR        |                   | 1,880     | 62.30     | 117,124.00                       |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    |                   | 973       | 195.70    | 190,416.10                       |
| UBS AG-REG                   |                   | 265,264   | 11.45     | 3,037,272.80                     |
| BALOISE HOLDING AG           |                   | 3,304     | 73.95     | 244,330.80                       |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    |                   | 2,112     | 111.90    | 236,332.80                       |
| SWISS RE LTD                 |                   | 25,669    | 60.45     | 1,551,691.05                     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    |                   | 10,741    | 234.20    | 2,515,542.20                     |
| SWISS PRIME SITE-REG         |                   | 3,464     | 77.70     | 269,152.80                       |
| SWISSCOM                     |                   | 1,693     | 378.00    | 639,954.00                       |
| スイスフラン小計                     |                   | 1,182,039 |           | 59,870,300.09<br>(4,947,681,599) |
|                              | HOPEWELL HOLDINGS | 41,500    | 26.80     | 1,112,200.00                     |
|                              | HUTCHISON WHAMPOA | 155,000   | 75.20     | 11,656,000.00                    |
|                              | NWS HOLDINGS LTD  | 101,000   | 12.46     | 1,258,460.00                     |

|                                   |         |        |               |
|-----------------------------------|---------|--------|---------------|
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS            | 82,000  | 12.62  | 1,034,840.00  |
| MTR CORP                          | 102,000 | 29.40  | 2,998,800.00  |
| ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD | 14,500  | 42.75  | 619,875.00    |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG          | 51,500  | 26.10  | 1,344,150.00  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L      | 103,000 | 26.00  | 2,678,000.00  |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD            | 67,200  | 13.42  | 901,824.00    |
| SANDS CHINA LTD                   | 175,200 | 28.95  | 5,072,040.00  |
| SHANGRI-LA ASIA LTD               | 110,000 | 15.04  | 1,654,400.00  |
| SJM HOLDINGS LTD                  | 136,000 | 16.86  | 2,292,960.00  |
| WYNN MACAU LTD                    | 108,000 | 20.95  | 2,262,600.00  |
| LI & FUNG                         | 412,800 | 12.02  | 4,961,856.00  |
| LIFESTYLE INTL HLDGS LTD          | 43,000  | 16.02  | 688,860.00    |
| BANK EAST ASIA                    | 95,360  | 29.10  | 2,774,976.00  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS -R         | 268,500 | 24.65  | 6,618,525.00  |
| HANG SENG BANK                    | 55,500  | 118.90 | 6,598,950.00  |
| WING HANG BANK LIMITED            | 12,500  | 72.80  | 910,000.00    |
| FIRST PACIFIC CO                  | 154,000 | 8.43   | 1,298,220.00  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR       | 74,500  | 117.20 | 8,731,400.00  |
| AIA GROUP LTD                     | 736,400 | 28.90  | 21,281,960.00 |
| CHEUNG KONG HOLDINGS              | 101,000 | 113.70 | 11,483,700.00 |
| HANG LUNG GROUP LTD               | 64,000  | 49.15  | 3,145,600.00  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD          | 164,000 | 26.50  | 4,346,000.00  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMEN         | 69,000  | 55.80  | 3,850,200.00  |
| HYSAN DEVELOPMENT CO              | 46,000  | 35.30  | 1,623,800.00  |
| KERRY PROPERTIES LTD              | 52,000  | 39.20  | 2,038,400.00  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT             | 265,500 | 12.02  | 3,191,310.00  |
| SINO LAND CO                      | 213,400 | 14.50  | 3,094,300.00  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES           | 114,000 | 113.60 | 12,950,400.00 |
| SWIRE PACIFIC A                   | 49,500  | 95.00  | 4,702,500.00  |
| WHARF HOLDINGS                    | 110,000 | 53.85  | 5,923,500.00  |
| WHEELLOCK & CO LTD                | 66,000  | 33.45  | 2,207,700.00  |
| FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS       | 141,000 | 2.55   | 359,550.00    |
| PCCW LTD                          | 292,000 | 3.17   | 925,640.00    |

|          |                                    |           |       |                                   |
|----------|------------------------------------|-----------|-------|-----------------------------------|
|          | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         | 35,000    | 46.95 | 1,643,250.00                      |
|          | CLP HOLDINGS                       | 131,000   | 65.90 | 8,632,900.00                      |
|          | HONG KONG & CHINA GAS              | 379,061   | 19.66 | 7,452,339.26                      |
|          | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED      | 100,500   | 65.85 | 6,617,925.00                      |
|          | ASM PACIFIC TECHNOLOGY             | 13,800    | 91.75 | 1,266,150.00                      |
| 香港ドル小計   |                                    | 5,506,221 |       | 174,206,060.26<br>(1,750,770,905) |
| シンガポールドル | COSCO CORP SINGAPORE LTD           | 68,000    | 0.96  | 65,620.00                         |
|          | FRASER AND NEAVE LTD               | 67,000    | 8.88  | 594,960.00                        |
|          | KEPPEL CORP LTD                    | 104,300   | 11.40 | 1,189,020.00                      |
|          | NOBLE GROUP LTD                    | 267,363   | 1.32  | 354,255.97                        |
|          | SEMBCORP INDUSTRIES LTD            | 71,000    | 5.67  | 402,570.00                        |
|          | SEMBCORP MARINE LTD                | 61,000    | 4.97  | 303,170.00                        |
|          | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 111,000   | 3.54  | 392,940.00                        |
|          | YANGZIJIAN SHIPBUILDING            | 133,000   | 0.98  | 130,340.00                        |
|          | COMFORTDELGRO CORP LTD             | 131,000   | 1.71  | 224,665.00                        |
|          | NEPTUNE ORIENT LINES LTD           | 61,000    | 1.13  | 68,930.00                         |
|          | SINGAPORE AIRLINES                 | 39,533    | 10.74 | 424,584.42                        |
|          | GENTING SINGAPORE PLC              | 443,000   | 1.37  | 606,910.00                        |
|          | SINGAPORE PRESS HOLDINGS           | 114,000   | 4.07  | 463,980.00                        |
|          | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD       | 8,000     | 48.10 | 384,800.00                        |
|          | OLAM INTERNATIONAL LTD             | 112,000   | 2.05  | 229,600.00                        |
|          | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD          | 485,000   | 0.66  | 320,100.00                        |
|          | WILMAR INTERNATIONAL LTD           | 136,000   | 3.25  | 442,000.00                        |
|          | DBS GROUP                          | 132,000   | 14.39 | 1,899,480.00                      |
|          | OCBC BANK                          | 187,000   | 9.34  | 1,746,580.00                      |
|          | UNITED OVERSEAS BANK               | 92,000    | 19.65 | 1,807,800.00                      |
|          | SINGAPORE EXCHANGE LTD             | 62,000    | 7.00  | 434,000.00                        |
|          | CAPITALAND LTD                     | 186,500   | 3.18  | 593,070.00                        |
|          | CAPITAMALLS ASIA LTD               | 99,000    | 1.65  | 163,350.00                        |
|          | CITY DEVELOPMENTS LTD              | 36,000    | 11.74 | 422,640.00                        |
|          | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L       | 146,000   | 2.51  | 366,460.00                        |
|          | KEPPEL LAND LTD                    | 50,000    | 3.55  | 177,500.00                        |

|                |                          |                              |           |        |                                  |
|----------------|--------------------------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
|                |                          | UOL GROUP LIMITED            | 31,300    | 5.73   | 179,349.00                       |
|                |                          | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 579,243   | 3.20   | 1,853,577.60                     |
|                |                          | STARHUB LTD                  | 44,000    | 3.72   | 163,680.00                       |
| シンガポールドル小計     |                          |                              | 4,057,239 |        | 16,405,931.99<br>(1,039,315,791) |
| ニュージーランド<br>ドル |                          | FLETCHER BUILDING LTD        | 47,170    | 6.97   | 328,774.90                       |
|                |                          | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 67,649    | 2.62   | 177,240.38                       |
|                |                          | SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP | 42,159    | 3.78   | 159,361.02                       |
|                |                          | TELECOM CORP NEW ZEALAND     | 133,366   | 2.38   | 317,411.08                       |
|                |                          | CONTACT ENERGY LTD           | 25,503    | 5.28   | 134,655.84                       |
| ニュージーランドドル小計   |                          |                              | 315,847   |        | 1,117,443.22<br>(72,153,308)     |
| スウェーデン<br>クローナ | LUNDIN PETROLEUM AB      |                              | 16,161    | 160.10 | 2,587,376.10                     |
|                | BOLIDEN AB               |                              | 19,863    | 109.50 | 2,174,998.50                     |
|                | HOLMEN AB-B SHARES       |                              | 3,671     | 179.50 | 658,944.50                       |
|                | SSAB AB-A SHS            |                              | 10,878    | 46.67  | 507,676.26                       |
|                | ALFA LAVAL AB            |                              | 24,369    | 119.10 | 2,902,347.90                     |
|                | ASSA ABLOY B             |                              | 24,083    | 213.20 | 5,134,495.60                     |
|                | ATLAS COPCO A            |                              | 48,766    | 153.30 | 7,475,827.80                     |
|                | ATLAS COPCO B            |                              | 28,338    | 137.40 | 3,893,641.20                     |
|                | SANDVIK AB               |                              | 72,876    | 89.15  | 6,496,895.40                     |
|                | SCANIA AB-B SHS          |                              | 22,591    | 120.50 | 2,722,215.50                     |
|                | SKANSKA B                |                              | 27,591    | 106.30 | 2,932,923.30                     |
|                | SKF AB-B                 |                              | 28,465    | 141.70 | 4,033,490.50                     |
|                | VOLVO B                  |                              | 101,065   | 92.10  | 9,308,086.50                     |
|                | SECURITAS B              |                              | 22,739    | 49.28  | 1,120,577.92                     |
|                | ELECTROLUX AB-SER B      |                              | 17,470    | 162.00 | 2,830,140.00                     |
|                | HUSQVARNA AB-B SHS       |                              | 30,739    | 33.51  | 1,030,063.89                     |
|                | MODERN TIMES GROUP-B SHS |                              | 3,258     | 290.10 | 945,145.80                       |
|                | HENNES & MAURITZ B       |                              | 68,295    | 228.20 | 15,584,919.00                    |
|                | SWEDISH MATCH AB         |                              | 14,818    | 265.60 | 3,935,660.80                     |

|               |                                 |           |        |                                   |
|---------------|---------------------------------|-----------|--------|-----------------------------------|
|               | SCA SV CELLULOSA B              | 42,020    | 122.00 | 5,126,440.00                      |
|               | ELEKTA AB-B SHS                 | 25,880    | 86.75  | 2,245,090.00                      |
|               | GETINGE AB-B SHS                | 14,129    | 198.20 | 2,800,367.80                      |
|               | NORDEA BANK AB                  | 191,746   | 64.95  | 12,453,902.70                     |
|               | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 102,808   | 55.00  | 5,654,440.00                      |
|               | SVENSKA HANDELSBK A             | 35,722    | 246.10 | 8,791,184.20                      |
|               | SWEDBANK AB-A                   | 59,797    | 123.40 | 7,378,949.80                      |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS         | 8,608     | 94.00  | 809,152.00                        |
|               | INVESTOR AB-B SHS               | 33,199    | 144.60 | 4,800,575.40                      |
|               | KINNEVIK INVESTMENT AB-B        | 14,990    | 136.40 | 2,044,636.00                      |
|               | RATOS AB-B SHS                  | 13,965    | 57.95  | 809,271.75                        |
|               | ERICSSON (LM) B                 | 216,630   | 59.85  | 12,965,305.50                     |
|               | HEXAGON AB-B SHS                | 17,560    | 140.80 | 2,472,448.00                      |
|               | MILlicom INTL CELLULAR-SDR      | 4,557     | 609.50 | 2,777,491.50                      |
|               | TELE2 AB-B SHS                  | 22,436    | 119.20 | 2,674,371.20                      |
|               | TELIASONERA AB                  | 157,227   | 47.28  | 7,433,692.56                      |
| スウェーデンクローナ小計  |                                 | 1,547,310 |        | 157,512,744.88<br>(1,864,950,899) |
| ノルウェー<br>クローネ | AKER SOLUTIONS ASA              | 11,939    | 108.50 | 1,295,381.50                      |
|               | SEADRILL LTD                    | 25,558    | 223.70 | 5,717,324.60                      |
|               | STATOIL ASA                     | 80,278    | 147.90 | 11,873,116.20                     |
|               | SUBSEA 7 SA                     | 20,438    | 132.20 | 2,701,903.60                      |
|               | NORSK HYDRO                     | 67,614    | 26.84  | 1,814,759.76                      |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA          | 13,578    | 287.00 | 3,896,886.00                      |
|               | ORKLA                           | 54,479    | 43.51  | 2,370,381.29                      |
|               | DNB ASA                         | 71,231    | 70.25  | 5,003,977.75                      |
|               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA       | 14,577    | 79.45  | 1,158,142.65                      |
|               | TELENOR ASA                     | 52,555    | 111.70 | 5,870,393.50                      |
| ノルウェークローネ小計   |                                 | 412,247   |        | 41,702,266.85<br>(565,482,738)    |
| デンマーク<br>クローネ | NOVOZYMES A/S                   | 17,729    | 159.90 | 2,834,867.10                      |

|               |                             |         |           |                                |
|---------------|-----------------------------|---------|-----------|--------------------------------|
|               | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 40      | 39,320.00 | 1,572,800.00                   |
|               | A P MOLLER-MAERSK AIS       | 96      | 41,520.00 | 3,985,920.00                   |
|               | DSV A/S                     | 13,798  | 130.40    | 1,799,259.20                   |
|               | CARLSBERG AS-B              | 7,768   | 514.00    | 3,992,752.00                   |
|               | COLOPLAST-B                 | 1,654   | 1,208.00  | 1,998,032.00                   |
|               | WILLIAM DEMANT HOLDING      | 1,854   | 520.00    | 964,080.00                     |
|               | NOVO NORDISK A/S-B          | 29,295  | 916.50    | 26,848,867.50                  |
|               | DANSKE BANK A/S             | 47,538  | 104.70    | 4,977,228.60                   |
|               | TRYG A/S                    | 1,646   | 376.90    | 620,377.40                     |
|               | TDC A/S                     | 34,299  | 42.26     | 1,449,475.74                   |
| デンマーククローネ小計   |                             | 155,717 |           | 51,043,659.54<br>(683,474,601) |
| イスラエル<br>シェケル | ISRAEL CHEMICALS LTD        | 31,437  | 47.50     | 1,493,257.50                   |
|               | ISRAEL CORP LIMITED/THE     | 161     | 2,488.00  | 400,568.00                     |
|               | DELEK GROUP LTD             | 299     | 653.60    | 195,426.40                     |
|               | TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 67,818  | 159.00    | 10,783,062.00                  |
|               | BANK HAPOALIM BM            | 73,582  | 13.95     | 1,026,468.90                   |
|               | BANK LEUMI LE-ISRAEL        | 91,292  | 10.95     | 999,647.40                     |
|               | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD    | 8,200   | 34.75     | 284,950.00                     |
|               | NICE SYSTEMS LTD            | 4,195   | 129.90    | 544,930.50                     |
|               | BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP  | 134,167 | 4.55      | 610,459.85                     |
|               | MELLANOX TECHNOLOGIES LTD   | 2,572   | 406.00    | 1,044,232.00                   |
| イスラエルシェケル小計   |                             | 413,723 |           | 17,383,002.55<br>(344,704,940) |
| ユーロ           | CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE | 9,997   | 24.50     | 244,926.50                     |
|               | CIE GENERALE DE GEOPHYSI-RT | 9,997   | 1.25      | 12,556.23                      |
|               | ENI                         | 182,990 | 17.02     | 3,114,489.80                   |
|               | FUGRO NV-CVA                | 5,024   | 52.92     | 265,870.08                     |
|               | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 16,031  | 12.62     | 202,311.22                     |
|               | NESTE OIL OYJ               | 8,623   | 10.20     | 87,954.60                      |
|               | OMV AG                      | 10,941  | 27.23     | 297,978.13                     |
|               | REPSOL SA                   | 57,629  | 15.09     | 869,621.61                     |

|                          |         |        |              |
|--------------------------|---------|--------|--------------|
| SAIPEM                   | 19,227  | 37.37  | 718,512.99   |
| SBM OFFSHORE NV          | 12,450  | 11.09  | 138,070.50   |
| TECHNIP S.A.             | 7,206   | 86.51  | 623,391.06   |
| TENARIS SA               | 34,293  | 15.88  | 544,572.84   |
| TOTAL SA                 | 153,027 | 38.60  | 5,906,842.20 |
| ACERINOX SA              | 6,932   | 8.72   | 60,488.63    |
| AIR LIQUIDE              | 22,463  | 96.45  | 2,166,556.35 |
| AKZO NOBEL               | 17,043  | 43.99  | 749,721.57   |
| ARCELORMITTAL            | 68,013  | 11.16  | 759,025.08   |
| ARKEMA                   | 4,366   | 72.86  | 318,106.76   |
| BASF SE                  | 66,068  | 65.65  | 4,337,364.20 |
| CRH                      | 52,215  | 15.00  | 783,225.00   |
| HEIDELBERGCEMENT AG      | 10,212  | 40.77  | 416,343.24   |
| IMERYS SA                | 2,361   | 45.66  | 107,803.26   |
| K+S AG                   | 12,510  | 38.26  | 478,695.15   |
| KONINKLIJKE DSM NV       | 11,199  | 38.80  | 434,521.20   |
| LAFARGE (FRANCE)         | 13,444  | 41.91  | 563,438.04   |
| LANXESS                  | 6,042   | 64.53  | 389,890.26   |
| LINDE AG                 | 13,307  | 134.00 | 1,783,138.00 |
| SALZGITTER AG            | 2,612   | 30.06  | 78,529.78    |
| SOLVAY SA                | 4,306   | 90.06  | 387,798.36   |
| STORA ENSO OYJ R         | 40,312  | 4.83   | 194,868.20   |
| THYSSEN KRUPP            | 28,022  | 16.54  | 463,483.88   |
| UMICORE                  | 8,048   | 40.67  | 327,352.40   |
| UPM KYMMENE CORP         | 38,131  | 8.79   | 335,362.14   |
| VOESTALPINE AG           | 7,614   | 23.29  | 177,330.06   |
| WACKER CHEMIE AG         | 1,088   | 49.96  | 54,356.48    |
| ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 10,283  | 16.03  | 164,836.49   |
| ALSTOM RGPT              | 14,969  | 27.28  | 408,429.16   |
| ANDRITZ AG               | 5,139   | 44.07  | 226,475.73   |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 5,133   | 28.13  | 144,391.29   |
| BOUYGUES ORD             | 13,337  | 19.00  | 253,403.00   |
| BRENTAG AG               | 3,704   | 99.60  | 368,918.40   |

|                             |        |       |              |
|-----------------------------|--------|-------|--------------|
| EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE | 29,819 | 24.66 | 735,485.63   |
| FERROVIAL SA                | 28,481 | 10.12 | 288,370.12   |
| FIAT INDUSTRIAL             | 62,149 | 7.60  | 472,643.14   |
| FINMECCANICA SPA            | 29,572 | 3.69  | 109,298.11   |
| GEA GROUP AG                | 12,681 | 23.54 | 298,574.14   |
| HOCHTIEF AG                 | 2,174  | 36.46 | 79,264.04    |
| KONE OYJ-B                  | 11,307 | 53.85 | 608,881.95   |
| LEGRAND SA                  | 17,208 | 29.33 | 504,710.64   |
| MAN SE                      | 2,986  | 71.25 | 212,752.50   |
| METSO OYJ                   | 9,281  | 27.81 | 258,104.61   |
| PHILIPS ELECTRS (KON.)      | 74,773 | 18.15 | 1,357,503.81 |
| PRYSMIAN SPA                | 14,113 | 13.88 | 195,888.44   |
| REXEL SA                    | 7,590  | 15.66 | 118,859.40   |
| SAFRAN SA                   | 16,657 | 27.98 | 466,146.14   |
| SAINT-GOBAIN                | 28,378 | 27.33 | 775,712.63   |
| SCHNEIDER ELECTRIC          | 37,512 | 46.05 | 1,727,615.16 |
| SIEMENS                     | 59,184 | 77.61 | 4,593,270.24 |
| THALES SA                   | 6,763  | 26.72 | 180,741.17   |
| VALLOUREC                   | 7,564  | 32.95 | 249,233.80   |
| VINCI S.A.                  | 32,926 | 33.14 | 1,091,332.27 |
| WARTSILA OYJ                | 11,836 | 26.95 | 318,980.20   |
| ZARDOYA OTIS SA             | 10,201 | 9.15  | 93,339.15    |
| ZODIAC AEROSPACE            | 2,409  | 75.98 | 183,035.82   |
| BUREAU VERITAS SA           | 3,969  | 79.92 | 317,202.48   |
| EDENRED                     | 11,961 | 21.86 | 261,527.26   |
| RANDSTAD HOLDING NV         | 8,690  | 25.86 | 224,766.85   |
| SOCIETE BIC SA              | 1,994  | 94.02 | 187,475.88   |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS    | 25,941 | 11.45 | 297,024.45   |
| ADP                         | 2,316  | 62.06 | 143,730.96   |
| ATLANTIA SPA                | 24,031 | 12.08 | 290,294.48   |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG      | 16,628 | 10.55 | 175,425.40   |
| DEUTSCHE POST AG-REG        | 61,460 | 15.20 | 934,192.00   |
| FRAPORT AG                  | 2,668  | 45.00 | 120,073.34   |

