

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年12月28日提出
【計算期間】	第9期(自 平成26年10月1日至 平成27年9月30日)
【ファンド名】	D CマイセレクションS 7 5
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0522
【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。

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

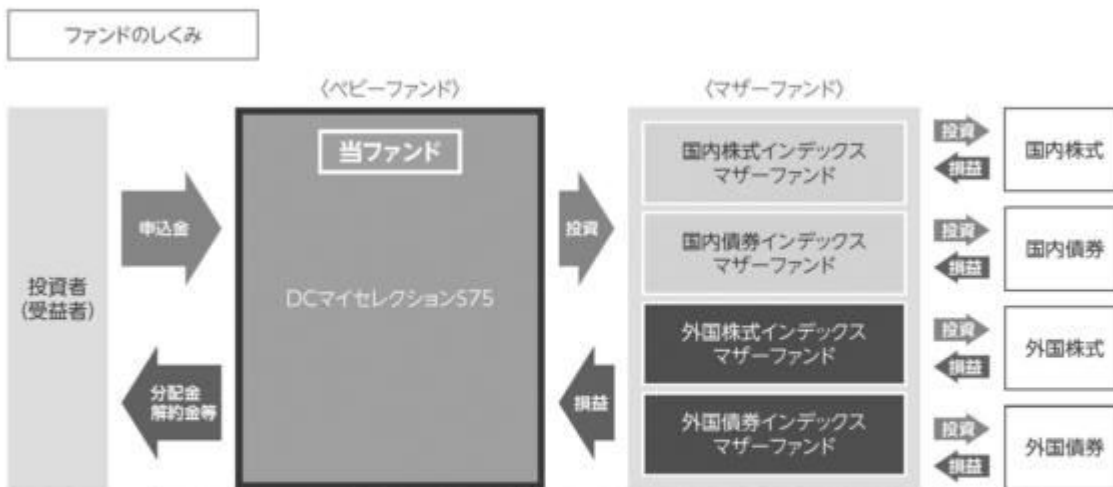
る旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

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

- 原則として、為替ヘッジは行いません。



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

? ファミリーファンド方式とは

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

2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

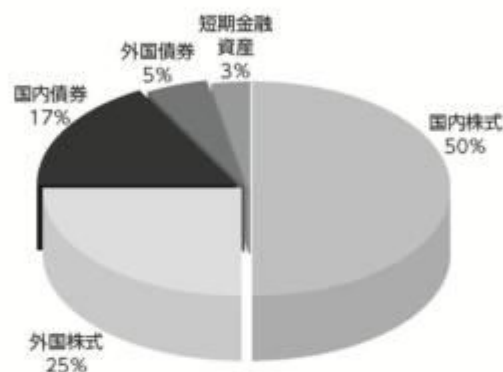
1「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

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

基準アセットミックス



ポートフォリオ構築プロセス

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

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

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以下とします。

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成18年10月30日
平成24年 4月 1日

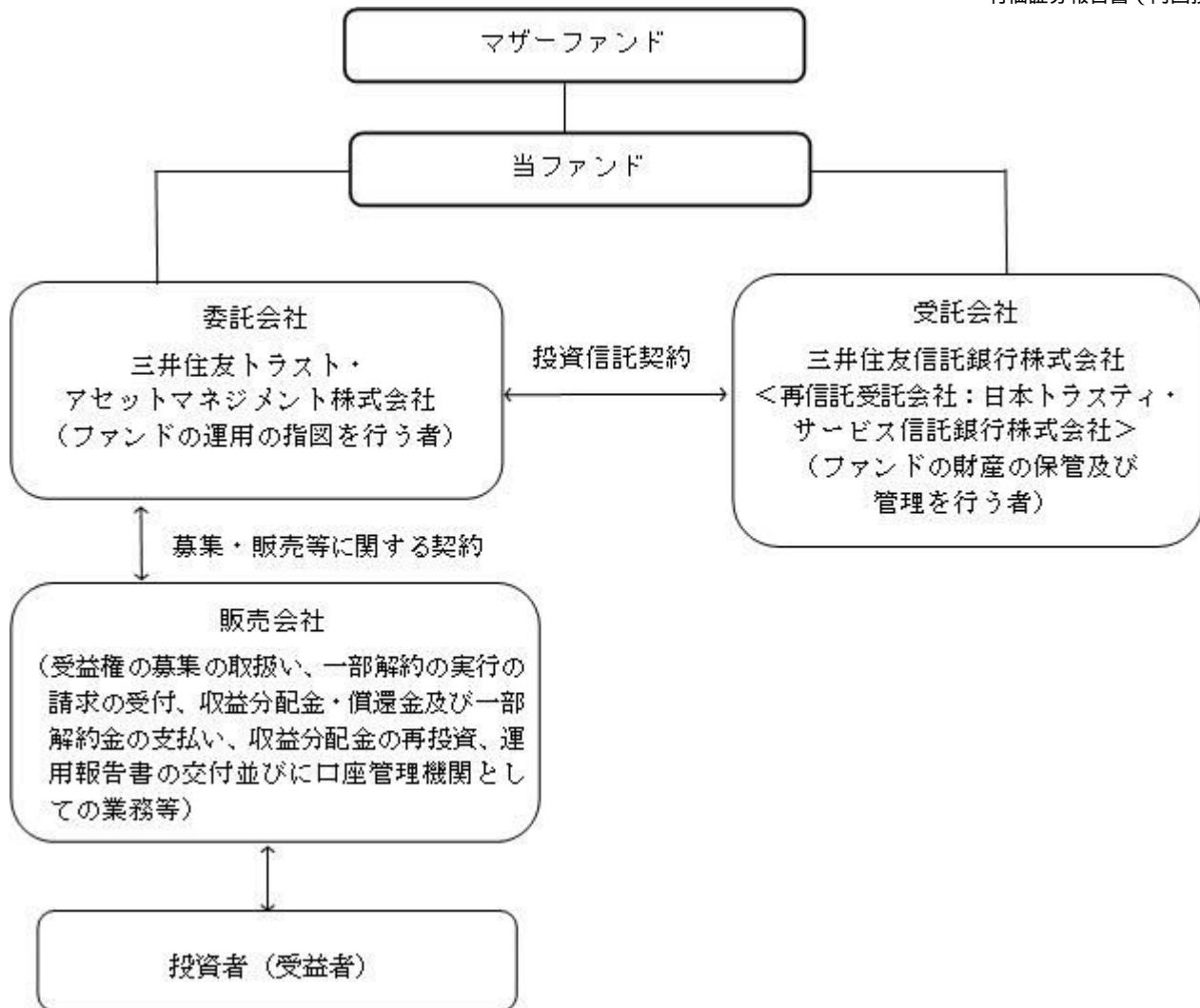
本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

本ファンドの名称を「すみしん DCマイセレクションS75」から「DCマイセレクション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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年10月30日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

（イ）基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法（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

投資対象

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

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2)基準ポートフォリオは、国内株式50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%の比率で基準配分します。
- 3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産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。

（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、)

八．金銭債権

二．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、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券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、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．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在

し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

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

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

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

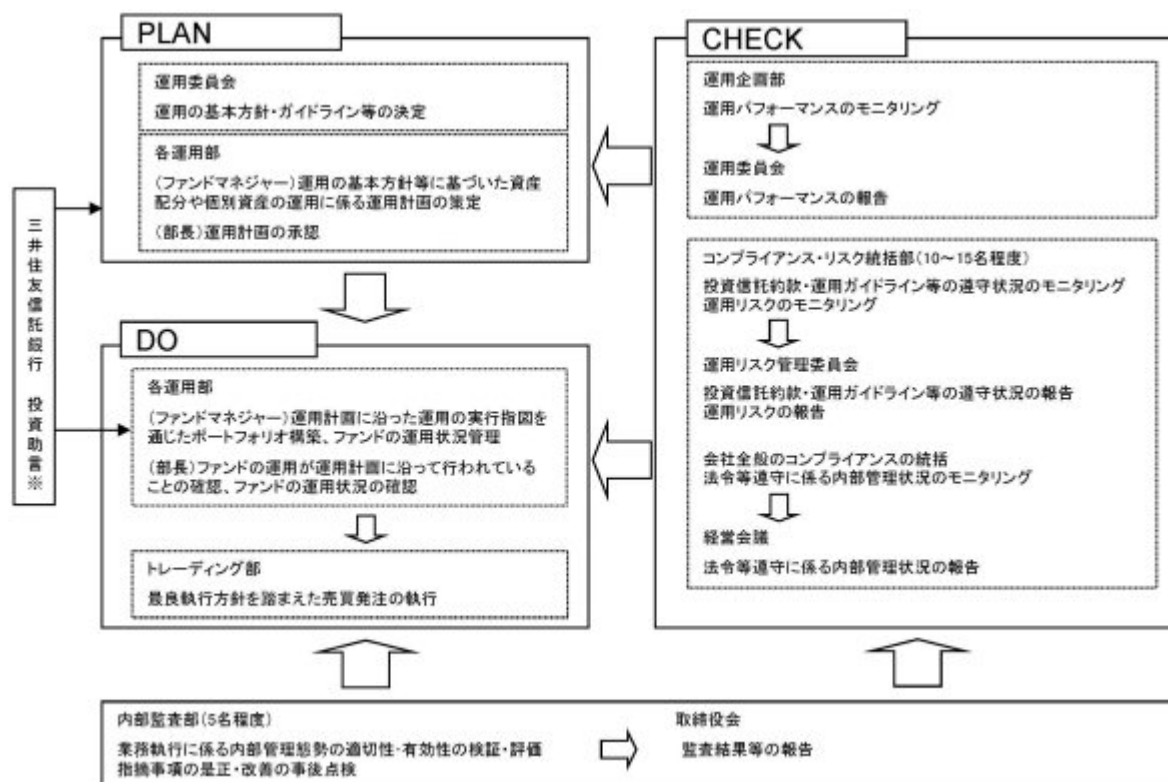
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比

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

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

（３）【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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

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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配対象額についての分配方針
委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。
- ・ 留保益の運用方針
留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。
将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

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

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

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

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

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

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

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

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第21条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。信用取引の指図は、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

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）

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）

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）

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。

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）

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）

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）

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）

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(イ)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われ

ると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

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

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

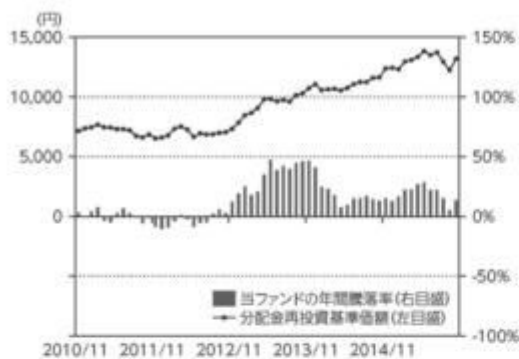
(ロ) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

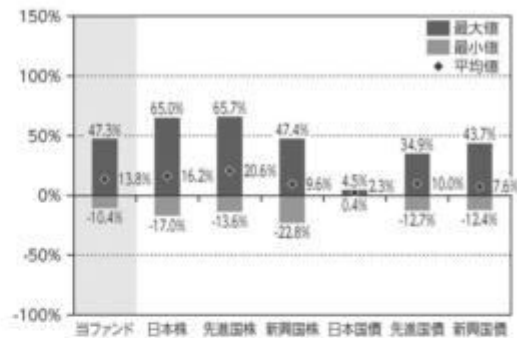
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2010年11月～2015年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

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

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

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

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

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

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額()の控除はありません。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図

るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.216%（税抜0.2%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1188% （税抜 0.11%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.0648% （税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.0324% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

せん。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、平成27年10月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

５【運用状況】

以下は、平成27年10月30日現在の状況について記載してあります。

【DCマイセレクションS75】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	9,791,690,452	97.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		287,159,631	2.85
合計(純資産総額)		10,078,850,083	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	3,822,262,654	1.2011	4,591,259,611	1.3256	5,066,791,374	50.27
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	1,223,528,455	1.8626	2,278,961,542	2.0651	2,526,708,612	25.07
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	1,268,086,435	1.3306	1,687,362,699	1.3357	1,693,783,051	16.81
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	178,589,228	2.8230	504,169,549	2.8244	504,407,415	5.00

(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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.15
合計	97.15

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（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（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（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（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（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（平成24年10月1日）	3,769,519,802	3,769,519,802	6,966	6,966
第7期計算期間末（平成25年9月30日）	6,329,088,679	6,329,088,679	10,143	10,143
第8期計算期間末（平成26年9月30日）	8,257,608,685	8,257,608,685	11,599	11,599
第9期計算期間末（平成27年9月30日）	9,320,324,358	9,320,324,358	12,241	12,241
平成26年10月末日	8,357,743,686		11,624	
11月末日	8,899,953,559		12,378	
12月末日	9,001,211,849		12,439	
平成27年1月末日	9,005,388,841		12,315	
2月末日	9,460,603,066		12,965	
3月末日	9,683,598,778		13,094	
4月末日	9,891,236,922		13,343	
5月末日	10,256,206,207		13,837	
6月末日	10,103,984,319		13,509	
7月末日	10,361,772,032		13,739	
8月末日	9,775,237,937		12,942	

9月末日	9,320,324,358		12,241	
10月末日	10,078,850,083		13,200	

【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
第7期計算期間	平成24年10月 2日～平成25年 9月30日	0
第8期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	0
第9期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	0

【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
第7期計算期間	平成24年10月 2日～平成25年 9月30日	45.6
第8期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	14.4
第9期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	5.5

(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	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	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	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	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	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	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
第7期計算期間	平成24年10月 2日～平成25年 9月30日	1,318,926,642	489,835,161	6,240,049,142
第8期計算期間	平成25年10月 1日～平成26年 9月30日	1,821,019,145	941,939,005	7,119,129,282
第9期計算期間	平成26年10月 1日～平成27年 9月30日	1,409,831,941	914,685,676	7,614,275,547

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	151,181,102,490	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,640,810,723	1.72
合計(純資産総額)		153,821,913,213	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,259,825,000	1.47

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	839,100	8,505.58	7,137,032,178	7,469.00	6,267,237,900	4.07
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,218,500	910.85	4,753,270,725	790.60	4,125,746,100	2.68
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	520,700	5,567.26	2,898,875,451	4,860.00	2,530,602,000	1.65
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	368,500	7,343.10	2,705,933,211	6,797.00	2,504,694,500	1.63

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	593,000	4,222.27	2,503,806,110	4,044.00	2,398,092,000	1.56
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,159,000	271.85	2,489,912,798	250.30	2,292,497,700	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	502,700	4,338.14	2,180,782,978	4,486.00	2,255,112,200	1.47
日本	株式	KDDI	情報・通信業	660,700	2,814.22	1,859,355,154	2,946.00	1,946,422,200	1.27
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	436,500	4,518.60	1,972,368,900	4,211.00	1,838,101,500	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	274,800	6,005.36	1,650,275,660	5,930.00	1,629,564,000	1.06
日本	株式	ソニー	電気機器	464,800	3,783.62	1,758,627,993	3,480.00	1,617,504,000	1.05
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	272,100	5,165.95	1,405,654,995	5,511.00	1,499,543,100	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	67,400	27,016.73	1,820,927,602	21,555.00	1,452,807,000	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	120,500	11,323.48	1,364,479,340	11,570.00	1,394,185,000	0.91
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	772,800	1,804.19	1,394,278,032	1,765.00	1,363,992,000	0.89
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	59,000	21,491.95	1,268,025,050	22,200.00	1,309,800,000	0.85
日本	株式	キヤノン	電気機器	354,800	4,246.13	1,506,526,924	3,640.00	1,291,472,000	0.84
日本	株式	三菱地所	不動産業	484,000	2,762.26	1,336,933,840	2,607.00	1,261,788,000	0.82
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	263,500	5,109.13	1,346,255,755	4,692.00	1,236,342,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	69,100	19,998.38	1,381,888,058	17,355.00	1,199,230,500	0.78
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	501,600	2,239.83	1,123,498,728	2,357.50	1,182,522,000	0.77
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,681,000	829.08	1,393,689,751	702.90	1,181,574,900	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	925,000	1,287.71	1,191,131,750	1,266.50	1,171,512,500	0.76
日本	株式	花王	化学	185,600	5,645.79	1,047,858,624	6,239.00	1,157,958,400	0.75
日本	株式	三井不動産	不動産業	345,000	3,603.96	1,243,366,200	3,310.00	1,141,950,000	0.74
日本	株式	パナソニック	電気機器	752,800	1,795.44	1,351,607,232	1,435.00	1,080,268,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	488,000	2,745.16	1,339,638,080	2,212.50	1,079,700,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	232,900	5,068.71	1,180,502,559	4,476.00	1,042,460,400	0.68
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	208,200	4,665.58	971,373,756	4,728.00	984,369,600	0.64
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,251,300	818.18	1,023,788,634	765.60	957,995,280	0.62

(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。

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.81
		食料品	4.26
		繊維製品	0.71
		パルプ・紙	0.27
		化学	5.88
		医薬品	4.97

石油・石炭製品	0.48
ゴム製品	0.93
ガラス・土石製品	0.91
鉄鋼	1.22
非鉄金属	0.90
金属製品	0.63
機械	4.48
電気機器	11.74
輸送用機器	10.61
精密機器	1.47
その他製品	1.59
電気・ガス業	2.23
陸運業	4.34
海運業	0.26
空運業	0.67
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	7.19
卸売業	4.06
小売業	4.57
銀行業	9.19
証券、商品先物取引業	1.25
保険業	2.53
その他金融業	1.36
不動産業	2.84
サービス業	3.30
小計	98.28
合計	98.28

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	145円		2,199,240,620	2,259,825,000	1.47

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	263,471,269,250	80.55
	ポーランド	201,410,000	0.06
	メキシコ	100,684,000	0.03
	小計	263,773,363,250	80.64
地方債証券	日本	19,069,331,788	5.83
特殊債券	日本	26,239,626,670	8.02
	アメリカ	208,988,000	0.06
	小計	26,448,614,670	8.09
社債券	日本	14,571,799,370	4.46
	アメリカ	504,631,000	0.15
	オーストラリア	402,770,000	0.12
	スウェーデン	401,881,000	0.12
	オランダ	303,074,000	0.09
	フランス	100,321,000	0.03
	小計	16,284,476,370	4.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,505,430,185	0.46
合計(純資産総額)		327,081,216,263	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	日本	445,680,000	0.14

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	5,090,000,000	100.13	5,097,049,700	100.32	5,106,746,100	0.100	2019/12/20	1.56
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	4,640,000,000	100.06	4,643,193,600	100.32	4,655,172,800	0.100	2020/3/20	1.42
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	4,520,000,000	100.64	4,549,108,800	100.64	4,548,928,000	0.200	2019/3/20	1.39
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	100.93	4,430,827,000	100.77	4,423,978,600	0.300	2018/6/20	1.35
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	4,350,000,000	100.62	4,376,970,000	100.68	4,379,928,000	0.200	2019/6/20	1.34
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	100.62	4,266,372,800	100.71	4,270,358,400	0.200	2019/9/20	1.31
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,960,000,000	100.67	3,986,532,000	100.59	3,983,482,800	0.200	2018/12/20	1.22
日本	国債証券	第355回利付国債(2年)	3,940,000,000	100.18	3,947,238,500	100.17	3,946,973,800	0.100	2017/8/15	1.21
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,480,000,000	100.08	3,482,784,000	101.32	3,526,179,600	0.400	2025/3/20	1.08
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,480,000,000	99.95	3,478,504,800	101.17	3,520,785,600	0.400	2025/6/20	1.08
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	100.42	3,514,700,000	100.32	3,511,340,000	0.200	2017/6/20	1.07
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	100.47	3,275,354,600	100.37	3,272,225,000	0.200	2017/9/20	1.00
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	3,210,000,000	100.08	3,212,846,500	100.32	3,220,368,300	0.100	2020/6/20	0.98
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	104.35	3,141,085,500	104.96	3,159,296,000	0.800	2022/9/20	0.97
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	3,040,000,000	101.28	3,079,137,400	102.48	3,115,452,800	0.500	2024/9/20	0.95
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	3,000,000,000	102.33	3,069,997,000	103.39	3,101,730,000	0.600	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,700,000,000	102.50	2,767,500,000	103.52	2,795,283,000	0.600	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	103.83	2,585,591,100	103.17	2,569,132,200	1.500	2017/12/20	0.79
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	100.55	2,513,925,000	100.41	2,510,275,000	0.300	2017/3/20	0.77
日本	国債証券	第115回利付国債(5年)	2,460,000,000	100.66	2,476,236,000	100.54	2,473,431,600	0.200	2018/9/20	0.76
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,420,000,000	100.80	2,439,361,800	101.00	2,444,369,400	0.400	2025/9/20	0.75
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,300,000,000	104.25	2,397,911,000	105.09	2,417,254,000	0.800	2023/6/20	0.74
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	104.21	2,334,483,200	105.14	2,355,158,400	0.800	2023/9/20	0.72
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	2,300,000,000	100.25	2,305,900,500	100.31	2,307,268,000	0.100	2020/9/20	0.71
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,220,000,000	102.75	2,281,081,500	103.58	2,299,542,600	0.600	2023/3/20	0.70
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	105.98	2,299,852,800	105.93	2,298,767,800	1.200	2020/12/20	0.70
日本	国債証券	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	100.48	2,290,944,000	100.33	2,287,683,600	0.300	2016/12/20	0.70
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	105.60	2,281,024,800	105.25	2,273,508,000	1.300	2019/12/20	0.70
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	2,130,000,000	105.75	2,252,475,000	105.93	2,256,372,900	1.000	2022/3/20	0.69
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	104.93	2,203,614,000	104.28	2,189,985,000	1.500	2018/9/20	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.64
地方債証券	5.83
特殊債券	8.09
社債券	4.98
合計	99.54

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	3円		445,920,972	445,680,000	0.14

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	154,300,038,271	56.51
	イギリス	21,101,653,461	7.73
	スイス	10,833,998,360	3.97
	フランス	10,051,082,346	3.68
	ドイツ	9,809,817,467	3.59
	カナダ	9,312,355,232	3.41
	オーストラリア	6,096,767,536	2.23
	アイルランド	4,309,666,966	1.58
	オランダ	4,283,116,277	1.57
	スペイン	3,688,851,658	1.35
	スウェーデン	3,073,490,958	1.13

	イタリア	2,446,287,131	0.90
	香港	2,379,171,803	0.87
	デンマーク	1,843,870,970	0.68
	シンガポール	1,529,992,371	0.56
	ベルギー	1,457,364,259	0.53
	ジャージー	1,195,040,028	0.44
	バミューダ	1,005,834,196	0.37
	フィンランド	935,408,362	0.34
	キュラソー	863,732,137	0.32
	イスラエル	648,577,492	0.24
	ケイマン	635,554,935	0.23
	ノルウェー	574,836,104	0.21
	ルクセンブルク	261,027,082	0.10
	パナマ	188,034,164	0.07
	オーストリア	187,285,066	0.07
	ニュージーランド	167,835,663	0.06
	ポルトガル	156,103,849	0.06
	リベリア	145,247,016	0.05
	英ヴァージン諸島	65,112,484	0.02
	マン島	29,573,285	0.01
	モーリシャス	14,125,160	0.01
	小計	253,590,852,089	92.87
投資信託受益証券	オーストラリア	147,271,861	0.05
	香港	27,042,444	0.01
	シンガポール	21,677,974	0.01
	小計	195,992,279	0.07
投資証券	アメリカ	4,727,011,718	1.73
	オーストラリア	587,313,378	0.22
	フランス	406,927,604	0.15
	イギリス	396,917,094	0.15
	香港	118,240,200	0.04
	シンガポール	95,077,171	0.03
	カナダ	43,244,749	0.02
	小計	6,374,731,914	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,907,632,738	4.73
合計(純資産総額)		273,069,209,020	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,680,958,350	2.81
	買建	カナダ	582,302,799	0.21
	買建	ドイツ	2,131,565,727	0.78
	買建	イギリス	1,168,574,348	0.43
	買建	オーストラリア	596,889,710	0.22

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		367,592,370	0.13
	売建		695,343,600	0.25