|                                    |        |        |              |
|------------------------------------|--------|--------|--------------|
| GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR        | 39,574 | 5.48   | 216,944.66   |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE | 67,369 | 1.87   | 126,047.39   |
| TNT EXPRESS                        | 24,466 | 8.12   | 198,810.71   |
| VOPAK                              | 5,106  | 54.64  | 278,991.84   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG        | 24,045 | 56.91  | 1,368,400.95 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD       | 3,791  | 39.94  | 151,412.54   |
| CONTINENTAL AG                     | 5,810  | 76.20  | 442,722.00   |
| DAIMLER AG                         | 65,202 | 37.66  | 2,455,833.33 |
| FIAT ORD                           | 61,791 | 4.15   | 256,556.23   |
| MICHELIN                           | 13,073 | 60.96  | 796,930.08   |
| NOKIAN RENKAAT OYJ                 | 7,831  | 31.65  | 247,851.15   |
| PEUGEOT SA                         | 16,283 | 6.15   | 100,140.45   |
| PIRELLI & CO                       | 17,274 | 8.38   | 144,756.12   |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE       | 11,120 | 46.54  | 517,580.40   |
| RENAULT SA                         | 13,959 | 36.52  | 509,782.68   |
| VOLKSWAGEN AG-PFD                  | 10,503 | 141.95 | 1,490,900.85 |
| VOLKSWAGEN STAMM                   | 2,143  | 130.20 | 279,018.60   |
| ADIDAS AG                          | 15,193 | 63.84  | 969,921.12   |
| CHRISTIAN DIOR                     | 3,959  | 104.40 | 413,319.60   |
| HUGO BOSS AG                       | 1,789  | 68.50  | 122,546.50   |
| LUXOTTICA GROUP SPA                | 8,490  | 27.53  | 233,729.70   |
| LVMH                               | 18,273 | 117.00 | 2,137,941.00 |
| ACCOR                              | 10,727 | 25.95  | 278,419.28   |
| AUTOGRILL SPA                      | 7,704  | 7.39   | 56,971.08    |
| OPAP SA                            | 14,930 | 4.00   | 59,720.00    |
| SODEXO                             | 6,847  | 58.59  | 401,165.73   |
| AXEL SPRINGER AG                   | 2,751  | 33.72  | 92,763.72    |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS            | 9,591  | 25.01  | 239,918.86   |
| JC DECAUX SA                       | 4,621  | 17.66  | 81,606.86    |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG       | 6,354  | 55.51  | 352,710.54   |
| LAGADERE S.C.A                     | 8,178  | 21.25  | 173,823.39   |
| MEDIASET                           | 47,386 | 1.46   | 69,230.94    |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD       | 6,178  | 19.60  | 121,119.69   |

|                                        |         |        |              |
|----------------------------------------|---------|--------|--------------|
| PUBLICIS GROUPE                        | 12,745  | 43.55  | 555,044.75   |
| REED ELSEVIER NV                       | 49,954  | 10.40  | 519,771.37   |
| SES                                    | 21,856  | 21.16  | 462,582.24   |
| WOLTERS KLUWER                         | 21,907  | 14.63  | 320,499.41   |
| INDITEX                                | 15,843  | 96.63  | 1,530,909.09 |
| PPR                                    | 5,526   | 119.40 | 659,804.40   |
| AHOLD (KON.)                           | 75,950  | 9.74   | 740,284.65   |
| CARREFOUR                              | 41,934  | 16.14  | 676,814.76   |
| CASINO GUICHARD PERRACHON              | 3,906   | 68.89  | 269,084.34   |
| COLRUYT SA                             | 5,507   | 33.89  | 186,659.76   |
| DELHAIZE GROUP                         | 7,400   | 30.04  | 222,333.00   |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT | 44,401  | 4.29   | 190,702.29   |
| JERONIMO MARTINS                       | 15,262  | 12.98  | 198,177.07   |
| KESKO OYJ-B SHS                        | 4,473   | 22.05  | 98,629.65    |
| METRO STAMM                            | 9,415   | 23.27  | 219,134.12   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV                   | 57,765  | 66.17  | 3,822,310.05 |
| COCA-COLA HELLENIC BOTTLING            | 12,699  | 14.52  | 184,389.48   |
| DANONE (GROUPE)                        | 41,637  | 47.91  | 1,994,828.67 |
| DE MASTER BLENDERS1753 NV              | 42,962  | 9.37   | 402,768.75   |
| HEINEKEN HOLDING NV                    | 7,251   | 37.79  | 274,051.54   |
| HEINEKEN NV                            | 16,732  | 46.39  | 776,197.48   |
| KERRY GROUP PLC-A                      | 10,835  | 39.85  | 431,774.75   |
| PERNOD-RICARD                          | 15,379  | 87.31  | 1,342,740.49 |
| REMY COINTREAU                         | 1,575   | 89.50  | 140,962.50   |
| SUEDZUCKER AG                          | 4,813   | 27.55  | 132,598.15   |
| UNILEVER NV-CVA                        | 117,176 | 27.53  | 3,225,855.28 |
| BEIERSDORF AG                          | 7,320   | 57.10  | 417,972.00   |
| HENKEL AG & CO KGAA                    | 9,433   | 50.77  | 478,913.41   |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD               | 12,938  | 61.89  | 800,732.82   |
| LOREAL                                 | 17,458  | 96.26  | 1,680,507.08 |
| CELESIO AG                             | 5,912   | 13.87  | 82,029.00    |
| ESSILOR INTERNATIONAL                  | 14,462  | 72.87  | 1,053,845.94 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA    | 15,235  | 57.06  | 869,309.10   |

|                                   |         |       |              |
|-----------------------------------|---------|-------|--------------|
| FRESENIUS SE&CO KGAA              | 9,006   | 90.34 | 813,602.04   |
| BAYER                             | 59,484  | 66.83 | 3,975,315.72 |
| ELAN CORPORATION PLC              | 36,493  | 8.39  | 306,176.27   |
| GRIFOLS SA                        | 10,529  | 25.70 | 270,595.30   |
| MERCK KGAA                        | 4,693   | 96.00 | 450,528.00   |
| ORION OYJ-CLASS B                 | 6,894   | 16.65 | 114,785.10   |
| QIAGEN N.V.                       | 17,009  | 14.32 | 243,568.88   |
| SANOFI                            | 85,516  | 66.35 | 5,673,986.60 |
| UCB (GROUPE)                      | 7,767   | 42.79 | 332,349.93   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA              | 391,661 | 6.11  | 2,394,223.69 |
| BANCO DE SABADELL SA              | 144,195 | 2.09  | 301,367.55   |
| BANCO POPOLARE SPA                | 122,198 | 1.16  | 142,360.67   |
| BANCO SANTANDER SA                | 713,093 | 5.79  | 4,132,373.93 |
| BNP PARIBAS                       | 69,972  | 36.98 | 2,587,564.56 |
| CAIXABANK                         | 54,400  | 2.92  | 159,174.40   |
| COMMERZBANK AG                    | 256,699 | 1.38  | 356,554.91   |
| CREDIT AGRICOLE SA                | 72,829  | 5.37  | 391,091.73   |
| ERSTE GROUP BANK AG               | 15,214  | 17.36 | 264,191.11   |
| INTESA SANPAOLO                   | 713,260 | 1.18  | 843,786.58   |
| INTESA SANPAOLO-RNC               | 64,873  | 1.00  | 65,262.23    |
| IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION | 45,054  | —     | —            |
| KBC GROEP NV                      | 11,204  | 18.67 | 209,178.68   |
| NATIXIS                           | 63,795  | 2.45  | 156,297.75   |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG  | 3,400   | 28.18 | 95,829.00    |
| SOCIETE GENERALE                  | 50,909  | 22.10 | 1,125,088.90 |
| UNICREDIT SPA                     | 285,979 | 3.23  | 924,284.12   |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC      | 54,261  | 2.87  | 156,054.63   |
| DEUTSCHE BANK NAMEN               | 67,748  | 30.74 | 2,082,912.26 |
| DEUTSCHE BOERSE                   | 14,213  | 43.06 | 612,082.84   |
| EURAZEO                           | 2,357   | 35.65 | 84,027.05    |
| EXOR SPA                          | 4,687   | 19.57 | 91,724.59    |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA       | 5,711   | 57.75 | 329,810.25   |
| ING GROEP                         | 279,174 | 6.14  | 1,716,640.92 |

|                                          |         |        |              |
|------------------------------------------|---------|--------|--------------|
| MEDIOBANCA                               | 34,666  | 4.15   | 144,141.22   |
| OKO BANK-A                               | 9,611   | 10.24  | 98,416.64    |
| WENDEL                                   | 2,395   | 65.70  | 157,351.50   |
| AEGON                                    | 125,270 | 4.04   | 506,717.15   |
| AGEAS                                    | 16,487  | 18.66  | 307,647.42   |
| ALLIANZ SE-REG                           | 32,973  | 92.59  | 3,052,970.07 |
| ASSICURAZIONI GENERALI                   | 85,107  | 11.19  | 952,347.33   |
| AXA                                      | 128,857 | 11.59  | 1,493,452.63 |
| CNP ASSURANCES                           | 9,966   | 10.16  | 101,304.39   |
| DELTA LLOYD NV                           | 10,040  | 11.86  | 119,124.60   |
| HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG             | 4,395   | 49.72  | 218,541.37   |
| MAPFRE SA                                | 55,064  | 2.13   | 117,396.44   |
| MUENCHENER RUECKVERSICH.                 | 13,072  | 121.50 | 1,588,248.00 |
| SAMPO OYJ-A SHS                          | 30,547  | 24.21  | 739,542.87   |
| SCOR SE                                  | 11,593  | 20.06  | 232,613.54   |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH | 2,808   | 33.00  | 92,664.00    |
| IMMOFINANZ AG                            | 68,672  | 2.82   | 193,861.05   |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS              | 22,753  | 18.13  | 412,511.89   |
| ATOS                                     | 3,835   | 54.24  | 208,010.40   |
| CAP GEMINI SA                            | 10,447  | 32.92  | 343,967.47   |
| DASSAULT SYSTEMES SA                     | 4,434   | 81.76  | 362,523.84   |
| SAP AG                                   | 66,254  | 55.11  | 3,651,257.94 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE             | 7,820   | 15.87  | 124,103.40   |
| ALCATEL-LUCENT                           | 168,500 | 0.85   | 144,741.50   |
| GEMALTO                                  | 5,753   | 68.45  | 393,792.85   |
| NOKIA CORP                               | 271,962 | 2.01   | 546,643.62   |
| BELGACOM                                 | 11,046  | 23.75  | 262,342.50   |
| DEUTSCHE TELEKOM                         | 202,046 | 9.57   | 1,934,590.45 |
| ELISA A                                  | 10,288  | 17.59  | 180,965.92   |
| FRANCE TELECOM                           | 134,655 | 9.38   | 1,264,141.14 |
| ILIAD SA                                 | 1,611   | 126.70 | 204,113.70   |
| KPN (KON.)                               | 72,771  | 5.94   | 432,696.36   |
| MOBISTAR SA                              | 2,086   | 24.55  | 51,211.30    |

|                              |            |       |                                      |
|------------------------------|------------|-------|--------------------------------------|
| PORTUGAL TELECOM             | 46,591     | 3.84  | 179,235.57                           |
| TELECOM ITALIA ORD           | 682,040    | 0.78  | 531,991.20                           |
| TELECOM ITALIA RNC           | 437,622    | 0.68  | 298,239.39                           |
| TELEFONICA                   | 290,015    | 10.37 | 3,008,905.62                         |
| TELEKOM AUSTRIA AG           | 15,933     | 5.50  | 87,631.50                            |
| TELENET GROUP HOLDING NV     | 4,004      | 34.85 | 139,539.40                           |
| VIVENDI                      | 93,597     | 15.17 | 1,420,334.47                         |
| ACCIONA SA                   | 1,857      | 44.29 | 82,246.53                            |
| E.ON AG                      | 129,542    | 18.46 | 2,391,993.03                         |
| ELECTRICITE DE FRANCE        | 16,968     | 16.30 | 276,663.24                           |
| ENAGAS                       | 12,407     | 15.35 | 190,447.45                           |
| ENEL                         | 478,016    | 2.75  | 1,315,500.03                         |
| ENEL GREEN POWER SPA         | 121,260    | 1.31  | 159,578.16                           |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA      | 127,604    | 2.14  | 273,327.76                           |
| FORTUM OYJ                   | 32,257     | 14.33 | 462,242.81                           |
| GAS NATURAL SDG SA           | 25,206     | 11.01 | 277,644.09                           |
| GDF SUEZ                     | 91,850     | 17.40 | 1,598,190.00                         |
| IBERDROLA SA                 | 281,941    | 3.52  | 994,687.84                           |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 7,859      | 36.89 | 289,957.80                           |
| RWE AG-NON VTG PFD           | 2,623      | 31.02 | 81,365.46                            |
| RWE STAMM                    | 35,539     | 34.81 | 1,237,290.28                         |
| SNAM SPA                     | 116,704    | 3.45  | 402,628.80                           |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA        | 20,379     | 8.81  | 179,722.40                           |
| TERNA SPA                    | 92,233     | 2.90  | 267,475.70                           |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 24,321     | 8.39  | 204,199.11                           |
| VERBUND AG                   | 4,553      | 16.10 | 73,303.30                            |
| ASML HOLDING NV              | 30,490     | 41.59 | 1,268,079.10                         |
| INFINEON TECHNOLOGIES        | 78,920     | 4.93  | 389,706.96                           |
| STMICROELECTRONICS           | 46,288     | 4.19  | 194,085.58                           |
| ユーロ小計                        | 11,732,182 |       | 158,495,168.73<br>(15,828,912,501)   |
| 合計                           | 74,578,235 |       | 126,162,476,376<br>(126,162,476,376) |

## (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      | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|----------|----------|------------|
| アメリカドル     | 株式 574銘柄 | 100.0%   | 58.7%      |
| カナダドル      | 株式 98銘柄  | 100.0%   | 5.6%       |
| オーストラリアドル  | 株式 57銘柄  | 100.0%   | 3.7%       |
| イギリスポンド    | 株式 102銘柄 | 100.0%   | 10.5%      |
| スイスフラン     | 株式 40銘柄  | 100.0%   | 3.9%       |
| 香港ドル       | 株式 41銘柄  | 100.0%   | 1.4%       |
| シンガポールドル   | 株式 29銘柄  | 100.0%   | 0.8%       |
| ニュージーランドドル | 株式 5銘柄   | 100.0%   | 0.1%       |
| スウェーデンクローナ | 株式 35銘柄  | 100.0%   | 1.5%       |
| ノルウェークローネ  | 株式 10銘柄  | 100.0%   | 0.4%       |
| デンマーククローネ  | 株式 11銘柄  | 100.0%   | 0.5%       |
| イスラエルシェケル  | 株式 10銘柄  | 100.0%   | 0.3%       |
| ユーロ        | 株式 235銘柄 | 100.0%   | 12.5%      |

(注) 組入株式時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する株式の比率であります。

## B. 株式以外の有価証券

| 種類           | 通貨            | 銘柄                           | 口数         | 評価額                        | 備考 |
|--------------|---------------|------------------------------|------------|----------------------------|----|
| 投資信託<br>受益証券 | アメリカドル        | HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U | 379,000.00 | 274,775.00                 |    |
|              | アメリカドル小計      |                              | 379,000.00 | 274,775.00<br>(21,418,711) |    |
|              | オーストラリア<br>ドル | APA GROUP                    | 45,498.00  | 215,660.52                 |    |
|              |               | LEND LEASE GROUP             | 39,449.00  | 309,674.65                 |    |
|              |               | SYDNEY AIRPORT               | 26,529.00  | 83,831.64                  |    |
|              | オーストラリアドル小計   |                              | 111,476.00 | 609,166.81<br>(49,196,311) |    |

| 投資信託受益証券合計 |        |                               |            | 70,615,022<br>(70,615,022)       |  |
|------------|--------|-------------------------------|------------|----------------------------------|--|
| 投資証券       | アメリカドル | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP  | 24,500.00  | 847,455.00                       |  |
|            |        | AMERICAN TOWER CORPORATION    | 28,577.00  | 2,040,112.03                     |  |
|            |        | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 70,459.00  | 1,186,529.56                     |  |
|            |        | AVALONBAY COMMUNITIES INC     | 6,957.00   | 946,082.43                       |  |
|            |        | BOSTON PROPERTIES             | 10,770.00  | 1,191,269.70                     |  |
|            |        | CAMDEN PROPERTY TRUST         | 5,800.00   | 374,042.00                       |  |
|            |        | DIGITAL REALTY TRUST INC      | 8,731.00   | 609,860.35                       |  |
|            |        | DUKE REALTY CORP              | 18,853.00  | 277,139.10                       |  |
|            |        | EQUITY RESIDENTIAL PPTY       | 21,832.00  | 1,255,994.96                     |  |
|            |        | FEDERAL REALTY INVS TRUST     | 4,645.00   | 489,118.50                       |  |
|            |        | GENERAL GROWTH PROPERTIES     | 29,165.00  | 568,134.20                       |  |
|            |        | HCP INC                       | 29,765.00  | 1,323,947.20                     |  |
|            |        | HEALTH CARE REIT INC          | 16,259.00  | 938,957.25                       |  |
|            |        | HOST HOTELS AND RESORTS INC   | 51,418.00  | 825,258.90                       |  |
|            |        | KIMCO REALTY CORP             | 29,508.00  | 598,127.16                       |  |
|            |        | LIBERTY PROPERTY TRUST        | 8,458.00   | 306,517.92                       |  |
|            |        | MACERICH CO/THE               | 9,622.00   | 550,667.06                       |  |
|            |        | PLUM CREEK TIMBER COMMON      | 11,675.00  | 511,832.00                       |  |
|            |        | PROLOGIS INC                  | 33,339.00  | 1,167,865.17                     |  |
|            |        | PUBLIC STORAGE                | 10,621.00  | 1,478,124.57                     |  |
|            |        | RAYONIER INC                  | 8,845.00   | 433,493.45                       |  |
|            |        | REALTY INCOME CORP            | 9,600.00   | 392,544.00                       |  |
|            |        | REGENCY CENTERS CORP          | 6,512.00   | 317,329.76                       |  |
|            |        | SIMON PROPERTY GROUP          | 21,842.00  | 3,315,834.02                     |  |
|            |        | SL GREEN REALTY CORP          | 6,300.00   | 504,441.00                       |  |
|            |        | UDR INC                       | 17,800.00  | 441,796.00                       |  |
|            |        | VENTAS INC                    | 20,950.00  | 1,304,137.50                     |  |
|            |        | VORNADO REALTY TRUST          | 12,102.00  | 980,867.10                       |  |
|            |        | アメリカドル小計                      | 534,905.00 | 25,177,477.89<br>(1,962,584,401) |  |

|             |                                       |              |                               |  |
|-------------|---------------------------------------|--------------|-------------------------------|--|
| カナダドル       | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT | 6,113.00     | 153,986.47                    |  |
|             | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR           | 9,483.00     | 262,394.61                    |  |
| カナダドル小計     |                                       | 15,596.00    | 416,381.08<br>(32,994,036)    |  |
| オーストラリアドル   | CENTRO RETAIL AUSTRALIA               | 89,917.00    | 187,926.53                    |  |
|             | CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP       | 140,325.00   | 270,827.25                    |  |
|             | DEXUS PROPERTY GROUP                  | 335,304.00   | 318,538.80                    |  |
|             | GOODMAN GROUP                         | 112,356.00   | 444,929.76                    |  |
|             | GPT GROUP                             | 102,192.00   | 347,452.80                    |  |
|             | MIRVAC GROUP                          | 248,145.00   | 354,847.35                    |  |
|             | STOCKLAND                             | 161,862.00   | 540,619.08                    |  |
|             | WESTFIELD GROUP                       | 155,181.00   | 1,576,638.96                  |  |
|             | WESTFIELD RETAIL TRUST                | 210,706.00   | 608,940.34                    |  |
| オーストラリアドル小計 |                                       | 1,555,988.00 | 4,650,720.87<br>(375,592,217) |  |
| イギリスポンド     | BRITISH LAND CO PLC                   | 60,538.00    | 316,008.36                    |  |
|             | CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC    | 40,760.00    | 133,366.72                    |  |
|             | HAMMERSON PLC                         | 51,853.00    | 233,857.03                    |  |
|             | LAND SECURITIES GROUP PLC             | 56,796.00    | 432,501.54                    |  |
|             | SEGRO PLC                             | 54,059.00    | 122,605.81                    |  |
| イギリスポンド小計   |                                       | 264,006.00   | 1,238,339.46<br>(155,646,886) |  |
| 香港ドル        | LINK REIT                             | 164,500.00   | 6,045,375.00                  |  |
| 香港ドル小計      |                                       | 164,500.00   | 6,045,375.00<br>(60,756,018)  |  |
| シンガポールドル    | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT          | 134,000.00   | 322,940.00                    |  |
|             | CAPITAMALL TRUST                      | 165,000.00   | 333,300.00                    |  |
| シンガポールドル小計  |                                       | 299,000.00   | 656,240.00<br>(41,572,804)    |  |
| ユーロ         | CORIO NV                              | 4,573.00     | 151,297.70                    |  |

|        |  |                      |          |                                  |                               |
|--------|--|----------------------|----------|----------------------------------|-------------------------------|
|        |  | FONCIERE DES REGIONS | 1,911.00 | 111,793.50                       |                               |
|        |  | GECINA SA            | 1,598.00 | 127,296.68                       |                               |
|        |  | ICADE                | 1,564.00 | 99,157.60                        |                               |
|        |  | KLEPIERRE            | 6,998.00 | 190,975.42                       |                               |
|        |  | UNIBAIL-RODAMCO SE   | 6,692.00 | 1,037,929.20                     |                               |
|        |  | ユーロ小計                |          | 23,336.00                        | 1,718,450.10<br>(171,621,611) |
| 投資証券合計 |  |                      |          | 2,800,767,973<br>(2,800,767,973) |                               |
| 合計     |  |                      |          | 2,871,382,995<br>(2,871,382,995) |                               |