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	411,408	15,701.13	6,459,570,892	14,572.07	5,995,069,054	2.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	549,044	5,700.86	3,130,025,666	6,451.22	3,542,005,830	1.30
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	298,277	10,144.60	3,025,903,690	9,941.60	2,965,352,711	1.09
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	718,680	3,304.92	2,375,180,386	3,547.20	2,549,306,008	0.93
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	197,782	12,163.20	2,405,663,622	12,255.63	2,423,943,606	0.89
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	348,898	6,780.68	2,365,767,105	6,660.38	2,323,793,610	0.85
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	28,241	52,843.24	1,492,346,006	75,749.89	2,139,252,785	0.78
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	230,102	8,988.47	2,068,265,091	9,290.23	2,137,702,804	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	264,723	7,990.11	2,115,166,653	7,883.88	2,087,046,748	0.76
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	152,743	9,902.90	1,512,599,394	12,679.99	1,936,780,018	0.71

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	22,046	66,567.16	1,467,539,789	86,675.62	1,910,850,895	0.70
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	20,610	68,571.22	1,413,252,978	90,052.36	1,855,979,243	0.68
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	439,346	4,155.81	1,825,842,303	4,203.69	1,846,875,705	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	193,587	9,493.30	1,837,781,290	9,311.71	1,802,627,552	0.66
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	162,383	11,990.17	1,947,000,575	11,038.27	1,792,427,722	0.66
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	438,612	4,165.62	1,827,092,937	4,056.19	1,779,095,801	0.65
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	50,151	34,264.69	1,718,408,738	32,796.99	1,644,801,946	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	291,030	5,946.57	1,730,630,657	5,609.76	1,632,608,453	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	115,045	13,248.89	1,524,219,040	13,908.33	1,600,084,515	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	749,534	2,015.02	1,510,331,553	2,066.18	1,548,672,910	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	295,556	4,951.47	1,463,437,550	5,173.31	1,529,003,106	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	134,308	12,132.59	1,629,505,192	10,867.70	1,459,619,186	0.53
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	216,580	6,590.90	1,427,458,830	6,487.49	1,405,061,451	0.51
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	339,374	4,026.20	1,366,390,458	4,114.22	1,396,261,674	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	83,237	17,359.08	1,444,918,416	16,670.90	1,387,635,787	0.51
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	92,729	13,631.46	1,264,032,195	14,946.86	1,386,008,030	0.51
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	104,905	13,644.77	1,431,405,421	13,203.48	1,385,112,014	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,419,653	1,131.72	1,606,656,153	950.67	1,349,635,600	0.49
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	201,689	7,153.01	1,442,685,235	6,633.78	1,337,961,059	0.49
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	140,034	8,448.15	1,183,028,957	9,491.85	1,329,182,983	0.49

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.87
		素材	4.25

資本財	6.71
商業・専門サービス	0.85
運輸	1.80
自動車・自動車部品	1.61
耐久消費財・アパレル	1.77
消費者サービス	1.77
メディア	2.99
小売	3.81
食品・生活必需品小売り	2.01
食品・飲料・タバコ	5.98
家庭用品・パーソナル用品	2.10
ヘルスケア機器・サービス	3.34
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.68
銀行	8.70
各種金融	3.87
保険	4.23
不動産	0.67
ソフトウェア・サービス	7.98
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.19
電気通信サービス	3.01
公益事業	2.99
半導体・半導体製造装置	1.69
小計	92.87
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.33
合計	95.27

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	122	アメリカドル	59,140,024	7,150,028,902	63,531,500	7,680,958,350	2.81
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	39	カナダドル	6,115,977.5	562,364,131	6,332,820	582,302,799	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	54	スイスフラン	4,654,658	568,985,394	4,827,060	590,059,814	0.22

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	341	ユーロ	10,779,334.5	1,431,926,795	11,604,230	1,541,505,913	0.56
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	53	オーストラリアドル	6,696,321	575,682,716	6,943,000	596,889,710	0.22
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	99	イギリスポンド	6,039,991.25	1,119,753,977	6,303,330	1,168,574,348	0.43

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,950,000.00	235,418,625	235,735,500	0.09
	カナダドル	買建	95,000.00	8,692,053	8,734,300	0.00
	ユーロ	買建	287,000.00	37,778,871	38,125,080	0.01
	イギリスポンド	買建	165,000.00	30,401,481	30,587,700	0.01
	スイスフラン	買建	110,000.00	13,346,531	13,446,400	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	788,000.00	11,103,471	11,181,720	0.00
	デンマーククローネ	買建	407,000.00	7,180,090	7,248,670	0.00
	オーストラリアドル	買建	148,000.00	12,691,177	12,720,600	0.00
	香港ドル	買建	629,000.00	9,799,820	9,812,400	0.00
	アメリカドル	売建	3,800,000.00	459,404,040	459,382,000	0.17
	カナダドル	売建	310,000.00	28,502,330	28,501,400	0.01
	ユーロ	売建	670,000.00	89,004,676	89,002,800	0.03
	イギリスポンド	売建	360,000.00	66,735,900	66,733,200	0.02
	スイスフラン	売建	220,000.00	26,895,594	26,895,000	0.01
	オーストラリアドル	売建	180,000.00	15,469,830	15,469,200	0.01
	香港ドル	売建	600,000.00	9,359,760	9,360,000	0.00

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	94,918,957,903	42.14
	イタリア	21,490,791,386	9.54
	フランス	21,401,767,115	9.50

イギリス	18,299,727,147	8.12
ドイツ	16,592,146,713	7.37
スペイン	12,000,804,575	5.33
ベルギー	5,535,932,713	2.46
オランダ	5,519,406,861	2.45
カナダ	4,423,545,978	1.96
オーストラリア	3,655,541,025	1.62
オーストリア	3,392,311,176	1.51
メキシコ	2,222,227,676	0.99
アイルランド	1,740,796,399	0.77
デンマーク	1,494,157,963	0.66
フィンランド	1,321,494,479	0.59
ポーランド	1,243,735,118	0.55
南アフリカ	1,050,503,620	0.47
スウェーデン	992,929,826	0.44
マレーシア	955,716,623	0.42
シンガポール	782,023,531	0.35
スイス	652,650,966	0.29
ノルウェー	607,318,702	0.27
小計	220,294,487,495	97.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4,935,570,242	2.19
合計(純資産総額)	225,230,057,737	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	926,114,791	0.41
	買建	ドイツ	1,428,105,718	0.63

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,286,017,400	1.46

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	12,137.22	1,456,467,187	12,128.72	1,455,447,101	0.750	2017/1/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/30/17	11,600,000	12,141.62	1,408,428,419	12,138.87	1,408,110,023	0.875	2017/4/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	12,160.13	1,216,013,143	12,147.61	1,214,761,647	0.875	2017/1/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	12,115.26	1,211,526,616	12,112.43	1,211,243,263	0.625	2016/12/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.375% 04/30/20	10,000,000	11,965.27	1,196,527,956	12,042.06	1,204,206,508	1.375	2020/4/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	10,000,000	11,964.50	1,196,450,580	12,000.03	1,200,003,335	0.625	2018/4/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	12,606.18	1,197,587,698	12,485.05	1,186,079,767	3.000	2017/2/28	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/45	10,580,000	11,071.61	1,171,377,203	10,953.49	1,158,879,529	2.500	2045/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	9,100,000	12,756.47	1,160,839,276	12,729.91	1,158,422,715	2.750	2024/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	12,682.22	1,154,082,124	12,594.61	1,146,110,037	2.750	2017/12/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	9,450,000	11,977.75	1,131,897,416	12,039.46	1,137,729,682	2.125	2025/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	9,300,000	11,998.11	1,115,824,788	11,891.17	1,105,879,386	2.875	2043/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	11,944.06	1,074,966,296	11,978.78	1,078,090,329	1.000	2019/6/30	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	12,133.44	1,067,743,463	12,128.72	1,067,327,874	0.875	2017/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	12,362.96	1,050,852,415	12,341.00	1,048,985,782	2.375	2024/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	12,499.69	1,049,973,996	12,476.07	1,047,990,476	2.500	2024/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	11,977.36	1,020,471,464	12,005.93	1,022,905,813	1.250	2020/1/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,400,000	11,956.69	1,004,361,973	11,926.12	1,001,794,399	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	12,600.75	1,008,060,418	12,494.25	999,540,750	2.750	2017/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	12,218.22	995,784,941	12,197.20	994,072,152	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	7,500,000	13,214.93	991,120,259	13,091.43	981,857,943	3.375	2044/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 05/31/19	8,000,000	12,156.85	972,548,616	12,197.44	975,795,236	1.500	2019/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	12,399.57	979,566,040	12,347.14	975,424,740	1.875	2017/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	7,900,000	12,183.98	962,534,489	12,155.40	960,277,297	1.000	2016/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	12,226.01	916,950,937	12,232.86	917,464,529	1.625	2019/8/31	0.41
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000	15,284.78	886,517,637	15,446.63	895,904,842	4.250	2020/3/1	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/44	6,500,000	13,806.95	897,452,203	13,728.05	892,323,465	3.625	2044/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	12,776.20	881,557,931	12,748.81	879,667,928	2.750	2023/11/15	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 6% 05/01/31	4,200,000	19,421.76	815,713,983	20,293.96	852,346,606	6.000	2031/5/1	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	11,835.92	846,268,361	11,862.60	848,176,196	1.625	2022/11/15	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.81

合計	97.81
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	32	アメリカ ドル	3,848,987.42	465,342,579	3,833,000	463,409,700	0.21
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	19	アメリカ ドル	2,440,497.94	295,056,201	2,424,578.22	293,131,507	0.13
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	9	アメリカ ドル	1,413,286	170,866,277	1,402,593.75	169,573,584	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,117,486	281,286,840	2,118,310	281,396,300	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	23	ユーロ	2,974,132	395,083,695	2,976,660	395,419,514	0.18
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	36	ユーロ	5,652,354	750,858,705	5,655,600	751,289,904	0.33

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

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


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	12,340,000.00	1,484,354,870	1,491,535,800	0.66
	カナダドル	買建	1,370,000.00	125,628,080	125,930,400	0.06
	ユーロ	買建	10,440,000.00	1,402,867,030	1,386,849,600	0.62
	イギリスポンド	買建	1,520,000.00	279,906,605	281,701,600	0.13

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2006年10月30日
 作成基準日：2015年10月30日
基準価額・純資産の推移

基準価額	13,200円
純資産総額	100.79億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

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	2011年9月	2012年10月	2013年9月	2014年9月	2015年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式 インデックス マザーファンド	50.3%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ 三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 銀行業 銀行業	-	-	2.0% 1.3% 0.8%
外国株式 インデックス マザーファンド	25.1%	APPLE INC MICROSOFT CORP EXXON MOBIL	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア ソフトウェア・サービス エネルギー	-	-	0.6% 0.3% 0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	16.8%	第122回利付国債(5年) 第123回利付国債(5年) 第117回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1% 0.1% 0.2%	2019/12/20 2020/03/20 2019/03/20	0.3% 0.2% 0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	5.0%	T 0.75% 01/15/17 T 0.875% 04/30/17 T 0.875% 01/31/17	アメリカ	国債	-	0.750% 0.875% 0.875%	2017/01/15 2017/04/30 2017/01/31	0.0% 0.0% 0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2006年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2015年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンDには、ベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

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。

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（平成18年10月30日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監

監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き>

(1)投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(平成26年10月1日から平成27年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCマイセレクションS75】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (平成26年 9月30日現在)	第9期 (平成27年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	231,602,228	301,478,660
親投資信託受益証券	8,037,796,333	9,031,995,680
未収入金	1,450,000	-
未収利息	79	54
流動資産合計	8,270,848,640	9,333,474,394
資産合計	8,270,848,640	9,333,474,394
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,744,035	1,867,398
未払受託者報酬	1,217,108	1,616,210
未払委託者報酬	6,896,903	9,158,459
その他未払費用	381,909	507,969
流動負債合計	13,239,955	13,150,036
負債合計	13,239,955	13,150,036
純資産の部		
元本等		
元本	7,119,129,282	7,614,275,547
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,138,479,403	1,706,048,811
(分配準備積立金)	2,268,479,449	2,302,497,722
元本等合計	8,257,608,685	9,320,324,358
純資産合計	8,257,608,685	9,320,324,358
負債純資産合計	8,270,848,640	9,333,474,394

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成25年10月1日	自	平成26年10月1日
	至	平成26年9月30日	至	平成27年9月30日
営業収益				
受取利息		101,353		138,328
有価証券売買等損益		984,732,198		439,189,347
営業収益合計		984,833,551		439,327,675
営業費用				
受託者報酬		2,292,184		3,048,533
委託者報酬		12,988,958		17,274,899
その他費用		381,909		507,969
営業費用合計		15,663,051		20,831,401
営業利益又は営業損失（ ）		969,170,500		418,496,274
経常利益又は経常損失（ ）		969,170,500		418,496,274
当期純利益又は当期純損失（ ）		969,170,500		418,496,274
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（ ）		39,391,558		118,732,913
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		89,039,537		1,138,479,403
剰余金増加額又は欠損金減少額		137,848,369		423,084,931
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		137,848,369		423,084,931
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,187,445		155,278,884
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,187,445		155,278,884
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,138,479,403		1,706,048,811

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 (平成26年 9月30日現在)	第9期 (平成27年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,119,129,282口	7,614,275,547口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1599円 (11,599円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2241円 (12,241円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日			第9期 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	95,863円	費用控除後の配当等収益額	A	124,308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	929,683,079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	299,639,053円
収益調整金額	C	422,864,462円	収益調整金額	C	875,807,355円
分配準備積立金額	D	1,338,700,507円	分配準備積立金額	D	2,002,734,361円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,691,343,911円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,178,305,077円
当ファンドの期末残存口数	F	7,119,129,282口	当ファンドの期末残存口数	F	7,614,275,547口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,780円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,174円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (平成27年 9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第8期	第9期
	自 平成25年10月 1日 至 平成26年 9月30日	自 平成26年10月 1日 至 平成27年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,240,049,142円	7,119,129,282円
期中追加設定元本額	1,821,019,145円	1,409,831,941円
期中一部解約元本額	941,939,005円	914,685,676円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期	第9期
	(平成26年 9月30日現在)	(平成27年 9月30日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	945,477,063	332,481,823
合計	945,477,063	332,481,823

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	3,808,639,205	4,571,890,501	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,219,107,847	2,269,247,346	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,269,019,079	1,688,556,786	
	外国債券インデックス マザーファンド	177,931,650	502,301,047	
合計		6,474,697,781	9,031,995,680	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「DCマイセクション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27年9月30日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,998,784,326
株式	135,287,148,920
派生商品評価勘定	16,700,900
未収入金	52,006,100
未収配当金	1,090,298,660
未収利息	543
前払金	87,395,000
差入委託証拠金	267,089,000
流動資産合計	139,799,423,449
資産合計	139,799,423,449
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	104,156,380
未払金	112,540,335
未払解約金	107,775,131
流動負債合計	324,471,846
負債合計	324,471,846
純資産の部	
元本等	

平成27年 9月30日現在	
項目	金額（円）
元本	116,187,467,555
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,287,484,048
元本等合計	139,474,951,603
純資産合計	139,474,951,603
負債純資産合計	139,799,423,449

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成27年 9月30日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成27年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,187,467,555口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2004円 (1万口当たり純資産額) (12,004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27年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

平成27年 9月30日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年10月 1日
期首元本額	131,270,959,071円
期中追加設定元本額	23,230,029,508円
期中一部解約元本額	38,313,521,024円
期末元本額	116,187,467,555円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,192,446,144円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,136,729,555円
SBI資産設計オープン（分配型）	27,304,176円
SMT TOPIXインデックス・オープン	7,732,148,829円
世界経済インデックスファンド	669,789,994円
マイセクション25	27,765,884円
マイセクション50	73,671,301円
マイセクション75	74,349,736円
日本株式インデックス・オープン	14,271,654,489円
DCマイセクション25	4,831,557,129円

区分	平成27年 9月30日現在
DCマイセレクション50	15,832,007,753円
DCマイセレクション75	14,527,788,079円
DC日本株式インデックス・オープン	4,517,340,528円
DCマイセレクションS25	1,933,204,465円
DCマイセレクションS50	5,979,087,652円
DCマイセレクションS75	3,808,639,205円
DC日本株式インデックス・オープンS	2,951,294,914円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	448,923,891円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	494,877,403円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	260,958,448円
DC世界経済インデックスファンド	645,607,906円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	383,286,899円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	62,246,087円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	155,127,737円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	88,906,018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）	958,944,487円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,951,623円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	347,421,115円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,178,537,112円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	844,249,528円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,148,561,265円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,318,072,959円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,254,578,198円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	7,112,672,807円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,159,432,224円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,028,783,417円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,428,360,409円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,670,180,839円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	793,805,743円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,078,277,237円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	85,388,366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）	1,969,850,931円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,850,224,842円
日本株式ファンド・シリーズ2	506,318,779円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	43,004,907円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	58,847,965円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	156,670,256円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,508,464円
SMT インデックスバランス・オープン	54,109,860円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	24,413,989,296	
合計	24,413,989,296	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成27年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,138,460,480	-	4,051,005,000	87,455,480
合計		4,138,460,480	-	4,051,005,000	87,455,480

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	31,000	262.00	8,122,000	
日本水産	89,900	356.00	32,004,400	
マルハニチロ	14,900	1,717.00	25,583,300	
サカタのタネ	11,800	1,970.00	23,246,000	
ホクト	8,100	2,156.00	17,463,600	
住石ホールディングス	20,300	110.00	2,233,000	
日鉄鉱業	20,000	475.00	9,500,000	
三井松島産業	48,000	117.00	5,616,000	
国際石油開発帝石	385,400	1,063.50	409,872,900	
日本海洋掘削	2,200	2,548.00	5,605,600	
石油資源開発	10,400	3,145.00	32,708,000	
K&Oエナジーグループ	4,900	1,451.00	7,109,900	
ショーボンドホールディングス	7,100	4,565.00	32,411,500	

ミライト・ホールディングス	22,500	1,082.00	24,345,000
タマホーム	5,500	451.00	2,480,500
サンヨーホームズ	1,000	564.00	564,000
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,236.00	2,101,200
安藤・間	48,800	763.00	37,234,400
東急建設	26,000	986.00	25,636,000
コムシスホールディングス	32,600	1,422.00	46,357,200
ミサワホーム	9,100	723.00	6,579,300
高松コンストラクショングループ	5,500	2,530.00	13,915,000
東建コーポレーション	2,700	8,980.00	24,246,000
ヤマウラ	3,600	489.00	1,760,400
大成建設	380,000	778.00	295,640,000
大林組	219,000	1,018.00	222,942,000
清水建設	224,000	1,024.00	229,376,000
飛鳥建設	53,200	211.00	11,225,200
長谷工コーポレーション	91,500	1,350.00	123,525,000
松井建設	8,200	599.00	4,911,800
銭高組	10,000	591.00	5,910,000
鹿島建設	322,000	633.00	203,826,000
不動テトラ	55,400	159.00	8,808,600
大末建設	2,800	746.00	2,088,800
鉄建建設	45,000	303.00	13,635,000
西松建設	79,000	496.00	39,184,000
三井住友建設	296,800	144.00	42,739,200
大豊建設	23,000	502.00	11,546,000
前田建設工業	49,000	872.00	42,728,000
佐田建設	5,000	542.00	2,710,000
ナカノフドー建設	5,700	702.00	4,001,400
奥村組	69,000	636.00	43,884,000
東鉄工業	8,800	2,557.00	22,501,600
イチケン	9,000	418.00	3,762,000
浅沼組	24,000	330.00	7,920,000
戸田建設	92,000	528.00	48,576,000
熊谷組	92,000	373.00	34,316,000
青木あすなろ建設	4,900	738.00	3,616,200
北野建設	16,000	314.00	5,024,000
植木組	10,000	238.00	2,380,000
三井ホーム	10,000	598.00	5,980,000
矢作建設工業	9,000	1,069.00	9,621,000
ピーエス三菱	7,900	383.00	3,025,700
日本ハウスホールディングス	14,900	504.00	7,509,600
大東建託	27,300	12,125.00	331,012,500

新日本建設	8,900	608.00	5,411,200
N I P P O	17,000	2,035.00	34,595,000
東亜道路工業	14,000	423.00	5,922,000
前田道路	23,000	2,092.00	48,116,000
日本道路	22,000	597.00	13,134,000
東亜建設工業	55,000	287.00	15,785,000
若築建設	42,000	149.00	6,258,000
東洋建設	21,900	523.00	11,453,700
五洋建設	81,200	560.00	45,472,000
大林道路	9,000	653.00	5,877,000
世紀東急工業	10,700	528.00	5,649,600
福田組	12,000	1,135.00	13,620,000
住友林業	54,000	1,334.00	72,036,000
日本基礎技術	8,800	575.00	5,060,000
日成ビルド工業	21,000	370.00	7,770,000
巴コーポレーション	10,100	343.00	3,464,300
パナホーム	27,000	774.00	20,898,000
大和ハウス工業	215,800	2,947.50	636,070,500
ライト工業	11,700	1,129.00	13,209,300
積水ハウス	230,200	1,865.00	429,323,000
日特建設	9,800	544.00	5,331,200
北陸電気工事	4,000	1,009.00	4,036,000
ユアテック	12,000	1,082.00	12,984,000
西部電気工業	6,000	433.00	2,598,000
四電工	6,000	397.00	2,382,000
中電工	10,600	2,318.00	24,570,800
関電工	33,000	772.00	25,476,000
きんでん	48,600	1,514.00	73,580,400
東京エネシス	8,000	830.00	6,640,000
トーエネック	10,000	874.00	8,740,000
住友電設	5,800	1,445.00	8,381,000
日本電設工業	11,900	2,140.00	25,466,000
協和エクシオ	31,000	1,153.00	35,743,000
新日本空調	6,200	955.00	5,921,000
N D S	12,000	292.00	3,504,000
九電工	13,000	1,987.00	25,831,000
三機工業	14,900	900.00	13,410,000
日揮	74,000	1,583.50	117,179,000
中外炉工業	22,000	219.00	4,818,000
ヤマト	7,000	419.00	2,933,000
太平電業	10,000	1,229.00	12,290,000
高砂熱学工業	20,100	1,651.00	33,185,100

三晃金属工業	8,000	254.00	2,032,000	
朝日工業社	8,000	408.00	3,264,000	
明星工業	12,000	522.00	6,264,000	
大気社	10,400	2,700.00	28,080,000	
ダイダン	10,000	807.00	8,070,000	
日比谷総合設備	9,400	1,330.00	12,502,000	
東芝プラントシステム	11,900	1,168.00	13,899,200	
O S J Bホールディングス	9,900	220.00	2,178,000	
東洋エンジニアリング	36,000	288.00	10,368,000	
千代田化工建設	53,000	815.00	43,195,000	
新興プランテック	15,000	971.00	14,565,000	
日本製粉	45,000	746.00	33,570,000	
日清製粉グループ本社	80,200	1,733.00	138,986,600	
日東富士製粉	6,000	325.00	1,950,000	
昭和産業	30,000	465.00	13,950,000	
鳥越製粉	5,900	736.00	4,342,400	
中部飼料	7,000	1,044.00	7,308,000	
フィード・ワンホールディングス	44,300	143.00	6,334,900	
東洋精糖	11,000	110.00	1,210,000	
日本甜菜製糖	37,000	192.00	7,104,000	
三井製糖	29,000	498.00	14,442,000	
塩水港精糖	8,000	231.00	1,848,000	
森永製菓	66,000	587.00	38,742,000	
中村屋	17,000	442.00	7,514,000	
江崎グリコ	16,900	5,520.00	93,288,000	
名糖産業	3,300	1,311.00	4,326,300	
不二家	42,000	191.00	8,022,000	
山崎製パン	54,000	1,836.00	99,144,000	
第一屋製パン	11,000	112.00	1,232,000	
モロゾフ	11,000	401.00	4,411,000	
亀田製菓	4,100	4,985.00	20,438,500	
寿スピリッツ	1,700	3,920.00	6,664,000	
カルビー	27,100	3,855.00	104,470,500	
森永乳業	66,000	497.00	32,802,000	
六甲バター	3,300	1,835.00	6,055,500	
ヤクルト本社	39,200	5,940.00	232,848,000	
明治ホールディングス	43,400	8,740.00	379,316,000	
雪印メグミルク	17,200	2,286.00	39,319,200	
プリマハム	44,000	319.00	14,036,000	
日本ハム	54,000	2,436.00	131,544,000	
伊藤ハム	40,000	649.00	25,960,000	
丸大食品	38,000	471.00	17,898,000	

米久	2,400	2,328.00	5,587,200
S Foods	4,600	2,400.00	11,040,000
サッポロホールディングス	112,000	466.00	52,192,000
アサヒグループホールディングス	137,300	3,870.00	531,351,000
キリンホールディングス	296,500	1,565.50	464,170,750
宝ホールディングス	57,400	717.00	41,155,800
オエノンホールディングス	20,000	211.00	4,220,000
養命酒製造	2,500	1,857.00	4,642,500
コカ・コーラウエスト	24,800	2,325.00	57,660,000
コカ・コーライーストジャパン	25,900	1,929.00	49,961,100
サントリー食品インターナショナル	50,100	4,585.00	229,708,500
ダイトードリンコ	3,700	5,090.00	18,833,000
伊藤園	21,700	2,499.00	54,228,300
キーコーヒー	6,500	2,023.00	13,149,500
ユニカフェ	2,000	868.00	1,736,000
ジャパンフーズ	1,000	1,092.00	1,092,000
日清オイリオグループ	35,000	433.00	15,155,000
不二製油	19,600	1,550.00	30,380,000
かどや製油	700	2,628.00	1,839,600
J - オイルミルズ	31,000	343.00	10,633,000
キッコーマン	60,000	3,280.00	196,800,000
味の素	169,000	2,515.00	425,035,000
キューピー	37,200	2,373.00	88,275,600
ハウス食品グループ本社	27,100	2,020.00	54,742,000
カゴメ	26,300	1,919.00	50,469,700
焼津水産化学工業	3,500	984.00	3,444,000
アリアケジャパン	6,700	4,675.00	31,322,500
エバラ食品工業	1,200	1,910.00	2,292,000
ニチレイ	78,000	746.00	58,188,000
東洋水産	38,200	4,520.00	172,664,000
イトアンド	800	2,119.00	1,695,200
日清食品ホールディングス	31,000	5,490.00	170,190,000
永谷園	7,000	1,059.00	7,413,000
一正蒲鉾	2,600	1,021.00	2,654,600
フジッコ	7,100	2,424.00	17,210,400
ロック・フィールド	3,800	2,754.00	10,465,200
日本たばこ産業	432,500	3,695.00	1,598,087,500
ケンコーマヨネーズ	2,400	1,550.00	3,720,000
わらべや日洋	4,300	2,077.00	8,931,100
なとり	3,400	1,455.00	4,947,000
ユーグレナ	24,600	1,758.00	43,246,800
ミヨシ油脂	25,000	130.00	3,250,000

理研ビタミン	2,200	3,790.00	8,338,000
片倉工業	8,700	1,275.00	11,092,500
グンゼ	55,000	361.00	19,855,000
東洋紡	271,000	162.00	43,902,000
ユニチカ	199,000	57.00	11,343,000
富士紡ホールディングス	33,000	223.00	7,359,000
日清紡ホールディングス	43,000	1,346.00	57,878,000
倉敷紡績	70,000	212.00	14,840,000
シキボウ	39,000	119.00	4,641,000
日本毛織	22,000	1,006.00	22,132,000
トーア紡コーポレーション	2,900	614.00	1,780,600
ダイドーリミテッド	7,700	487.00	3,749,900
帝国繊維	7,200	1,392.00	10,022,400
帝人	280,000	362.00	101,360,000
東レ	529,000	1,030.50	545,134,500
サカイオーベックス	19,000	189.00	3,591,000
住江織物	19,000	338.00	6,422,000
日本フェルト	3,700	488.00	1,805,600
イチカワ	5,000	328.00	1,640,000
芦森工業	19,000	181.00	3,439,000
アツギ	57,000	108.00	6,156,000
ダイニック	13,000	160.00	2,080,000
セーレン	17,000	1,323.00	22,491,000
東海染工	10,000	117.00	1,170,000
小松精練	12,300	633.00	7,785,900
ワコールホールディングス	41,000	1,428.00	58,548,000
ホギメディカル	4,300	5,480.00	23,564,000
レナウン	16,400	129.00	2,115,600
クラウドディア	2,500	528.00	1,320,000
T S Iホールディングス	30,700	863.00	26,494,100
三陽商会	40,000	360.00	14,400,000
オンワードホールディングス	49,000	706.00	34,594,000
ルック	16,000	176.00	2,816,000
ゴールドウイン	3,200	5,400.00	17,280,000
デサント	15,900	1,687.00	26,823,300
キング	3,500	417.00	1,459,500
ヤマトインターナショナル	4,700	386.00	1,814,200
特種東海製紙	40,000	321.00	12,840,000
王子ホールディングス	280,000	512.00	143,360,000
日本製紙	33,000	1,823.00	60,159,000
三菱製紙	104,000	78.00	8,112,000
北越紀州製紙	42,400	649.00	27,517,600

中越パルプ工業	26,000	187.00	4,862,000	
巴川製紙所	11,000	208.00	2,288,000	
大王製紙	30,000	982.00	29,460,000	
レンゴー	60,000	462.00	27,720,000	
トーモク	22,000	246.00	5,412,000	
ザ・パック	4,800	2,636.00	12,652,800	
クラレ	107,900	1,486.00	160,339,400	
旭化成	426,000	840.00	357,840,000	
共和レザー	4,500	1,039.00	4,675,500	
コープケミカル	10,000	69.00	690,000	
昭和電工	455,000	131.00	59,605,000	
住友化学	503,000	602.00	302,806,000	
日本化成	13,000	124.00	1,612,000	
住友精化	14,000	764.00	10,696,000	
日産化学工業	44,400	2,619.00	116,283,600	
ラサ工業	26,000	125.00	3,250,000	
クレハ	48,000	429.00	20,592,000	
多木化学	4,000	695.00	2,780,000	
テイカ	11,000	461.00	5,071,000	
石原産業	115,000	103.00	11,845,000	
片倉チッカリン	4,000	252.00	1,008,000	
日東エフシー	4,000	865.00	3,460,000	
日本曹達	44,000	679.00	29,876,000	
東ソー	183,000	573.00	104,859,000	
トクヤマ	106,000	195.00	20,670,000	
セントラル硝子	70,000	522.00	36,540,000	
東亜合成	42,800	865.00	37,022,000	
ダイソー	27,000	410.00	11,070,000	
関東電化工業	16,000	760.00	12,160,000	
電気化学工業	142,000	470.00	66,740,000	
信越化学工業	122,600	6,115.00	749,699,000	
日本カーバイド工業	23,000	172.00	3,956,000	
堺化学工業	28,000	335.00	9,380,000	
エア・ウォーター	60,000	1,791.00	107,460,000	
大陽日酸	87,800	1,132.00	99,389,600	
日本化学工業	25,000	253.00	6,325,000	
日本パーカライズン	32,300	974.00	31,460,200	
高圧ガス工業	10,000	646.00	6,460,000	
チタン工業	8,000	214.00	1,712,000	
四国化成工業	10,000	1,008.00	10,080,000	
戸田工業	14,000	280.00	3,920,000	
ステラ ケミファ	3,500	1,160.00	4,060,000	

保土谷化学工業	20,000	158.00	3,160,000
日本触媒	10,800	8,100.00	87,480,000
大日精化工業	28,000	509.00	14,252,000
カネカ	92,000	878.00	80,776,000
三菱瓦斯化学	118,000	550.00	64,900,000
三井化学	311,000	381.00	118,491,000
J S R	67,500	1,718.00	115,965,000
東京応化工業	14,200	3,160.00	44,872,000
大阪有機化学工業	4,900	612.00	2,998,800
三菱ケミカルホールディングス	427,500	621.30	265,605,750
日本合成化学工業	16,000	746.00	11,936,000
ダイセル	96,200	1,462.00	140,644,400
住友ベークライト	64,000	438.00	28,032,000
積水化学工業	158,000	1,253.00	197,974,000
日本ゼオン	59,000	941.00	55,519,000
アイカ工業	20,600	2,387.00	49,172,200
宇部興産	344,000	208.00	71,552,000
積水樹脂	10,600	1,557.00	16,504,200
タキロン	14,000	489.00	6,846,000
旭有機材工業	24,000	219.00	5,256,000
日立化成	33,800	1,641.00	55,465,800
ニチバン	7,000	582.00	4,074,000
リケンテクノス	11,100	379.00	4,206,900
大倉工業	16,000	314.00	5,024,000
積水化成成品工業	19,000	381.00	7,239,000
群栄化学工業	18,000	274.00	4,932,000
タイガースポリマー	3,400	650.00	2,210,000
ミライアル	2,500	1,085.00	2,712,500
ダイキアクシス	1,300	992.00	1,289,600
ダイキョーニシカワ	2,200	5,530.00	12,166,000
日本化薬	44,000	1,242.00	54,648,000
カーリットホールディングス	6,300	483.00	3,042,900
日本精化	5,700	776.00	4,423,200
A D E K A	31,500	1,522.00	47,943,000
日油	56,000	818.00	45,808,000
ハリマ化成グループ	5,900	447.00	2,637,300
花王	183,900	5,403.00	993,611,700
第一工業製薬	15,000	347.00	5,205,000
ニイタカ	1,000	1,490.00	1,490,000
三洋化成工業	22,000	802.00	17,644,000
大日本塗料	39,000	160.00	6,240,000
日本ペイントホールディングス	59,200	2,081.00	123,195,200

関西ペイント	83,000	1,622.00	134,626,000
神東塗料	5,000	194.00	970,000
中国塗料	20,000	755.00	15,100,000
日本特殊塗料	5,300	943.00	4,997,900
藤倉化成	9,300	531.00	4,938,300
太陽ホールディングス	5,600	3,650.00	20,440,000
D I C	274,000	267.00	73,158,000
サカティンクス	14,000	950.00	13,300,000
東洋インキＳＣホールディングス	68,000	437.00	29,716,000
T & K T O K A	2,300	2,028.00	4,664,400
富士フィルムホールディングス	156,500	4,456.00	697,364,000
資生堂	121,600	2,600.50	316,220,800
ライオン	79,000	1,049.00	82,871,000
高砂香料工業	4,600	2,919.00	13,427,400
マンダム	6,900	3,900.00	26,910,000
ミルボン	4,000	3,955.00	15,820,000
ファンケル	15,900	1,712.00	27,220,800
コーセー	11,100	10,850.00	120,435,000
コタ	2,400	1,207.00	2,896,800
ドクターシーラボ	9,300	2,251.00	20,934,300
シーボン	800	2,538.00	2,030,400
ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	7,400.00	51,800,000
ノエビアホールディングス	4,300	2,584.00	11,111,200
アジュバンコスメジャパン	1,300	867.00	1,127,100
エステー	4,700	1,008.00	4,737,600
アグロ カネショウ	2,700	994.00	2,683,800
コニシ	5,400	2,063.00	11,140,200
長谷川香料	8,700	1,553.00	13,511,100
星光P M C	3,800	1,061.00	4,031,800
小林製薬	11,200	8,990.00	100,688,000
荒川化学工業	5,800	1,096.00	6,356,800
メック	5,300	653.00	3,460,900
日本高純度化学	1,900	2,194.00	4,168,600
J C U	1,900	3,970.00	7,543,000
新田ゼラチン	4,200	755.00	3,171,000
デクセリアルズ	15,300	1,542.00	23,592,600
アース製薬	4,900	4,550.00	22,295,000
イハラケミカル工業	10,500	1,237.00	12,988,500
北興化学工業	7,000	428.00	2,996,000
大成ラミック	1,900	2,663.00	5,059,700
クミアイ化学工業	14,100	845.00	11,914,500
日本農薬	15,600	803.00	12,526,800

アキレス	58,000	147.00	8,526,000	
有沢製作所	11,500	705.00	8,107,500	
日東電工	52,800	7,125.00	376,200,000	
レック	2,300	1,340.00	3,082,000	
きもと	12,400	255.00	3,162,000	
藤森工業	5,900	2,930.00	17,287,000	
前澤化成工業	4,800	1,032.00	4,953,600	
J S P	5,100	1,865.00	9,511,500	
エフピコ	6,100	4,425.00	26,992,500	
天馬	5,300	1,959.00	10,382,700	
信越ポリマー	13,400	541.00	7,249,400	
東リ	18,000	297.00	5,346,000	
ニフコ	15,300	4,075.00	62,347,500	
日本バルカー工業	28,000	288.00	8,064,000	
ユニ・チャーム	138,500	2,114.00	292,789,000	
協和発酵キリン	82,000	1,778.00	145,796,000	
武田薬品工業	256,300	5,237.00	1,342,243,100	
アステラス製薬	765,700	1,545.00	1,183,006,500	
大日本住友製薬	48,400	1,194.00	57,789,600	
塩野義製薬	106,800	4,275.00	456,570,000	
田辺三菱製薬	79,700	2,105.00	167,768,500	
わかもと製薬	8,000	265.00	2,120,000	
あすか製薬	8,100	1,296.00	10,497,600	
日本新薬	16,000	4,305.00	68,880,000	
バイオフェルミン製薬	1,100	3,350.00	3,685,000	
中外製薬	68,100	3,665.00	249,586,500	
科研製薬	12,000	11,050.00	132,600,000	
エーザイ	90,200	7,030.00	634,106,000	
ロート製薬	31,100	1,833.00	57,006,300	
小野薬品工業	31,100	14,130.00	439,443,000	
久光製薬	19,300	3,990.00	77,007,000	
有機合成薬品工業	4,000	259.00	1,036,000	
持田製薬	4,700	6,910.00	32,477,000	
参天製薬	125,800	1,599.00	201,154,200	
扶桑薬品工業	23,000	274.00	6,302,000	
日本ケミファ	9,000	558.00	5,022,000	
ツムラ	21,500	2,595.00	55,792,500	
日医工	16,000	3,135.00	50,160,000	
キッセイ薬品工業	12,100	2,720.00	32,912,000	
生化学工業	13,100	1,463.00	19,165,300	
栄研化学	5,700	2,037.00	11,610,900	
日水製薬	2,700	1,302.00	3,515,400	

鳥居薬品	4,700	2,804.00	13,178,800
JCRファーマ	5,300	2,282.00	12,094,600
東和薬品	3,500	7,650.00	26,775,000
富士製薬工業	1,900	2,002.00	3,803,800
沢井製薬	10,800	6,940.00	74,952,000
ゼリア新薬工業	14,000	1,474.00	20,636,000
第一三共	230,000	2,070.00	476,100,000
キョーリン製薬ホールディングス	18,200	1,826.00	33,233,200
大幸薬品	3,000	1,702.00	5,106,000
ダイト	3,000	2,657.00	7,971,000
大塚ホールディングス	147,000	3,808.00	559,776,000
大正製薬ホールディングス	16,400	6,860.00	112,504,000
日本コークス工業	61,300	101.00	6,191,300
昭和シェル石油	68,800	941.00	64,740,800
コスモ石油	189,000	164.00	30,996,000
ニチレキ	8,000	926.00	7,408,000
東燃ゼネラル石油	103,000	1,157.00	119,171,000
ユシロ化学工業	3,700	1,256.00	4,647,200
ピーピー・カストロール	2,800	1,187.00	3,323,600
富士石油	15,800	347.00	5,482,600
MORESCO	1,800	1,575.00	2,835,000
出光興産	32,400	1,826.00	59,162,400
JXホールディングス	758,800	430.90	326,966,920
横浜ゴム	41,200	2,101.00	86,561,200
東洋ゴム工業	30,900	2,578.00	79,660,200
ブリヂストン	230,800	4,126.00	952,280,800
住友ゴム工業	64,000	1,656.00	105,984,000
藤倉ゴム工業	5,700	528.00	3,009,600
オカモト	23,000	1,130.00	25,990,000
フコク	2,900	959.00	2,781,100
ニッタ	6,800	2,866.00	19,488,800
住友理工	12,700	1,040.00	13,208,000
三ツ星ベルト	17,000	908.00	15,436,000
バンドー化学	25,000	462.00	11,550,000
日東紡績	51,000	357.00	18,207,000
旭硝子	361,000	697.00	251,617,000
日本板硝子	330,000	101.00	33,330,000
石塚硝子	9,000	205.00	1,845,000
日本山村硝子	28,000	173.00	4,844,000
日本電気硝子	141,000	576.00	81,216,000
オハラ	2,600	574.00	1,492,400
住友大阪セメント	127,000	424.00	53,848,000

太平洋セメント	427,000	358.00	152,866,000	
デイ・シイ	7,800	371.00	2,893,800	
日本ヒューム	7,300	757.00	5,526,100	
日本コンクリート工業	12,400	403.00	4,997,200	
三谷セキサン	3,400	1,744.00	5,929,600	
ジャパンパイル	9,300	742.00	6,900,600	
東海カーボン	60,000	286.00	17,160,000	
日本カーボン	35,000	277.00	9,695,000	
東洋炭素	3,800	1,494.00	5,677,200	
ノリタケカンパニーリミテド	39,000	252.00	9,828,000	
TOTO	50,000	3,715.00	185,750,000	
日本碍子	86,000	2,277.00	195,822,000	
日本特殊陶業	58,900	2,729.00	160,738,100	
MARUWA	2,000	2,442.00	4,884,000	
品川リフラクトリーズ	18,000	248.00	4,464,000	
黒崎播磨	16,000	224.00	3,584,000	
ヨータイ	4,000	322.00	1,288,000	
イソライト工業	5,400	201.00	1,085,400	
東京窯業	9,000	177.00	1,593,000	
ニッカトー	2,600	386.00	1,003,600	
フジミインコーポレーテッド	6,600	1,611.00	10,632,600	
ニチアス	31,000	716.00	22,196,000	
ニチハ	9,200	1,650.00	15,180,000	
新日鐵住金	291,900	2,168.50	632,985,150	
神戸製鋼所	1,182,000	129.00	152,478,000	
合同製鐵	36,000	185.00	6,660,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	174,500	1,562.50	272,656,250	
日新製鋼	29,200	1,065.00	31,098,000	
東京製鐵	34,600	651.00	22,524,600	
共英製鋼	7,300	1,874.00	13,680,200	
大和工業	15,200	2,390.00	36,328,000	
東京鐵鋼	14,000	490.00	6,860,000	
大阪製鐵	4,300	1,673.00	7,193,900	
淀川製鋼所	9,400	2,228.00	20,943,200	
東洋鋼鈹	16,600	357.00	5,926,200	
丸一鋼管	21,000	2,700.00	56,700,000	
モリ工業	12,000	352.00	4,224,000	
大同特殊鋼	115,000	378.00	43,470,000	
日本高周波鋼業	29,000	97.00	2,813,000	
日本冶金工業	56,000	150.00	8,400,000	
山陽特殊製鋼	41,000	453.00	18,573,000	
愛知製鋼	41,000	450.00	18,450,000	

日立金属	69,600	1,383.00	96,256,800
日本金属	18,000	131.00	2,358,000
大太平洋金属	44,000	276.00	12,144,000
新日本電工	39,200	215.00	8,428,000
栗本鐵工所	37,000	185.00	6,845,000
虹技	10,000	159.00	1,590,000
日本鑄鉄管	8,000	183.00	1,464,000
三菱製鋼	46,000	219.00	10,074,000
日亜鋼業	10,300	262.00	2,698,600
日本精線	6,000	484.00	2,904,000
シンニッタン	6,900	549.00	3,788,100
新家工業	15,000	137.00	2,055,000
大紀アルミニウム工業所	12,000	312.00	3,744,000
日本軽金属ホールディングス	165,900	178.00	29,530,200
三井金属鉱業	186,000	214.00	39,804,000
東邦亜鉛	39,000	273.00	10,647,000
三菱マテリアル	427,000	362.00	154,574,000
住友金属鉱山	189,000	1,352.00	255,528,000
DOWAホールディングス	82,000	903.00	74,046,000
古河機械金属	107,000	252.00	26,964,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	6,700	3,130.00	20,971,000
東邦チタニウム	11,600	1,421.00	16,483,600
UACJ	78,000	191.00	14,898,000
古河電気工業	201,000	188.00	37,788,000
住友電気工業	257,500	1,523.50	392,301,250
フジクラ	95,000	492.00	46,740,000
昭和電線ホールディングス	75,000	77.00	5,775,000
東京特殊電線	1,200	876.00	1,051,200
タツタ電線	12,900	434.00	5,598,600
沖電線	9,000	205.00	1,845,000
カナレ電気	1,200	1,932.00	2,318,400
平河ヒューテック	1,800	1,252.00	2,253,600
リョービ	38,000	446.00	16,948,000
アーレスティ	8,000	702.00	5,616,000
アサヒホールディングス	10,300	1,793.00	18,467,900
稲葉製作所	3,700	1,233.00	4,562,100
宮地エンジニアリンググループ	23,000	204.00	4,692,000
トーカロ	4,600	2,160.00	9,936,000
アルファC o	2,800	1,170.00	3,276,000
SUMCO	54,200	1,066.00	57,777,200
川田テクノロジーズ	1,500	4,215.00	6,322,500
東洋製罐グループホールディングス	48,700	1,894.00	92,237,800

ホッカホールディングス	19,000	281.00	5,339,000
コロナ	3,600	1,085.00	3,906,000
横河ブリッジホールディングス	13,200	1,008.00	13,305,600
駒井ハルテック	15,000	204.00	3,060,000
高田機工	7,000	211.00	1,477,000
三和ホールディングス	64,600	820.00	52,972,000
文化シャッター	19,100	857.00	16,368,700
三協立山	9,200	1,854.00	17,056,800
アルインコ	2,900	1,079.00	3,129,100
東洋シャッター	2,000	881.00	1,762,000
LIXILグループ	101,600	2,420.00	245,872,000
日本フィルコン	6,000	481.00	2,886,000
ノーリツ	13,500	1,795.00	24,232,500
長府製作所	7,300	2,324.00	16,965,200
リンナイ	12,700	9,100.00	115,570,000
ダイニチ工業	3,500	716.00	2,506,000
日東精工	11,000	279.00	3,069,000
三洋工業	10,000	184.00	1,840,000
岡部	14,600	1,008.00	14,716,800
ジーテクト	6,400	1,361.00	8,710,400
東プレ	13,200	2,302.00	30,386,400
高周波熱錬	11,800	856.00	10,100,800
サンコール	4,200	611.00	2,566,200
モリテック スチール	4,300	279.00	1,199,700
パイオラックス	3,500	5,480.00	19,180,000
日本発條	59,400	1,155.00	68,607,000
中央発條	10,000	284.00	2,840,000
アドバネクス	1,600	1,609.00	2,574,400
立川ブラインド工業	3,500	814.00	2,849,000
三益半導体工業	5,200	1,091.00	5,673,200
日本ドライケミカル	900	2,192.00	1,972,800
日本製鋼所	98,000	378.00	37,044,000
三浦工業	30,500	1,381.00	42,120,500
タクマ	22,000	901.00	19,822,000
ツガミ	20,000	441.00	8,820,000
オークマ	44,000	744.00	32,736,000
東芝機械	37,000	374.00	13,838,000
アマダホールディングス	101,900	908.00	92,525,200
アイダエンジニアリング	14,900	983.00	14,646,700
滝澤鉄工所	21,000	173.00	3,633,000
富士機械製造	22,300	1,048.00	23,370,400
牧野フライス製作所	34,000	747.00	25,398,000