(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          | 組入投資信託<br>受益証券時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-----------|--------------|--------------------|----------------|------------|
| アメリカドル    | 投資信託受益証券 1銘柄 | 1.1%               | —              | 69.1%      |
|           | 投資証券 28銘柄    | —                  | 98.9%          |            |
| カナダドル     | 投資証券 2銘柄     | —                  | 100.0%         | 1.1%       |
| オーストラリアドル | 投資信託受益証券 3銘柄 | 11.6%              | —              | 14.8%      |
|           | 投資証券 9銘柄     | —                  | 88.4%          |            |
| イギリスポンド   | 投資証券 5銘柄     | —                  | 100.0%         | 5.4%       |
| 香港ドル      | 投資証券 1銘柄     | —                  | 100.0%         | 2.1%       |
| シンガポールドル  | 投資証券 2銘柄     | —                  | 100.0%         | 1.4%       |
| ユーロ       | 投資証券 6銘柄     | —                  | 100.0%         | 6.0%       |

(注1)組入投資信託受益証券時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する投資信託受益証券の比率であります。

(注2)組入投資証券時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する投資証券の比率であります。

## 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](#)

## 「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24年10月 1日現在<br>金額(円) |
|-------------|------------------------|
| 資産の部        |                        |
| 流動資産        |                        |
| 預金          | 249,009,824            |
| コール・ローン     | 1,145,786,824          |
| 国債証券        | 195,257,627,816        |
| 派生商品評価勘定    | 134,729                |
| 未収入金        | 4,270,106,113          |
| 未収利息        | 2,037,371,973          |
| 前払費用        | 104,531,427            |
| 流動資産合計      | 203,064,568,706        |
| 資産合計        | 203,064,568,706        |
| 負債の部        |                        |
| 流動負債        |                        |
| 派生商品評価勘定    | 1,402,681              |
| 前受金         | 27,915                 |
| 未払金         | 4,276,353,522          |
| 未払解約金       | 114,352,933            |
| 流動負債合計      | 4,392,137,051          |
| 負債合計        | 4,392,137,051          |
| 純資産の部       |                        |
| 元本等         |                        |
| 元本          | 111,040,348,401        |
| 剰余金         |                        |
| 剰余金又は欠損金（△） | 87,632,083,254         |
| 元本等合計       | 198,672,431,655        |
| 純資産合計       | 198,672,431,655        |
| 負債純資産合計     | 203,064,568,706        |

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                      | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                               |
|----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法   | <p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>                             |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>(2)為替予約取引<br/>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>                                                                                                              |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | <p>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<br/>約定日基準で計上しております。</p>                                                                                                                                                                          |

## (貸借対照表に関する注記)

|                        | 平成24年10月 1日現在    |
|------------------------|------------------|
| 1. 計算期間の期首元本額          | 122,900,787,734円 |
| 計算期間中の追加設定元本額          | 10,179,140,673円  |
| 計算期間中の一部解約元本額          | 22,039,580,006円  |
| 計算日の元本額                | 111,040,348,401円 |
| 計算日の元本額の内訳             |                  |
| 外国債券オープン（毎月決算型）        | 7,287,625,974円   |
| 外国債券オープン（3ヶ月決算型）       | 326,830,034円     |
| グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）  | 2,707,984,452円   |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型）       | 1,883,285,067円   |
| SBI資産設計オープン（資産成長型）     | 454,887,735円     |
| SBI資産設計オープン（分配型）       | 12,309,220円      |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン | 3,112,211,905円   |
| 世界経済インデックスファンド         | 375,033,481円     |
| マイセクション25              | 20,242,309円      |
| マイセクション50              | 12,922,003円      |
| マイセクション75              | 8,803,723円       |
| DCマイセクション25            | 1,048,715,286円   |
| DCマイセクション50            | 913,617,567円     |
| DCマイセクション75            | 532,986,514円     |
| DC外国債券インデックス・オープン      | 1,115,036,768円   |
| DCマイセクションS25           | 301,330,877円     |
| DCマイセクションS50           | 253,807,628円     |
| DCマイセクションS75           | 102,928,275円     |
| DCターゲット・イヤー ファンド2015   | 2,191,586円       |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| DCターゲット・イヤー ファンド2025               | 31,967,212円      |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035               | 20,712,146円      |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045               | 6,493,823円       |
| DC世界経済インデックスファンド                   | 98,425,014円      |
| 外国債券インデックス・オープン（SMA専用）             | 6,155,235,651円   |
| 外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）          | 2,433,166,559円   |
| マイセクション50V A1（適格機関投資家専用）           | 43,433,804円      |
| マイセクション75V A1（適格機関投資家専用）           | 13,113,589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）      | 563,116,408円     |
| マイセクション50V A 2（適格機関投資家専用）          | 215,662円         |
| バランス30V A 1（適格機関投資家専用）             | 1,578,802,160円   |
| バランス50V A 1（適格機関投資家専用）             | 2,519,222,494円   |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用）               | 31,268,066,590円  |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用）               | 3,215,189,978円   |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）            | 10,214,883,764円  |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）          | 1,363,317,193円   |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）            | 4,445,548,753円   |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）               | 5,290,295,127円   |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）               | 5,601,657,256円   |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）            | 1,530,081,602円   |
| グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）       | 3,476,629,135円   |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）            | 618,056,447円     |
| バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）            | 836,440,236円     |
| FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）           | 5,573,184,541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）       | 895,024,212円     |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1               | 297,942,392円     |
| 外国債券ファンド・シリーズ1                     | 1,271,043,892円   |
| コア投資戦略ファンド（安定型）                    | 494,145,376円     |
| コア投資戦略ファンド（成長型）                    | 200,438,178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） | 511,748,803円     |
| 2. 計算日における受益権総数                    | 111,040,348,401口 |
| 3. 1口当たり純資産額                       | 1.7892円          |
| （1万口当たり純資産額）                       | （17,892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24年10月 1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。<br>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。 |

|                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引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。</p> <p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p> |
|--------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

|                        | 平成24年10月 1日現在                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額     | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                                                                                                                                 |
| 2. 時価の算定方法             | <p>(1)国債証券<br/>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>                                            |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |
| 4. 金銭債権の計算日後の償還予定額     | 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。                                                                                                                                                                                                              |

### （有価証券に関する注記）

#### 売買目的有価証券

| 種類   | 平成24年10月 1日現在      |
|------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 1,588,343,781      |

|    |               |
|----|---------------|
| 合計 | 1,588,343,781 |
|----|---------------|

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年10月1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24年10月 1日現在 |       |             |             |
|------|---------------|---------------|-------|-------------|-------------|
|      |               | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|      |               |               | うち1年超 |             |             |
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買 建 | 907,710,544   | —     | 907,669,925 | △40,619     |
| 合計   |               | 907,710,544   | —     | 907,669,925 | △40,619     |

(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24年10月 1日現在 |       |               |             |
|---------------|---------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|               |               | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|               |               |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約取引<br>買 建 |               |       |               |             |
|               | アメリカドル        | 592,374,400   | —     | 592,268,000   | △106,400    |
|               | カナダドル         | 55,447,700    | —     | 55,440,000    | △7,700      |
|               | イギリスポンド       | 100,538,640   | —     | 100,528,000   | △10,640     |
|               | シンガポールドル      | 5,067,920     | —     | 5,067,200     | △720        |
|               | 南アフリカランド      | 1,329,720,000 | —     | 1,328,600,000 | △1,120,000  |
|               | ユーロ           | 569,287,500   | —     | 569,202,000   | △85,500     |
|               | 計             | 2,652,436,160 | —     | 2,651,105,200 | △1,330,960  |
|               | 売 建           |               |       |               |             |
|               | アメリカドル        | 388,185,024   | —     | 388,141,200   | 43,824      |
|               | カナダドル         | 137,076,550   | —     | 137,067,900   | 8,650       |
|               | イギリスポンド       | 379,571,720   | —     | 379,553,600   | 18,120      |
|               | スイスフラン        | 9,916,920     | —     | 9,916,800     | 120         |
|               | マレーシアリンギット    | 20,397,616    | —     | 20,416,938    | △19,322     |
|               | デンマーククローネ     | 21,825,863    | —     | 21,825,700    | 163         |
|               | ポーランドズロチ      | 7,521,220     | —     | 7,533,000     | △11,780     |
|               | ユーロ           | 625,187,452   | —     | 625,123,600   | 63,852      |
|               | 計             | 1,589,682,365 | —     | 1,589,578,738 | 103,627     |
| 合計            |               | 4,242,118,525 | —     | 4,240,683,938 | △1,227,333  |

(注)時価の算定方法

わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ① 計算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24年10月 1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24年10月 1日現在 |
| 該当事項はありません。   |

[次へ](#)

## (3)附属明細表(平成24年10月1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% 07/15/15  | 14,000,000.00 | 13,980,859.20 |    |
|      |        | T 0.375% 04/15/15 | 11,500,000.00 | 11,526,956.00 |    |
|      |        | T 0.375% 06/15/15 | 10,000,000.00 | 10,022,270.00 |    |
|      |        | T 0.5% 10/15/13   | 16,200,000.00 | 16,251,256.80 |    |
|      |        | T 0.75% 06/30/17  | 19,400,000.00 | 19,552,328.80 |    |
|      |        | T 0.75% 12/15/13  | 15,000,000.00 | 15,098,430.00 |    |
|      |        | T 0.875% 02/28/17 | 22,900,000.00 | 23,256,026.30 |    |
|      |        | T 1% 01/15/14     | 3,900,000.00  | 3,939,912.60  |    |
|      |        | T 1% 03/31/17     | 1,400,000.00  | 1,428,436.80  |    |
|      |        | T 1% 06/30/19     | 4,500,000.00  | 4,501,053.00  |    |
|      |        | T 1% 09/30/16     | 3,500,000.00  | 3,575,194.00  |    |
|      |        | T 1.25% 04/15/14  | 2,100,000.00  | 2,132,894.40  |    |
|      |        | T 1.375% 02/28/19 | 4,400,000.00  | 4,526,843.20  |    |
|      |        | T 1.375% 09/30/18 | 3,900,000.00  | 4,024,616.70  |    |
|      |        | T 1.375% 12/31/18 | 2,000,000.00  | 2,060,468.00  |    |
|      |        | T 1.5% 03/31/19   | 11,000,000.00 | 11,392,733.00 |    |
|      |        | T 1.5% 07/31/16   | 20,000,000.00 | 20,807,820.00 |    |
|      |        | T 1.5% 12/31/13   | 8,650,000.00  | 8,790,225.15  |    |
|      |        | T 1.625% 08/15/22 | 2,000,000.00  | 1,998,281.20  |    |
|      |        | T 1.75% 01/31/14  | 22,600,000.00 | 23,063,480.80 |    |
|      |        | T 1.75% 03/31/14  | 22,000,000.00 | 22,502,744.00 |    |
|      |        | T 1.75% 05/15/22  | 12,500,000.00 | 12,680,662.50 |    |
|      |        | T 1.75% 07/31/15  | 15,000,000.00 | 15,610,545.00 |    |
|      |        | T 1.875% 02/28/14 | 7,800,000.00  | 7,982,816.40  |    |
|      |        | T 1.875% 04/30/14 | 15,100,000.00 | 15,491,663.80 |    |
|      |        | T 1.875% 06/30/15 | 13,100,000.00 | 13,666,470.20 |    |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| T 1.875% 08/31/17 | 9,800,000.00  | 10,405,228.40 |  |
| T 1.875% 09/30/17 | 4,000,000.00  | 4,245,936.00  |  |
| T 1.875% 10/31/17 | 2,500,000.00  | 2,654,102.50  |  |
| T 2% 01/31/16     | 13,500,000.00 | 14,236,168.50 |  |
| T 2% 02/15/22     | 10,000,000.00 | 10,405,470.00 |  |
| T 2% 11/15/21     | 2,400,000.00  | 2,506,312.80  |  |
| T 2% 11/30/13     | 15,000,000.00 | 15,313,470.00 |  |
| T 2.125% 02/29/16 | 4,800,000.00  | 5,086,876.80  |  |
| T 2.125% 08/15/21 | 6,100,000.00  | 6,454,086.70  |  |
| T 2.125% 11/30/14 | 12,600,000.00 | 13,107,931.20 |  |
| T 2.25% 01/31/15  | 5,400,000.00  | 5,649,118.20  |  |
| T 2.25% 05/31/14  | 10,100,000.00 | 10,438,511.60 |  |
| T 2.25% 07/31/18  | 5,750,000.00  | 6,226,623.25  |  |
| T 2.25% 11/30/17  | 2,000,000.00  | 2,161,876.00  |  |
| T 2.375% 02/28/15 | 19,200,000.00 | 20,171,251.20 |  |
| T 2.375% 03/31/16 | 9,600,000.00  | 10,264,128.00 |  |
| T 2.375% 05/31/18 | 4,000,000.00  | 4,356,876.00  |  |
| T 2.375% 06/30/18 | 10,250,000.00 | 11,170,901.00 |  |
| T 2.375% 08/31/14 | 12,500,000.00 | 13,009,762.50 |  |
| T 2.375% 10/31/14 | 6,000,000.00  | 6,264,138.00  |  |
| T 2.5% 03/31/15   | 21,700,000.00 | 22,904,523.60 |  |
| T 2.625% 02/29/16 | 1,000,000.00  | 1,076,641.00  |  |
| T 2.625% 04/30/16 | 9,100,000.00  | 9,823,377.20  |  |
| T 2.625% 04/30/18 | 5,000,000.00  | 5,514,845.00  |  |
| T 2.625% 06/30/14 | 16,000,000.00 | 16,667,504.00 |  |
| T 2.625% 07/31/14 | 37,400,000.00 | 39,033,332.80 |  |
| T 2.625% 08/15/20 | 11,700,000.00 | 12,939,474.60 |  |
| T 2.625% 11/15/20 | 13,500,000.00 | 14,910,115.50 |  |
| T 2.625% 12/31/14 | 3,550,000.00  | 3,739,286.00  |  |
| T 2.75% 02/15/19  | 5,300,000.00  | 5,908,259.80  |  |
| T 2.75% 02/28/18  | 3,800,000.00  | 4,213,250.00  |  |
| T 2.75% 05/31/17  | 8,000,000.00  | 8,808,440.00  |  |
| T 2.75% 08/15/42  | 4,000,000.00  | 3,940,624.80  |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| T 2.75% 10/31/13  | 1,500,000.00  | 1,541,250.00  |  |
| T 2.75% 11/30/16  | 14,000,000.00 | 15,308,132.00 |  |
| T 2.875% 03/31/18 | 3,900,000.00  | 4,353,375.00  |  |
| T 3% 02/28/17     | 9,500,000.00  | 10,525,335.00 |  |
| T 3% 05/15/42     | 8,000,000.00  | 8,310,000.00  |  |
| T 3% 08/31/16     | 8,700,000.00  | 9,565,580.40  |  |
| T 3.125% 01/31/17 | 3,500,000.00  | 3,891,153.00  |  |
| T 3.125% 04/30/17 | 6,500,000.00  | 7,254,611.00  |  |
| T 3.125% 05/15/19 | 12,800,000.00 | 14,599,001.60 |  |
| T 3.125% 05/15/21 | 10,150,000.00 | 11,606,687.40 |  |
| T 3.125% 10/31/16 | 8,500,000.00  | 9,412,092.50  |  |
| T 3.125% 11/15/41 | 9,300,000.00  | 9,924,848.40  |  |
| T 3.25% 06/30/16  | 6,100,000.00  | 6,742,165.30  |  |
| T 3.25% 07/31/16  | 7,000,000.00  | 7,751,135.00  |  |
| T 3.25% 12/31/16  | 3,500,000.00  | 3,905,097.00  |  |
| T 3.375% 11/15/19 | 8,300,000.00  | 9,626,705.20  |  |
| T 3.5% 02/15/18   | 5,700,000.00  | 6,539,638.50  |  |
| T 3.5% 02/15/39   | 7,200,000.00  | 8,280,561.60  |  |
| T 3.625% 02/15/20 | 5,150,000.00  | 6,071,365.90  |  |
| T 3.625% 02/15/21 | 18,000,000.00 | 21,317,346.00 |  |
| T 3.625% 08/15/19 | 3,900,000.00  | 4,582,195.80  |  |
| T 3.75% 08/15/41  | 7,000,000.00  | 8,384,138.00  |  |
| T 3.75% 11/15/18  | 10,000,000.00 | 11,741,410.00 |  |
| T 3.875% 08/15/40 | 10,900,000.00 | 13,338,875.00 |  |
| T 4% 02/15/14     | 5,450,000.00  | 5,733,143.85  |  |
| T 4.0% 02/15/15   | 7,200,000.00  | 7,833,938.40  |  |
| T 4.0% 08/15/18   | 3,300,000.00  | 3,913,595.40  |  |
| T 4.125% 05/15/15 | 6,700,000.00  | 7,370,261.30  |  |
| T 4.25% 05/15/39  | 2,500,000.00  | 3,244,922.50  |  |
| T 4.25% 08/15/14  | 12,000,000.00 | 12,897,660.00 |  |
| T 4.25% 08/15/15  | 12,500,000.00 | 13,904,787.50 |  |
| T 4.25% 11/15/13  | 5,100,000.00  | 5,331,494.10  |  |
| T 4.25% 11/15/14  | 7,700,000.00  | 8,349,987.80  |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| T 4.25% 11/15/17  | 4,600,000.00  | 5,433,211.80  |  |
| T 4.25% 11/15/40  | 10,000,000.00 | 13,003,910.00 |  |
| T 4.375% 02/15/38 | 2,800,000.00  | 3,692,063.20  |  |
| T 4.375% 05/15/40 | 4,900,000.00  | 6,492,882.20  |  |
| T 4.375% 05/15/41 | 2,000,000.00  | 2,654,062.00  |  |
| T 4.375% 11/15/39 | 6,500,000.00  | 8,604,882.00  |  |
| T 4.5% 02/15/16   | 3,200,000.00  | 3,643,750.40  |  |
| T 4.5% 02/15/36   | 3,900,000.00  | 5,210,766.60  |  |
| T 4.5% 05/15/17   | 9,800,000.00  | 11,562,089.00 |  |
| T 4.5% 05/15/38   | 2,000,000.00  | 2,687,968.00  |  |
| T 4.5% 08/15/39   | 4,500,000.00  | 6,066,913.50  |  |
| T 4.5% 11/15/15   | 3,100,000.00  | 3,500,458.00  |  |
| T 4.625% 02/15/17 | 5,000,000.00  | 5,884,765.00  |  |
| T 4.625% 02/15/40 | 1,150,000.00  | 1,580,980.90  |  |
| T 4.75% 02/15/37  | 1,500,000.00  | 2,079,141.00  |  |
| T 4.75% 05/15/14  | 6,200,000.00  | 6,654,584.00  |  |
| T 4.75% 08/15/17  | 1,300,000.00  | 1,559,441.00  |  |
| T 5.0% 05/15/37   | 500,000.00    | 717,187.50    |  |
| T 5.125% 05/15/16 | 5,800,000.00  | 6,781,922.60  |  |
| T 5.25% 02/15/29  | 1,900,000.00  | 2,666,085.70  |  |
| T 5.25% 11/15/28  | 1,300,000.00  | 1,820,101.40  |  |
| T 5.375% 02/15/31 | 2,010,000.00  | 2,909,475.00  |  |
| T 5.5% 08/15/28   | 1,200,000.00  | 1,718,719.20  |  |
| T 6.0% 02/15/26   | 2,200,000.00  | 3,221,110.20  |  |
| T 6.125% 08/15/29 | 1,400,000.00  | 2,149,984.20  |  |
| T 6.125% 11/15/27 | 2,220,000.00  | 3,342,314.34  |  |
| T 6.25% 05/15/30  | 1,880,000.00  | 2,947,928.36  |  |
| T 6.25% 08/15/23  | 4,900,000.00  | 7,113,423.10  |  |
| T 6.5% 11/15/26   | 600,000.00    | 923,015.40    |  |
| T 6.875% 08/15/25 | 1,000,000.00  | 1,559,531.00  |  |
| T 7.25% 05/15/16  | 6,350,000.00  | 7,914,182.80  |  |
| T 7.25% 08/15/22  | 2,600,000.00  | 3,968,047.20  |  |
| T 7.5% 11/15/16   | 5,100,000.00  | 6,561,670.20  |  |

|               |                     |                |                                      |  |
|---------------|---------------------|----------------|--------------------------------------|--|
|               | T 8.0% 11/15/21     | 2,560,000.00   | 4,012,001.28                         |  |
|               | T 8.125% 08/15/19   | 2,100,000.00   | 3,103,241.40                         |  |
| アメリカドル小計      |                     | 959,620,000.00 | 1,050,367,730.73<br>(81,876,164,610) |  |
| カナダドル         | CAN 1% 02/01/15     | 200,000.00     | 199,602.00                           |  |
|               | CAN 1.5% 11/01/13   | 3,350,000.00   | 3,366,046.50                         |  |
|               | CAN 2% 03/01/14     | 2,900,000.00   | 2,938,164.00                         |  |
|               | CAN 2% 06/01/16     | 1,400,000.00   | 1,440,096.00                         |  |
|               | CAN 2% 12/01/14     | 5,300,000.00   | 5,404,569.00                         |  |
|               | CAN 2.5% 06/01/15   | 1,800,000.00   | 1,866,438.00                         |  |
|               | CAN 2.75% 06/01/22  | 2,000,000.00   | 2,181,620.00                         |  |
|               | CAN 2.75% 09/01/16  | 3,100,000.00   | 3,278,963.00                         |  |
|               | CAN 3% 12/01/15     | 1,000,000.00   | 1,056,860.00                         |  |
|               | CAN 3.0% 06/01/14   | 5,150,000.00   | 5,314,027.50                         |  |
|               | CAN 3.25% 06/01/21  | 2,300,000.00   | 2,601,852.00                         |  |
|               | CAN 3.5% 06/01/20   | 2,350,000.00   | 2,681,044.50                         |  |
|               | CAN 3.5% 12/01/45   | 1,000,000.00   | 1,275,520.00                         |  |
|               | CAN 3.75% 06/01/19  | 3,400,000.00   | 3,896,468.00                         |  |
|               | CAN 4% 06/01/16     | 4,000,000.00   | 4,400,840.00                         |  |
|               | CAN 4% 06/01/17     | 2,400,000.00   | 2,694,984.00                         |  |
|               | CAN 4.0% 06/01/41   | 2,850,000.00   | 3,850,036.50                         |  |
|               | CAN 4.25% 06/01/18  | 1,950,000.00   | 2,258,490.00                         |  |
|               | CAN 4.5% 06/01/15   | 3,000,000.00   | 3,268,050.00                         |  |
|               | CAN 5% 06/01/14     | 2,600,000.00   | 2,768,350.00                         |  |
|               | CAN 5% 06/01/37     | 2,850,000.00   | 4,268,958.00                         |  |
|               | CAN 5.75% 06/01/29  | 2,160,000.00   | 3,240,626.40                         |  |
|               | CAN 5.75% 06/01/33  | 2,510,000.00   | 3,948,857.50                         |  |
|               | CAN 8.0% 06/01/27   | 950,000.00     | 1,661,958.50                         |  |
|               | CAN 9% 06/01/25     | 650,000.00     | 1,166,249.50                         |  |
| カナダドル小計       |                     | 61,170,000.00  | 71,028,670.90<br>(5,628,311,882)     |  |
| オーストラリア<br>ドル | ACGB 2.75% 04/21/24 | 950,000.00     | 917,861.50                           |  |

|             |                     |               |                                  |  |
|-------------|---------------------|---------------|----------------------------------|--|
|             | ACGB 4.25% 07/21/17 | 1,000,000.00  | 1,077,580.00                     |  |
|             | ACGB 4.5% 04/15/20  | 3,500,000.00  | 3,917,725.00                     |  |
|             | ACGB 4.5% 10/21/14  | 3,000,000.00  | 3,121,080.00                     |  |
|             | ACGB 4.75% 04/21/27 | 1,000,000.00  | 1,167,190.00                     |  |
|             | ACGB 4.75% 06/15/16 | 3,150,000.00  | 3,406,441.50                     |  |
|             | ACGB 4.75% 10/21/15 | 1,000,000.00  | 1,067,640.00                     |  |
|             | ACGB 5.25% 03/15/19 | 2,700,000.00  | 3,111,696.00                     |  |
|             | ACGB 5.5% 01/21/18  | 2,400,000.00  | 2,744,544.00                     |  |
|             | ACGB 5.5% 04/21/23  | 1,400,000.00  | 1,716,428.00                     |  |
|             | ACGB 5.5% 12/15/13  | 2,400,000.00  | 2,480,592.00                     |  |
|             | ACGB 5.75% 05/15/21 | 2,500,000.00  | 3,055,950.00                     |  |
|             | ACGB 5.75% 07/15/22 | 2,550,000.00  | 3,164,014.50                     |  |
|             | ACGB 6% 02/15/17    | 3,200,000.00  | 3,667,840.00                     |  |
|             | ACGB 6.25% 04/15/15 | 2,100,000.00  | 2,295,594.00                     |  |
|             | ACGB 6.25% 06/15/14 | 1,200,000.00  | 1,273,020.00                     |  |
| オーストラリアドル小計 |                     | 34,050,000.00 | 38,185,196.50<br>(3,083,836,469) |  |
| イギリスポンド     | UKT 1% 09/07/17     | 3,900,000.00  | 3,952,455.00                     |  |
|             | UKT 1.75% 01/22/17  | 800,000.00    | 840,344.00                       |  |
|             | UKT 1.75% 09/07/22  | 1,900,000.00  | 1,904,237.00                     |  |
|             | UKT 2% 01/22/16     | 1,300,000.00  | 1,369,485.00                     |  |
|             | UKT 2.25% 03/07/14  | 4,800,000.00  | 4,941,984.00                     |  |
|             | UKT 2.75% 01/22/15  | 5,250,000.00  | 5,553,975.00                     |  |
|             | UKT 3.75% 07/22/52  | 1,300,000.00  | 1,456,845.00                     |  |
|             | UKT 3.75% 09/07/19  | 3,100,000.00  | 3,656,450.00                     |  |
|             | UKT 3.75% 09/07/20  | 3,350,000.00  | 3,972,865.50                     |  |
|             | UKT 3.75% 09/07/21  | 2,400,000.00  | 2,859,792.00                     |  |
|             | UKT 4% 01/22/60     | 2,050,000.00  | 2,469,737.50                     |  |
|             | UKT 4% 03/07/22     | 2,550,000.00  | 3,099,525.00                     |  |
|             | UKT 4% 09/07/16     | 6,500,000.00  | 7,404,345.00                     |  |
|             | UKT 4.25% 03/07/36  | 3,650,000.00  | 4,503,735.00                     |  |
|             | UKT 4.25% 06/07/32  | 3,200,000.00  | 3,993,536.00                     |  |
|             | UKT 4.25% 09/07/39  | 1,750,000.00  | 2,150,837.50                     |  |

|          |                      |                    |                |                                    |  |
|----------|----------------------|--------------------|----------------|------------------------------------|--|
|          |                      | UKT 4.25% 12/07/27 | 2,300,000.00   | 2,896,045.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.25% 12/07/40 | 3,450,000.00   | 4,234,702.50                       |  |
|          |                      | UKT 4.25% 12/07/46 | 2,950,000.00   | 3,633,603.50                       |  |
|          |                      | UKT 4.25% 12/07/49 | 3,000,000.00   | 3,701,790.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.25% 12/07/55 | 3,100,000.00   | 3,881,107.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.5% 03/07/19  | 3,400,000.00   | 4,154,902.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.5% 09/07/34  | 2,550,000.00   | 3,266,601.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.5% 12/07/42  | 3,100,000.00   | 3,971,410.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.75% 03/07/20 | 4,050,000.00   | 5,081,251.50                       |  |
|          |                      | UKT 4.75% 09/07/15 | 3,050,000.00   | 3,451,685.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.75% 12/07/30 | 3,100,000.00   | 4,120,675.00                       |  |
|          |                      | UKT 4.75% 12/07/38 | 3,550,000.00   | 4,713,512.50                       |  |
|          |                      | UKT 5% 03/07/18    | 2,800,000.00   | 3,429,860.00                       |  |
|          |                      | UKT 5% 03/07/25    | 2,770,000.00   | 3,712,991.10                       |  |
|          |                      | UKT 5.0% 09/07/14  | 4,710,000.00   | 5,147,559.00                       |  |
|          |                      | UKT 6.0% 12/07/28  | 1,960,000.00   | 2,953,680.80                       |  |
|          |                      | UKT 8% 06/07/21    | 3,240,000.00   | 5,007,582.00                       |  |
|          |                      | UKT 8% 12/07/15    | 2,995,000.00   | 3,730,422.25                       |  |
|          |                      | UKT 8.75% 08/25/17 | 1,500,000.00   | 2,086,650.00                       |  |
|          |                      | イギリスポンド小計          | 105,375,000.00 | 127,306,178.65<br>(16,001,113,594) |  |
| スイスフラン   | SWISS 2.25% 07/06/20 | 100,000.00         | 114,475.90     |                                    |  |
|          | SWISS 3% 01/08/18    | 4,100,000.00       | 4,736,139.60   |                                    |  |
|          | SWISS 4% 02/11/23    | 2,400,000.00       | 3,220,632.00   |                                    |  |
|          | SWISS 4% 04/08/28    | 300,000.00         | 437,238.00     |                                    |  |
|          | SWISS 4.25% 01/06/14 | 850,000.00         | 895,288.85     |                                    |  |
|          |                      | スイスフラン小計           | 7,750,000.00   | 9,403,774.35<br>(777,127,912)      |  |
| シンガポールドル | SIGB 0.25% 02/01/14  | 600,000.00         | 599,760.00     |                                    |  |
|          | SIGB 1.125% 04/01/16 | 650,000.00         | 668,622.50     |                                    |  |
|          | SIGB 2.25% 06/01/21  | 400,000.00         | 430,600.00     |                                    |  |
|          | SIGB 2.375% 04/01/17 | 450,000.00         | 489,825.00     |                                    |  |
|          | SIGB 2.5% 06/01/19   | 650,000.00         | 719,680.00     |                                    |  |

|                |                      |               |                                  |  |
|----------------|----------------------|---------------|----------------------------------|--|
|                | SIGB 2.75% 04/01/42  | 400,000.00    | 421,600.00                       |  |
|                | SIGB 2.875% 07/01/15 | 1,250,000.00  | 1,337,875.00                     |  |
|                | SIGB 2.875% 09/01/30 | 500,000.00    | 551,100.00                       |  |
|                | SIGB 3% 09/01/24     | 200,000.00    | 226,890.00                       |  |
|                | SIGB 3.125% 09/01/22 | 950,000.00    | 1,095,635.00                     |  |
|                | SIGB 3.25% 09/01/20  | 900,000.00    | 1,040,670.00                     |  |
|                | SIGB 3.5% 03/01/27   | 1,100,000.00  | 1,303,170.00                     |  |
|                | SIGB 3.625% 07/01/14 | 1,300,000.00  | 1,375,595.00                     |  |
|                | SIGB 3.75% 09/01/16  | 900,000.00    | 1,019,250.00                     |  |
|                | SIGB 4% 09/01/18     | 900,000.00    | 1,076,850.00                     |  |
| シンガポールドル小計     |                      | 11,150,000.00 | 12,357,122.50<br>(782,823,710)   |  |
| マレーシア<br>リンギット | MGS 3.314% 10/31/17  | 2,550,000.00  | 2,550,127.50                     |  |
|                | MGS 3.418% 08/15/22  | 400,000.00    | 395,908.00                       |  |
|                | MGS 3.434% 08/15/14  | 3,000,000.00  | 3,021,420.00                     |  |
|                | MGS 3.502% 05/31/27  | 2,200,000.00  | 2,126,742.20                     |  |
|                | MGS 3.58% 09/28/18   | 1,000,000.00  | 1,008,210.00                     |  |
|                | MGS 3.741% 02/27/15  | 4,800,000.00  | 4,865,472.00                     |  |
|                | MGS 3.814% 02/15/17  | 1,500,000.00  | 1,530,435.00                     |  |
|                | MGS 3.892% 03/15/27  | 1,150,000.00  | 1,164,156.50                     |  |
|                | MGS 4.16% 07/15/21   | 2,750,000.00  | 2,878,562.50                     |  |
|                | MGS 4.24% 02/07/18   | 2,650,000.00  | 2,759,418.50                     |  |
|                | MGS 4.262% 09/15/16  | 8,550,000.00  | 8,869,684.50                     |  |
|                | MGS 4.378% 11/29/19  | 3,100,000.00  | 3,269,880.00                     |  |
|                | MGS 4.72% 09/30/15   | 1,300,000.00  | 1,356,381.00                     |  |
|                | MGS 5.094% 04/30/14  | 3,000,000.00  | 3,095,880.00                     |  |
|                | MGS 5.248% 09/15/28  | 1,800,000.00  | 2,107,764.00                     |  |
| マレーシアリンギット小計   |                      | 39,750,000.00 | 41,000,041.70<br>(1,039,761,057) |  |
| スウェーデン<br>クローナ | SGB 3% 07/12/16      | 11,500,000.00 | 12,411,605.00                    |  |
|                | SGB 3.5% 03/30/39    | 8,300,000.00  | 10,738,789.00                    |  |

|              |                     |                |                                   |  |
|--------------|---------------------|----------------|-----------------------------------|--|
|              | SGB 3.5% 06/01/22   | 7,300,000.00   | 8,628,089.00                      |  |
|              | SGB 3.75% 08/12/17  | 13,000,000.00  | 14,712,750.00                     |  |
|              | SGB 4.25% 03/12/19  | 14,150,000.00  | 16,873,875.00                     |  |
|              | SGB 4.5% 08/12/15   | 4,900,000.00   | 5,413,667.00                      |  |
|              | SGB 5% 12/01/20     | 13,500,000.00  | 17,327,790.00                     |  |
|              | SGB 6.75% 05/05/14  | 15,300,000.00  | 16,766,046.00                     |  |
| スウェーデンクローナ小計 |                     | 87,950,000.00  | 102,872,611.00<br>(1,218,011,714) |  |
| ノルウェークローネ    | NGB 3.75% 05/25/21  | 6,000,000.00   | 6,869,280.00                      |  |
|              | NGB 4.25% 05/19/17  | 8,450,000.00   | 9,508,193.50                      |  |
|              | NGB 4.5% 05/22/19   | 6,900,000.00   | 8,095,080.00                      |  |
|              | NGB 5% 05/15/15     | 10,550,000.00  | 11,538,007.50                     |  |
| ノルウェークローネ小計  |                     | 31,900,000.00  | 36,010,561.00<br>(488,303,207)    |  |
| デンマーククローネ    | DGB 2% 11/15/14     | 1,900,000.00   | 1,984,417.00                      |  |
|              | DGB 3% 11/15/21     | 14,650,000.00  | 16,865,080.00                     |  |
|              | DGB 4% 11/15/15     | 16,000,000.00  | 17,976,320.00                     |  |
|              | DGB 4% 11/15/17     | 9,800,000.00   | 11,536,560.00                     |  |
|              | DGB 4% 11/15/19     | 15,600,000.00  | 18,950,100.00                     |  |
|              | DGB 4.5% 11/15/39   | 20,850,000.00  | 31,253,107.50                     |  |
|              | DGB 5% 11/15/13     | 20,100,000.00  | 21,263,790.00                     |  |
|              | DGB 7% 11/10/24     | 4,190,000.00   | 6,754,070.50                      |  |
| デンマーククローネ小計  |                     | 103,090,000.00 | 126,583,445.00<br>(1,694,952,328) |  |
| メキシコペソ       | MBONO 5% 06/15/17   | 9,000,000.00   | 9,007,740.00                      |  |
|              | MBONO 6% 06/18/15   | 79,900,000.00  | 82,547,087.00                     |  |
|              | MBONO 8% 06/11/20   | 38,700,000.00  | 45,711,279.00                     |  |
|              | MBONO 8% 12/07/23   | 8,100,000.00   | 9,889,776.00                      |  |
|              | MBONO 8% 12/19/13   | 43,800,000.00  | 45,562,074.00                     |  |
|              | MBONO 8.5% 05/31/29 | 65,900,000.00  | 82,804,668.00                     |  |
|              | MBONO 8.5% 11/18/38 | 35,550,000.00  | 44,572,945.50                     |  |

|            |                      |                |                                   |  |
|------------|----------------------|----------------|-----------------------------------|--|
| メキシコペソ小計   |                      | 280,950,000.00 | 320,095,569.50<br>(1,933,377,239) |  |
| ポーランドズロチ   | POLGB 4.75% 04/25/17 | 1,300,000.00   | 1,330,420.00                      |  |
|            | POLGB 4.75% 10/25/16 | 3,900,000.00   | 3,986,307.00                      |  |
|            | POLGB 5% 10/24/13    | 6,500,000.00   | 6,562,400.00                      |  |
|            | POLGB 5.25% 10/25/17 | 6,400,000.00   | 6,701,440.00                      |  |
|            | POLGB 5.25% 10/25/20 | 3,200,000.00   | 3,348,096.00                      |  |
|            | POLGB 5.5% 04/25/15  | 5,000,000.00   | 5,170,850.00                      |  |
|            | POLGB 5.5% 10/25/19  | 6,200,000.00   | 6,601,016.00                      |  |
|            | POLGB 5.75% 04/25/14 | 6,900,000.00   | 7,076,226.00                      |  |
|            | POLGB 5.75% 04/25/29 | 1,550,000.00   | 1,692,491.50                      |  |
|            | POLGB 5.75% 09/23/22 | 5,300,000.00   | 5,741,914.00                      |  |
|            | POLGB 5.75% 10/25/21 | 2,800,000.00   | 3,017,924.00                      |  |
|            | POLGB 6.25% 10/24/15 | 9,600,000.00   | 10,185,792.00                     |  |
| ポーランドズロチ小計 |                      | 58,650,000.00  | 61,414,876.50<br>(1,492,995,647)  |  |
| 南アフリカランド   | SAGB 10.5% 12/21/26  | 20,200,000.00  | 25,581,684.00                     |  |
|            | SAGB 13.5% 09/15/15  | 8,500,000.00   | 10,359,715.00                     |  |
|            | SAGB 6.25% 03/31/36  | 10,700,000.00  | 8,528,114.00                      |  |
|            | SAGB 6.5% 02/28/41   | 6,900,000.00   | 5,600,937.00                      |  |
|            | SAGB 6.75% 03/31/21  | 15,300,000.00  | 15,504,255.00                     |  |
|            | SAGB 7% 02/28/31     | 6,900,000.00   | 6,234,909.00                      |  |
|            | SAGB 7.25% 01/15/20  | 15,800,000.00  | 16,563,456.00                     |  |
|            | SAGB 7.75% 02/28/23  | 2,500,000.00   | 2,642,425.00                      |  |
|            | SAGB 8% 12/21/18     | 14,600,000.00  | 15,990,504.00                     |  |
|            | SAGB 8.25% 09/15/17  | 15,100,000.00  | 16,655,149.00                     |  |
|            | SAGB 8.75% 12/21/14  | 11,600,000.00  | 12,528,348.00                     |  |
| 南アフリカランド小計 |                      | 128,100,000.00 | 136,189,496.00<br>(1,293,800,212) |  |
| ユーロ        | BGB 3.25% 09/28/16   | 2,950,000.00   | 3,219,187.50                      |  |
|            | BGB 3.5% 03/28/15    | 900,000.00     | 967,077.00                        |  |
|            | BGB 3.75% 09/28/15   | 3,400,000.00   | 3,716,030.00                      |  |
|            | BGB 3.75% 09/28/20   | 4,700,000.00   | 5,253,801.00                      |  |