オーエスジー	31,100	2,255.00	70,130,500
ダイジェット工業	11,000	160.00	1,760,000
旭ダイヤモンド工業	18,700	1,081.00	20,214,700
D M G 森精機	43,100	1,511.00	65,124,100
ソディック	13,000	745.00	9,685,000
ディスコ	8,000	8,360.00	66,880,000
日東工器	4,000	2,286.00	9,144,000
パンチ工業	2,400	840.00	2,016,000
豊和工業	4,100	679.00	2,783,900
大阪機工	30,000	135.00	4,050,000
東洋機械金属	4,600	377.00	1,734,200
津田駒工業	17,000	118.00	2,006,000
島精機製作所	9,700	1,640.00	15,908,000
日阪製作所	8,600	892.00	7,671,200
やまびこ	10,800	972.00	10,497,600
ペガサスミシン製造	6,000	429.00	2,574,000
ナプテスコ	41,600	2,173.00	90,396,800
三井海洋開発	8,000	1,453.00	11,624,000
レオン自動機	5,200	555.00	2,886,000
S M C	20,500	26,055.00	534,127,500
新川	5,700	655.00	3,733,500
ホソカワミクロン	11,000	572.00	6,292,000
ユニオンツール	2,900	2,883.00	8,360,700
オイレス工業	8,100	1,771.00	14,345,100
日精エー・エス・ビー機械	2,500	2,355.00	5,887,500
サトーホールディングス	8,500	2,225.00	18,912,500
日本エアーテック	2,400	614.00	1,473,600
日精樹脂工業	5,200	961.00	4,997,200
ワイエイシイ	2,700	865.00	2,335,500
小松製作所	335,000	1,752.50	587,087,500
住友重機械工業	187,000	471.00	88,077,000
日立建機	30,500	1,597.00	48,708,500
日工	9,000	394.00	3,546,000
巴工業	2,800	1,595.00	4,466,000
井関農機	70,000	172.00	12,040,000
T O W A	5,600	737.00	4,127,200
丸山製作所	16,000	186.00	2,976,000
北川鉄工所	32,000	272.00	8,704,000
クボタ	328,000	1,635.50	536,444,000
荏原実業	2,100	1,399.00	2,937,900
三菱化工機	24,000	274.00	6,576,000
月島機械	12,000	992.00	11,904,000

帝国電機製作所	4,500	790.00	3,555,000	
新東工業	15,500	936.00	14,508,000	
澁谷工業	5,700	1,797.00	10,242,900	
アイチ コーポレーション	9,700	670.00	6,499,000	
小森コーポレーション	16,600	1,227.00	20,368,200	
鶴見製作所	5,100	1,916.00	9,771,600	
住友精密工業	11,000	458.00	5,038,000	
酒井重工業	13,000	228.00	2,964,000	
荏原製作所	142,000	440.00	62,480,000	
石井鐵工所	12,000	185.00	2,220,000	
西島製作所	6,700	857.00	5,741,900	
北越工業	6,700	776.00	5,199,200	
ダイキン工業	95,100	6,676.00	634,887,600	
オルガノ	13,000	436.00	5,668,000	
トーヨーカネツ	39,000	190.00	7,410,000	
栗田工業	38,700	2,533.00	98,027,100	
椿本チエイン	35,000	747.00	26,145,000	
大同工業	16,000	197.00	3,152,000	
日本コンベヤ	21,000	179.00	3,759,000	
木村化工機	6,800	481.00	3,270,800	
アネスト岩田	10,200	783.00	7,986,600	
ダイフク	32,300	1,635.00	52,810,500	
サムコ	1,100	875.00	962,500	
加藤製作所	15,000	480.00	7,200,000	
油研工業	14,000	216.00	3,024,000	
タダノ	32,000	1,321.00	42,272,000	
フジテック	19,000	1,040.00	19,760,000	
C K D	18,200	983.00	17,890,600	
キトー	7,100	886.00	6,290,600	
平和	19,400	2,049.00	39,750,600	
理想科学工業	7,900	2,030.00	16,037,000	
S A N K Y O	18,200	4,250.00	77,350,000	
日本金銭機械	6,000	1,276.00	7,656,000	
マースエンジニアリング	3,700	2,012.00	7,444,400	
福島工業	3,600	2,417.00	8,701,200	
オーイズミ	2,300	587.00	1,350,100	
ダイコク電機	2,700	1,615.00	4,360,500	
竹内製作所	8,200	2,080.00	17,056,000	
アマノ	21,800	1,376.00	29,996,800	
J U K I	9,700	1,273.00	12,348,100	
サンデンホールディングス	40,000	371.00	14,840,000	
蛇の目マシン工業	6,300	824.00	5,191,200	

マックス	10,000	1,125.00	11,250,000
グローリー	20,900	2,817.00	58,875,300
新晃工業	4,600	1,252.00	5,759,200
大和冷機工業	10,500	815.00	8,557,500
セガサミーホールディングス	70,200	1,164.00	81,712,800
日本ピストンリング	2,500	1,761.00	4,402,500
リケン	28,000	395.00	11,060,000
T P R	7,300	2,713.00	19,804,900
ホシザキ電機	14,300	8,350.00	119,405,000
大豊工業	5,300	1,283.00	6,799,900
日本精工	134,100	1,153.00	154,617,300
N T N	151,000	490.00	73,990,000
ジェイテクト	69,600	1,664.00	115,814,400
不二越	61,000	494.00	30,134,000
日本トムソン	22,000	494.00	10,868,000
T H K	43,400	1,894.00	82,199,600
ユーシン精機	2,900	2,032.00	5,892,800
前澤給装工業	2,500	1,526.00	3,815,000
イーグル工業	9,100	2,126.00	19,346,600
前澤工業	4,800	379.00	1,819,200
日本ピラー工業	7,100	1,008.00	7,156,800
キッツ	29,300	530.00	15,529,000
日立工機	17,500	832.00	14,560,000
マキタ	42,600	6,330.00	269,658,000
日立造船	51,100	619.00	31,630,900
三菱重工業	1,094,000	532.40	582,445,600
I H I	471,000	306.00	144,126,000
イビデン	42,800	1,563.00	66,896,400
コニカミノルタ	152,900	1,254.00	191,736,600
ブラザー工業	84,400	1,434.00	121,029,600
ミネベア	97,000	1,261.00	122,317,000
日立製作所	1,568,000	600.90	942,211,200
東芝	1,374,000	300.40	412,749,600
三菱電機	653,000	1,090.00	711,770,000
富士電機	182,000	432.00	78,624,000
東洋電機製造	13,000	389.00	5,057,000
安川電機	80,000	1,212.00	96,960,000
シンフォニアテクノロジー	45,000	176.00	7,920,000
明電舎	60,000	355.00	21,300,000
オリジン電気	10,000	307.00	3,070,000
山洋電気	15,000	713.00	10,695,000
デンヨー	5,600	1,890.00	10,584,000

東芝テック	47,000	380.00	17,860,000
芝浦メカトロニクス	11,000	203.00	2,233,000
マブチモーター	18,700	5,170.00	96,679,000
日本電産	72,200	8,186.00	591,029,200
東光高岳	3,300	1,360.00	4,488,000
ダイヘン	36,000	564.00	20,304,000
田淵電機	7,400	777.00	5,749,800
ヤーマン	800	1,675.00	1,340,000
JVCケンウッド	48,000	267.00	12,816,000
ミマキエンジニアリング	3,900	626.00	2,441,400
第一精工	2,700	1,458.00	3,936,600
日新電機	15,300	735.00	11,245,500
大崎電気工業	12,000	589.00	7,068,000
オムロン	70,500	3,585.00	252,742,500
日東工業	10,500	2,087.00	21,913,500
I D E C	7,700	921.00	7,091,700
不二電機工業	600	1,397.00	838,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	126,000	450.00	56,700,000
サクサホールディングス	16,000	220.00	3,520,000
メルコホールディングス	3,600	1,954.00	7,034,400
テクノメディカ	1,500	2,466.00	3,699,000
日本電気	845,000	367.00	310,115,000
富士通	629,000	518.50	326,136,500
沖電気工業	230,000	186.00	42,780,000
岩崎通信機	29,000	78.00	2,262,000
電気興業	19,000	540.00	10,260,000
サンケン電気	33,000	402.00	13,266,000
ナカヨ	6,000	325.00	1,950,000
アイホン	3,800	1,791.00	6,805,800
ルネサスエレクトロニクス	33,800	631.00	21,327,800
セイコーエプソン	89,100	1,687.00	150,311,700
ワコム	51,500	440.00	22,660,000
アルバック	11,000	1,940.00	21,340,000
アクセル	3,000	1,440.00	4,320,000
E I Z O	6,000	2,780.00	16,680,000
ジャパンディスプレイ	134,200	343.00	46,030,600
日本信号	18,000	1,152.00	20,736,000
京三製作所	15,000	319.00	4,785,000
能美防災	8,700	1,297.00	11,283,900
ホーチキ	4,800	1,138.00	5,462,400
エレコム	5,400	1,371.00	7,403,400
日本無線	14,000	387.00	5,418,000

パナソニック	799,400	1,203.50	962,077,900
シャープ	552,000	137.00	75,624,000
アンリツ	39,200	725.00	28,420,000
富士通ゼネラル	20,000	1,296.00	25,920,000
日立国際電気	17,000	1,259.00	21,403,000
ソニー	458,800	2,898.50	1,329,831,800
T D K	39,400	6,730.00	265,162,000
帝国通信工業	16,000	189.00	3,024,000
ミツミ電機	23,100	660.00	15,246,000
タムラ製作所	25,000	331.00	8,275,000
アルプス電気	53,600	3,355.00	179,828,000
池上通信機	22,000	134.00	2,948,000
パイオニア	98,100	259.00	25,407,900
日本電波工業	5,900	830.00	4,897,000
鈴木	1,700	545.00	926,500
日本トリム	1,600	4,470.00	7,152,000
ローランド ディー . ジー .	2,600	2,558.00	6,650,800
フォスター電機	7,600	2,381.00	18,095,600
クラリオン	34,000	377.00	12,818,000
S M K	19,000	494.00	9,386,000
ヨコオ	5,100	590.00	3,009,000
東光	13,000	282.00	3,666,000
ホシデン	19,800	631.00	12,493,800
ヒロセ電機	11,100	12,970.00	143,967,000
日本航空電子工業	19,000	1,783.00	33,877,000
T O A	7,000	1,078.00	7,546,000
日立マクセル	13,000	1,725.00	22,425,000
古野電気	7,800	788.00	6,146,400
ユニデンホールディングス	18,000	177.00	3,186,000
アルパイン	15,600	1,305.00	20,358,000
スミダコーポレーション	5,400	781.00	4,217,400
アイコム	3,600	2,480.00	8,928,000
リオン	2,500	1,781.00	4,452,500
船井電機	6,600	1,101.00	7,266,600
横河電機	65,300	1,247.00	81,429,100
新電元工業	25,000	384.00	9,600,000
アズビル	21,300	3,020.00	64,326,000
東亜ディーケーケー	2,800	459.00	1,285,200
日本光電工業	27,300	1,978.00	53,999,400
チノー	2,300	1,056.00	2,428,800
共和電業	8,000	412.00	3,296,000
日本電子材料	2,800	629.00	1,761,200

堀場製作所	12,100	4,350.00	52,635,000
アドバンテスト	44,500	856.00	38,092,000
小野測器	3,200	958.00	3,065,600
エスベック	7,300	1,154.00	8,424,200
パナソニック デバイスSUNX	5,800	610.00	3,538,000
キーエンス	14,800	53,200.00	787,360,000
日置電機	3,400	2,104.00	7,153,600
シスメックス	50,600	6,280.00	317,768,000
メガチップス	6,800	1,147.00	7,799,600
OBARA GROUP	4,200	4,685.00	19,677,000
澤藤電機	4,000	217.00	868,000
コーセル	9,500	1,156.00	10,982,000
新日本無線	5,000	532.00	2,660,000
オブテックス	4,800	2,204.00	10,579,200
千代田インテグレ	3,400	2,555.00	8,687,000
レーザーテック	6,700	1,215.00	8,140,500
スタンレー電気	46,900	2,375.00	111,387,500
岩崎電気	22,000	239.00	5,258,000
ウシオ電機	39,600	1,433.00	56,746,800
岡谷電機産業	3,600	375.00	1,350,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,100	395.00	2,409,500
日本セラミック	3,800	1,764.00	6,703,200
遠藤照明	3,000	1,236.00	3,708,000
日本デジタル研究所	5,500	1,647.00	9,058,500
古河電池	5,000	716.00	3,580,000
双信電機	3,200	329.00	1,052,800
山一電機	7,600	911.00	6,923,600
図研	4,700	1,126.00	5,292,200
日本電子	28,000	684.00	19,152,000
カシオ計算機	65,400	2,165.00	141,591,000
ファナック	68,000	18,315.00	1,245,420,000
日本シイエムケイ	16,700	221.00	3,690,700
エンプラス	3,000	4,130.00	12,390,000
大真空	12,000	231.00	2,772,000
ローム	32,200	5,290.00	170,338,000
浜松ホトニクス	51,000	2,700.00	137,700,000
三井ハイテック	8,700	642.00	5,585,400
新光電気工業	24,700	671.00	16,573,700
京セラ	107,200	5,460.00	585,312,000
太陽誘電	34,200	1,554.00	53,146,800
村田製作所	68,500	15,370.00	1,052,845,000
ユーシン	8,200	820.00	6,724,000

双葉電子工業	11,200	1,541.00	17,259,200
北陸電気工業	28,000	139.00	3,892,000
ニチコン	20,600	857.00	17,654,200
日本ケミコン	53,000	261.00	13,833,000
K O A	9,100	1,037.00	9,436,700
市光工業	16,000	191.00	3,056,000
小糸製作所	39,100	3,885.00	151,903,500
ミツバ	12,000	1,596.00	19,152,000
スター精密	12,400	1,626.00	20,162,400
S C R E E Nホールディングス	62,000	582.00	36,084,000
キャノン電子	6,000	1,926.00	11,556,000
キャノン	351,500	3,454.00	1,214,081,000
リコー	196,300	1,204.50	236,443,350
M U T O Hホールディングス	9,000	283.00	2,547,000
東京エレクトロン	54,900	5,614.00	308,208,600
トヨタ紡織	23,100	2,021.00	46,685,100
鬼怒川ゴム工業	15,000	592.00	8,880,000
ユニプレス	12,700	2,270.00	28,829,000
豊田自動織機	59,600	5,660.00	337,336,000
モリタホールディングス	11,700	1,100.00	12,870,000
三櫻工業	9,200	711.00	6,541,200
デンソー	161,400	5,036.00	812,810,400
東海理化電機製作所	17,200	2,457.00	42,260,400
三井造船	253,000	172.00	43,516,000
川崎重工業	474,000	411.00	194,814,000
名村造船所	18,500	868.00	16,058,000
サノヤスホールディングス	11,000	236.00	2,596,000
日本車輛製造	24,000	287.00	6,888,000
ニチユ三菱フォークリフト	7,500	470.00	3,525,000
近畿車輛	10,000	354.00	3,540,000
日産自動車	916,400	1,094.00	1,002,541,600
いすゞ自動車	206,400	1,195.00	246,648,000
トヨタ自動車	900,700	6,971.00	6,278,779,700
日野自動車	93,200	1,213.00	113,051,600
三菱自動車工業	239,300	912.00	218,241,600
エフテック	4,400	1,026.00	4,514,400
レシップホールディングス	2,500	840.00	2,100,000
G M B	1,400	1,053.00	1,474,200
ファルテック	1,400	1,364.00	1,909,600
武蔵精密工業	7,100	2,089.00	14,831,900
日産車体	28,700	1,317.00	37,797,900
新明和工業	26,000	1,202.00	31,252,000

極東開発工業	12,100	1,192.00	14,423,200
日信工業	12,000	1,788.00	21,456,000
トピー工業	56,000	246.00	13,776,000
ティラド	26,000	188.00	4,888,000
曙ブレーキ工業	29,700	379.00	11,256,300
タチエス	10,400	1,554.00	16,161,600
NOK	31,700	2,573.00	81,564,100
フタバ産業	21,900	431.00	9,438,900
カヤバ工業	74,000	315.00	23,310,000
シロキ工業	15,000	291.00	4,365,000
大同メタル工業	9,400	992.00	9,324,800
プレス工業	33,100	455.00	15,060,500
ミクニ	7,500	446.00	3,345,000
カルソニックカンセイ	50,000	893.00	44,650,000
太平洋工業	13,600	1,191.00	16,197,600
ケーヒン	15,100	1,686.00	25,458,600
河西工業	8,300	1,331.00	11,047,300
アイシン精機	59,900	4,000.00	239,600,000
富士機工	7,800	472.00	3,681,600
マツダ	194,600	1,880.00	365,848,000
ダイハツ工業	77,900	1,381.00	107,579,900
今仙電機製作所	5,800	1,023.00	5,933,400
本田技研工業	587,500	3,539.00	2,079,162,500
スズキ	136,500	3,662.00	499,863,000
富士重工業	222,200	4,283.00	951,682,600
安永	3,300	513.00	1,692,900
ヤマハ発動機	92,200	2,391.00	220,450,200
ショーワ	15,600	950.00	14,820,000
T B K	9,100	446.00	4,058,600
エクセディ	9,000	2,644.00	23,796,000
豊田合成	21,200	2,343.00	49,671,600
愛三工業	10,400	1,093.00	11,367,200
盟和産業	600	1,166.00	699,600
ヨロズ	6,200	2,442.00	15,140,400
エフ・シー・シー	9,800	1,913.00	18,747,400
シマノ	26,300	16,740.00	440,262,000
テイ・エス テック	13,800	3,250.00	44,850,000
ジャムコ	2,600	4,590.00	11,934,000
テルモ	100,100	3,370.00	337,337,000
クリエートメディック	2,200	923.00	2,030,600
日機装	21,200	799.00	16,938,800
島津製作所	78,000	1,715.00	133,770,000

JMS	12,000	277.00	3,324,000
モリテックス	1,400	217.00	303,800
長野計器	4,200	755.00	3,171,000
ブイ・テクノロジー	1,300	3,075.00	3,997,500
東京計器	23,000	212.00	4,876,000
愛知時計電機	9,000	316.00	2,844,000
オーバル	6,500	234.00	1,521,000
東京精密	11,800	2,211.00	26,089,800
マニー	6,000	2,320.00	13,920,000
ニコン	121,900	1,442.00	175,779,800
トプコン	19,700	1,561.00	30,751,700
オリンパス	97,300	3,715.00	361,469,500
理研計器	5,800	1,253.00	7,267,400
タムロン	5,300	2,177.00	11,538,100
H O Y A	151,900	3,903.00	592,865,700
ノーリツ鋼機	5,900	575.00	3,392,500
エー・アンド・デイ	6,000	403.00	2,418,000
シチズンホールディングス	80,400	824.00	66,249,600
リズム時計工業	29,000	161.00	4,669,000
大研医器	4,600	986.00	4,535,600
メニコン	3,300	2,689.00	8,873,700
松風	3,200	1,495.00	4,784,000
セイコーホールディングス	46,000	693.00	31,878,000
ニプロ	41,700	1,226.00	51,124,200
パラマウントベッドホールディングス	6,900	3,550.00	24,495,000
トランザクション	1,000	433.00	433,000
S H O - B I	2,200	400.00	880,000
ニホンフラッシュ	1,900	1,216.00	2,310,400
前田工織	7,200	930.00	6,696,000
永大産業	9,000	411.00	3,699,000
アートネイチャー	4,700	1,202.00	5,649,400
ダンロップスポーツ	4,100	1,122.00	4,600,200
バンダイナムコホールディングス	72,000	2,770.00	199,440,000
アイフィスジャパン	1,100	465.00	511,500
共立印刷	11,800	306.00	3,610,800
フランスベッドホールディングス	9,200	846.00	7,783,200
パイロットコーポレーション	11,400	4,925.00	56,145,000
萩原工業	1,400	1,927.00	2,697,800
トッパン・フォームズ	11,700	1,416.00	16,567,200
フジシールインターナショナル	7,900	3,440.00	27,176,000
タカラトミー	23,400	583.00	13,642,200
廣濟堂	6,100	389.00	2,372,900

A s - m e エステール	1,700	710.00	1,207,000
アーク	20,600	106.00	2,183,600
タカノ	2,900	639.00	1,853,100
プロネクサス	6,100	795.00	4,849,500
ホクシン	5,200	130.00	676,000
ウッドワン	11,000	240.00	2,640,000
大建工業	26,000	363.00	9,438,000
凸版印刷	184,000	961.00	176,824,000
大日本印刷	193,000	1,154.00	222,722,000
図書印刷	10,000	482.00	4,820,000
共同印刷	20,000	330.00	6,600,000
日本写真印刷	11,000	2,277.00	25,047,000
光村印刷	6,000	244.00	1,464,000
宝印刷	3,400	1,249.00	4,246,600
アシックス	60,800	2,838.00	172,550,400
ツツミ	3,300	2,457.00	8,108,100
小松ウオール工業	2,000	2,039.00	4,078,000
ヤマハ	48,000	2,638.00	126,624,000
河合楽器製作所	2,300	2,044.00	4,701,200
クリナップ	6,000	876.00	5,256,000
ピジョン	37,000	2,783.00	102,971,000
兼松日産農林	8,000	150.00	1,200,000
キングジム	5,400	812.00	4,384,800
リンテック	15,500	2,507.00	38,858,500
T A S A K I	1,200	1,336.00	1,603,200
イトーキ	13,700	761.00	10,425,700
任天堂	40,200	20,060.00	806,412,000
三菱鉛筆	4,900	5,640.00	27,636,000
タカラスタンダード	27,000	848.00	22,896,000
コクヨ	33,900	1,265.00	42,883,500
ナカバヤシ	14,000	310.00	4,340,000
グローブライド	3,200	1,400.00	4,480,000
岡村製作所	25,100	1,076.00	27,007,600
美津濃	35,000	544.00	19,040,000
アデランス	7,600	951.00	7,227,600
東京電力	553,800	797.00	441,378,600
中部電力	199,800	1,761.00	351,847,800
関西電力	266,400	1,327.00	353,512,800
中国電力	90,300	1,647.00	148,724,100
北陸電力	64,000	1,606.00	102,784,000
東北電力	163,100	1,617.00	263,732,700
四国電力	58,800	1,945.00	114,366,000

九州電力	144,200	1,301.00	187,604,200
北海道電力	61,100	1,159.00	70,814,900
沖縄電力	6,400	2,687.00	17,196,800
電源開発	47,300	3,645.00	172,408,500
東京瓦斯	777,000	577.80	448,950,600
大阪瓦斯	676,000	453.00	306,228,000
東邦瓦斯	165,000	704.00	116,160,000
北海道瓦斯	14,000	277.00	3,878,000
広島ガス	10,300	413.00	4,253,900
西部瓦斯	74,000	273.00	20,202,000
静岡ガス	18,500	775.00	14,337,500
メタウォーター	4,100	3,015.00	12,361,500
SBSホールディングス	6,400	993.00	6,355,200
東武鉄道	349,000	513.00	179,037,000
相鉄ホールディングス	112,000	653.00	73,136,000
東京急行電鉄	355,000	875.00	310,625,000
京浜急行電鉄	179,000	950.00	170,050,000
小田急電鉄	209,000	1,074.00	224,466,000
京王電鉄	182,000	848.00	154,336,000
京成電鉄	98,000	1,309.00	128,282,000
富士急行	18,000	1,118.00	20,124,000
新京成電鉄	8,000	405.00	3,240,000
東日本旅客鉄道	119,400	10,055.00	1,200,567,000
西日本旅客鉄道	62,800	7,481.00	469,806,800
東海旅客鉄道	58,500	19,225.00	1,124,662,500
西武ホールディングス	52,000	2,417.00	125,684,000
鴻池運輸	8,100	1,485.00	12,028,500
西日本鉄道	84,000	585.00	49,140,000
ハマキョウレックス	4,600	2,151.00	9,894,600
サカイ引越センター	1,100	5,950.00	6,545,000
近鉄グループホールディングス	657,000	429.00	281,853,000
阪急阪神ホールディングス	438,000	730.00	319,740,000
南海電気鉄道	146,000	610.00	89,060,000
京阪電気鉄道	146,000	796.00	116,216,000
神戸電鉄	16,000	348.00	5,568,000
名糖運輸	2,700	681.00	1,838,700
名古屋鉄道	238,000	469.00	111,622,000
山陽電気鉄道	24,000	469.00	11,256,000
日本通運	253,000	569.00	143,957,000
ヤマトホールディングス	112,100	2,284.00	256,036,400
山九	79,000	577.00	45,583,000
丸運	3,500	251.00	878,500