|                     |              |              |  |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| BGB 4% 03/28/14     | 2,000,000.00 | 2,111,800.00 |  |
| BGB 4% 03/28/18     | 2,300,000.00 | 2,614,410.00 |  |
| BGB 4% 03/28/22     | 3,100,000.00 | 3,517,787.00 |  |
| BGB 4.0% 03/28/17   | 3,500,000.00 | 3,943,730.00 |  |
| BGB 4.0% 03/28/19   | 2,200,000.00 | 2,504,546.00 |  |
| BGB 4.25% 03/28/41  | 2,050,000.00 | 2,386,569.00 |  |
| BGB 4.25% 09/28/14  | 2,500,000.00 | 2,693,950.00 |  |
| BGB 4.25% 09/28/21  | 550,000.00   | 635,459.00   |  |
| BGB 4.25% 09/28/22  | 1,700,000.00 | 1,955,850.00 |  |
| BGB 4.5% 03/28/26   | 1,650,000.00 | 1,944,772.50 |  |
| BGB 5% 03/28/35     | 3,100,000.00 | 3,937,000.00 |  |
| BGB 5.5% 03/28/28   | 3,550,000.00 | 4,647,482.50 |  |
| BGB 5.5% 09/28/17   | 1,650,000.00 | 1,985,247.00 |  |
| BGB 8.0% 03/28/15   | 1,550,000.00 | 1,837,261.50 |  |
| BKO 0.25% 03/14/14  | 1,300,000.00 | 1,304,940.00 |  |
| BKO 0.25% 12/13/13  | 4,100,000.00 | 4,113,325.00 |  |
| BTNS 2% 07/12/15    | 900,000.00   | 941,967.00   |  |
| BTNS 2.25% 02/25/16 | 3,350,000.00 | 3,550,832.50 |  |
| BTNS 2.5% 01/12/14  | 5,750,000.00 | 5,927,560.00 |  |
| BTNS 2.5% 01/15/15  | 5,300,000.00 | 5,577,349.00 |  |
| BTNS 2.5% 07/25/16  | 5,900,000.00 | 6,322,322.00 |  |
| BTNS 3% 07/12/14    | 6,100,000.00 | 6,410,673.00 |  |
| BTPS 2.25% 11/01/13 | 2,400,000.00 | 2,409,072.00 |  |
| BTPS 3% 04/01/14    | 2,500,000.00 | 2,533,200.00 |  |
| BTPS 3% 04/15/15    | 2,500,000.00 | 2,512,125.00 |  |
| BTPS 3% 06/15/15    | 4,900,000.00 | 4,920,727.00 |  |
| BTPS 3% 11/01/15    | 2,800,000.00 | 2,803,220.00 |  |
| BTPS 3.5% 06/01/14  | 3,750,000.00 | 3,823,237.50 |  |
| BTPS 3.75% 03/01/21 | 4,700,000.00 | 4,404,981.00 |  |
| BTPS 3.75% 04/15/16 | 2,200,000.00 | 2,238,676.00 |  |
| BTPS 3.75% 08/01/15 | 6,050,000.00 | 6,178,139.00 |  |
| BTPS 3.75% 08/01/16 | 7,900,000.00 | 7,991,640.00 |  |
| BTPS 3.75% 08/01/21 | 8,000,000.00 | 7,416,240.00 |  |

|                     |              |               |  |
|---------------------|--------------|---------------|--|
| BTPS 3.75% 12/15/13 | 3,900,000.00 | 3,980,730.00  |  |
| BTPS 4% 02/01/17    | 4,300,000.00 | 4,362,049.00  |  |
| BTPS 4% 02/01/37    | 4,700,000.00 | 3,762,726.00  |  |
| BTPS 4% 09/01/20    | 3,500,000.00 | 3,365,005.00  |  |
| BTPS 4.25% 02/01/15 | 6,300,000.00 | 6,535,179.00  |  |
| BTPS 4.25% 02/01/19 | 5,000,000.00 | 5,002,150.00  |  |
| BTPS 4.25% 03/01/20 | 2,950,000.00 | 2,898,670.00  |  |
| BTPS 4.25% 08/01/14 | 9,800,000.00 | 10,134,180.00 |  |
| BTPS 4.25% 09/01/19 | 3,250,000.00 | 3,230,435.00  |  |
| BTPS 4.5% 02/01/18  | 3,250,000.00 | 3,324,425.00  |  |
| BTPS 4.5% 02/01/20  | 7,050,000.00 | 7,045,981.50  |  |
| BTPS 4.5% 03/01/19  | 4,900,000.00 | 4,949,147.00  |  |
| BTPS 4.5% 03/01/26  | 2,900,000.00 | 2,666,985.00  |  |
| BTPS 4.5% 08/01/18  | 5,850,000.00 | 5,957,815.50  |  |
| BTPS 4.75% 06/01/17 | 3,900,000.00 | 4,033,107.00  |  |
| BTPS 4.75% 08/01/23 | 6,300,000.00 | 6,160,329.00  |  |
| BTPS 4.75% 09/01/21 | 4,000,000.00 | 3,993,600.00  |  |
| BTPS 4.75% 09/15/16 | 2,050,000.00 | 2,141,327.50  |  |
| BTPS 5% 03/01/22    | 2,000,000.00 | 2,013,460.00  |  |
| BTPS 5% 03/01/25    | 3,850,000.00 | 3,759,332.50  |  |
| BTPS 5% 08/01/34    | 3,500,000.00 | 3,188,255.00  |  |
| BTPS 5% 09/01/40    | 3,400,000.00 | 3,057,722.00  |  |
| BTPS 5.0% 08/01/39  | 3,600,000.00 | 3,242,340.00  |  |
| BTPS 5.25% 08/01/17 | 5,040,000.00 | 5,334,235.20  |  |
| BTPS 5.25% 11/01/29 | 4,800,000.00 | 4,649,760.00  |  |
| BTPS 5.5% 09/01/22  | 1,000,000.00 | 1,037,230.00  |  |
| BTPS 5.75% 02/01/33 | 3,000,000.00 | 3,003,300.00  |  |
| BTPS 6% 05/01/31    | 5,330,000.00 | 5,492,724.90  |  |
| BTPS 6.5% 11/01/27  | 4,150,000.00 | 4,484,282.50  |  |
| BTPS 7.25% 11/01/26 | 2,000,000.00 | 2,330,560.00  |  |
| BTPS 9% 11/01/23    | 800,000.00   | 1,047,024.00  |  |
| DBR 1.5% 09/04/22   | 1,200,000.00 | 1,206,456.00  |  |
| DBR 1.75% 07/04/22  | 4,400,000.00 | 4,534,992.00  |  |

|                     |              |              |  |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| DBR 2% 01/04/22     | 1,850,000.00 | 1,957,448.00 |  |
| DBR 2.25% 09/04/20  | 4,650,000.00 | 5,056,549.50 |  |
| DBR 2.25% 09/04/21  | 4,000,000.00 | 4,331,120.00 |  |
| DBR 2.5% 01/04/21   | 3,200,000.00 | 3,540,256.00 |  |
| DBR 2.5% 07/04/44   | 700,000.00   | 738,955.00   |  |
| DBR 3% 07/04/20     | 5,100,000.00 | 5,836,695.00 |  |
| DBR 3.25% 01/04/20  | 2,300,000.00 | 2,667,471.00 |  |
| DBR 3.25% 07/04/15  | 5,300,000.00 | 5,763,909.00 |  |
| DBR 3.25% 07/04/21  | 3,000,000.00 | 3,501,240.00 |  |
| DBR 3.25% 07/04/42  | 1,900,000.00 | 2,327,272.00 |  |
| DBR 3.5% 01/04/16   | 5,700,000.00 | 6,324,150.00 |  |
| DBR 3.5% 07/04/19   | 5,200,000.00 | 6,097,520.00 |  |
| DBR 3.75% 01/04/15  | 2,550,000.00 | 2,764,072.50 |  |
| DBR 3.75% 01/04/17  | 7,500,000.00 | 8,584,875.00 |  |
| DBR 3.75% 01/04/19  | 2,900,000.00 | 3,427,452.00 |  |
| DBR 4% 07/04/16     | 4,400,000.00 | 5,020,840.00 |  |
| DBR 4.0% 01/04/18   | 3,000,000.00 | 3,535,140.00 |  |
| DBR 4.0% 01/04/37   | 4,200,000.00 | 5,610,276.00 |  |
| DBR 4.25% 01/04/14  | 4,500,000.00 | 4,742,550.00 |  |
| DBR 4.25% 07/04/14  | 7,700,000.00 | 8,273,265.00 |  |
| DBR 4.25% 07/04/17  | 3,200,000.00 | 3,774,304.00 |  |
| DBR 4.25% 07/04/18  | 5,000,000.00 | 6,012,900.00 |  |
| DBR 4.25% 07/04/39  | 2,800,000.00 | 3,946,600.00 |  |
| DBR 4.75% 07/04/28  | 2,750,000.00 | 3,767,775.00 |  |
| DBR 4.75% 07/04/34  | 3,500,000.00 | 5,049,030.00 |  |
| DBR 4.75% 07/04/40  | 3,400,000.00 | 5,180,240.00 |  |
| DBR 5.5% 01/04/31   | 3,400,000.00 | 5,132,402.00 |  |
| DBR 5.625% 01/04/28 | 1,470,000.00 | 2,176,188.00 |  |
| DBR 6% 06/20/16     | 560,000.00   | 678,764.80   |  |
| DBR 6.25% 01/04/24  | 2,000,000.00 | 2,963,700.00 |  |
| DBR 6.25% 01/04/30  | 1,700,000.00 | 2,726,120.00 |  |
| DBR 6.5% 07/04/27   | 1,600,000.00 | 2,542,368.00 |  |
| FRTR 2.5% 10/25/20  | 5,050,000.00 | 5,297,702.50 |  |

|                     |              |              |  |
|---------------------|--------------|--------------|--|
| FRTR 2.75% 10/25/27 | 400,000.00   | 397,780.00   |  |
| FRTR 3% 04/25/22    | 5,000,000.00 | 5,352,750.00 |  |
| FRTR 3% 10/25/15    | 5,300,000.00 | 5,721,615.00 |  |
| FRTR 3.25% 04/25/16 | 8,300,000.00 | 9,103,274.00 |  |
| FRTR 3.25% 10/25/21 | 4,150,000.00 | 4,554,957.00 |  |
| FRTR 3.5% 04/25/15  | 7,900,000.00 | 8,552,777.00 |  |
| FRTR 3.5% 04/25/20  | 5,600,000.00 | 6,302,240.00 |  |
| FRTR 3.5% 04/25/26  | 5,650,000.00 | 6,192,400.00 |  |
| FRTR 3.75% 04/25/17 | 6,100,000.00 | 6,901,723.00 |  |
| FRTR 3.75% 04/25/21 | 6,600,000.00 | 7,531,788.00 |  |
| FRTR 3.75% 10/25/19 | 6,600,000.00 | 7,546,110.00 |  |
| FRTR 4% 04/25/14    | 5,100,000.00 | 5,409,060.00 |  |
| FRTR 4% 04/25/18    | 4,100,000.00 | 4,731,195.00 |  |
| FRTR 4% 04/25/55    | 2,700,000.00 | 3,140,991.00 |  |
| FRTR 4% 04/25/60    | 1,600,000.00 | 1,862,848.00 |  |
| FRTR 4% 10/25/13    | 4,100,000.00 | 4,270,970.00 |  |
| FRTR 4% 10/25/14    | 2,900,000.00 | 3,127,650.00 |  |
| FRTR 4% 10/25/38    | 5,200,000.00 | 5,984,940.00 |  |
| FRTR 4.25% 04/25/19 | 5,200,000.00 | 6,110,416.00 |  |
| FRTR 4.25% 10/25/17 | 5,750,000.00 | 6,673,047.50 |  |
| FRTR 4.25% 10/25/18 | 3,050,000.00 | 3,574,691.50 |  |
| FRTR 4.25% 10/25/23 | 7,550,000.00 | 8,910,736.50 |  |
| FRTR 4.5% 04/25/41  | 3,100,000.00 | 3,868,645.00 |  |
| FRTR 4.75% 04/25/35 | 3,200,000.00 | 4,061,760.00 |  |
| FRTR 5% 10/25/16    | 6,010,000.00 | 7,052,434.50 |  |
| FRTR 5.5% 04/25/29  | 4,480,000.00 | 6,028,960.00 |  |
| FRTR 5.75% 10/25/32 | 4,300,000.00 | 6,077,964.00 |  |
| FRTR 6.0% 10/25/25  | 2,800,000.00 | 3,858,344.00 |  |
| FRTR 8.5% 04/25/23  | 1,000,000.00 | 1,578,320.00 |  |
| FRTR 8.5% 10/25/19  | 1,120,000.00 | 1,640,945.60 |  |
| IRISH 4% 01/15/14   | 750,000.00   | 768,300.00   |  |
| IRISH 4.4% 06/18/19 | 1,700,000.00 | 1,668,601.00 |  |
| IRISH 4.5% 02/18/15 | 1,500,000.00 | 1,596,075.00 |  |

|                       |              |              |  |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| IRISH 4.5% 04/18/20   | 4,000,000.00 | 3,887,120.00 |  |
| IRISH 4.5% 10/18/18   | 1,200,000.00 | 1,202,496.00 |  |
| IRISH 4.6% 04/18/16   | 2,000,000.00 | 2,099,540.00 |  |
| IRISH 5.4% 03/13/25   | 2,050,000.00 | 2,055,740.00 |  |
| IRISH 5.5% 10/18/17   | 200,000.00   | 216,340.00   |  |
| IRISH 5.9% 10/18/19   | 1,250,000.00 | 1,329,687.50 |  |
| NETHER 0.75% 04/15/15 | 2,300,000.00 | 2,333,350.00 |  |
| NETHER 1% 01/15/14    | 800,000.00   | 810,200.00   |  |
| NETHER 2.25% 07/15/22 | 1,000,000.00 | 1,047,980.00 |  |
| NETHER 2.5% 01/15/17  | 2,100,000.00 | 2,269,260.00 |  |
| NETHER 2.5% 01/15/33  | 500,000.00   | 509,140.00   |  |
| NETHER 2.75% 01/15/15 | 1,750,000.00 | 1,854,177.50 |  |
| NETHER 3.25% 07/15/15 | 4,600,000.00 | 4,987,550.00 |  |
| NETHER 3.25% 07/15/21 | 2,900,000.00 | 3,303,187.00 |  |
| NETHER 3.5% 07/15/20  | 3,050,000.00 | 3,527,721.50 |  |
| NETHER 3.75% 01/15/23 | 2,150,000.00 | 2,542,547.00 |  |
| NETHER 3.75% 01/15/42 | 2,300,000.00 | 2,933,420.00 |  |
| NETHER 3.75% 07/15/14 | 4,000,000.00 | 4,262,520.00 |  |
| NETHER 4% 01/15/37    | 2,750,000.00 | 3,549,425.00 |  |
| NETHER 4% 07/15/16    | 3,100,000.00 | 3,512,920.00 |  |
| NETHER 4% 07/15/19    | 3,150,000.00 | 3,724,812.00 |  |
| NETHER 4.0% 07/15/18  | 2,850,000.00 | 3,333,645.00 |  |
| NETHER 4.5% 07/15/17  | 2,700,000.00 | 3,182,220.00 |  |
| NETHER 5.5% 01/15/28  | 2,100,000.00 | 2,990,568.00 |  |
| NETHER 7.5% 01/15/23  | 700,000.00   | 1,076,586.00 |  |
| OBL 0.5% 04/07/17     | 1,900,000.00 | 1,909,120.00 |  |
| OBL 0.75% 02/24/17    | 3,000,000.00 | 3,050,640.00 |  |
| OBL 1.75% 10/09/15    | 2,100,000.00 | 2,204,958.00 |  |
| OBL 2.25% 04/10/15    | 3,500,000.00 | 3,693,970.00 |  |
| OBL 2.25% 04/11/14    | 2,900,000.00 | 2,999,905.00 |  |
| OBL 2.5% 02/27/15     | 2,200,000.00 | 2,330,350.00 |  |
| OBL 2.5% 10/10/14     | 3,800,000.00 | 3,990,380.00 |  |
| OBL 2.75% 04/08/16    | 5,500,000.00 | 5,993,900.00 |  |

|                      |              |              |  |
|----------------------|--------------|--------------|--|
| OBL 4% 10/11/13      | 2,900,000.00 | 3,019,335.00 |  |
| RAGB 3.2% 02/20/17   | 500,000.00   | 554,600.00   |  |
| RAGB 3.4% 10/20/14   | 800,000.00   | 854,080.00   |  |
| RAGB 3.4% 11/22/22   | 750,000.00   | 844,350.00   |  |
| RAGB 3.5% 07/15/15   | 3,000,000.00 | 3,270,150.00 |  |
| RAGB 3.5% 09/15/21   | 3,200,000.00 | 3,642,400.00 |  |
| RAGB 3.8% 10/20/13   | 2,900,000.00 | 3,013,680.00 |  |
| RAGB 3.9% 07/15/20   | 2,850,000.00 | 3,323,328.00 |  |
| RAGB 4% 09/15/16     | 2,650,000.00 | 3,008,359.50 |  |
| RAGB 4.15% 03/15/37  | 2,150,000.00 | 2,654,282.50 |  |
| RAGB 4.3% 07/15/14   | 2,200,000.00 | 2,364,406.00 |  |
| RAGB 4.3% 09/15/17   | 500,000.00   | 584,075.00   |  |
| RAGB 4.35% 03/15/19  | 1,450,000.00 | 1,724,818.50 |  |
| RAGB 4.65% 01/15/18  | 3,500,000.00 | 4,166,575.00 |  |
| RAGB 4.85% 03/15/26  | 1,700,000.00 | 2,176,731.00 |  |
| RAGB 6.25% 07/15/27  | 1,700,000.00 | 2,490,670.00 |  |
| RFGB 1.625% 09/15/22 | 600,000.00   | 594,528.00   |  |
| RFGB 1.75% 04/15/16  | 400,000.00   | 420,408.00   |  |
| RFGB 2.75% 07/04/28  | 500,000.00   | 533,390.00   |  |
| RFGB 3.125% 09/15/14 | 1,350,000.00 | 1,431,378.00 |  |
| RFGB 3.375% 04/15/20 | 1,250,000.00 | 1,431,725.00 |  |
| RFGB 3.5% 04/15/21   | 400,000.00   | 462,820.00   |  |
| RFGB 3.875% 09/15/17 | 1,600,000.00 | 1,847,088.00 |  |
| RFGB 4% 07/04/25     | 1,350,000.00 | 1,642,518.00 |  |
| RFGB 4.25% 07/04/15  | 1,400,000.00 | 1,557,780.00 |  |
| RFGB 4.375% 07/04/19 | 1,600,000.00 | 1,933,808.00 |  |
| SPGB 2.5% 10/31/13   | 2,300,000.00 | 2,286,660.00 |  |
| SPGB 3.15% 01/31/16  | 8,200,000.00 | 7,928,580.00 |  |
| SPGB 3.25% 04/30/16  | 1,000,000.00 | 962,030.00   |  |
| SPGB 3.3% 10/31/14   | 1,600,000.00 | 1,598,128.00 |  |
| SPGB 3.4% 04/30/14   | 1,250,000.00 | 1,251,787.50 |  |
| SPGB 3.8% 01/31/17   | 4,250,000.00 | 4,096,787.50 |  |
| SPGB 4% 04/30/20     | 4,700,000.00 | 4,262,665.00 |  |

|  |                     |                |                                      |  |
|--|---------------------|----------------|--------------------------------------|--|
|  | SPGB 4% 07/30/15    | 4,550,000.00   | 4,561,147.50                         |  |
|  | SPGB 4.1% 07/30/18  | 2,900,000.00   | 2,757,842.00                         |  |
|  | SPGB 4.2% 01/31/37  | 3,100,000.00   | 2,203,418.00                         |  |
|  | SPGB 4.25% 01/31/14 | 5,000,000.00   | 5,066,400.00                         |  |
|  | SPGB 4.25% 10/31/16 | 700,000.00     | 688,821.00                           |  |
|  | SPGB 4.3% 10/31/19  | 1,600,000.00   | 1,491,808.00                         |  |
|  | SPGB 4.4% 01/31/15  | 7,000,000.00   | 7,142,310.00                         |  |
|  | SPGB 4.6% 07/30/19  | 3,300,000.00   | 3,158,199.00                         |  |
|  | SPGB 4.65% 07/30/25 | 1,600,000.00   | 1,360,928.00                         |  |
|  | SPGB 4.7% 07/30/41  | 1,800,000.00   | 1,362,060.00                         |  |
|  | SPGB 4.75% 07/30/14 | 2,850,000.00   | 2,918,400.00                         |  |
|  | SPGB 4.8% 01/31/24  | 3,450,000.00   | 3,054,699.00                         |  |
|  | SPGB 4.85% 10/31/20 | 4,100,000.00   | 3,865,685.00                         |  |
|  | SPGB 4.9% 07/30/40  | 2,500,000.00   | 1,939,200.00                         |  |
|  | SPGB 5.5% 04/30/21  | 3,400,000.00   | 3,321,052.00                         |  |
|  | SPGB 5.5% 07/30/17  | 3,800,000.00   | 3,898,534.00                         |  |
|  | SPGB 5.75% 07/30/32 | 2,350,000.00   | 2,142,683.00                         |  |
|  | SPGB 5.85% 01/31/22 | 1,750,000.00   | 1,742,790.00                         |  |
|  | SPGB 5.9% 07/30/26  | 1,300,000.00   | 1,237,119.00                         |  |
|  | SPGB 6.0% 01/31/29  | 3,400,000.00   | 3,241,560.00                         |  |
|  | ユーロ小計               | 717,960,000.00 | 780,485,113.00<br>(77,947,048,235)   |  |
|  | 国債証券合計              |                | 195,257,627,816<br>(195,257,627,816) |  |
|  | 合計                  |                | 195,257,627,816<br>(195,257,627,816) |  |

(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 | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|----|-----|--------------|----------------|
|----|-----|--------------|----------------|

|             |      |       |        |       |
|-------------|------|-------|--------|-------|
| アメリカドル      | 国債証券 | 127銘柄 | 100.0% | 41.9% |
| カナダドル       | 国債証券 | 25銘柄  | 100.0% | 2.9%  |
| オーストラリアドル   | 国債証券 | 16銘柄  | 100.0% | 1.6%  |
| イギリスポンド     | 国債証券 | 35銘柄  | 100.0% | 8.2%  |
| スイスフラン      | 国債証券 | 5銘柄   | 100.0% | 0.4%  |
| シンガポールドル    | 国債証券 | 15銘柄  | 100.0% | 0.4%  |
| マレーシアリングgit | 国債証券 | 15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 | 4銘柄   | 100.0% | 0.3%  |
| デンマーククローネ   | 国債証券 | 8銘柄   | 100.0% | 0.9%  |
| メキシコペソ      | 国債証券 | 7銘柄   | 100.0% | 1.0%  |
| ポーランドズロチ    | 国債証券 | 12銘柄  | 100.0% | 0.8%  |
| 南アフリカランド    | 国債証券 | 11銘柄  | 100.0% | 0.7%  |
| ユーロ         | 国債証券 | 222銘柄 | 100.0% | 39.9% |

(注)組入債券時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する債券の比率であります。

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。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成24年10月31日現在）

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 3,877,616,658 円 |
| II 負債総額             | 1,382,110 円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 3,876,234,548 円 |
| IV 発行済口数            | 5,494,737,676 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.7054 円        |
| 1万口当たり純資産額          | 7,054 円         |

（参考情報）

### 国内株式インデックス マザーファンド

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| I 資産総額              | 118,792,568,152 円 |
| II 負債総額             | 1,876,820,028 円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 116,915,748,124 円 |
| IV 発行済口数            | 196,166,383,536 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.5960 円          |
| 1万口当たり純資産額          | 5,960 円           |

### 国内債券インデックス マザーファンド

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| I 資産総額              | 217,106,370,683 円 |
| II 負債総額             | 3,702,186,927 円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 213,404,183,756 円 |
| IV 発行済口数            | 170,532,925,926 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.2514 円          |
| 1万口当たり純資産額          | 12,514 円          |

### 外国株式インデックス マザーファンド

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| I 資産総額              | 134,661,836,029 円 |
| II 負債総額             | 114,731,735 円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 134,547,104,294 円 |
| IV 発行済口数            | 138,491,317,768 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 0.9715 円          |
| 1万口当たり純資産額          | 9,715 円           |

### 外国債券インデックス マザーファンド

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| I 資産総額              | 207,883,939,976 円 |
| II 負債総額             | 88,639,962 円      |
| III 純資産総額（I－II）     | 207,795,300,014 円 |
| IV 発行済口数            | 113,121,777,672 口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.8369 円          |
| 1万口当たり純資産額          | 18,369 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。

## 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24年10月31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

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### ② 投資運用の意思決定機構

###### [PLAN（計画）]

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

###### [DO（実行）]

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

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

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

## 〔CHECK（検証・評価）〕

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）にパフォーマンス等に係るモニタリング状況を報告します。

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

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

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

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

委託会社の機構は平成24年12月14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24年10月31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  | 300   | 3,662,013  |
| 追加型公社債投資信託 | 0     | 0          |
| 単位型株式投資信託  | 5     | 623        |
| 単位型公社債投資信託 | 0     | 0          |
| 合計         | 305   | 3,662,636  |

### 3【委託会社等の経理状況】

（イ） 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（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

（ロ） 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23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

|             | 前事業年度<br>(平成23年3月31日現在) |           | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |           |
|-------------|-------------------------|-----------|-------------------------|-----------|
| 資産の部        |                         |           |                         |           |
| 流動資産        |                         |           |                         |           |
| 現金及び預金      | ※2                      | 6,223,302 |                         | 4,826,115 |
| 前払費用        |                         | 34,720    |                         | 30,184    |
| 未収委託者報酬     |                         | 953,916   |                         | 944,716   |
| 未収運用受託報酬    |                         | 42,516    |                         | 26,998    |
| 未収入金        |                         | —         |                         | 75,514    |
| 一年以内返還予定保証金 |                         | —         |                         | 187,128   |
| 繰延税金資産      |                         | 50,152    |                         | 69,857    |
| その他         |                         | 34        |                         | 31,325    |
| 流動資産合計      |                         | 7,304,641 |                         | 6,191,840 |
| 固定資産        |                         |           |                         |           |
| 有形固定資産      |                         |           |                         |           |
| 建物          |                         | 38,802    |                         | 3,525     |
| 器具備品        |                         | 27,919    |                         | 14,970    |
| 建設仮勘定       |                         | —         |                         | 62,454    |
| 有形固定資産合計    | ※1                      | 66,721    | ※1                      | 80,949    |
| 無形固定資産      |                         |           |                         |           |
| ソフトウェア      |                         | 91,774    |                         | 60,130    |
| ソフトウェア仮勘定   |                         | —         |                         | 12,151    |
| その他無形固定資産   |                         | 1,415     |                         | 928       |
| 無形固定資産合計    |                         | 93,189    |                         | 73,209    |
| 投資その他の資産    |                         |           |                         |           |
| 投資有価証券      |                         | 239,090   |                         | 43,194    |
| 敷金・保証金      |                         | 228,451   |                         | —         |
| 長期前払費用      |                         | 409       |                         | 357       |
| 繰延税金資産      |                         | 80,017    |                         | —         |
| その他の投資      |                         | 195       |                         | 165       |
| 投資その他の資産合計  |                         | 548,164   |                         | 43,717    |
| 固定資産合計      |                         | 708,076   |                         | 197,876   |
| 資産合計        |                         | 8,012,717 |                         | 6,389,717 |

(単位：千円)

|                 | 前事業年度<br>(平成23年3月31日現在) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>負債の部</b>     |                         |                         |
| <b>流動負債</b>     |                         |                         |
| 預り金             | 18,485                  | 22,794                  |
| 未払金             | 495,343                 | 644,600                 |
| 未払収益分配金         | 130                     | 30                      |
| 未払手数料 ※2        | 452,781                 | 438,778                 |
| その他未払金          | 42,432                  | 205,791                 |
| 未払費用 ※2         | 135,706                 | 112,121                 |
| 未払法人税等          | 220,711                 | 20,166                  |
| 未払消費税等          | 25,316                  | 5,683                   |
| 賞与引当金           | 79,835                  | 71,044                  |
| 移転関連費用引当金       | —                       | 41,450                  |
| 流動負債合計          | 975,399                 | 917,862                 |
| <b>固定負債</b>     |                         |                         |
| 退職給付引当金         | 171,115                 | 199,976                 |
| 繰延税金負債          | —                       | 308,964                 |
| 固定負債合計          | 171,115                 | 508,940                 |
| 負債合計            | 1,146,514               | 1,426,803               |
| <b>純資産の部</b>    |                         |                         |
| <b>株主資本</b>     |                         |                         |
| 資本金             | 300,000                 | 300,000                 |
| <b>利益剰余金</b>    |                         |                         |
| 利益準備金           | 53,500                  | 56,500                  |
| <b>その他利益剰余金</b> |                         |                         |
| 別途積立金           | 5,100,000               | 2,100,000               |
| 繰越利益剰余金         | 1,421,205               | 2,516,273               |
| 利益剰余金合計         | 6,574,705               | 4,672,773               |
| 株主資本合計          | 6,874,705               | 4,972,773               |
| <b>評価・換算差額等</b> |                         |                         |
| その他有価証券評価差額金    | △ 8,501                 | △ 9,859                 |
| 評価・換算差額等合計      | △ 8,501                 | △ 9,859                 |
| 純資産合計           | 6,866,203               | 4,962,913               |
| 負債・純資産合計        | 8,012,717               | 6,389,717               |

## (2) 【損益計算書】

|          | 前事業年度                         | 当事業年度                         |
|----------|-------------------------------|-------------------------------|
|          | (自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) | (自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) |
| 営業収益     |                               |                               |
| 委託者報酬    | 8,619,288                     | 7,821,113                     |
| 運用受託報酬   | 126,038                       | 98,179                        |
| 営業収益合計   | 8,745,326                     | 7,919,292                     |
| 営業費用     |                               |                               |
| 支払手数料    | ※1 4,301,606                  | 3,715,816                     |
| 広告宣伝費    | 67,247                        | 61,165                        |
| 公告費      | 2,744                         | 2,451                         |
| 調査費      | 898,998                       | 1,023,870                     |
| 調査費      | 87,937                        | 86,225                        |
| 委託調査費    | 809,173                       | 936,024                       |
| 図書費      | 1,887                         | 1,620                         |
| 営業雑経費    | 640,623                       | 610,455                       |
| 通信費      | 11,303                        | 10,764                        |
| 印刷費      | 152,354                       | 121,287                       |
| 協会費      | 10,102                        | 10,136                        |
| 諸会費      | 594                           | 803                           |
| 情報機器関連費  | 433,365                       | 436,328                       |
| その他営業雑経費 | 32,903                        | 31,135                        |
| 営業費用合計   | 5,911,221                     | 5,413,759                     |
| 一般管理費    |                               |                               |
| 給料       | 1,315,974                     | 1,276,685                     |
| 役員報酬     | 38,295                        | 35,160                        |
| 給料・手当    | 1,062,048                     | 1,048,061                     |
| 賞与       | 215,631                       | 193,464                       |
| 退職給付費用   | 63,772                        | 66,790                        |
| 福利費      | 156,648                       | 152,149                       |
| 交際費      | 1,350                         | 1,012                         |
| 旅費交通費    | 31,880                        | 25,687                        |
| 租税公課     | 17,981                        | 16,148                        |
| 不動産賃借料   | 238,033                       | 238,033                       |
| 寄付金      | 7,972                         | 2,832                         |
| 減価償却費    | 57,385                        | 55,540                        |
| 敷金償却     | 2,804                         | 2,804                         |
| 諸経費      | 91,394                        | 81,858                        |

|         |           |           |
|---------|-----------|-----------|
| 一般管理費合計 | 1,985,197 | 1,919,541 |
| 営業利益    | 848,907   | 585,991   |

（単位：千円）

|                         | 前事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) |
|-------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業外収益                   |                                        |                                        |
| 受取配当金                   | 1,280                                  | 2,795                                  |
| 受取利息                    | ※1 14,783                              | 13,889                                 |
| 投資有価証券売却益               | 756                                    | 149                                    |
| その他                     | 1,877                                  | 2,125                                  |
| 営業外収益合計                 | 18,697                                 | 18,961                                 |
| 営業外費用                   |                                        |                                        |
| 支払手数料                   | —                                      | 800                                    |
| 投資有価証券売却損               | 480                                    | 12                                     |
| その他                     | 242                                    | 74                                     |
| 営業外費用合計                 | 722                                    | 887                                    |
| 経常利益                    | 866,883                                | 604,065                                |
| 特別利益                    |                                        |                                        |
| 投資有価証券売却益               | —                                      | 1,277,804                              |
| 特別利益合計                  | —                                      | 1,277,804                              |
| 特別損失                    |                                        |                                        |
| 資産除去債務会計基準の適用に伴う<br>影響額 | 6,776                                  | —                                      |
| 統合関連損失                  | —                                      | 123,726                                |
| 特別損失合計                  | 6,776                                  | 123,726                                |
| 税引前当期純利益                | 860,106                                | 1,758,142                              |
| 法人税、住民税及び事業税            | 377,534                                | 241,760                                |
| 法人税等調整額                 | △ 29,183                               | 368,903                                |
| 法人税等合計                  | 348,350                                | 610,664                                |
| 当期純利益                   | 511,755                                | 1,147,477                              |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

|      | 前事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) |
|------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 株主資本 |                                        |                                        |

|                 |           |             |
|-----------------|-----------|-------------|
| <b>資本金</b>      |           |             |
| 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     |
| <b>資本剰余金</b>    |           |             |
| <b>その他資本剰余金</b> |           |             |
| 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   |
| 当期変動額合計         | —         | —           |
| 当期末残高           | —         | —           |
| <b>利益剰余金</b>    |           |             |
| <b>利益準備金</b>    |           |             |
| 当期首残高           | 50,500    | 53,500      |
| 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           | 53,500    | 56,500      |
| <b>その他利益剰余金</b> |           |             |
| <b>別途積立金</b>    |           |             |
| 当期首残高           | 5,100,000 | 5,100,000   |
| 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           | 5,100,000 | 2,100,000   |
| <b>繰越利益剰余金</b>  |           |             |
| 当期首残高           | 942,449   | 1,421,205   |
| 当期変動額           |           |             |
| 剰余金の配当          | △ 33,000  | △ 33,000    |
| 当期純利益           | 511,755   | 1,147,477   |
| 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 |
| 当期変動額合計         | 478,755   | 1,095,067   |
| 当期末残高           | 1,421,205 | 2,516,273   |
| <b>利益剰余金合計</b>  |           |             |
| 当期首残高           | 6,092,949 | 6,574,705   |
| 当期変動額           |           |             |
| 剰余金の配当          | △ 30,000  | △ 30,000    |
| 当期純利益           | 511,755   | 1,147,477   |
| その他資本剰余金へ振替     | —         | △ 3,019,410 |

|         |           |             |
|---------|-----------|-------------|
| 当期変動額合計 | 481,755   | △ 1,901,932 |
| 当期末残高   | 6,574,705 | 4,672,773   |

(単位：千円)

|                     | 前事業年度<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24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               | 6,392,949                              | 6,874,705                              |
| 当期変動額               |                                        |                                        |
| 剰余金の配当              | △ 30,000                               | △ 30,000                               |
| 当期純利益               | 511,755                                | 1,147,477                              |
| その他資本剰余金へ振替         | —                                      | △ 3,019,410                            |
| 当期変動額合計             | 481,755                                | △ 1,901,932                            |
| 当期末残高               | 6,874,705                              | 4,972,773                              |
| 評価・換算差額等            |                                        |                                        |
| その他有価証券評価差額金        |                                        |                                        |
| 当期首残高               | △ 6,299                                | △ 8,501                                |
| 当期変動額               |                                        |                                        |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | △ 2,202                                | △ 1,357                                |
| 当期変動額合計             | △ 2,202                                | △ 1,357                                |
| 当期末残高               | △ 8,501                                | △ 9,859                                |
| 評価・換算差額等合計          |                                        |                                        |
| 当期首残高               | △ 6,299                                | △ 8,501                                |
| 当期変動額               |                                        |                                        |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | △ 2,202                                | △ 1,357                                |
| 当期変動額合計             | △ 2,202                                | △ 1,357                                |
| 当期末残高               | △ 8,501                                | △ 9,859                                |
| 純資産合計               |                                        |                                        |
| 当期首残高               | 6,386,650                              | 6,866,203                              |
| 当期変動額               |                                        |                                        |
| 剰余金の配当              | △ 30,000                               | △ 30,000                               |
| 当期純利益               | 511,755                                | 1,147,477                              |
| その他資本剰余金へ振替         | —                                      | △ 3,019,410                            |

|                     |           |             |
|---------------------|-----------|-------------|
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | △ 2,202   | △ 1,357     |
| 当期変動額合計             | 479,553   | △ 1,903,289 |
| 当期末残高               | 6,866,203 | 4,962,913   |

## 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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1)有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。

#### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2)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。

#### (3)移転関連費用引当金

本店事務所の移転に伴い発生する損失に備えるため、合理的な見積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。

## 会計上の見積りの変更

### 1. 耐用年数の変更

当社が保有する建物附属設備は、従来、耐用年数を8～18年として減価償却を行ってきましたが、当事業年度において、平成24年5月に本店事務所を移転することを決定したため、当該建物附属設備の耐用年数を使用見込期間までに見直し、将来にわたって変更しております。また、当社が保有するソフトウェアの一部は、従来、利用可能期間を5年として償却を行っていましたが、平成24年4月1日の中央三井アセットマネジメント株式会社との合併に伴い、翌事業年度以降の利用見込がなくなったことから、利用可能期間を当事業年度末までとしております。

この変更により、従来の方法に比べて、当事業年度の特別損失が33,532千円増加し、税引前当期純利益が同額減少しております。

### 2. 資産除去債務の見積りの変更

当社は賃借した本店事務所の原状回復義務に係る資産除去債務について、敷金のうち回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、10年（定期貸室賃貸借契約期間）で償却を行っていましたが、当事業年度において、平成24

年5月に本店事務所を移転することを決定しました。これに伴い、敷金のうち回収が最終的に見込めないと認められる金額を新たに見積り、また、当該敷金の償却期間を使用見込期間までに見直し、将来にわたって変更しております。

この変更により、従来の方法に比べて、当事業年度の特別損失が38,519千円増加し、税引前当期純利益が同額減少しております。

## 追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 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<br>(平成23年3月31日) |    | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |    |
|------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 建 物  | 49,316                | 千円 | 84,592                | 千円 |
| 器具備品 | 113,320               | 〃  | 127,549               | 〃  |
| 計    | 162,636               | 〃  | 212,142               | 〃  |

※2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<br>(平成23年3月31日) |    | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |  |
|-------|-----------------------|----|-----------------------|--|
| 預金    | 3,477,508             | 千円 | —                     |  |
| 未払手数料 | 333,570               | 〃  | —                     |  |
| 未払費用  | 123,687               | 〃  | —                     |  |

（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<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) |    | 当事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) |  |
|-------|----------------------------------------|----|----------------------------------------|--|
| 支払手数料 | 3,761,890                              | 千円 | —                                      |  |
| 受取利息  | 6,579                                  | 〃  | —                                      |  |

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

| 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 | — | — | 6,000 |
|---------|-------|---|---|-------|

## 2. 自己株式の種類及び株式数

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<br>総額（千円） | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成22年6月29日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 30,000         | 5,000           | 平成22年3月31日 | 平成22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<br>総額（千円） | 配当金の<br>原資 | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|----------------|------------|-----------------|------------|------------|
| 平成23年6月29日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 30,000         | 利益剰余金      | 5,000           | 平成23年3月31日 | 平成23年6月29日 |

当事業年度（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

| 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

| 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<br>総額（千円） | 1株当たり<br>配当額（円） | 基準日        | 効力発生日      |
|----------------------|-------|----------------|-----------------|------------|------------|
| 平成23年6月29日<br>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

平成24年6月29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。

(1) 配当金の総額            30,000千円

197/236

|                     |           |           |   |
|---------------------|-----------|-----------|---|
| (1)現金及び預金           | 6,223,302 | 6,223,302 | — |
| (2)未収委託者報酬          | 953,916   | 953,916   | — |
| (3)投資有価証券<br>其他有価証券 | 39,590    | 39,590    | — |
| (4)未払金              | (495,343) | (495,343) | — |

(\*)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<br>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。

#### （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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

##### （3）投資有価証券

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

##### （4）未払金

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

（注2）前事業年度（平成23年3月31日）において保有する非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「（3）投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

#### （注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23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  | 6,223,302 | —       | —        | —    |
| 未収委託者報酬 | 953,916   | —       | —        | —    |

当事業年度（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 | — | — | — |
|---------|---------|---|---|---|

## （有価証券関係）

## 1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位:千円）

| 区分                       | 取得原価   | 貸借対照表<br>計上額 | 差額       |
|--------------------------|--------|--------------|----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価<br>を超えるもの  |        |              |          |
| その他                      | 3,000  | 3,075        | 75       |
| 小計                       | 3,000  | 3,075        | 75       |
| 貸借対照表計上額が取得原価<br>を超えないもの |        |              |          |
| その他                      | 50,925 | 36,515       | △ 14,409 |
| 小計                       | 50,925 | 36,515       | △ 14,409 |
| 計                        | 53,925 | 39,590       | △ 14,334 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（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<br>計上額 | 差額       |
|--------------------------|--------|--------------|----------|
| 貸借対照表計上額が取得原価<br>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<br>を超えないもの |        |              |          |
| その他                      | 51,511 | 35,754       | △ 15,756 |
| 小計                       | 51,511 | 35,754       | △ 15,756 |
| 計                        | 58,513 | 43,194       | △ 15,318 |

## 2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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 |
|-------|---------|---------|
| 7,639 | 756     | 480     |

当事業年度（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      |

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（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. 退職給付債務及びその他に関する事項（単位：千円）

|             | 前事業年度<br>(平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付債務  | 171,115               | 199,976               |
| (2) 退職給付引当金 | 171,115               | 199,976               |

（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<br>(平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付費用 | 63,772                | 66,790                |

（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13,307千円、当事業年度で12,680千円であります。