丸全昭和運輸	22,000	419.00	9,218,000
センコー	29,000	840.00	24,360,000
トナミホールディングス	13,000	398.00	5,174,000
日本梱包運輸倉庫	21,400	2,107.00	45,089,800
日本石油輸送	7,000	226.00	1,582,000
福山通運	40,000	645.00	25,800,000
セイノーホールディングス	50,500	1,243.00	62,771,500
神奈川中央交通	8,000	661.00	5,288,000
日立物流	13,600	1,965.00	26,724,000
丸和運輸機関	1,200	2,492.00	2,990,400
日本郵船	552,000	276.00	152,352,000
商船三井	343,000	286.00	98,098,000
川崎汽船	286,000	262.00	74,932,000
N S ユナイテッド海運	38,000	235.00	8,930,000
飯野海運	37,000	540.00	19,980,000
共栄タンカー	13,000	168.00	2,184,000
日本航空	125,000	4,215.00	526,875,000
A N Aホールディングス	1,283,000	334.40	429,035,200
パスコ	6,000	292.00	1,752,000
ランコム	1,900	6,360.00	12,084,000
日新	25,000	344.00	8,600,000
三菱倉庫	43,000	1,382.00	59,426,000
三井倉庫ホールディングス	38,000	348.00	13,224,000
住友倉庫	48,000	576.00	27,648,000
澁澤倉庫	17,000	305.00	5,185,000
東陽倉庫	11,000	266.00	2,926,000
乾汽船	4,400	813.00	3,577,200
日本トランスシティ	15,000	406.00	6,090,000
ケイヒン	12,000	175.00	2,100,000
中央倉庫	3,800	892.00	3,389,600
安田倉庫	5,100	910.00	4,641,000
東洋埠頭	20,000	186.00	3,720,000
宇徳	5,300	451.00	2,390,300
上組	78,000	976.00	76,128,000
サンリツ	1,600	505.00	808,000
キムラユニティー	1,700	1,296.00	2,203,200
キューソー流通システム	1,800	2,420.00	4,356,000
郵船ロジスティクス	6,000	1,223.00	7,338,000
近鉄エクスプレス	11,600	2,102.00	24,383,200
東海運	3,500	272.00	952,000
エーアイティー	3,000	929.00	2,787,000
内外トランスライン	1,600	1,037.00	1,659,200

NEC ネットエスアイ	8,100	2,133.00	17,277,300
システナ	6,300	1,099.00	6,923,700
デジタルアーツ	3,400	1,863.00	6,334,200
新日鉄住金ソリューションズ	5,400	5,040.00	27,216,000
キューブシステム	2,800	578.00	1,618,400
コア	2,700	801.00	2,162,700
ソフトクリエイティブホールディングス	2,100	911.00	1,913,100
ITホールディングス	21,400	2,703.00	57,844,200
ネオス	1,700	516.00	877,200
電算システム	2,200	1,974.00	4,342,800
グリー	39,000	535.00	20,865,000
コーエーテクモホールディングス	17,520	1,523.00	26,682,960
三菱総合研究所	2,500	2,938.00	7,345,000
ボルテージ	1,200	1,505.00	1,806,000
電算	700	2,191.00	1,533,700
AGS	900	1,000.00	900,000
ファインデックス	4,200	882.00	3,704,400
ヒト・コミュニケーションズ	700	2,028.00	1,419,600
ブレインパッド	1,000	466.00	466,000
KLab	10,000	1,152.00	11,520,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	4,300	1,079.00	4,639,700
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	765.00	1,147,500
ネクソン	61,000	1,585.00	96,685,000
アイスタイル	5,400	987.00	5,329,800
エムアップ	1,800	596.00	1,072,800
エイチーム	2,400	1,620.00	3,888,000
enish	1,800	899.00	1,618,200
コロプラ	17,700	1,916.00	33,913,200
モバイルクリエイティブ	3,800	433.00	1,645,400
オルトプラス	2,400	463.00	1,111,200
ブロードリーフ	6,700	1,213.00	8,127,100
ハーツユナイテッドグループ	1,900	1,644.00	3,123,600
ブイキューブ	1,600	2,525.00	4,040,000
ベリサーブ	700	933.00	653,100
ティーガイア	6,400	1,859.00	11,897,600
日本アジアグループ	5,500	418.00	2,299,000
豆蔵ホールディングス	5,000	461.00	2,305,000
テクマトリックス	2,800	910.00	2,548,000
GMOペイメントゲートウェイ	5,600	4,600.00	25,760,000
ザッパラス	3,600	480.00	1,728,000
インターネットイニシアティブ	10,400	2,138.00	22,235,200
GMOクラウド	1,400	724.00	1,013,600

ビットアイル	7,300	915.00	6,679,500
S R Aホールディングス	3,400	1,898.00	6,453,200
朝日ネット	6,500	517.00	3,360,500
コムチュア	1,100	1,926.00	2,118,600
g u m i	6,600	1,285.00	8,481,000
パイプドHD	800	1,109.00	887,200
フェイス	1,900	1,423.00	2,703,700
ハイマックス	900	1,155.00	1,039,500
野村総合研究所	40,150	4,575.00	183,686,250
サイバネットシステム	5,300	398.00	2,109,400
C Eホールディングス	1,000	856.00	856,000
インテージホールディングス	3,700	1,705.00	6,308,500
東邦システムサイエンス	1,900	608.00	1,155,200
ソースネクスト	3,200	451.00	1,443,200
ティー・ワイ・オー	8,900	188.00	1,673,200
クレスコ	1,500	1,690.00	2,535,000
フジ・メディア・ホールディングス	67,100	1,394.00	93,537,400
オービック	22,200	5,450.00	120,990,000
ジャストシステム	11,700	882.00	10,319,400
T D Cソフトウェアエンジニアリング	1,400	1,201.00	1,681,400
ヤフー	461,800	454.00	209,657,200
トレンドマイクロ	31,300	4,215.00	131,929,500
インフォメーション・ディベロプメント	1,200	922.00	1,106,400
日本オラクル	10,300	5,040.00	51,912,000
アルファシステムズ	2,100	1,839.00	3,861,900
フューチャーアーキテクト	7,700	675.00	5,197,500
C A C H o l d i n g s	4,800	927.00	4,449,600
ソフトバンク・テクノロジー	1,700	1,143.00	1,943,100
トーセ	1,700	704.00	1,196,800
オービックビジネスコンサルタント	4,100	5,670.00	23,247,000
伊藤忠テクノソリューションズ	14,600	2,545.00	37,157,000
アイティフォー	7,800	482.00	3,759,600
東計電算	1,100	2,046.00	2,250,600
エックスネット	600	1,455.00	873,000
大塚商会	17,300	5,820.00	100,686,000
サイボウズ	8,600	305.00	2,623,000
ソフトブレーン	9,400	158.00	1,485,200
電通国際情報サービス	4,000	1,647.00	6,588,000
E Mシステムズ	1,000	2,240.00	2,240,000
ウェザーニューズ	1,900	3,800.00	7,220,000
C I J	5,800	490.00	2,842,000
東洋ビジネスエンジニアリング	600	1,321.00	792,600

日本エンタープライズ	5,700	256.00	1,459,200
WOWOW	3,100	3,260.00	10,106,000
フュージョンパートナー	3,600	486.00	1,749,600
日本コロムビア	2,200	430.00	946,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	4,500	455.00	2,047,500
ネットワンシステムズ	26,200	676.00	17,711,200
アルゴグラフィックス	2,700	1,731.00	4,673,700
マーベラス	10,900	914.00	9,962,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,800	1,359.00	17,395,200
日本ユニシス	17,800	1,233.00	21,947,400
兼松エレクトロニクス	4,100	1,740.00	7,134,000
東京放送ホールディングス	38,600	1,598.00	61,682,800
日本テレビホールディングス	58,800	1,926.00	113,248,800
朝日放送	6,400	777.00	4,972,800
テレビ朝日ホールディングス	17,600	1,824.00	32,102,400
スカパーJ S A Tホールディングス	48,900	561.00	27,432,900
テレビ東京ホールディングス	5,300	2,028.00	10,748,400
日本BS放送	1,100	911.00	1,002,100
コネクシオ	4,500	1,150.00	5,175,000
日本通信	29,900	312.00	9,328,800
クロップス	800	494.00	395,200
日本電信電話	504,300	4,178.00	2,106,965,400
K D D I	654,600	2,667.00	1,745,818,200
光通信	5,800	8,350.00	48,430,000
N T T ドコモ	497,000	1,993.00	990,521,000
エムティーアイ	8,200	819.00	6,715,800
G M O インターネット	23,900	1,544.00	36,901,600
K A D O K A W A ・ D W A N G O	15,800	1,587.00	25,074,600
学研ホールディングス	21,000	231.00	4,851,000
ゼンリン	8,500	1,611.00	13,693,500
昭文社	3,900	690.00	2,691,000
インプレスホールディングス	4,500	155.00	697,500
アイネット	3,300	1,240.00	4,092,000
松竹	42,000	1,007.00	42,294,000
東宝	46,000	2,723.00	125,258,000
東映	24,000	939.00	22,536,000
A O I P r o .	3,000	874.00	2,622,000
エヌ・ティ・ティ・データ	39,800	6,010.00	239,198,000
ピー・シー・エー	800	1,414.00	1,131,200
ビジネスブレイン太田昭和	900	990.00	891,000
D T S	6,600	2,819.00	18,605,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	24,800	2,961.00	73,432,800

シーイーシー	4,200	931.00	3,910,200
カブコン	16,500	2,353.00	38,824,500
アイ・エス・ピー	800	731.00	584,800
ジャステック	4,100	1,030.00	4,223,000
S C S K	15,300	4,475.00	68,467,500
日本システムウエア	2,400	900.00	2,160,000
アイネス	8,800	1,079.00	9,495,200
T K C	6,000	3,075.00	18,450,000
富士ソフト	9,600	2,090.00	20,064,000
N S D	15,000	1,466.00	21,990,000
コナミ	26,200	2,583.00	67,674,600
福井コンピュータホールディングス	1,800	821.00	1,477,800
J B C Cホールディングス	5,400	734.00	3,963,600
ミロク情報サービス	4,200	846.00	3,553,200
ソフトバンクグループ	340,800	5,477.00	1,866,561,600
ハウスイ	5,000	121.00	605,000
高千穂交易	2,500	982.00	2,455,000
伊藤忠食品	1,600	3,930.00	6,288,000
エレマテック	3,000	2,693.00	8,079,000
J A L U X	1,800	2,245.00	4,041,000
あらた	2,900	2,748.00	7,969,200
トーメンデバイス	1,000	1,972.00	1,972,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	1,556.00	2,645,200
フィールズ	4,200	1,622.00	6,812,400
双日	431,300	222.00	95,748,600
アルフレッサ ホールディングス	76,200	2,035.00	155,067,000
横浜冷凍	16,000	941.00	15,056,000
神栄	10,000	140.00	1,400,000
山下医科器械	500	1,634.00	817,000
ラサ商事	3,000	554.00	1,662,000
アルコニックス	3,700	1,523.00	5,635,100
神戸物産	2,100	10,810.00	22,701,000
あい ホールディングス	10,300	2,953.00	30,415,900
ディーブイエックス	1,900	1,053.00	2,000,700
ダイワボウホールディングス	59,000	209.00	12,331,000
マクニカ・富士エレホールディングス	11,600	1,418.00	16,448,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12,100	807.00	9,764,700
八洲電機	5,000	594.00	2,970,000
U K Cホールディングス	4,100	2,286.00	9,372,600
O C H Iホールディングス	1,700	962.00	1,635,400
T O K A Iホールディングス	31,500	499.00	15,718,500
三洋貿易	3,500	1,531.00	5,358,500

ウイン・パートナーズ	2,100	1,654.00	3,473,400
ミタチ産業	1,500	722.00	1,083,000
シップヘルスケアホールディングス	11,800	2,570.00	30,326,000
明治電機工業	1,800	1,120.00	2,016,000
デリカフーズ	1,100	1,003.00	1,103,300
スターティア	1,400	764.00	1,069,600
富士興産	2,500	486.00	1,215,000
協栄産業	8,000	171.00	1,368,000
小野建	5,600	1,019.00	5,706,400
佐島電機	5,100	806.00	4,110,600
エコートレーディング	1,500	638.00	957,000
伯東	4,400	1,252.00	5,508,800
コンドーテック	4,700	733.00	3,445,100
中山福	3,700	779.00	2,882,300
ナガイレーベン	9,300	2,210.00	20,553,000
三菱食品	7,100	2,725.00	19,347,500
松田産業	4,700	1,288.00	6,053,600
メディバルホールディングス	64,400	1,891.00	121,780,400
アドヴァン	6,600	921.00	6,078,600
S P K	1,400	2,196.00	3,074,400
萩原電気	1,800	1,742.00	3,135,600
アズワン	4,600	3,645.00	16,767,000
スズデン	2,100	895.00	1,879,500
尾家産業	2,100	867.00	1,820,700
シモジマ	3,900	1,023.00	3,989,700
ドウシシャ	8,300	2,191.00	18,185,300
小津産業	1,300	2,061.00	2,679,300
高速	3,800	880.00	3,344,000
たけびし	2,300	1,016.00	2,336,800
黒田電気	11,200	2,214.00	24,796,800
丸文	5,700	856.00	4,879,200
ハピネット	3,900	1,162.00	4,531,800
橋本総業	1,200	1,265.00	1,518,000
エクセル	2,900	1,495.00	4,335,500
マルカキカイ	2,100	1,727.00	3,626,700
ガリバーインターナショナル	19,500	1,092.00	21,294,000
日本エム・ディ・エム	5,400	616.00	3,326,400
進和	3,800	1,561.00	5,931,800
エスケイジャパン	1,600	434.00	694,400
ダイトエレクトロン	3,000	854.00	2,562,000
シークス	4,100	3,105.00	12,730,500
田中商事	2,000	677.00	1,354,000

オーハシテクニカ	4,000	1,260.00	5,040,000
白銅	1,900	1,268.00	2,409,200
伊藤忠商事	539,400	1,257.50	678,295,500
丸紅	563,700	583.80	329,088,060
高島	12,000	252.00	3,024,000
長瀬産業	36,200	1,386.00	50,173,200
蝶理	4,100	1,735.00	7,113,500
豊田通商	71,800	2,513.00	180,433,400
三共生興	11,000	464.00	5,104,000
兼松	128,000	167.00	21,376,000
ツカモトコーポレーション	12,000	123.00	1,476,000
三井物産	546,300	1,340.50	732,315,150
日本紙パルプ商事	34,000	322.00	10,948,000
日立ハイテクノロジーズ	22,300	2,577.00	57,467,100
カメイ	8,400	1,119.00	9,399,600
東都水産	11,000	187.00	2,057,000
OUGホールディングス	10,000	243.00	2,430,000
スターゼン	2,500	3,130.00	7,825,000
山善	24,700	985.00	24,329,500
椿本興業	7,000	306.00	2,142,000
住友商事	380,300	1,152.00	438,105,600
内田洋行	16,000	392.00	6,272,000
三菱商事	483,500	1,953.50	944,517,250
第一実業	16,000	573.00	9,168,000
キャノンマーケティングジャパン	18,400	1,766.00	32,494,400
西華産業	21,000	252.00	5,292,000
佐藤商事	5,800	704.00	4,083,200
菱洋エレクトロ	7,400	1,517.00	11,225,800
東京産業	6,400	447.00	2,860,800
ユアサ商事	5,600	2,455.00	13,748,000
神鋼商事	16,000	226.00	3,616,000
小林産業	4,300	224.00	963,200
阪和興業	64,000	438.00	28,032,000
カナデン	5,500	888.00	4,884,000
菱電商事	10,000	796.00	7,960,000
フルサト工業	3,600	1,926.00	6,933,600
岩谷産業	71,000	678.00	48,138,000
すてきナイスグループ	27,000	161.00	4,347,000
昭光通商	23,000	84.00	1,932,000
ニチモウ	10,000	223.00	2,230,000
極東貿易	8,000	221.00	1,768,000
イワキ	10,000	230.00	2,300,000

三愛石油	17,000	817.00	13,889,000
稲畑産業	15,500	1,244.00	19,282,000
G S Iクレオス	17,000	108.00	1,836,000
明和産業	5,100	361.00	1,841,100
ワキタ	13,700	1,079.00	14,782,300
東邦ホールディングス	22,200	2,488.00	55,233,600
サンゲツ	22,100	1,905.00	42,100,500
ミツウロコグループホールディングス	10,400	549.00	5,709,600
シナネン	14,000	443.00	6,202,000
伊藤忠エネクス	14,200	907.00	12,879,400
サンリオ	18,100	3,255.00	58,915,500
サンワテクノス	4,100	1,058.00	4,337,800
リョーサン	10,900	2,791.00	30,421,900
新光商事	7,600	1,253.00	9,522,800
トーホー	2,900	1,989.00	5,768,100
三信電気	8,900	1,215.00	10,813,500
東陽テクニカ	9,400	881.00	8,281,400
モスフードサービス	8,400	2,537.00	21,310,800
加賀電子	5,800	1,520.00	8,816,000
ソーダニッカ	6,700	472.00	3,162,400
立花エレテック	4,800	1,286.00	6,172,800
フォーバル	2,600	535.00	1,391,000
P A L T A C	10,300	2,155.00	22,196,500
三谷産業	6,900	371.00	2,559,900
ヤマタネ	32,000	178.00	5,696,000
丸紅建材リース	6,000	224.00	1,344,000
日鉄住金物産	42,000	353.00	14,826,000
トラスコ中山	7,400	4,215.00	31,191,000
オートバックスセブン	22,900	1,983.00	45,410,700
加藤産業	10,100	2,584.00	26,098,400
イノテック	5,900	453.00	2,672,700
イエローハット	6,100	2,592.00	15,811,200
J Kホールディングス	6,500	467.00	3,035,500
日伝	2,700	2,607.00	7,038,900
北沢産業	5,400	204.00	1,101,600
杉本商事	3,500	1,280.00	4,480,000
因幡電機産業	9,600	3,600.00	34,560,000
バイテック	2,200	1,493.00	3,284,600
ミスミグループ本社	72,300	1,229.00	88,856,700
アルテック	5,500	178.00	979,000
タキヒヨー	11,000	437.00	4,807,000
蔵王産業	900	1,370.00	1,233,000

スズケン	29,300	3,975.00	116,467,500
ジェコス	4,400	1,028.00	4,523,200
ルネサスイーストン	3,200	438.00	1,401,600
ローソン	24,400	8,810.00	214,964,000
サンエー	4,900	5,240.00	25,676,000
ダイユーエイト	2,000	755.00	1,510,000
カワチ薬品	5,100	1,963.00	10,011,300
エービーシー・マート	9,500	6,660.00	63,270,000
ハードオフコーポレーション	3,100	1,566.00	4,854,600
アスクル	6,700	4,545.00	30,451,500
ゲオホールディングス	12,200	1,909.00	23,289,800
アダストリア	5,400	7,150.00	38,610,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	8,000	105.00	840,000
くらコーポレーション	3,800	3,785.00	14,383,000
キャンドウ	3,500	1,525.00	5,337,500
パル	3,800	3,460.00	13,148,000
エディオン	29,700	820.00	24,354,000
サーラコーポレーション	5,600	543.00	3,040,800
ワッツ	2,600	1,007.00	2,618,200
あみやき亭	1,100	4,695.00	5,164,500
ひらまつ	8,900	631.00	5,615,900
ゲンキー	1,300	5,780.00	7,514,000
サッポロドラッグストアー	700	1,893.00	1,325,100
大黒天物産	1,500	4,100.00	6,150,000
ハニーズ	5,700	1,007.00	5,739,900
ファーマライズホールディングス	2,100	632.00	1,327,200
アルペン	5,800	1,909.00	11,072,200
クオール	6,600	1,711.00	11,292,600
ジェイアイエヌ	4,400	5,600.00	24,640,000
ビックカメラ	32,900	1,039.00	34,183,100
D C Mホールディングス	31,700	874.00	27,705,800
Monotaro	22,600	2,727.00	61,630,200
東京一番フーズ	1,100	661.00	727,100
ダイヤモンドダイニング	1,100	1,089.00	1,197,900
きちり	1,800	673.00	1,211,400
アーランドサービス	1,000	4,835.00	4,835,000
J.フロント リテイリング	81,600	1,934.00	157,814,400
ドトール・日レスホールディングス	11,300	1,833.00	20,712,900
マツモトキヨシホールディングス	14,400	5,290.00	76,176,000
ブロンコビリー	2,500	2,509.00	6,272,500
スタートトゥデイ	20,100	3,940.00	79,194,000
トレジャー・ファクトリー	1,600	1,551.00	2,481,600

物語コーポレーション	1,800	4,665.00	8,397,000
ココカラファイン	6,700	4,410.00	29,547,000
三越伊勢丹ホールディングス	128,100	1,792.00	229,555,200
ウエルシアホールディングス	6,400	5,800.00	37,120,000
クリエイティブSDホールディングス	3,200	6,560.00	20,992,000
丸善CHホールディングス	7,500	364.00	2,730,000
ミサワ	800	665.00	532,000
エー・ピーカンパニー	1,000	1,437.00	1,437,000
チムニー	1,600	2,721.00	4,353,600
ネクステージ	1,100	810.00	891,000
ジョイフル本田	9,400	2,314.00	21,751,600
キリン堂ホールディングス	2,100	1,191.00	2,501,100
すかいらーく	19,800	1,555.00	30,789,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,200	1,010.00	21,412,000
ブックオフコーポレーション	4,100	901.00	3,694,100
あさひ	4,300	1,305.00	5,611,500
日本調剤	1,600	4,770.00	7,632,000
コスモス薬品	3,300	14,070.00	46,431,000
トーエル	3,400	584.00	1,985,600
一六堂	1,900	399.00	758,100
セブン&アイ・ホールディングス	269,600	5,444.00	1,467,702,400
薬王堂	900	3,045.00	2,740,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	4,500	2,473.00	11,128,500
ツルハホールディングス	13,800	10,290.00	142,002,000
サンマルクホールディングス	4,600	3,650.00	16,790,000
フェリシモ	1,700	996.00	1,693,200
トリドール	6,900	1,417.00	9,777,300
クスリのアオキ	5,100	6,330.00	32,283,000
メディカルシステムネットワーク	6,900	655.00	4,519,500
総合メディカル	3,100	3,770.00	11,687,000
はるやま商事	2,900	708.00	2,053,200
カッパ・クリエイティブホールディングス	10,000	1,230.00	12,300,000
ライトオン	4,800	971.00	4,660,800
良品計画	8,000	24,320.00	194,560,000
三城ホールディングス	8,100	455.00	3,685,500
アルビス	1,500	2,058.00	3,087,000
コナカ	7,600	616.00	4,681,600
ハウスオブローゼ	800	1,405.00	1,124,000
G-7ホールディングス	1,400	1,801.00	2,521,400
イオン北海道	5,000	511.00	2,555,000
コジマ	9,600	303.00	2,908,800

ヒマラヤ	2,100	1,016.00	2,133,600
コーナン商事	10,100	1,508.00	15,230,800
エコス	2,300	1,187.00	2,730,100
マルシェ	1,700	834.00	1,417,800
ドンキホーテホールディングス	41,600	4,490.00	186,784,000
西松屋チェーン	12,700	1,107.00	14,058,900
ゼンショーホールディングス	33,100	1,116.00	36,939,600
幸楽苑ホールディングス	4,300	1,490.00	6,407,000
ハークスレイ	1,800	1,285.00	2,313,000
サイゼリヤ	10,600	2,706.00	28,683,600
V Tホールディングス	20,000	720.00	14,400,000
魚力	1,800	1,512.00	2,721,600
ポブラ	1,600	511.00	817,600
ユナイテッドアローズ	8,400	4,940.00	41,496,000
ハイデイ日高	4,900	3,030.00	14,847,000
京都きもの友禅	3,900	1,000.00	3,900,000
コロワイド	21,600	1,678.00	36,244,800
壱番屋	2,900	5,440.00	15,776,000
トップカルチャー	3,000	509.00	1,527,000
P L A N T	1,600	1,199.00	1,918,400
スギホールディングス	11,600	5,360.00	62,176,000
スクロール	8,400	410.00	3,444,000
ヨンドシーホールディングス	4,900	2,910.00	14,259,000
ファミリーマート	21,800	5,450.00	118,810,000
木曽路	7,900	1,979.00	15,634,100
サトレストラシステムズ	7,300	823.00	6,007,900
千趣会	12,900	749.00	9,662,100
タカキュー	4,800	193.00	926,400
ケーヨー	12,100	513.00	6,207,300
上新電機	14,000	929.00	13,006,000
日本瓦斯	10,300	3,400.00	35,020,000
ベスト電器	20,700	123.00	2,546,100
ロイヤルホールディングス	10,800	2,046.00	22,096,800
東天紅	5,000	160.00	800,000
いなげや	7,200	1,215.00	8,748,000
島忠	16,700	2,618.00	43,720,600
チヨダ	7,600	3,835.00	29,146,000
ライフコーポレーション	4,300	3,400.00	14,620,000
リンガーハット	6,300	2,584.00	16,279,200
Mr M a x	6,900	308.00	2,125,200
テンアライド	5,400	376.00	2,030,400
A O K Iホールディングス	14,800	1,453.00	21,504,400

オークワ	10,000	984.00	9,840,000
コメリ	11,000	2,587.00	28,457,000
青山商事	14,600	4,210.00	61,466,000
しまむら	7,500	12,860.00	96,450,000
はせがわ	2,500	505.00	1,262,500
高島屋	94,000	965.00	90,710,000
松屋	13,400	1,726.00	23,128,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	30,500	2,259.00	68,899,500
近鉄百貨店	25,000	314.00	7,850,000
ニッセンホールディングス	9,700	202.00	1,959,400
パルコ	6,300	958.00	6,035,400
丸井グループ	68,000	1,439.00	97,852,000
アクシアル リテイリング	5,000	3,925.00	19,625,000
イオン	265,800	1,855.00	493,059,000
ユニーグループ・ホールディングス	62,400	752.00	46,924,800
イズミ	14,400	4,835.00	69,624,000
東武ストア	8,000	299.00	2,392,000
平和堂	13,100	2,623.00	34,361,300
フジ	7,300	2,859.00	20,870,700
ヤオコー	7,300	5,400.00	39,420,000
ゼビオ	8,700	2,146.00	18,670,200
ケーズホールディングス	14,900	3,750.00	55,875,000
O l y m p i c グループ	4,100	575.00	2,357,500
日産東京販売ホールディングス	10,900	305.00	3,324,500
アインファーマシーズ	7,800	6,090.00	47,502,000
元気寿司	2,000	1,936.00	3,872,000
ヤマダ電機	255,100	482.00	122,958,200
アークランドサカモト	4,600	2,570.00	11,822,000
ニトリホールディングス	27,800	9,350.00	259,930,000
グルメ杵屋	5,000	927.00	4,635,000
愛眼	5,100	255.00	1,300,500
ケーユーホールディングス	3,400	811.00	2,757,400
吉野家ホールディングス	18,200	1,554.00	28,282,800
松屋フーズ	3,100	2,298.00	7,123,800
サガミチェーン	8,000	1,214.00	9,712,000
関西スーパーマーケット	5,100	806.00	4,110,600
王将フードサービス	4,700	3,960.00	18,612,000
プレナス	7,200	1,847.00	13,298,400
ミニストップ	4,800	2,719.00	13,051,200
アークス	11,200	2,250.00	25,200,000
バロー	13,900	2,999.00	41,686,100
藤久	600	1,685.00	1,011,000

ベルク	2,900	4,080.00	11,832,000	
大庄	3,000	1,398.00	4,194,000	
ファーストリテイリング	12,900	48,490.00	625,521,000	
サンドラッグ	13,600	6,280.00	85,408,000	
サクスパー ホールディングス	4,900	2,041.00	10,000,900	
ヤマザワ	1,400	1,630.00	2,282,000	
やまや	1,100	2,460.00	2,706,000	
ペルーナ	16,100	653.00	10,513,300	
島根銀行	1,400	1,436.00	2,010,400	
じもとホールディングス	46,200	206.00	9,517,200	
足利ホールディングス	40,500	499.00	20,209,500	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	8,300	3,730.00	30,959,000	
新生銀行	613,000	245.00	150,185,000	
あおぞら銀行	435,000	414.00	180,090,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,289,000	716.40	3,789,039,600	
りそなホールディングス	753,800	606.30	457,028,940	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,425,000	437.40	623,295,000	
三井住友フィナンシャルグループ	487,300	4,512.00	2,198,697,600	
第四銀行	81,000	561.00	45,441,000	
北越銀行	70,000	243.00	17,010,000	
西日本シティ銀行	226,000	327.00	73,902,000	
千葉銀行	248,000	846.00	209,808,000	
横浜銀行	432,000	724.10	312,811,200	
常陽銀行	233,000	628.00	146,324,000	
群馬銀行	153,000	763.00	116,739,000	
武蔵野銀行	10,300	4,305.00	44,341,500	
千葉興業銀行	16,000	664.00	10,624,000	
筑波銀行	26,800	418.00	11,202,400	
七十七銀行	109,000	677.00	73,793,000	
青森銀行	50,000	384.00	19,200,000	
秋田銀行	43,000	383.00	16,469,000	
山形銀行	39,000	477.00	18,603,000	
岩手銀行	4,500	5,410.00	24,345,000	
東邦銀行	58,000	442.00	25,636,000	
東北銀行	35,000	150.00	5,250,000	
みちのく銀行	32,000	207.00	6,624,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	261,000	567.00	147,987,000	
静岡銀行	189,000	1,196.00	226,044,000	
十六銀行	81,000	522.00	42,282,000	
スルガ銀行	68,000	2,216.00	150,688,000	
八十二銀行	117,000	845.00	98,865,000	
山梨中央銀行	40,000	623.00	24,920,000	

大垣共立銀行	81,000	470.00	38,070,000	
福井銀行	55,000	245.00	13,475,000	
北國銀行	72,000	484.00	34,848,000	
清水銀行	2,200	2,986.00	6,569,200	
滋賀銀行	65,000	606.00	39,390,000	
南都銀行	62,000	377.00	23,374,000	
百五銀行	62,000	575.00	35,650,000	
京都銀行	123,000	1,211.00	148,953,000	
紀陽銀行	25,300	1,912.00	48,373,600	
三重銀行	29,000	265.00	7,685,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	438,000	273.00	119,574,000	
広島銀行	190,000	688.00	130,720,000	
山陰合同銀行	39,000	1,167.00	45,513,000	
中国銀行	45,700	1,769.00	80,843,300	
鳥取銀行	20,000	207.00	4,140,000	
伊予銀行	68,900	1,369.00	94,324,100	
百十四銀行	71,000	430.00	30,530,000	
四国銀行	50,000	253.00	12,650,000	
阿波銀行	53,000	688.00	36,464,000	
鹿児島銀行	45,000	965.00	43,425,000	
大分銀行	40,000	496.00	19,840,000	
宮崎銀行	43,000	404.00	17,372,000	
肥後銀行	53,000	878.00	46,534,000	
佐賀銀行	39,000	272.00	10,608,000	
十八銀行	40,000	369.00	14,760,000	
沖縄銀行	5,100	4,935.00	25,168,500	
琉球銀行	13,300	1,754.00	23,328,200	
セブン銀行	217,300	516.00	112,126,800	
みずほフィナンシャルグループ	9,057,900	222.90	2,019,005,910	
高知銀行	25,000	137.00	3,425,000	
山口フィナンシャルグループ	64,000	1,462.00	93,568,000	
長野銀行	21,000	198.00	4,158,000	
名古屋銀行	58,000	458.00	26,564,000	
北洋銀行	97,100	472.00	45,831,200	
愛知銀行	2,300	6,860.00	15,778,000	
第三銀行	36,000	179.00	6,444,000	
中京銀行	26,000	246.00	6,396,000	
東日本銀行	28,000	392.00	10,976,000	
大光銀行	23,000	229.00	5,267,000	
愛媛銀行	38,000	248.00	9,424,000	
トマト銀行	25,000	170.00	4,250,000	
みなと銀行	58,000	213.00	12,354,000	

京葉銀行	53,000	634.00	33,602,000
関西アーバン銀行	9,000	1,384.00	12,456,000
栃木銀行	32,000	655.00	20,960,000
北日本銀行	2,000	3,280.00	6,560,000
東和銀行	90,000	105.00	9,450,000
福島銀行	79,000	90.00	7,110,000
大東銀行	41,000	163.00	6,683,000
トモニホールディングス	49,400	466.00	23,020,400
フィデアホールディングス	44,300	239.00	10,587,700
池田泉州ホールディングス	61,400	518.00	31,805,200
F P G	19,900	858.00	17,074,200
S B Iホールディングス	77,800	1,341.00	104,329,800
ジャフコ	8,900	4,700.00	41,830,000
大和証券グループ本社	603,000	769.70	464,129,100
野村ホールディングス	1,317,300	688.10	906,434,130
岡三証券グループ	55,000	717.00	39,435,000
丸三証券	20,500	1,209.00	24,784,500
東洋証券	25,000	372.00	9,300,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	73,900	708.00	52,321,200
光世証券	16,000	181.00	2,896,000
水戸証券	20,600	392.00	8,075,200
いちよし証券	13,600	1,033.00	14,048,800
松井証券	32,800	1,032.00	33,849,600
だいこう証券ビジネス	3,300	1,072.00	3,537,600
マネックスグループ	76,200	293.00	22,326,600
カブドットコム証券	58,500	386.00	22,581,000
極東証券	8,700	1,597.00	13,893,900
岩井コスモホールディングス	6,700	1,360.00	9,112,000
藍澤證券	9,200	723.00	6,651,600
マネースクウェアHD	2,800	1,705.00	4,774,000
マネーパートナーズグループ	7,400	362.00	2,678,800
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	143,100	3,456.00	494,553,600
アニコムホールディングス	3,600	2,659.00	9,572,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	205,400	3,193.00	655,842,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	61,700	1,958.00	120,808,600
第一生命保険	412,900	1,893.50	781,826,150
東京海上ホールディングス	261,100	4,442.00	1,159,806,200
T & Dホールディングス	234,800	1,404.50	329,776,600
全国保証	16,800	3,950.00	66,360,000
クレディセゾン	52,600	2,165.00	113,879,000
アクリーティブ	4,400	511.00	2,248,400
芙蓉総合リース	6,800	4,575.00	31,110,000

興銀リース	12,100	2,324.00	28,120,400
東京センチュリーリース	15,100	3,445.00	52,019,500
日本証券金融	28,400	610.00	17,324,000
アイフル	107,800	442.00	47,647,600
ポケットカード	4,800	593.00	2,846,400
リコーリース	5,100	3,230.00	16,473,000
イオンフィナンシャルサービス	42,300	2,356.00	99,658,800
アコム	132,400	609.00	80,631,600
ジャックス	36,000	449.00	16,164,000
オリエントコーポレーション	199,700	202.00	40,339,400
日立キャピタル	12,700	2,906.00	36,906,200
アプラスフィナンシャル	30,900	110.00	3,399,000
オリックス	456,300	1,532.00	699,051,600
三菱UFJリース	163,400	524.00	85,621,600
日本取引所グループ	189,200	1,737.00	328,640,400
イー・ギャランティ	1,900	2,235.00	4,246,500
アサックス	1,100	1,459.00	1,604,900
NECキャピタルソリューション	2,600	1,619.00	4,209,400
日本駐車場開発	70,300	127.00	8,928,100
ヒューリック	134,300	1,077.00	144,641,100
三栄建築設計	2,800	1,364.00	3,819,200
野村不動産ホールディングス	38,800	2,396.00	92,964,800
三重交通グループホールディングス	11,400	421.00	4,799,400
ディア・ライフ	3,300	478.00	1,577,400
日本商業開発	2,200	1,908.00	4,197,600
プレサンスコーポレーション	2,200	4,665.00	10,263,000
ユニゾホールディングス	3,500	5,010.00	17,535,000
日本管理センター	4,400	1,205.00	5,302,000
サンセイランディック	1,800	1,009.00	1,816,200
エストラスト	900	517.00	465,300
フージャースホールディングス	9,600	446.00	4,281,600
オープンハウス	9,400	1,842.00	17,314,800
東急不動産ホールディングス	168,900	793.00	133,937,700
飯田グループホールディングス	41,800	1,863.00	77,873,400
パーク24	32,400	2,246.00	72,770,400
パラカ	2,200	1,620.00	3,564,000
三井不動産	342,000	3,263.00	1,115,946,000
三菱地所	479,000	2,435.50	1,166,604,500
平和不動産	12,200	1,278.00	15,591,600
東京建物	70,400	1,421.00	100,038,400
ダイビル	16,600	928.00	15,404,800
京阪神ビルディング	10,700	681.00	7,286,700

住友不動産	154,000	3,791.00	583,814,000
大京	103,000	202.00	20,806,000
テオーシー	22,200	836.00	18,559,200
東京楽天地	11,000	484.00	5,324,000
レオパレス21	70,500	556.00	39,198,000
スターツコーポレーション	7,400	1,849.00	13,682,600
フジ住宅	8,200	672.00	5,510,400
空港施設	7,800	545.00	4,251,000
明和地所	4,100	505.00	2,070,500
住友不動産販売	4,600	3,050.00	14,030,000
ゴールドクレスト	5,800	2,217.00	12,858,600
日本エスリード	2,500	1,135.00	2,837,500
日神不動産	8,600	377.00	3,242,200
タカラレーベン	28,600	584.00	16,702,400
サンヨーハウジング名古屋	3,600	1,064.00	3,830,400
イオンモール	41,600	1,831.00	76,169,600
ファースト住建	2,500	1,337.00	3,342,500
トーセイ	9,800	768.00	7,526,400
穴吹興産	6,000	234.00	1,404,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	40,000	1,097.00	43,880,000
サンフロンティア不動産	7,200	901.00	6,487,200
エフ・ジェー・ネクスト	5,300	557.00	2,952,100
ランドビジネス	4,300	366.00	1,573,800
グランディハウス	6,200	365.00	2,263,000
日本空港ビルデング	22,300	5,130.00	114,399,000
日本工営	23,000	495.00	11,385,000
ネクスト	16,300	943.00	15,370,900
ジェイエシーリクルートメント	3,200	861.00	2,755,200
日本M&Aセンター	10,500	5,200.00	54,600,000
ノバレーゼ	2,000	854.00	1,708,000
アコーディア・ゴルフ	25,800	1,080.00	27,864,000
タケエイ	6,700	1,253.00	8,395,100
トラスト・テック	1,200	2,045.00	2,454,000
パソナグループ	5,300	1,009.00	5,347,700
CDS	1,600	930.00	1,488,000
リンクアンドモチベーション	15,900	128.00	2,035,200
GCAサヴィアン	6,100	1,490.00	9,089,000
エス・エム・エス	7,700	2,016.00	15,523,200
テンプホールディングス	13,800	5,440.00	75,072,000
リニカル	1,900	1,676.00	3,184,400
クックパッド	15,200	2,513.00	38,197,600
エスクリ	3,000	847.00	2,541,000

アイ・ケイ・ケイ	4,000	527.00	2,108,000
学情	2,600	1,060.00	2,756,000
スタジオアリス	3,100	2,313.00	7,170,300
シミックホールディングス	3,200	1,700.00	5,440,000
N J S	1,400	1,374.00	1,923,600
総合警備保障	22,800	5,440.00	124,032,000
カカクコム	45,000	1,934.00	87,030,000
アイロムグループ	1,700	1,530.00	2,601,000
ルネサンス	3,800	1,212.00	4,605,600
ディップ	7,600	1,962.00	14,911,200
オプトホールディング	4,700	568.00	2,669,600
ツクイ	8,300	1,149.00	9,536,700
総合臨床ホールディングス	3,600	446.00	1,605,600
キャリアデザインセンター	2,000	1,099.00	2,198,000
エムスリー	59,100	2,367.00	139,889,700
ツカダ・グローバルホールディング	5,300	734.00	3,890,200
アウトソーシング	3,200	2,590.00	8,288,000
ウェルネット	2,400	2,353.00	5,647,200
ディー・エヌ・エー	33,600	2,219.00	74,558,400
博報堂D Yホールディングス	94,500	1,131.00	106,879,500
ぐるなび	7,900	1,968.00	15,547,200
エスアールジータカミヤ	6,000	602.00	3,612,000
一休	5,300	2,597.00	13,764,100
ファンコミュニケーションズ	15,800	784.00	12,387,200
ジェイコムホールディングス	1,700	947.00	1,609,900
W D Bホールディングス	2,500	1,381.00	3,452,500
ティア	3,300	731.00	2,412,300
バリューコマース	6,500	466.00	3,029,000
J Pホールディングス	17,800	344.00	6,123,200
E P Sホールディングス	6,300	1,169.00	7,364,700
レッグス	1,400	670.00	938,000
プレステージ・インターナショナル	5,300	1,188.00	6,296,400
アミューズ	2,100	5,180.00	10,878,000
ドリームインキュベータ	2,400	1,985.00	4,764,000
クイック	3,200	850.00	2,720,000
T A C	5,900	233.00	1,374,700
ケネディクス	92,300	396.00	36,550,800
電通	76,000	6,120.00	465,120,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	663.00	2,254,200
ぴあ	2,000	2,052.00	4,104,000
イオンファンタジー	2,200	1,555.00	3,421,000
シーティーエス	1,800	716.00	1,288,800

ネクシィーズ	2,700	877.00	2,367,900
みらかホールディングス	17,400	5,060.00	88,044,000
アルプス技研	2,600	2,160.00	5,616,000
ダイオーズ	1,500	1,237.00	1,855,500
日本空調サービス	3,400	1,130.00	3,842,000
オリエンタルランド	73,700	6,669.00	491,505,300
ダスキン	19,300	2,166.00	41,803,800
明光ネットワークジャパン	7,900	1,309.00	10,341,100
ファルコホールディングス	3,000	1,493.00	4,479,000
田谷	1,100	707.00	777,700
ラウンドワン	19,600	481.00	9,427,600
リゾートトラスト	26,500	2,969.00	78,678,500
ビー・エム・エル	4,000	3,325.00	13,300,000
ワタベウェディング	2,400	469.00	1,125,600
もしもしホットライン	12,700	1,235.00	15,684,500
早稲田アカデミー	1,300	795.00	1,033,500
ユー・エス・エス	82,600	1,984.00	163,878,400
東京個別指導学院	3,500	582.00	2,037,000
サイバーエージェント	16,700	4,660.00	77,822,000
楽天	318,900	1,524.00	486,003,600
テー・オー・ダブリュー	4,200	763.00	3,204,600
セントラルスポーツ	2,400	2,303.00	5,527,200
フルキャストホールディングス	6,500	796.00	5,174,000
リゾートソリューション	9,000	273.00	2,457,000
テクノプロ・ホールディングス	9,700	3,160.00	30,652,000
リブセンス	4,800	431.00	2,068,800
ジャパンマテリアル	2,900	1,896.00	5,498,400
ベクトル	1,600	1,988.00	3,180,800
ウチヤマホールディングス	4,600	456.00	2,097,600
サクセスホールディングス	1,100	1,290.00	1,419,000
キャリアリンク	1,000	1,668.00	1,668,000
I B J	1,400	1,381.00	1,933,400
アサンテ	2,300	1,435.00	3,300,500
N・フィールド	2,500	1,508.00	3,770,000
M&Aキャピタルパートナーズ	600	1,658.00	994,800
E R Iホールディングス	2,100	714.00	1,499,400
アビスト	800	1,477.00	1,181,600
ウィルグループ	1,700	812.00	1,380,400
日本ビューホテル	800	2,113.00	1,690,400
リクルートホールディングス	103,100	3,580.00	369,098,000
リロ・ホールディング	2,300	11,660.00	26,818,000
東祥	1,500	2,977.00	4,465,500

エイチ・アイ・エス	11,100	3,895.00	43,234,500	
共立メンテナンス	4,300	7,670.00	32,981,000	
イチネンホールディングス	7,500	1,029.00	7,717,500	
建設技術研究所	4,000	1,207.00	4,828,000	
スペース	3,700	1,268.00	4,691,600	
燦ホールディングス	1,500	1,527.00	2,290,500	
スバル興業	5,000	415.00	2,075,000	
東京テアトル	26,000	132.00	3,432,000	
よみうりランド	15,000	386.00	5,790,000	
東京都競馬	47,000	286.00	13,442,000	
カナモト	9,600	2,144.00	20,582,400	
東京ドーム	47,000	522.00	24,534,000	
西尾レントオール	5,500	2,342.00	12,881,000	
トランス・コスモス	8,900	2,910.00	25,899,000	
乃村工藝社	13,400	1,690.00	22,646,000	
藤田観光	25,000	410.00	10,250,000	
KNT-CTホールディングス	33,000	244.00	8,052,000	
日本管財	6,600	1,800.00	11,880,000	
トーカイ	3,000	3,300.00	9,900,000	
白洋舎	9,000	262.00	2,358,000	
セコム	66,200	7,169.00	474,587,800	
セントラル警備保障	3,100	1,452.00	4,501,200	
丹青社	11,800	785.00	9,263,000	
メイテック	9,100	4,160.00	37,856,000	
アサツー ディ・ケイ	12,000	2,685.00	32,220,000	
応用地質	7,200	1,391.00	10,015,200	
船井総研ホールディングス	7,900	1,700.00	13,430,000	
進学会	3,000	682.00	2,046,000	
オオバ	3,800	576.00	2,188,800	
ベネッセホールディングス	24,900	3,195.00	79,555,500	
イオンディライト	6,600	3,450.00	22,770,000	
ナック	4,800	814.00	3,907,200	
ニチイ学館	13,700	830.00	11,371,000	
ダイセキ	11,000	2,034.00	22,374,000	
ステップ	2,300	1,005.00	2,311,500	
合計	106,492,670		135,287,148,920	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成27年 9月30日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,461,694,971
国債証券	264,489,709,050
地方債証券	19,430,142,033
特殊債券	26,650,033,617
社債券	16,685,594,470
派生商品評価勘定	29,028
未収入金	2,351,177,200
未収利息	482,805,646
前払金	240,000
前払費用	10,726,639
流動資産合計	334,562,152,654
資産合計	334,562,152,654
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	272,916
未払金	4,349,825,200
未払解約金	377,218,686
流動負債合計	4,727,316,802
負債合計	4,727,316,802
純資産の部	
元本等	
元本	247,877,657,762
剰余金	
剰余金又は欠損金()	81,957,178,090
元本等合計	329,834,835,852
純資産合計	329,834,835,852
負債純資産合計	334,562,152,654

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

	平成27年 9月30日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	247,877,657,762口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 105,900,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3306円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,306円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成27年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

平成27年 9月30日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
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コンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</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27年 9月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年10月 1日
期首元本額	214,971,115,502円
期中追加設定元本額	60,140,934,983円
期中一部解約元本額	27,234,392,723円
期末元本額	247,877,657,762円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,428,211,878円
S B I 資産設計オープン（分配型）	23,143,817円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,164,695,454円
世界経済インデックスファンド	472,335,160円
マイセレクション2 5	81,756,090円
マイセレクション5 0	77,029,204円
マイセレクション7 5	24,982,054円
D C マイセレクション2 5	13,988,261,429円
D C マイセレクション5 0	16,565,255,319円
D C マイセレクション7 5	4,899,007,222円
D C 日本債券インデックス・オープン	412,604,107円
D C 日本債券インデックス・オープン S	58,411,516,309円
D C 日本債券インデックス・オープン P	22,510,535,945円
D C マイセレクション S 2 5	5,714,247,306円
D C マイセレクション S 5 0	6,240,381,880円
D C マイセレクション S 7 5	1,269,019,079円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,266,532,481円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	698,018,716円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	184,009,119円