4. 退職給付債務等の計算基礎

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<br>(平成23年3月31日) |    | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |    |
|--------------------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 繰延税金資産             |                       |    |                       |    |
| 未払事業税              | 17,667                | 千円 | 4,898                 | 千円 |
| 賞与引当金損金算入限度超過額     | 32,484                | 〃  | 27,004                | 〃  |
| 退職給付引当金損金算入限度超過額   | 69,626                | 〃  | 71,271                | 〃  |
| 有価証券評価差額           | 5,832                 | 〃  | 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                | 〃  |
| 敷金償却超過額            | —                     |    | 19,348                | 〃  |
| その他                | 4,558                 | 〃  | 3,334                 | 〃  |

|                 |         |   |          |   |
|-----------------|---------|---|----------|---|
| 繰延税金資産 合計       | 130,169 | 〃 | 159,817  | 〃 |
| 繰延税金負債          |         |   |          |   |
| 投資有価証券売却益益金不算入額 | —       |   | △398,925 | 〃 |
| 繰延税金負債 合計       | —       |   | △398,925 | 〃 |
| 繰延税金資産(負債)の純額   | 130,169 | 〃 | △239,107 | 〃 |

## 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<br>(平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(平成24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                 | 〃 |

前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。

## 3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23 年法律第114 号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23 年法律第117 号）が平成23 年12 月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から、法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.69%から平成24 年4月1日に開始する事業年度から平成26 年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27 年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この税率変更により、繰延税金資産は4,925千円減少（繰延税金負債は44,685千円減少）し、その他有価証券評価差額金が773千円、法人税等調整額が40,534千円、それぞれ減少しております。

（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

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

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22年4月1日 至 平成23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 | 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 | 直接30%,<br>間接70% | 営業上の取引<br>役員の兼任 | 投信販売<br>代行手数料 | 3,761,890 | 未払手数料 | 333,570  |
|     |            |        |               |            |                 |                 | 投資助言費用<br>の支払 | 692,451   | 未払費用  | 123,687  |

(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。

当事業年度（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      | 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。

(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22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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<br>役員の兼任 | 投信販売<br>代行手数料 | 2,721,441 | 未払手数料 | 286,815  |
|      |             |        |               |                |            |                 | 投資助言費用<br>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<br>仲介業務    | —          | —               | 投資有価証券<br>の譲渡 | 185,484   | —     | —        |
|      |             |        |               |                |            |                 | 自己株式の<br>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<br>カード業務 | —          | —               | 投資有価証券<br>の譲渡 | 494,720   | —     | —        |
|      |             |        |               |                |            |                 | 自己株式の<br>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<br>タ関連業務 | —          | —               | 投資有価証券<br>の譲渡 | 729,782   | —     | —        |
|      |             |        |               |                |            |                 | 自己株式の<br>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。

(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23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（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）

## （１株当たり情報）

|            | 前事業年度<br>(平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(平成24年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 1株当たり純資産額  | 1,144,367円30銭         | 1,654,304円66銭         |
| 1株当たり当期純利益 | 85,292円63銭            | 197,729円22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<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) | 当事業年度<br>(自 平成23年4月1日<br>至 平成24年3月31日) |
|--------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 当期純利益        | 511,755千円                              | 1,147,477千円                            |
| 普通株主に帰属しない金額 | —                                      | —                                      |
| 普通株式に係る当期純利益 | 511,755千円                              | 1,147,477千円                            |
| 期中平均株式数      | 6,000株                                 | 5,803株                                 |

## （重要な後発事象）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## (2)企業結合日

平成24年4月1日

## (3)企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## (4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5)その他取引の概要に関する事項

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

## 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す。

[次へ](#)

**<参考>中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況**

- (1) 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」といいます。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「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については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

- (2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31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。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 木村 充 男 印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅 則 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」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26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、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と住信アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併し、会社名を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以 上

---

※ 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](#)

## (1) 貸借対照表

| 科目            | 第25期<br>平成23年3月31日 |           | 第26期<br>平成24年3月31日 |           |
|---------------|--------------------|-----------|--------------------|-----------|
|               | 金額（千円）             |           | 金額（千円）             |           |
| (資産の部)        |                    |           |                    |           |
| I 流動資産        |                    |           |                    |           |
| 1. 現金・預金      |                    | 2,336,337 |                    | 2,641,578 |
| 2. 前払費用       |                    | 56,149    |                    | 40,865    |
| 3. 未収委託者報酬    |                    | 967,198   |                    | 970,835   |
| 4. 未収収益       |                    | 53        |                    | 58        |
| 5. 繰延税金資産     |                    | 43,658    |                    | 61,881    |
| 6. その他        |                    | 6,108     |                    | 4,232     |
| 流動資産 計        |                    | 3,409,505 |                    | 3,719,451 |
| II 固定資産       |                    |           |                    |           |
| 1. 有形固定資産※1   |                    |           |                    |           |
| (1) 建物        |                    | 7,448     |                    | 2,300     |
| (2) 器具備品      |                    | 23,068    |                    | 17,749    |
| (3) 建設仮勘定     |                    | —         |                    | 62,454    |
| 有形固定資産 計      |                    | 30,517    |                    | 82,504    |
| 2. 無形固定資産     |                    |           |                    |           |
| (1) ソフトウェア    |                    | 78,445    |                    | 47,468    |
| (2) ソフトウェア仮勘定 |                    | —         |                    | 11,446    |
| (3) 電話加入権     |                    | 1,847     |                    | 1,847     |
| (4) 電話施設利用権   |                    | 37        |                    | 17        |
| 無形固定資産 計      |                    | 80,330    |                    | 60,779    |
| 3. 投資その他の資産   |                    |           |                    |           |
| (1) 投資有価証券    |                    | 69,135    |                    | 62,728    |
| (2) 長期貸付金     |                    | 37,588    |                    | 34,838    |
| (3) 長期差入保証金   |                    | 90,141    |                    | —         |
| (4) 長期前払費用    |                    | 2,216     |                    | 2,023     |
| (5) 会員権       |                    | 25,000    |                    | 25,000    |
| (6) 貸倒引当金     |                    | △37,588   |                    | △34,838   |
| 投資その他の資産 計    |                    | 186,494   |                    | 89,751    |
| 固定資産 計        |                    | 297,342   |                    | 233,034   |
| 資 産 合 計       |                    | 3,706,847 |                    | 3,952,486 |

| 科目              | 第25期<br>平成23年 3 月31日 |           | 第26期<br>平成24年 3 月31日 |           |
|-----------------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                 | 金額（千円）               |           | 金額（千円）               |           |
| (負債の部)          |                      |           |                      |           |
| I 流動負債          |                      |           |                      |           |
| 1. 預り金          |                      | 3,682     |                      | 15,109    |
| 2. 未払金          |                      |           |                      |           |
| (1) 未払手数料       | 298,465              |           | 342,664              |           |
| (2) その他未払金      | 109,112              | 407,578   | 150,014              | 492,679   |
| 3. 未払費用         |                      | 365,151   |                      | 332,531   |
| 4. 未払法人税等       |                      | 82,266    |                      | 91,057    |
| 5. 賞与引当金        |                      | 50,180    |                      | 49,936    |
| 6. 役員賞与引当金      |                      | —         |                      | 7,068     |
| 7. 資産除去債務       |                      | 16,345    |                      | 20,000    |
| 8. 移転関連費用引当金    |                      | —         |                      | 29,277    |
| 流動負債 計          |                      | 925,203   |                      | 1,037,661 |
| II 固定負債         |                      |           |                      |           |
| 1. 退職給付引当金      |                      | 18,693    |                      | 20,003    |
| 2. 繰延税金負債       |                      | 1,600     |                      | 901       |
| 3. その他          |                      | 20,700    |                      | —         |
| 固定負債 計          |                      | 40,993    |                      | 20,904    |
| 負債合計            |                      | 966,197   |                      | 1,058,565 |
| (純資産の部)         |                      |           |                      |           |
| I 株主資本          |                      |           |                      |           |
| 1. 資本金          |                      | 300,000   |                      | 300,000   |
| 2. 資本剰余金        |                      |           |                      |           |
| (1) 資本準備金       |                      | 50,000    |                      | 50,000    |
| 資本剰余金 計         |                      | 50,000    |                      | 50,000    |
| 3. 利益剰余金        |                      |           |                      |           |
| (1) 利益準備金       |                      | 25,401    |                      | 25,401    |
| (2) その他利益剰余金    |                      |           |                      |           |
| 繰越利益剰余金         |                      | 2,364,106 |                      | 2,516,892 |
| 利益剰余金 計         |                      | 2,389,507 |                      | 2,542,294 |
| 株主資本計           |                      | 2,739,507 |                      | 2,892,294 |
| II 評価・換算差額等     |                      |           |                      |           |
| 1. その他有価証券評価差額金 |                      | 1,142     |                      | 1,627     |
| 評価・換算差額等計       |                      | 1,142     |                      | 1,627     |
| 純資産合計           |                      | 2,740,649 |                      | 2,893,921 |
| 負債・純資産合計        |                      | 3,706,847 |                      | 3,952,486 |

## (2) 損益計算書

| 科目             | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) |           | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |            |
|----------------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|------------|
|                | 金額（千円）                                |           | 金額（千円）                                |            |
| I 営業収益         |                                       |           |                                       |            |
| 1. 委託者報酬       |                                       | 9,561,211 |                                       | 10,971,754 |
| 営業収益 計         |                                       | 9,561,211 |                                       | 10,971,754 |
| II 営業費用        |                                       |           |                                       |            |
| 1. 支払手数料       |                                       | 3,634,705 |                                       | 4,769,780  |
| 2. 広告宣伝費       |                                       | 83,750    |                                       | 98,743     |
| 3. 調査費         |                                       |           |                                       |            |
| (1) 調査費        | 232,183                               |           | 229,530                               |            |
| (2) 委託調査費      | 3,098,589                             | 3,330,773 | 3,343,750                             | 3,573,280  |
| 4. 営業雑経費       |                                       |           |                                       |            |
| (1) 通信費        | 14,141                                |           | 12,330                                |            |
| (2) 印刷費        | 206,247                               |           | 187,155                               |            |
| (3) 協会費        | 12,069                                |           | 12,334                                |            |
| (4) 諸会費        | 507                                   | 232,966   | 620                                   | 212,440    |
| 営業費用 計         |                                       | 7,282,194 |                                       | 8,654,245  |
| III 一般管理費      |                                       |           |                                       |            |
| 1. 給料          |                                       |           |                                       |            |
| (1) 役員報酬       | 62,111                                |           | 118,031                               |            |
| (2) 給料・手当      | 633,310                               |           | 639,241                               |            |
| (3) 賞与         | 158,866                               | 854,287   | 161,905                               | 919,177    |
| 2. 福利厚生費       |                                       | 232,228   |                                       | 249,419    |
| 3. 交際費         |                                       | 770       |                                       | 990        |
| 4. 旅費交通費       |                                       | 21,590    |                                       | 21,102     |
| 5. 租税公課        |                                       | 11,095    |                                       | 10,660     |
| 6. 不動産賃借料      |                                       | 116,174   |                                       | 117,946    |
| 7. 退職給付費用      |                                       | 7,250     |                                       | 7,090      |
| 8. 役員退職慰労引当金繰入 |                                       | 8,250     |                                       | —          |
| 9. 賞与引当金繰入     |                                       | 50,180    |                                       | 49,936     |
| 10. 役員賞与引当金繰入  |                                       | —         |                                       | 7,068      |
| 11. 減価償却費      |                                       | 53,926    |                                       | 53,782     |
| 12. 諸経費        |                                       | 540,822   |                                       | 555,222    |
| 一般管理費 計        |                                       | 1,896,577 |                                       | 1,992,396  |
| 営業利益           |                                       | 382,439   |                                       | 325,113    |

| 科目                         | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) |         | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |         |
|----------------------------|---------------------------------------|---------|---------------------------------------|---------|
|                            | 金額（千円）                                |         | 金額（千円）                                |         |
| IV 営業外収益                   |                                       |         |                                       |         |
| 1. 受取配当金                   |                                       | 63,400  |                                       | —       |
| 2. 受取利息                    |                                       | 787     |                                       | 712     |
| 3. 貸倒引当金戻入                 |                                       | —       |                                       | 2,750   |
| 4. 雑収入                     |                                       | 4,513   |                                       | 37      |
| 営業外収益 計                    |                                       | 68,700  |                                       | 3,499   |
| V 営業外費用                    |                                       |         |                                       |         |
| 1. 雑損失                     |                                       | 573     |                                       | 1,714   |
| 営業外費用 計                    |                                       | 573     |                                       | 1,714   |
| 経常利益                       |                                       | 450,566 |                                       | 326,897 |
| VI 特別利益                    |                                       |         |                                       |         |
| 1. 投資有価証券売却益               |                                       | 67,194  |                                       | 153     |
| 2. 投資有価証券償還益               |                                       | 584     |                                       | —       |
| 3. 貸倒引当金戻入                 |                                       | 2,400   |                                       | —       |
| 特別利益 計                     |                                       | 70,179  |                                       | 153     |
| VII 特別損失                   |                                       |         |                                       |         |
| 1. 投資有価証券売却損               |                                       | 344     |                                       | 2       |
| 2. 固定資産除却損                 |                                       | 980     |                                       | —       |
| 3. 資産除去債務会計基準の適用に伴う<br>影響額 |                                       | 12,305  |                                       | —       |
| 4. 減損損失※2                  |                                       | 17,622  |                                       | —       |
| 5. 統合関連費用※1                |                                       | 51,394  |                                       | 53,349  |
| 特別損失 計                     |                                       | 82,648  |                                       | 53,352  |
| 税引前当期純利益                   |                                       | 438,098 |                                       | 273,699 |
| 法人税、住民税及び事業税               | 173,405                               |         | 139,942                               |         |
| 法人税等調整額                    | △12,604                               | 160,801 | △19,029                               | 120,912 |
| 当期純利益                      |                                       | 277,297 |                                       | 152,786 |

## (3) 株主資本等変動計算書

|              |             | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |
|--------------|-------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 株主資本         |             | (単位：千円)                               | (単位：千円)                               |
| 資本金          | 当期首残高       | 300,000                               | 300,000                               |
|              | 当期変動額       | —                                     | —                                     |
|              | 当期末残高       | 300,000                               | 300,000                               |
| 資本剰余金        |             |                                       |                                       |
| 資本準備金        | 当期首残高       | 50,000                                | 50,000                                |
|              | 当期変動額       | —                                     | —                                     |
|              | 当期末残高       | 50,000                                | 50,000                                |
| 資本剰余金合計      | 当期首残高       | 50,000                                | 50,000                                |
|              | 当期変動額       | —                                     | —                                     |
|              | 当期末残高       | 50,000                                | 50,000                                |
| 利益剰余金        |             |                                       |                                       |
| 利益準備金        | 当期首残高       | 25,401                                | 25,401                                |
|              | 当期変動額       | —                                     | —                                     |
|              | 当期末残高       | 25,401                                | 25,401                                |
| その他利益剰余金     |             |                                       |                                       |
| 繰越利益剰余金      | 当期首残高       | 2,086,808                             | 2,364,106                             |
|              | 当期変動額 当期純利益 | 277,297                               | 152,786                               |
|              | 当期末残高       | 2,364,106                             | 2,516,892                             |
| 利益剰余金合計      | 当期首残高       | 2,112,210                             | 2,389,507                             |
|              | 当期変動額       | 277,297                               | 152,786                               |
|              | 当期末残高       | 2,389,507                             | 2,542,294                             |
| 株主資本合計       | 当期首残高       | 2,462,210                             | 2,739,507                             |
|              | 当期変動額       | 277,297                               | 152,786                               |
|              | 当期末残高       | 2,739,507                             | 2,892,294                             |
| 評価・換算差額等     |             |                                       |                                       |
| その他有価証券評価差額金 | 当期首残高       | △103                                  | 1,142                                 |
|              | 当期変動額 (純額)  | 1,245                                 | 484                                   |
|              | 当期末残高       | 1,142                                 | 1,627                                 |
| 評価・換算差額等合計   | 当期首残高       | △103                                  | 1,142                                 |
|              | 当期変動額       | 1,245                                 | 484                                   |
|              | 当期末残高       | 1,142                                 | 1,627                                 |
| 純資産合計        | 当期首残高       | 2,462,107                             | 2,740,649                             |
|              | 当期変動額       | 278,542                               | 153,271                               |
|              | 当期末残高       | 2,740,649                             | 2,893,921                             |

## 重要な会計方針

| 項目                      | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで)                                                                                                                   |
|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法      | <p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの<br/>決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの<br/>移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p> |
| 2. 固定資産の減価償却の方法         |                                                                                                                                                         |
| (1) 有形固定資産              | <p>定率法を採用しております。</p> <p>なお、耐用年数は、建物については主として10年～15年、器具備品については主として5年～20年であります。</p>                                                                       |
| (2) 無形固定資産              | <p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>                                                                                 |
| 3. 引当金の計上基準             |                                                                                                                                                         |
| (1) 貸倒引当金               | <p>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。</p>                                                                               |
| (2) 賞与引当金               | <p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>                                                                                                         |
| (3) 役員賞与引当金             | <p>役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>                                                                                                          |
| (4) 退職給付引当金             | <p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>                                                                                                  |
| (5) 移転関連費用引当金           | <p>移転関連費用引当金は、当社グループの東京地区拠点ビルの統廃合に伴うオフィス移転で発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。</p>                                                                           |
| 4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。</p>                                                                                                                         |

## 追加情報

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

## 1. 会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 2. 役員賞与引当金

役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号 平成17年11月29日）を適用し、当事業年度より役員賞与引当金を計上しております。

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

| 項目                     | 期別         | 第25期<br>(平成23年3月31日)  | 第26期<br>(平成24年3月31日)          |
|------------------------|------------|-----------------------|-------------------------------|
| ※1. 有形固定資産の減価<br>償却累計額 | 建物<br>器具備品 | 33,765千円<br>142,605千円 | 建物 41,266千円<br>器具備品 149,241千円 |

## 2. 損益計算書関係

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)                                                                                                                                                      | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで)                      |            |          |    |            |                  |            |          |  |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|------------|----------|----|------------|------------------|------------|----------|--|
| ※1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれて<br>おります。<br><br>統合関連費用 51,394千円                                                                                                                                 | ※1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれて<br>おります。<br><br>統合関連費用 12,011千円 |            |          |    |            |                  |            |          |  |
| ※2 当事業年度において、以下の資産グループについて<br>減損損失を計上しました。                                                                                                                                                 |                                                            |            |          |    |            |                  |            |          |  |
| <table><tr><th>用途</th><th>場所</th><th>種類</th><th>金額</th></tr><tr><td>処分予定<br/>資産</td><td>本社事務所<br/>(東京都港区)</td><td>建物<br/>器具備品</td><td>17,622千円</td></tr></table>                           | 用途                                                         | 場所         | 種類       | 金額 | 処分予定<br>資産 | 本社事務所<br>(東京都港区) | 建物<br>器具備品 | 17,622千円 |  |
| 用途                                                                                                                                                                                         | 場所                                                         | 種類         | 金額       |    |            |                  |            |          |  |
| 処分予定<br>資産                                                                                                                                                                                 | 本社事務所<br>(東京都港区)                                           | 建物<br>器具備品 | 17,622千円 |    |            |                  |            |          |  |
| (経緯)<br><br>上記の資産グループについては、当社グループの<br>経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却さ<br>れる可能性が高い資産について、除去予定時の帳<br>簿価額を減損損失として特別損失に計上しまし<br>た。<br>(減損損失の金額)<br><br>建物 15,615千円<br>器具備品 2,007千円<br><hr/> 合計 17,622千円 |                                                            |            |          |    |            |                  |            |          |  |
| (グルーピングの方法)<br><br>当社は、基本的に全ての資産が一体となって<br>キャッシュ・フローを生成しておりますが、将来<br>使用見込みがなく処分される可能性が高いもの<br>については、処分予定資産としてグルーピングして<br>おります。                                                             |                                                            |            |          |    |            |                  |            |          |  |

## 3. 株主資本等変動計算書関係

| 期別<br>項目        | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)                                            |         |    |    |        |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------|---------|----|----|--------|
| 1. 発行済株式に関する事項  | 株式の種類                                                                            | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|                 | 普通株式（株）                                                                          | 5,050   | —  | —  | 5,050  |
| 2. 自己株式に関する事項   | 該当事項はありません。                                                                      |         |    |    |        |
| 3. 新株予約権等に関する事項 | 該当事項はありません。                                                                      |         |    |    |        |
| 4. 配当に関する事項     | (1) 配当金支払額<br>該当事項はありません。<br>(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの<br>該当事項はありません。 |         |    |    |        |

| 期別<br>項目        | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |         |    |    |        |
|-----------------|---------------------------------------|---------|----|----|--------|
| 1. 発行済株式に関する事項  | 株式の種類                                 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|                 | 普通株式（株）                               | 5,050   | —  | —  | 5,050  |
| 2. 自己株式に関する事項   | 該当事項はありません。                           |         |    |    |        |
| 3. 新株予約権等に関する事項 | 該当事項はありません。                           |         |    |    |        |
| 4. 配当に関する事項     | 配当金支払額<br>該当事項はありません。                 |         |    |    |        |

## 4. リース取引関係

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。       | 当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。       |