区分	平成27年 9月30日現在
D C世界経済インデックスファンド	448,000,898円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,310,979,600円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	20,741,139円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	163,555,469円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	27,247,765円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	975,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	675,715,896円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	964,220,273円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	802,631,076円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	317,237,304円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	10,256,969,672円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,603,615,672円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,893,961,622円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,372,353,147円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,232,367,301円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,198,564,633円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,837,579,142円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,290,953,042円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,260,996,980円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	221,443,070円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,702,389,845円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,051,578,189円
コア投資戦略ファンド（安定型）	8,572,566,868円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,027,352,724円
分散投資コア戦略ファンドA	1,286,211,589円
分散投資コア戦略ファンドS	708,185,002円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	12,401,289円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	158,974,200円
国内債券SMTBセクション（SMA専用）	34,157,514,463円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,594,990,225円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	44,171,243円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,445,666円
SMT インデックスバランス・オープン	52,251,135円
債券コア戦略ファンド	91,061円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,144,655,013円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,135,331,550

地方債証券	19,510,700
特殊債券	12,581,997
社債券	22,800,950
合計	1,080,437,903

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成27年 9月30日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,778,163,888	-	1,777,920,000	243,888
	合計	1,778,163,888	-	1,777,920,000	243,888

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第346回利付国債(2年)	590,000,000	590,625,400	
	第349回利付国債(2年)	1,850,000,000	1,852,405,000	
	第350回利付国債(2年)	1,030,000,000	1,031,339,000	
	第351回利付国債(2年)	130,000,000	130,179,400	
	第353回利付国債(2年)	1,600,000,000	1,602,448,000	
	第354回利付国債(2年)	310,000,000	310,496,000	
	第355回利付国債(2年)	4,160,000,000	4,166,988,800	
	第356回利付国債(2年)	1,090,000,000	1,091,907,500	
	第101回利付国債(5年)	950,000,000	954,560,000	
	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,288,162,400	
	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,510,775,000	

第104回利付国債(5年)	810,000,000	812,308,500	
第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	3,511,690,000	
第106回利付国債(5年)	3,260,000,000	3,272,159,800	
第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,124,715,200	
第108回利付国債(5年)	590,000,000	591,174,100	
第109回利付国債(5年)	1,190,000,000	1,192,629,900	
第110回利付国債(5年)	700,000,000	704,998,000	
第111回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,605,264,000	
第112回利付国債(5年)	900,000,000	909,522,000	
第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	4,424,549,300	
第114回利付国債(5年)	1,210,000,000	1,220,224,500	
第115回利付国債(5年)	2,460,000,000	2,473,480,800	
第116回利付国債(5年)	4,200,000,000	4,224,276,000	
第117回利付国債(5年)	4,520,000,000	4,547,346,000	
第118回利付国債(5年)	4,350,000,000	4,377,405,000	
第119回利付国債(5年)	700,000,000	701,813,000	
第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	4,267,687,200	
第121回利付国債(5年)	630,000,000	631,619,100	
第122回利付国債(5年)	5,090,000,000	5,101,757,900	
第123回利付国債(5年)	4,640,000,000	4,650,300,800	
第124回利付国債(5年)	3,210,000,000	3,216,773,100	
第125回利付国債(5年)	1,090,000,000	1,092,158,200	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	187,881,000	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	360,438,000	
第3回利付国債(40年)	420,000,000	505,155,000	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	638,035,200	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	562,328,900	
第6回利付国債(40年)	690,000,000	770,985,300	
第7回利付国債(40年)	1,090,000,000	1,153,012,900	
第8回利付国債(40年)	750,000,000	725,115,000	
第284回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,234,938,100	
第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	2,039,192,800	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	896,700,300	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	557,496,000	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,159,450,700	
第289回利付国債(10年)	2,490,000,000	2,572,194,900	
第290回利付国債(10年)	470,000,000	486,083,400	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	866,678,400	
第292回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,156,187,100	
第293回利付国債(10年)	370,000,000	387,922,800	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	188,231,400	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	104,030,000	

第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,192,484,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	584,931,200	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,728,574,600	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,368,019,900	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	872,504,300	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,307,642,000	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	210,166,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,465,157,300	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	504,052,800	
第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,274,069,600	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,452,350,700	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	738,962,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,047,964,500	
第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,867,469,200	
第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,664,014,500	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	632,350,400	
第312回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,298,030,000	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,760,434,500	
第314回利付国債(10年)	910,000,000	961,005,500	
第315回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,830,114,400	
第316回利付国債(10年)	720,000,000	761,990,400	
第317回利付国債(10年)	620,000,000	657,553,400	
第318回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,065,176,300	
第319回利付国債(10年)	750,000,000	797,070,000	
第320回利付国債(10年)	920,000,000	972,053,600	
第321回利付国債(10年)	2,330,000,000	2,467,027,300	
第322回利付国債(10年)	950,000,000	999,761,000	
第323回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,275,412,600	
第324回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,115,727,800	
第325回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,154,660,600	
第326回利付国債(10年)	720,000,000	749,606,400	
第327回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,886,886,000	
第328回利付国債(10年)	2,220,000,000	2,294,569,800	
第329回利付国債(10年)	2,300,000,000	2,411,251,000	
第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,349,065,600	
第331回利付国債(10年)	680,000,000	702,426,400	
第332回利付国債(10年)	2,700,000,000	2,787,291,000	
第333回利付国債(10年)	2,260,000,000	2,331,348,200	
第334回利付国債(10年)	3,000,000,000	3,092,190,000	
第335回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,103,931,200	
第336回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,335,885,600	
第337回利付国債(10年)	1,990,000,000	1,993,562,100	

第338回利付国債(10年)	3,680,000,000	3,712,126,400
第339回利付国債(10年)	3,480,000,000	3,504,568,800
第340回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,156,083,500
第1回利付国債(30年)	40,000,000	51,506,400
第2回利付国債(30年)	160,000,000	197,747,200
第3回利付国債(30年)	120,000,000	146,647,200
第4回利付国債(30年)	110,000,000	144,003,200
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,438,500
第6回利付国債(30年)	190,000,000	235,288,400
第7回利付国債(30年)	180,000,000	219,951,000
第8回利付国債(30年)	50,000,000	57,148,500
第9回利付国債(30年)	240,000,000	258,657,600
第10回利付国債(30年)	160,000,000	164,209,600
第11回利付国債(30年)	90,000,000	101,000,700
第12回利付国債(30年)	190,000,000	225,262,100
第13回利付国債(30年)	290,000,000	338,598,200
第14回利付国債(30年)	300,000,000	370,071,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	424,751,800
第16回利付国債(30年)	370,000,000	461,797,000
第17回利付国債(30年)	330,000,000	405,774,600
第18回利付国債(30年)	445,000,000	538,810,450
第19回利付国債(30年)	280,000,000	338,550,800
第20回利付国債(30年)	420,000,000	522,244,800
第21回利付国債(30年)	370,000,000	446,752,800
第22回利付国債(30年)	400,000,000	497,272,000
第23回利付国債(30年)	420,000,000	521,837,400
第24回利付国債(30年)	330,000,000	410,110,800
第25回利付国債(30年)	350,000,000	421,883,000
第26回利付国債(30年)	730,000,000	894,001,800
第27回利付国債(30年)	730,000,000	908,397,400
第28回利付国債(30年)	530,000,000	660,671,500
第29回利付国債(30年)	940,000,000	1,154,526,800
第30回利付国債(30年)	660,000,000	798,025,800
第31回利付国債(30年)	770,000,000	915,876,500
第32回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,284,147,600
第33回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,482,558,300
第34回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,882,633,200
第35回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,379,136,000
第36回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,424,921,200
第37回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,419,453,000
第38回利付国債(30年)	790,000,000	871,701,800
第39回利付国債(30年)	740,000,000	833,854,200
第40回利付国債(30年)	720,000,000	793,836,000

第41回利付国債(30年)	580,000,000	625,953,400	
第42回利付国債(30年)	710,000,000	765,820,200	
第43回利付国債(30年)	940,000,000	1,013,320,000	
第44回利付国債(30年)	720,000,000	775,706,400	
第45回利付国債(30年)	680,000,000	699,903,600	
第46回利付国債(30年)	750,000,000	770,460,000	
第47回利付国債(30年)	680,000,000	714,537,200	
第48回利付国債(30年)	220,000,000	220,231,000	
第34回利付国債(20年)	50,000,000	52,556,000	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	10,482,000	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	74,109,000	
第37回利付国債(20年)	70,000,000	74,246,200	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	21,324,600	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	531,885,000	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	106,761,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	346,839,900	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	87,127,200	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	155,890,000	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	188,587,800	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	320,418,100	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	187,168,300	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	99,567,900	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	146,464,500	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	155,523,200	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	241,997,800	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	110,991,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	123,201,100	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	89,996,000	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	226,226,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	157,290,000	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	169,179,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	269,083,200	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	337,476,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	222,686,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	382,186,000	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	255,338,400	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	335,606,400	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	225,082,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	363,513,600	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	250,434,800	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	372,982,500	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	148,330,000	

第68回利付国債(20年)	190,000,000	221,623,600	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	451,666,800	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	474,564,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	233,862,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	732,538,800	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	416,379,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	233,122,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	151,811,400	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	310,321,800	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	335,982,400	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	195,675,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	313,326,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	257,503,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	453,285,300	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	703,158,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	340,393,300	
第84回利付国債(20年)	670,000,000	779,806,300	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	340,877,600	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	251,204,100	
第87回利付国債(20年)	550,000,000	652,041,500	
第88回利付国債(20年)	550,000,000	659,059,500	
第89回利付国債(20年)	450,000,000	534,595,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	749,926,800	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	540,396,000	
第92回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,275,717,600	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	480,319,100	
第94回利付国債(20年)	680,000,000	804,052,400	
第95回利付国債(20年)	660,000,000	796,316,400	
第96回利付国債(20年)	420,000,000	497,116,200	
第97回利付国債(20年)	640,000,000	766,310,400	
第98回利付国債(20年)	680,000,000	806,493,600	
第99回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,187,620,000	
第100回利付国債(20年)	620,000,000	744,527,000	
第101回利付国債(20年)	435,000,000	532,901,100	
第102回利付国債(20年)	440,000,000	539,620,400	
第103回利付国債(20年)	420,000,000	509,766,600	
第104回利付国債(20年)	460,000,000	547,331,000	
第105回利付国債(20年)	790,000,000	940,487,100	
第106回利付国債(20年)	360,000,000	433,206,000	
第107回利付国債(20年)	250,000,000	297,925,000	
第108回利付国債(20年)	480,000,000	559,838,400	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	396,538,600	
第110回利付国債(20年)	850,000,000	1,013,871,500	

第111回利付国債(20年)	330,000,000	398,168,100	
第112回利付国債(20年)	800,000,000	954,480,000	
第113回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,444,824,700	
第114回利付国債(20年)	810,000,000	967,253,400	
第115回利付国債(20年)	720,000,000	869,760,000	
第116回利付国債(20年)	550,000,000	664,455,000	
第117回利付国債(20年)	820,000,000	979,129,200	
第118回利付国債(20年)	850,000,000	1,003,433,500	
第119回利付国債(20年)	380,000,000	438,102,000	
第120回利付国債(20年)	330,000,000	371,104,800	
第121回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,270,645,700	
第122回利付国債(20年)	280,000,000	322,599,200	
第123回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,266,678,800	
第124回利付国債(20年)	400,000,000	472,156,000	
第125回利付国債(20年)	630,000,000	761,317,200	
第126回利付国債(20年)	430,000,000	507,283,900	
第127回利付国債(20年)	460,000,000	535,895,400	
第128回利付国債(20年)	660,000,000	768,319,200	
第129回利付国債(20年)	620,000,000	712,516,400	
第130回利付国債(20年)	630,000,000	723,290,400	
第131回利付国債(20年)	580,000,000	657,163,200	
第132回利付国債(20年)	530,000,000	599,758,600	
第133回利付国債(20年)	880,000,000	1,009,210,400	
第134回利付国債(20年)	420,000,000	481,097,400	
第135回利付国債(20年)	380,000,000	429,749,600	
第136回利付国債(20年)	710,000,000	792,047,600	
第137回利付国債(20年)	290,000,000	327,273,700	
第138回利付国債(20年)	630,000,000	691,450,200	
第139回利付国債(20年)	410,000,000	456,338,200	
第140回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,532,543,200	
第141回利付国債(20年)	360,000,000	405,043,200	
第142回利付国債(20年)	780,000,000	889,948,800	
第143回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,162,665,000	
第144回利付国債(20年)	640,000,000	698,476,800	
第145回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,659,627,600	
第146回利付国債(20年)	1,810,000,000	2,026,114,000	
第147回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,618,367,100	
第148回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,655,674,200	
第149回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,629,018,200	
第150回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,854,195,000	
第151回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,348,419,600	
第152回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,619,367,300	

	第153回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,632,519,200
	第154回利付国債(20年)	250,000,000	253,055,000
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,744,000
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,492,000
	国債証券合計	247,530,000,000	264,489,709,050
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,947,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,443,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,655,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	114,062,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,319,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,975,000
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,871,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	222,964,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	220,306,000
	第695回東京都公募公債	200,000,000	211,552,000
	第696回東京都公募公債	100,000,000	105,948,000
	第700回東京都公募公債	100,000,000	105,169,000
	第702回東京都公募公債	200,000,000	210,968,000
	第716回東京都公募公債	100,000,000	103,910,000
	第717回東京都公募公債	100,000,000	102,861,000
	第720回東京都公募公債	100,000,000	104,617,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	102,841,000
	平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	102,217,000
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	113,744,400
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,467,000
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	106,020,000
	平成23年度第6回北海道公募公債	200,000,000	210,510,000
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,739,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	122,307,000
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,383,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,910,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,695,000
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	102,148,000
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	103,526,000
	第172回神奈川県公募公債	200,000,000	210,892,000
	第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	225,314,000
	第26回大阪府公募公債(2年)	270,000,000	269,738,100
	第91回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,072,000
	第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,540,000
	第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,717,000
	第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,438,000
	第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,441,000

第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,509,000	
第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,959,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,851,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	101,998,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,123,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	112,551,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	104,009,000	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,731,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,406,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,633,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	103,516,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	105,887,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	103,762,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	98,455,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	103,228,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	104,557,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	105,706,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,259,129	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,131,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	103,178,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,124,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	119,781,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	211,524,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,768,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,891,000	
平成23年度第14回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,099,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,860,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,368,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	207,032,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	120,147,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,762,000	
平成23年度第6回広島県公募公債(5年)	200,000,000	200,762,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	104,123,000	
平成20年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,532,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,840,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,635,970	

平成23年度第11回埼玉県公募公債(5年)	100,000,000	100,394,000	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,715,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	104,393,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	102,302,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,832,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	116,069,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	211,598,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,423,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	110,605,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	392,700,000	400,522,584	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	105,807,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,192,400	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	104,367,000	
第46回共同発行市場公募地方債	336,500,000	344,111,630	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,291,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	164,154,672	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,487,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,360,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	172,821,786	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,101,700	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,078,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,968,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,458,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,920,715	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,705,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,632,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,669,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	264,930,000	
第97回共同発行市場公募地方債	356,000,000	379,827,080	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,647,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,587,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,316,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,644,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,628,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,372,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,447,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,996,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,132,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,947,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,775,000	

	第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,184,000	
	第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,900,000	
	第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,752,000	
	第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,338,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,659,000	
	平成24年度第2回熊本県公募公債(10年)	200,000,000	208,078,000	
	平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,368,000	
	第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	233,356,000	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	103,345,000	
	平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	105,094,000	
	平成26年度第1回大阪市公募公債(3年)	200,000,000	200,084,000	
	第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	119,895,000	
	第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	117,004,000	
	第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	103,829,000	
	第481回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,725,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	100,000,000	102,550,000	
	平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	106,819,500	
	平成23年度第4回京都市公募公債	100,000,000	105,428,000	
	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	104,002,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,390,000	
	平成24年度第6回京都市公募公債	100,000,000	100,091,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,972,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	102,197,000	
	第20回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,612,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	210,792,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,976,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,263,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	104,050,000	
	第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	113,773,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	105,117,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,618,000	
	平成18年度第6回福岡市公募公債	120,050,000	122,611,867	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,832,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	153,661,500	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	200,000,000	210,768,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,856,000	
	地方債証券合計	18,337,940,000	19,430,142,033	
特殊債券	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,536,000	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,324,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,987,000	

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	109,447,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,624,000	
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	219,158,000	
第14回道路債券	100,000,000	111,502,000	
第17回道路債券	100,000,000	108,844,000	
第21回道路債券	100,000,000	125,129,000	
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	102,013,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,822,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	311,096,160	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,364,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	324,850,050	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,870,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,806,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,271,000	
第42回道路債券	100,000,000	115,770,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,446,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,780,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,263,000	
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	103,153,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,124,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,401,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,836,000	
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	30,975,000	
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	114,718,500	
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	104,697,000	
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	189,260,840	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,937,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	316,140,000	
	100,000,000	120,066,000	

第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	236,606,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,323,000	
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	315,267,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,843,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,199,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	145,512,720	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,790,000	
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	105,546,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,249,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,925,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,634,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,808,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,036,000	
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	118,340,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,609,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,420,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,516,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	315,255,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	301,000,000	315,065,730	
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	209,768,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,904,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,278,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,439,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,522,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,547,000	
	300,000,000	313,251,000	

第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,652,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,353,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,358,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,848,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,900,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,960,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,799,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,413,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,753,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,988,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	211,289,980	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,166,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,925,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,876,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,284,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	334,563,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,701,300	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,892,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,851,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	124,079,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	117,903,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,104,800	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,579,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,632,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,856,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,882,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,919,810	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,480,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,331,690	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,440,770	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,772,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,711,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,660,000	
第38回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,445,000	

第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,658,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,348,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,810,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,554,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,132,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,783,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,478,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,275,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,796,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,509,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	217,628,600	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	125,803,960	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	105,479,210	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	82,608,000	
第11回首都高速道路株式会社債券	300,000,000	301,056,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	105,764,170	
第18回株式会社日本政策金融公庫債券	100,000,000	117,763,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,514,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,714,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,740,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,172,800	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,545,000	32,770,508	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,898,000	26,842,533	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	25,623,000	27,863,731	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,783,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,466,000	34,023,556	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,370,000	29,472,563	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	22,016,000	23,364,480	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,574,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,972,000	49,791,813	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,053,000	28,949,685	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,980,000	25,913,987	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,644,000	30,640,773	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,698,000	25,637,207	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,015,000	30,879,503	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,552,000	37,242,142	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,826,000	37,460,382	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,570,000	45,082,249	

第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,804,000	46,604,567	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,382,000	47,124,565	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,372,000	52,908,022	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,023,000	55,780,621	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,415,000	57,065,915	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,922,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	112,296,000	119,714,273	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,373,000	32,350,889	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,050,000	65,975,903	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,116,000	32,021,439	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,637,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,925,000	32,547,028	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,229,000	77,176,686	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,452,000	29,794,479	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,417,000	77,634,644	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,645,000	75,848,710	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,098,000	33,790,153	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,334,000	148,863,500	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,906,000	79,478,262	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,717,000	33,124,291	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,768,000	85,734,565	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,629,000	84,587,883	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,121,000	85,202,197	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,231,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,154,000	171,398,116	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,890,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,034,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,040,000	176,092,521	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,958,000	89,312,822	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,359,000	90,724,942	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,878,000	91,390,483	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,200,000	89,501,460	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,283,000	88,563,459	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,604,000	92,293,470	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,992,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,417,000	91,672,096	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,920,000	94,855,523	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,110,000	96,100,426	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,908,000	96,458,796	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,295,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,416,000	195,338,799	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,974,000	96,923,182	

	第9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,208,000	193,971,066
	第9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,940,000	98,303,357
	第9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,387,000	98,300,419
	第9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,789,000	99,367,903
	第9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,308,000	200,752,983
	第1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,264,000
	第1 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,949,000
	第1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,473,000
	第1 4 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,070,000
	第1 2 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,849,000
	第1 1 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,030,000
	い第7 4 1 号商工債	100,000,000	100,394,000
	い第7 5 0 号商工債	100,000,000	100,268,000
	い第7 5 2 号商工債	200,000,000	200,554,000
	い第7 5 6 号商工債	100,000,000	100,276,000
	い第7 4 0 号農林債	100,000,000	100,403,000
	い第7 4 3 号農林債	100,000,000	100,391,000
	い第7 4 6 号農林債	100,000,000	100,263,000
	い第7 4 8 号農林債	100,000,000	100,287,000
	い第7 4 9 号農林債	300,000,000	300,588,000
	い第7 5 2 号農林債	200,000,000	200,414,000
	第2 6 7 回信金中金債(5年)	200,000,000	200,788,000
	第2 7 4 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,248,000
	第2 9 0 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,346,000
	第2 9 9 回信金中金債(5年)	100,000,000	99,950,000
	第3 0 0 回信金中金債(5年)	300,000,000	300,129,000
	第3 0 3 回信金中金債(5年)	100,000,000	100,129,000
	第1 7 5 号商工債(3年)	100,000,000	99,952,000
	第1 7 8 号商工債(3年)	300,000,000	299,838,000
	第1 7 9 号商工債(3年)	200,000,000	199,820,000
	第1 9 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,465,000
	第2 0 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,374,000
	第2 8 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,616,000
	第3 3 回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	210,038,000
	第5 9 回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,419,000
	第2 6 回政府保証銀行等保有株式取得機構債	400,000,000	400,104,000
	第5 3 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,582,000
	特殊債券合計	25,351,153,000	26,650,033,617
社債券	第2 回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	101,733,000
	第6 回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,172,000

第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,321,000	
第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	99,955,000	
第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,484,000	
第9回JPモルガン・チェース・アンド・カン パニー円貨社債	100,000,000	101,550,000	
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	102,389,000	
第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,811,000	
第6回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,328,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	100,000,000	100,971,000	
第11回ナショナル・オーストラリア銀行円 貨社債	100,000,000	100,319,000	
第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行 円貨社債	100,000,000	100,212,000	
第9回ウエストパック・バンキング・コーポ レーション円貨社債	100,000,000	101,551,000	
第9回オーストラリア・ニュージーランド銀 行円貨社債	100,000,000	100,375,000	
第14回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	101,135,000	
第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	203,124,000	
第27回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	100,000,000	100,244,000	
第21回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,261,000	
第5回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,379,000	
第3回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	103,735,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	105,750,000	
第10回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,382,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	102,099,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会 社無担保社債	100,000,000	100,916,000	
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	104,851,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	105,200,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	101,759,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,055,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディ ングス無担保社債	100,000,000	102,891,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,273,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディ ングス無担保社債	100,000,000	101,132,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保 社債	100,000,000	99,199,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	100,776,000	

第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,178,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,309,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,068,000	
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,018,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,624,000	
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,101,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,395,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	201,848,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,141,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,119,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,375,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,131,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,608,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,064,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,635,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,047,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,598,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,301,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,377,000	
第8回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,844,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,786,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,654,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,011,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	111,508,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,787,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,505,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,779,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,120,000	
第29回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,399,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,239,000	
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	200,258,000	
第33回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,020,000	
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	125,068,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,863,000	

第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,021,000	
第134回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,387,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	100,193,000	
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	107,301,000	
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	106,771,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	100,691,000	
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	107,213,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,318,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,775,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	207,888,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,591,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,424,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,530,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,507,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	100,496,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,373,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,890,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,816,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,577,000	
第19回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,292,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,446,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,860,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,421,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,946,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,418,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,393,000	
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,771,000	
	100,000,000	104,262,000	

第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債			
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,630,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,789,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,751,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,044,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,081,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,409,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,003,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	239,348,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,122,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,467,150	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,926,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,535,200	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,748,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,836,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,488,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	105,497,000	
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	101,425,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,586,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,936,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	124,723,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,614,800	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,083,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,711,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,089,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,120,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,257,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,800,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,619,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,612,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,467,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,719,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,319,000	
第496回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,293,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,405,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,910,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,663,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,706,000	

第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,299,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,102,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,861,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	20,907,200	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,294,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,919,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	103,144,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,785,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,833,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,699,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,673,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,234,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,171,000	
第426回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,235,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	32,643,000	
第320回北海道電力株式会社社債	101,000,000	101,698,920	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,641,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,373,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,433,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,861,000	
社債券合計	16,221,000,000	16,685,594,470	
合計		327,255,479,170	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,160,906,411
コール・ローン	1,765,654,366
株式	228,769,237,105