## 5. 金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

|             | 貸借対照表計上額（※） | 時価（※）     | 差額 |
|-------------|-------------|-----------|----|
|             | 千円          | 千円        | 千円 |
| (1) 現金・預金   | 2,336,337   | 2,336,337 | —  |
| (2) 未収委託者報酬 | 967,198     | 967,198   | —  |
| (3) 投資有価証券  |             |           |    |
| その他有価証券     | 59,135      | 59,135    | —  |
| (4) 未払金     | (407,578)   | (407,578) | —  |

（※）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・預金

満期のない預金については、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。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 未収委託者報酬及び (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。

## (3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

| 内容    | 貸借対照表計上額（千円） |
|-------|--------------|
| 非上場株式 | 10,000       |

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

## 第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

### 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

|             | 貸借対照表計上額（※） | 時価（※）     | 差額 |
|-------------|-------------|-----------|----|
|             | 千円          | 千円        | 千円 |
| (1) 現金・預金   | 2,641,578   | 2,641,578 | —  |
| (2) 未収委託者報酬 | 970,835     | 970,835   | —  |
| (3) 投資有価証券  |             |           |    |
| その他有価証券     | 52,728      | 52,728    | —  |
| (4) 未払金     | (492,679)   | (492,679) | —  |

（※）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・預金

満期のない預金については、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。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

#### (2) 未収委託者報酬及び (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。

#### (3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

| 内容    | 貸借対照表計上額（千円） |
|-------|--------------|
| 非上場株式 | 10,000       |

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象とはしておりません。

## ６．有価証券関係

| 第25期<br>(平成23年 3 月31日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 第26期<br>(平成24年 3 月31日) |              |             |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|--------------|-------------|----|-----|--------------|--------------|-------------|---|--------|--------|-------|----|--------------|------|----|-----|-----------|-------------|-----------|---|-----|-------|-----|----|-----|-------------|-------------|-----|---------------|--------------|-----------|---|---------|--------|-----|----|--------------|------------------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--------------|------|----|-----|--------------|--------------|-------------|---|--------|--------|-------|----|-----|-------------|-------------|-----|-------------|-----------|---------|---|-------|-----|---|----|--------------|------------------|--------|
| <div>1. その他有価証券<br/>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの</div> <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表<br/>計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円<br/>58,149</td><td>千円<br/>56,200</td><td>千円<br/>1,949</td></tr><tr><td>計</td><td>58,149</td><td>56,200</td><td>1,949</td></tr></table> <div>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの</div> <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表<br/>計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円<br/>986</td><td>千円<br/>1,000</td><td>千円<br/>△13</td></tr><tr><td>計</td><td>986</td><td>1,000</td><td>△13</td></tr></table> <div>2. 当事業年度中に売却したその他有価証券</div> <table><tr><th>区分</th><th>売却額</th><th>売却益の<br/>合計額</th><th>売却損の<br/>合計額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円<br/>128,650</td><td>千円<br/>67,194</td><td>千円<br/>344</td></tr><tr><td>計</td><td>128,650</td><td>67,194</td><td>344</td></tr></table> <div>3. 時価評価されていない有価証券</div> <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券<br/>非上場株式</td><td>10,000</td></tr></table> <div>4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額<br/>該当事項はありません。</div> | 区分                     | 貸借対照表<br>計上額 | 取得原価        | 差額 | その他 | 千円<br>58,149 | 千円<br>56,200 | 千円<br>1,949 | 計 | 58,149 | 56,200 | 1,949 | 区分 | 貸借対照表<br>計上額 | 取得原価 | 差額 | その他 | 千円<br>986 | 千円<br>1,000 | 千円<br>△13 | 計 | 986 | 1,000 | △13 | 区分 | 売却額 | 売却益の<br>合計額 | 売却損の<br>合計額 | その他 | 千円<br>128,650 | 千円<br>67,194 | 千円<br>344 | 計 | 128,650 | 67,194 | 344 | 内容 | 貸借対照表計上額（千円） | その他有価証券<br>非上場株式 | 10,000 | <div>1. その他有価証券<br/>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの</div> <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表<br/>計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円<br/>52,728</td><td>千円<br/>50,200</td><td>千円<br/>2,528</td></tr><tr><td>計</td><td>52,728</td><td>50,200</td><td>2,528</td></tr></table> <div>2. 当事業年度中に売却したその他有価証券</div> <table><tr><th>区分</th><th>売却額</th><th>売却益の<br/>合計額</th><th>売却損の<br/>合計額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円<br/>7,151</td><td>千円<br/>153</td><td>千円<br/>2</td></tr><tr><td>計</td><td>7,151</td><td>153</td><td>2</td></tr></table> <div>3. 時価評価されていない有価証券</div> <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券<br/>非上場株式</td><td>10,000</td></tr></table> <div>4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額<br/>該当事項はありません。</div> | 区分 | 貸借対照表<br>計上額 | 取得原価 | 差額 | その他 | 千円<br>52,728 | 千円<br>50,200 | 千円<br>2,528 | 計 | 52,728 | 50,200 | 2,528 | 区分 | 売却額 | 売却益の<br>合計額 | 売却損の<br>合計額 | その他 | 千円<br>7,151 | 千円<br>153 | 千円<br>2 | 計 | 7,151 | 153 | 2 | 内容 | 貸借対照表計上額（千円） | その他有価証券<br>非上場株式 | 10,000 |
| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 貸借対照表<br>計上額           | 取得原価         | 差額          |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 千円<br>58,149           | 千円<br>56,200 | 千円<br>1,949 |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 58,149                 | 56,200       | 1,949       |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 貸借対照表<br>計上額           | 取得原価         | 差額          |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 千円<br>986              | 千円<br>1,000  | 千円<br>△13   |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 986                    | 1,000        | △13         |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 売却額                    | 売却益の<br>合計額  | 売却損の<br>合計額 |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 千円<br>128,650          | 千円<br>67,194 | 千円<br>344   |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 128,650                | 67,194       | 344         |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 内容                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 貸借対照表計上額（千円）           |              |             |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他有価証券<br>非上場株式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 10,000                 |              |             |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 貸借対照表<br>計上額           | 取得原価         | 差額          |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 千円<br>52,728           | 千円<br>50,200 | 千円<br>2,528 |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 52,728                 | 50,200       | 2,528       |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 区分                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 売却額                    | 売却益の<br>合計額  | 売却損の<br>合計額 |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 千円<br>7,151            | 千円<br>153    | 千円<br>2     |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 7,151                  | 153          | 2           |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| 内容                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 貸借対照表計上額（千円）           |              |             |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |
| その他有価証券<br>非上場株式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 10,000                 |              |             |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |              |      |    |     |           |             |           |   |     |       |     |    |     |             |             |     |               |              |           |   |         |        |     |    |              |                  |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |              |      |    |     |              |              |             |   |        |        |       |    |     |             |             |     |             |           |         |   |       |     |   |    |              |                  |        |

## 7. デリバティブ関係

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)     | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで)     |
|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、<br>該当事項はありません。 | 当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、<br>該当事項はありません。 |

## 8. 退職給付関係

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------|---------|-----------|------|---------|--------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-----------|---------|-----------|------|---------|--------|---------|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>△18,693千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>△18,693千円</td></tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項<br/>（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>7,250千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>7,250千円</td></tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p> | 退職給付債務                                | △18,693千円 | 退職給付引当金 | △18,693千円 | 勤務費用 | 7,250千円 | 退職給付費用 | 7,250千円 | <p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成24年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>△20,003千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>△20,003千円</td></tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項<br/>（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>7,090千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>7,090千円</td></tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p> | 退職給付債務 | △20,003千円 | 退職給付引当金 | △20,003千円 | 勤務費用 | 7,090千円 | 退職給付費用 | 7,090千円 |
| 退職給付債務                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | △18,693千円                             |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 退職給付引当金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | △18,693千円                             |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 勤務費用                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 7,250千円                               |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 退職給付費用                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 7,250千円                               |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 退職給付債務                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | △20,003千円                             |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 退職給付引当金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | △20,003千円                             |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 勤務費用                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 7,090千円                               |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |
| 退職給付費用                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 7,090千円                               |           |         |           |      |         |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |        |           |         |           |      |         |        |         |

## 9. 税効果会計関係

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|----------|------------|----------|--------|---------|---------------|---------|-------|---------|-----|----------|----------|----------|--------|-----------|----------|----------|--------------|--------|-----|--------|----------|----------|--------|-------|------|--|----------------------|-------|-----------|-------|--------|------|-----|------|-------------------|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|----------|------------|----------|--------|---------|---------------|---------|-------|---------|-----|----------|----------|----------|--------|-----------|----------|----------|--------------|--------|----------|--------|--------|-------|------|--|--------------------|------|-----------|-------|--------|------|----------------------|------|-------------------|-------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>15,294千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>20,418千円</td></tr> <tr> <td>資産除去債務</td><td>6,650千円</td></tr> <tr> <td>移転による除却予定資産減損</td><td>7,170千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>6,824千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>19,740千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>76,099千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△32,440千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>43,658千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>△793千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>△806千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△1,600千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>40.7%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>△2.9%</td></tr> <tr> <td>評価性引当額の減少</td><td>△1.6%</td></tr> <tr> <td>住民税均等割</td><td>0.1%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>36.7%</td></tr> </table> | 貸倒引当金繰入超過額                            | 15,294千円 | 賞与引当金繰入超過額 | 20,418千円 | 資産除去債務 | 6,650千円 | 移転による除却予定資産減損 | 7,170千円 | 未払事業税 | 6,824千円 | その他 | 19,740千円 | 繰延税金資産小計 | 76,099千円 | 評価性引当額 | △32,440千円 | 繰延税金資産合計 | 43,658千円 | その他有価証券評価差額金 | △793千円 | その他 | △806千円 | 繰延税金負債合計 | △1,600千円 | 法定実効税率 | 40.7% | (調整) |  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目 | △2.9% | 評価性引当額の減少 | △1.6% | 住民税均等割 | 0.1% | その他 | 0.4% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 36.7% | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>12,629千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>18,980千円</td></tr> <tr> <td>資産除去債務</td><td>7,602千円</td></tr> <tr> <td>移転による除却予定資産減損</td><td>6,698千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>7,012千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>28,721千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>81,645千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△19,763千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>61,881千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table> <tr> <td>その他有価証券評価差額金</td><td>△901千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>△901千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>40.7%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>5.4%</td></tr> <tr> <td>評価性引当額の減少</td><td>△3.7%</td></tr> <tr> <td>住民税均等割</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td>1.6%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>44.2%</td></tr> </table> | 貸倒引当金繰入超過額 | 12,629千円 | 賞与引当金繰入超過額 | 18,980千円 | 資産除去債務 | 7,602千円 | 移転による除却予定資産減損 | 6,698千円 | 未払事業税 | 7,012千円 | その他 | 28,721千円 | 繰延税金資産小計 | 81,645千円 | 評価性引当額 | △19,763千円 | 繰延税金資産合計 | 61,881千円 | その他有価証券評価差額金 | △901千円 | 繰延税金負債合計 | △901千円 | 法定実効税率 | 40.7% | (調整) |  | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 5.4% | 評価性引当額の減少 | △3.7% | 住民税均等割 | 0.2% | 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 1.6% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 44.2% |
| 貸倒引当金繰入超過額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 15,294千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 賞与引当金繰入超過額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 20,418千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 資産除去債務                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 6,650千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 移転による除却予定資産減損                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 7,170千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 未払事業税                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 6,824千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 19,740千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金資産小計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 76,099千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 評価性引当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | △32,440千円                             |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金資産合計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 43,658千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他有価証券評価差額金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | △793千円                                |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | △806千円                                |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金負債合計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | △1,600千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 法定実効税率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 40.7%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| (調整)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                       |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | △2.9%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 評価性引当額の減少                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | △1.6%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 住民税均等割                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 0.1%                                  |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 0.4%                                  |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 36.7%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 貸倒引当金繰入超過額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 12,629千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 賞与引当金繰入超過額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 18,980千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 資産除去債務                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 7,602千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 移転による除却予定資産減損                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 6,698千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 未払事業税                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 7,012千円                               |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 28,721千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金資産小計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 81,645千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 評価性引当額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | △19,763千円                             |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金資産合計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 61,881千円                              |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| その他有価証券評価差額金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | △901千円                                |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 繰延税金負債合計                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | △901千円                                |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 法定実効税率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 40.7%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| (調整)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                       |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 5.4%                                  |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 評価性引当額の減少                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | △3.7%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 住民税均等割                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 0.2%                                  |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 1.6%                                  |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 44.2%                                 |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |     |        |          |          |        |       |      |  |                      |       |           |       |        |      |     |      |                   |       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |          |            |          |        |         |               |         |       |         |     |          |          |          |        |           |          |          |              |        |          |        |        |       |      |  |                    |      |           |       |        |      |                      |      |                   |       |

| 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                       | <p>3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.6%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産は4,363千円減少（繰延税金負債は127千円減少）し、その他有価証券評価差額金が127千円、法人税等調整額が4,363千円、それぞれ増加しております。</p> |

## 10. 資産除去債務関係

| 第25期<br>平成23年3月31日                                |          |
|---------------------------------------------------|----------|
| 資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの                           |          |
| 1. 当該資産除去債務の概要                                    |          |
| 事業用に貸借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。           |          |
| 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法                               |          |
| 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。 |          |
| 3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減                        |          |
| 期首残高                                              | 5,776千円  |
| 時の経過による調整額                                        | 79千円     |
| 見積りの変更による増加額※                                     | 10,489千円 |
| 期末残高                                              | 16,345千円 |
| ※当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの           |          |

| 第26期<br>平成24年3月31日                                                  |          |
|---------------------------------------------------------------------|----------|
| 資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの                                             |          |
| 1. 当該資産除去債務の概要                                                      |          |
| 事業用に貸借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。                             |          |
| 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法                                                 |          |
| 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。                   |          |
| 3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減                                          |          |
| 期首残高                                                                | 16,345千円 |
| 時の経過による調整額                                                          | 80千円     |
| 見積りの変更による増加額※                                                       | 3,574千円  |
| 期末残高                                                                | 20,000千円 |
| ※当社グループの経営統合に伴い、平成24年5月にオフィス移転することを決定したことから、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの |          |

## 11. セグメント情報等

第25期  
(平成22年4月1日から  
平成23年3月31日まで)

## (セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託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

投資信託委託業の区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益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        |
|-------------------------|-------------|
| 中央三井高金利ソブリンオープン         | 1,336,886千円 |
| 中央三井VAバランスファンド（株25／100） | 1,150,446千円 |

(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)

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託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。

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

(セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託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

投資信託委託業の区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益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） | 2,529,799千円 |

(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。

## 12. 関連当事者との取引関係

## I 第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

| 種類  | 会社等の名称                | 所在地   | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容               | 取引金額<br>(千円) | 科目  | 期末残高<br>(千円) |
|-----|-----------------------|-------|-------------------|-------------|---------------------|---------------|---------------------|--------------|-----|--------------|
| 親会社 | 中央三井トラスト・ホールディングス株式会社 | 東京都港区 | 261,608           | グループの業務執行管理 | (被所有) 直接100%        | 持株会社経営指導      | 統合関連費用の支払<br>統合関連費用 | 51,394       | 未払金 | 15,680       |

## (2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

| 種類          | 会社等の名称                                               | 所在地   | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容     | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                                             | 取引金額<br>(千円)       | 科目                          | 期末残高<br>(千円)                    |
|-------------|------------------------------------------------------|-------|-------------------|-----------|---------------------|---------------|---------------------------------------------------|--------------------|-----------------------------|---------------------------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 中央三井信託銀行株式会社<br>(注) 親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社     | 東京都港区 | 399,697           | 銀行業務・信託業務 | 該当なし                | 投資信託販売        | 投資信託に係る営業費用の支払<br>(注1) 支払代 hands 手数料              | 3,100,880          | 未払手数料                       | 243,621                         |
| 同一の親会社を持つ会社 | 中央三井アセット信託銀行株式会社<br>(注) 親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社 | 東京都港区 | 11,000            | 信託業務      | 該当なし                | 投資信託委託投資顧問    | 支払投資顧問料<br>(注1) 調査費（支払投資顧問料）<br><br>建物の賃借<br>(注2) | 2,425,966<br><br>— | 未払費用<br>前払費用<br><br>長期差入保証金 | 201,863<br>11,088<br><br>72,681 |

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高（長期差入保証金を除く）には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注2）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 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

中央三井トラスト・ホールディングス株式会社（東京、大阪、名古屋証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## Ⅱ 第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

| 種類  | 会社等の名称                | 所在地   | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容       | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                   | 取引金額<br>(千円) | 科目 | 期末残高 |
|-----|-----------------------|-------|-------------------|-------------|---------------------|---------------|-------------------------|--------------|----|------|
| 親会社 | 三井住友トラスト・ホールディングス株式会社 | 東京都港区 | 261,608           | グループの業務執行管理 | (被所有) 直接100%        | 持株会社経営指導      | 統合関連費用の支払(注2)<br>統合関連費用 | 12,011       | —  | —    |

## (2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

| 種類          | 会社等の名称                                               | 所在地   | 資本金又は出資金<br>(百万円) | 事業の内容     | 議決権等の所有<br>(被所有) 割合 | 関連当事者<br>との関係 | 取引の内容                         | 取引金額<br>(千円) | 科目           | 期末残高<br>(千円)   |
|-------------|------------------------------------------------------|-------|-------------------|-----------|---------------------|---------------|-------------------------------|--------------|--------------|----------------|
| 同一の親会社を持つ会社 | 中央三井信託銀行株式会社<br>(注) 親会社三井住友トラスト・ホールディングス株式会社の子会社     | 東京都港区 | 399,697           | 銀行業務・信託業務 | 該当なし                | 投資信託販売        | 投資信託に係る営業費用の支払(注1)<br>支払代行手数料 | 2,678,471    | 未払手数料        | 194,559        |
| 同一の親会社を持つ会社 | 中央三井アセット信託銀行株式会社<br>(注) 親会社三井住友トラスト・ホールディングス株式会社の子会社 | 東京都港区 | 11,000            | 信託業務      | 該当なし                | 投資信託委託投資顧問    | 支払投資顧問料(注1)<br>調査費(支払投資顧問料)   | 1,850,089    | 未払費用<br>前払費用 | 157,857<br>176 |

上記の金額のうち、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 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

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## 13. 1株当たり情報

| 項目            | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで)                           | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで)                           |
|---------------|-----------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 1. 1株当たり純資産額  | 542,702円95銭                                                     | 573,053円68銭                                                     |
| 2. 1株当たり当期純利益 | 54,910円36銭<br>(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。 | 30,254円79銭<br>(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。 |

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

| 項目               | 第25期<br>(平成22年4月1日から<br>平成23年3月31日まで) | 第26期<br>(平成23年4月1日から<br>平成24年3月31日まで) |
|------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益（千円）        | 277,297                               | 152,786                               |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | —                                     | —                                     |
| 普通株式に係る当期純利益（千円） | 277,297                               | 152,786                               |
| 普通株式の期中平均株式数（株）  | 5,050                                 | 5,050                                 |

## 14. 重要な後発事象

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

## (企業結合)

当社は、平成24年1月31日開催の取締役会における決議に基づき、住信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、当社及び住信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 住信アセットマネジメント株式会社

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

住信アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、当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結合後の企業の名称

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

旧中央三井トラスト・グループと旧住友信託銀行グループは、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、当社及び住信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」として発足するものです。

## (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す。

#### 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24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

##### （ロ）訴訟事件その他の重要事項

平成24年12月14日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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

- 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24年4月1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。

**（ロ）販売会社**

| 名称           | 資本金の額（百万円）<br>（平成24年4月1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。 |

**2【関係業務の概要】****（イ）受託会社**

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

**（ロ）販売会社**

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

**3【資本関係】****（イ）受託会社**

該当事項はありません。

**（ロ）販売会社**

該当事項はありません。

**（参考）再信託受託会社**

- 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24年3月末日現在）
- ④事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

**第3【参考情報】**

当ファンドについては、当計算期間中に、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23年12月15日 | 有価証券報告書       |
| 平成23年12月15日 | 有価証券届出書       |
| 平成24年3月30日  | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 平成24年6月21日  | 半期報告書         |
| 平成24年6月21日  | 有価証券届出書の訂正届出書 |

# 独立監査人の監査報告書

平成24年11月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山田 信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCマイセレクションS75（旧ファンド名：すみしん DCマイセレクションS75）の平成23年10月1日から平成24年10月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCマイセレクションS75（旧ファンド名：すみしん DCマイセレクションS75）の平成24年10月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの平成23年9月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成23年11月4日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以 上

---

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

2. 財務諸表の範囲にはX B R Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

**独立監査人の監査報告書**

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

|                    |       |           |
|--------------------|-------|-----------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 羽 太 典 明 印 |
|--------------------|-------|-----------|

|                    |       |           |
|--------------------|-------|-----------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 石 井 勝 也 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、「委託会社等の経理の状況」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（旧社名：住信アセットマネジメント株式会社）の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26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24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。

**強調事項**

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、会社名を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以 上

※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。