	平成27年 9月30日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	181,884,582
投資証券	5,842,121,235
派生商品評価勘定	5,814,654
未収入金	2,354,869
未収配当金	403,271,469
未収利息	319
前払金	247,594,487
差入委託証拠金	874,853,000
流動資産合計	243,253,692,497
資産合計	243,253,692,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	250,638,246
未払解約金	151,140,718
流動負債合計	401,778,964
負債合計	401,778,964
純資産の部	
元本等	
元本	130,465,120,039
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,386,793,494
元本等合計	242,851,913,533
純資産合計	242,851,913,533
負債純資産合計	243,253,692,497

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 9月30日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

平成27年 9月30日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,465,120,039口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.8614円
の額	(1万口当たり純資産額) (18,614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27年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成27年 9月30日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年10月 1日
期首元本額	103,878,614,653円
期中追加設定元本額	76,356,948,219円
期中一部解約元本額	49,770,442,833円
期末元本額	130,465,120,039円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,993,728,722円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,586,430円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	24,803,273,743円
世界経済インデックスファンド	2,191,250,924円
マイセレクション25	4,329,362円
マイセレクション50	20,404,671円
マイセレクション75	23,488,621円
外国株式インデックス・オープン	1,027,589,370円
D C マイセレクション25	884,773,512円

区分	平成27年 9月30日現在
DCマイセレクション50	4,382,284,337円
DCマイセレクション75	4,647,723,061円
DC外国株式インデックス・オープン	6,264,189,672円
DCマイセレクションS25	313,635,861円
DCマイセレクションS50	1,655,684,733円
DCマイセレクションS75	1,219,107,847円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	140,814,391円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	155,252,286円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	81,873,386円
DC世界経済インデックスファンド	2,135,676,097円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,953,602,205円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	42,980,235円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	28,010,126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）	142,191,148円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	218,368,853円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	745,208,939円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	555,254,778円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	753,766,051円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,881,085,594円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	709,636,651円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,589,087,831円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,817,837,497円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,032,528,621円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	695,212,573円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	701,325,623円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,436,652円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,640,547,051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）	3,750,901,039円
外国株式ファンド・シリーズ1	690,805,098円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,953,962,057円
コア投資戦略ファンド（成長型）	12,495,231,648円
分散投資コア戦略ファンドA	705,314,507円
分散投資コア戦略ファンドS	1,260,706,748円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	144,521,058円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	200,357,018円
コア投資戦略ファンド（切替型）	913,478,720円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	521,061,761円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	39,007,373円
SMT インデックスバランス・オープン	184,506,810円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	4,185,967,701円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,523,947,636円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,198,603,411円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	32,062,860,999	
投資信託受益証券	22,627,063	
投資証券	307,367,468	
合計	32,392,855,530	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成27年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,742,041,494	-	9,494,447,007	247,594,487
	合計	9,742,041,494	-	9,494,447,007	247,594,487

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,069,179,205	-	3,071,950,100	2,770,895
	アメリカドル	1,965,668,000	-	1,967,180,000	1,512,000
	カナダドル	120,623,400	-	120,595,500	27,900
	ユーロ	404,439,000	-	404,910,000	471,000
	イギリスポンド	263,560,500	-	263,682,500	122,000
	スイスフラン	129,446,650	-	129,738,000	291,350
	スウェーデンク ローナ	43,311,315	-	43,543,500	232,185

デンマーククローネ	13,357,740	-	13,386,600	28,860
オーストラリアドル	67,064,900	-	67,235,000	170,100
香港ドル	44,889,100	-	44,863,000	26,100
シンガポールドル	16,818,600	-	16,816,000	2,600
合計	3,069,179,205	-	3,071,950,100	2,770,895

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	36,549	59.04	2,157,852.96	
	ANTERO RESOURCES CORP	6,631	20.51	136,001.81	
	APACHE CORP	26,227	37.12	973,546.24	
	BAKER HUGHES	31,466	50.47	1,588,089.02	
	CABOT OIL & GAS CORP	29,004	21.54	624,746.16	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,037	61.41	862,012.17	
	CHENIERE ENERGY INC	15,691	48.50	761,013.50	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	41,770	6.79	283,618.30	
	CHEVRON CORP	134,308	76.25	10,240,985.00	
	CIMAREX ENERGY CO	6,569	99.53	653,812.57	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	19,979	6.80	135,857.20	
	COLUMBIA PIPELINE GROUP	21,371	17.70	378,266.70	
	CONCHO RESOURCES INC	8,359	96.60	807,479.40	
	CONOCOPHILLIPS	88,345	46.57	4,114,226.65	
	CONSOL ENERGY INC	14,731	9.41	138,618.71	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,265	28.03	175,607.95	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,702	97.78	264,201.56	
	DEVON ENERGY CORPORATION	27,140	36.43	988,710.20	
	ENERGEN CORP	4,802	50.03	240,244.06	
	ENSCO PLC-CL A	14,882	14.25	212,068.50	
EOG RESOURCES INC	39,428	70.13	2,765,085.64		
EQT CORPORATION	10,652	65.06	693,019.12		

EXXON MOBIL	298,277	72.97	21,765,272.69
FMC TECHNOLOGIES INC	15,287	31.55	482,304.85
HALLIBURTON CO	61,292	34.68	2,125,606.56
HELMERICH & PAYNE	6,883	47.84	329,282.72
HESS CORP	17,961	48.28	867,157.08
HOLLYFRONTIER CORP	12,448	46.77	582,192.96
KINDER MORGAN INC	132,085	26.16	3,455,343.60
MARATHON OIL CORP	47,335	14.97	708,604.95
MARATHON PETROLEUM CORP	39,252	45.54	1,787,536.08
MURPHY OIL CORP	11,085	23.98	265,818.30
NABORS INDUSTRIES LTD	18,529	9.66	178,990.14
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,272	37.08	1,048,325.76
NOBLE ENERGY INC	29,710	29.70	882,387.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,076	64.47	3,550,749.72
OCEANEERING INTL INC	7,126	39.25	279,695.50
ONEOK INC	15,568	30.86	480,428.48
PHILLIPS 66	38,948	74.51	2,902,015.48
PIONEER NATURAL RESOURCES	10,365	118.45	1,227,734.25
RANGE RESOURCES CORP	12,769	31.07	396,732.83
SCHLUMBERGER	90,789	69.10	6,273,519.90
SOUTHWESTERN ENERGY CO	29,105	12.17	354,207.85
SPECTRA ENERGY CORP	46,574	25.34	1,180,185.16
TESORO CORP	9,230	98.33	907,585.90
VALERO ENERGY CORP	36,660	58.74	2,153,408.40
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	52,887	8.35	441,606.45
WHITING PETROLEUM CORP	14,018	14.59	204,522.62
WILLIAMS COS	51,233	34.93	1,789,568.69
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,784	125.82	1,860,122.88
AIRGAS INC	5,138	89.09	457,744.42
ALBEMARLE CORP	7,098	42.53	301,877.94
ALCOA	92,840	9.45	877,338.00
ASHLAND INC	4,845	99.55	482,319.75
AVERY DENNISON CORP	6,084	55.59	338,209.56
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	11,076	25.00	276,900.00
BALL CORP	9,343	60.50	565,251.50
CELANESE CORP-SERIES A	11,407	56.51	644,609.57
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,307	44.19	764,796.33
CROWN HOLDINGS INC	10,494	45.01	472,334.94
DOW CHEMICAL CO	83,043	40.56	3,368,224.08
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	65,265	47.50	3,100,087.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,546	63.43	668,932.78
ECOLAB INC	19,413	108.36	2,103,592.68

FMC CORP	8,555	32.93	281,716.15
FREEPOR-T-MCMORAN INC	76,807	9.11	699,711.77
INT'L PAPER CO	27,907	37.39	1,043,442.73
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,028	101.09	609,370.52
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,091	80.96	2,355,207.36
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,255	148.37	631,314.35
MONSANTO CO	34,323	83.60	2,869,402.80
MOSAIC CO/THE	23,240	31.04	721,369.60
NEWMONT MINING CORP	39,440	15.82	623,940.80
NUCOR CORP	22,283	37.16	828,036.28
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,887	59.49	409,707.63
PPG INDUSTRIES INC	19,788	85.95	1,700,778.60
PRAXAIR INC	20,875	100.55	2,098,981.25
SEALED AIR CORP	14,781	45.97	679,482.57
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,525	218.94	1,209,643.50
SIGMA-ALDRICH	8,333	138.58	1,154,787.14
VULCAN MATERIALS CO	9,287	85.15	790,788.05
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,260	49.97	162,902.20
WESTROCK CO	18,286	50.57	924,723.02
3 M COMPANY	45,347	141.55	6,418,867.85
ACUITY BRANDS INC	3,065	169.87	520,651.55
AGCO CORP	5,969	46.36	276,722.84
AMETEK INC	16,903	51.13	864,250.39
B/E AEROSPACE INC	6,965	43.59	303,604.35
BOEING CO	46,968	128.75	6,047,130.00
CATERPILLAR	41,174	64.31	2,647,899.94
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	6,538	37.34	244,128.92
CUMMINS INC	11,934	108.10	1,290,065.40
DANAHER CORP	43,959	83.21	3,657,828.39
DEERE&CO	22,921	73.62	1,687,444.02
DOVER CORP	11,832	56.50	668,508.00
EATON CORP	33,730	50.66	1,708,761.80
EMERSON ELECTRIC CO	48,150	43.46	2,092,599.00
FASTENAL CO	19,679	36.49	718,086.71
FLOWSERVE CORP	8,985	40.19	361,107.15
FLUOR CORP	10,027	41.35	414,616.45
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,074	46.75	517,709.50
GENERAL DYNAMICS CORP	20,072	135.59	2,721,562.48
GENERAL ELECTRIC CO	718,680	24.57	17,657,967.60
GRAINGER (WW) INC	4,203	211.93	890,741.79
HONEYWELL INTL INC	53,131	92.52	4,915,680.12
ILLINOIS TOOL WORKS	23,885	81.34	1,942,805.90

INGERSOLL-RAND PLC	18,349	50.61	928,642.89
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	37.31	295,383.27
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,117	102.08	624,423.36
LOCKHEED MARTIN CORP	19,263	202.47	3,900,179.61
MASCO CORP	23,242	24.58	571,288.36
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,265	163.55	2,169,490.75
PACCAR INC	24,562	52.21	1,282,382.02
PARKER HANNIFIN CORP	10,107	96.50	975,325.50
PENTAIR PLC	12,104	50.79	614,762.16
PRECISION CASTPARTS CORP	9,957	229.24	2,282,542.68
QUANTA SERVICES INC	14,015	23.85	334,257.75
RAYTHEON COMPANY	21,971	106.68	2,343,866.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,353	100.36	938,667.08
ROCKWELL COLLIN	9,269	80.03	741,798.07
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,964	153.12	1,066,327.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,018	43.35	520,980.30
SNAP-ON INC	4,317	148.90	642,801.30
STANLEY BLACK&DECKER	10,775	94.90	1,022,547.50
TEXTRON	19,521	37.43	730,671.03
TRANSDIGM GROUP INC	3,709	212.22	787,123.98
UNITED RENTALS INC	7,302	59.94	437,681.88
UNITED TECHNOLOGIES CORP	60,490	87.98	5,321,910.20
WABCO HOLDINGS INC	3,875	104.09	403,348.75
WABTEC CORP	7,158	85.77	613,941.66
XYLEM INC	11,717	31.99	374,826.83
ADT CORPORATION	11,437	30.07	343,910.59
CINTAS CORP	6,449	84.80	546,875.20
DUN & BRADSTREET CORP	2,440	102.54	250,197.60
EQUIFAX INC	8,759	95.80	839,112.20
IHS INC-CLASS A	5,122	110.56	566,288.32
MANPOWER GROUP	5,272	77.43	408,210.96
NIELSEN HOLDINGS PLC	24,369	45.24	1,102,453.56
REPUBLIC SERVICES INC	18,168	40.32	732,533.76
ROBERT HALF INTL INC	9,340	49.77	464,851.80
STERICYCLE INC	5,973	138.21	825,528.33
TOWERS WATSON & CO-CL A	5,146	118.44	609,492.24
TYCO INTERNATIONAL PLC	29,209	33.39	975,288.51
VERISK ANALYTICS INC	11,168	72.25	806,888.00
WASTE MANAGEMENT INC	33,137	49.22	1,631,003.14
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	12,336	39.18	483,324.48
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,328	68.15	703,853.20
CSX CORP	71,296	25.94	1,849,418.24

DELTA AIR LINES INC	15,095	44.04	664,783.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,154	46.53	658,585.62
FEDEX CORP	19,359	141.93	2,747,622.87
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	25,586	16.23	415,260.78
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,122	71.77	439,375.94
KANSAS CITY SOUTHERN	7,756	88.15	683,691.40
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,053	74.91	1,651,990.23
SOUTHWEST AIRLINES CO	11,137	37.68	419,642.16
UNION PACIFIC CORP	62,862	86.55	5,440,706.10
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,125	52.46	321,317.50
UNITED PARCEL SERVICE B	50,208	98.14	4,927,413.12
AUTOLIV INC	6,037	104.35	629,960.95
BORGWARNER INC	15,914	40.42	643,243.88
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	20,004	72.94	1,459,091.76
FORD MOTOR COMPANY	265,953	13.15	3,497,281.95
GENERAL MOTORS CO	103,843	29.15	3,027,023.45
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,642	28.32	527,941.44
HARLEY-DAVIDSON	14,677	53.22	781,109.94
JOHNSON CONTROLS INC	47,274	39.80	1,881,505.20
LEAR CORP	5,323	105.58	562,002.34
TESLA MOTORS INC	6,859	246.65	1,691,772.35
COACH INC	19,687	27.74	546,117.38
DR HORTON INC	24,329	28.82	701,161.78
GARMIN LTD	7,608	35.19	267,725.52
HANESBRANDS INC	28,237	28.03	791,483.11
HARMAN INTL INDS INC	4,743	91.99	436,308.57
HASBRO INC	7,972	72.69	579,484.68
JARDEN CORP	13,882	47.63	661,199.66
LEGGETT & PLATT INC	9,020	40.68	366,933.60
LENNAR CORP-CL A	12,360	47.00	580,920.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,472	49.81	421,990.32
MATTEL INC	25,250	21.03	531,007.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	13,920	40.70	566,544.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,358	176.19	767,836.02
NEWELL RUBBERMAID	19,732	38.56	760,865.92
NIKE B	48,802	119.67	5,840,135.34
POLARIS INDUSTRIES INC	4,691	118.68	556,727.88
PULTE GROUP INC	24,602	18.72	460,549.44
PVH CORP	5,867	96.76	567,690.92
RALPH LAUREN CORPORATION	3,958	104.05	411,829.90
TOLL BROTHERS INC	11,131	34.02	378,676.62
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12,439	93.96	1,168,768.44

VF CORP	24,586	67.23	1,652,916.78
WHIRLPOOL CORP	5,470	145.46	795,666.20
ARAMARK	17,044	28.81	491,037.64
BLOCK H & R INC	19,500	35.25	687,375.00
CARNIVAL CORPORATION	28,759	48.23	1,387,046.57
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,247	708.54	1,592,089.38
DARDEN RESTAURANTS INC	8,439	67.89	572,923.71
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,483	21.90	755,177.70
LAS VEGAS SANDS CORP	27,583	37.81	1,042,913.23
MARRIOTT INTL A	15,364	65.44	1,005,420.16
MCDONALD'S CORP	68,516	97.48	6,678,939.68
MGM RESORTS INTERNATIONAL	31,282	17.76	555,568.32
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11,086	56.08	621,702.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,264	85.85	1,052,864.40
STARBUCKS CORP	107,240	55.72	5,975,412.80
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,530	64.53	808,560.90
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,080	70.18	567,054.40
WYNN RESORTS LTD	5,532	53.22	294,413.04
YUM BRANDS INC	31,103	76.15	2,368,493.45
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,178	32.10	423,013.80
CBS CORP-CL B	31,516	38.97	1,228,178.52
CHARTER COMMUNICATION-A	5,860	167.36	980,729.60
COMCAST CORP-CL A	151,626	55.14	8,360,657.64
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,986	55.58	1,611,041.88
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,803	26.40	258,799.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,203	24.70	449,614.10
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,581	56.36	878,145.16
INTERPUBLIC GROUP OF COS	30,771	18.74	576,648.54
LIBERTY GLOBAL PLC-A	17,571	42.49	746,591.79
LIBERTY GLOBAL PLC-C	44,688	40.70	1,818,801.60
LIBERTY MEDIA CORP	6,384	35.09	224,014.56
LIBERTY MEDIA CORP-C	15,233	33.70	513,352.10
NEWS CORP-CLASS A	27,721	12.26	339,859.46
OMNICOM GROUP	16,939	64.85	1,098,494.15
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	48.14	236,896.94
SIRIUS XM HOLDINGS INC	166,017	3.65	605,962.05
TEGNA INC	15,014	21.85	328,055.90
THE WALT DISNEY CO	115,045	99.42	11,437,773.90
TIME WARNER CABLE-A	20,265	174.00	3,526,110.00
TIME WARNER INC	59,065	66.60	3,933,729.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	90,566	25.80	2,336,602.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	30,649	25.88	793,196.12

VIACOM INC-CLASS B	25,254	42.83	1,081,628.82
ADVANCE AUTO PARTS	5,123	170.53	873,625.19
AMAZON.COM	28,241	496.07	14,009,512.87
AUTONATION INC	5,015	56.65	284,099.75
AUTOZONE INC	2,296	724.72	1,663,957.12
BED BATH & BEYOND INC	12,615	56.52	712,999.80
BEST BUY COMPANY INC	22,277	35.97	801,303.69
CARMAX INC	14,601	57.96	846,273.96
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,344	49.00	310,856.00
DOLLAR GENERAL CORP	22,000	70.33	1,547,260.00
DOLLAR TREE INC	15,514	66.24	1,027,647.36
EXPEDIA INC	7,575	114.01	863,625.75
FOOT LOCKER INC	9,388	71.91	675,091.08
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	40.43	302,861.13
GAP	17,852	30.22	539,487.44
GENUINE PARTS CO	10,617	82.54	876,327.18
HOME DEPOT	92,729	112.91	10,470,031.39
KOHL'S CORP	14,309	46.27	662,077.43
L BRANDS INC	17,992	89.39	1,608,304.88
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	31,128	26.09	812,129.52
LKQ CORP	22,518	27.94	629,152.92
LOWES COMPANIES	67,794	66.77	4,526,605.38
MACY'S INC	23,441	50.39	1,181,191.99
NETFLIX INC	28,992	98.35	2,851,363.20
NORDSTROM INC	10,094	70.44	711,021.36
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,304	242.98	1,774,725.92
PRICELINE GROUP INC/THE	3,710	1,200.32	4,453,187.20
ROSS STORES INC	30,013	47.56	1,427,418.28
SIGNET JEWELERS LTD	5,419	133.80	725,062.20
STAPLES INC	47,470	11.83	561,570.10
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,511	77.98	3,392,987.78
TIFFANY & CO	9,101	75.20	684,395.20
TJX COMPANIES INC	48,793	69.48	3,390,137.64
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,011	82.31	824,005.41
TRIPADVISOR INC	8,771	63.42	556,256.82
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,504	161.71	728,341.84
URBAN OUTFITTERS INC	7,303	29.01	211,860.03
COSTCO WHOLESALE CORP	31,505	143.72	4,527,898.60
CVS HEALTH CORP	80,600	95.12	7,666,672.00
KROGER CO	67,058	35.61	2,387,935.38
RITE AID CORP	69,829	6.10	425,956.90
SYSCO CORP	42,954	38.93	1,672,199.22

WAL-MART STORES	115,229	63.78	7,349,305.62
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,415	82.06	5,121,774.90
WHOLE FOODS MKT INC	25,128	31.27	785,752.56
ALTRIA GROUP INC	140,516	54.23	7,620,182.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,789	41.02	1,837,244.78
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,415	95.52	803,800.80
BUNGE LIMITED	10,583	72.39	766,103.37
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,202	50.59	667,889.18
COCA-COLA CO	295,556	39.66	11,721,750.96
COCA-COLA ENTERPRISES	15,090	47.71	719,943.90
CONAGRA	29,521	40.06	1,182,611.26
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,414	123.50	1,533,129.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,320	78.24	1,042,156.80
GENERAL MILLS INC	42,898	55.56	2,383,412.88
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,504	92.39	970,464.56
HORMEL FOODS CORP	10,754	61.78	664,382.12
JM SMUCKER CO	7,181	112.54	808,149.74
KELLOGG CO	18,340	66.45	1,218,693.00
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	8,222	53.71	441,603.62
KRAFT HEINZ CO/THE	42,751	69.20	2,958,369.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,566	81.19	695,473.54
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,100	69.64	981,924.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,738	82.00	880,516.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,411	40.81	4,750,732.91
MONSTER BEVERAGE CORP	9,868	134.55	1,327,739.40
PEPSICO INC	105,394	93.04	9,805,857.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,640	78.64	8,700,729.60
REYNOLDS AMERICAN INC	61,705	43.47	2,682,316.35
TYSON FOODS INC	21,224	41.82	887,587.68
WHITEWAVE FOODS CO	12,395	40.23	498,650.85
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,620	84.53	813,178.60
CLOROX COMPANY	9,110	114.56	1,043,641.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,584	63.07	3,884,102.88
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	4,504	81.11	365,319.44
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,024	78.73	1,261,569.52
KIMBERLY-CLARK CORP	26,166	107.74	2,819,124.84
PROCTER & GAMBLE CO	193,587	72.28	13,992,468.36
ABBOTT LABORATORIES	106,578	39.50	4,209,831.00
AETNA INC	25,079	106.31	2,666,148.49
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,456	95.05	1,374,042.80
ANTHEM INC	19,010	137.72	2,618,057.20
BARD C R INC	5,186	185.40	961,484.40

BAXTER INTERNATIONAL	37,616	32.69	1,229,667.04
BECTON DICKINSON & CO	15,099	130.89	1,976,308.11
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,069	16.00	1,553,104.00
CARDINAL HEALTH	23,879	76.72	1,831,996.88
CENTENE CORP	7,820	52.87	413,443.40
CERNER CORP	21,475	59.48	1,277,333.00
CIGNA CORP	18,507	132.50	2,452,177.50
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	11,984	71.18	853,021.12
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,467	50.52	528,792.84
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,475	137.79	1,029,980.25
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	12,845	35.99	462,291.55
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	52,190	80.80	4,216,952.00
HCA HOLDINGS INC	23,905	74.08	1,770,882.40
HENRY SCHEIN INC	5,885	129.95	764,755.75
HOLOGIC INC	16,762	37.86	634,609.32
HUMANA INC	10,808	175.76	1,899,614.08
INTUITIVE SURGICAL INC	2,554	455.47	1,163,270.38
LABORATORY CRP OF AMER	7,053	106.86	753,683.58
MCKESSON CORP	16,616	184.77	3,070,138.32
MEDTRONIC PLC	101,217	66.37	6,717,772.29
PATTERSON COMPANIES INC	5,552	42.97	238,569.44
QUEST DIAGNOSTICS	10,170	60.70	617,319.00
RESMED INC	10,525	50.62	532,775.50
ST JUDE MEDICAL INC	19,447	62.94	1,223,994.18
STRYKER CORP	24,512	93.23	2,285,253.76
THE COOPER COS INC	3,161	145.29	459,261.69
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,006	114.22	7,767,645.32
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,432	121.16	779,301.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,730	73.25	492,972.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,989	93.79	1,124,448.31
ABBVIE INC	122,912	52.79	6,488,524.48
AGILENT TECHNOLOGIES	23,439	33.74	790,831.86
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,101	147.75	2,378,922.75
ALKERMES PLC	10,522	55.08	579,551.76
ALLERGAN PLC	28,032	252.10	7,066,867.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,369	77.40	415,560.60
AMGEN	54,309	133.82	7,267,630.38
BAXALTA INC	37,546	31.07	1,166,554.22
BIOGEN INC	16,831	278.23	4,682,889.13
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,088	96.82	1,073,540.16
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	119,135	58.95	7,023,008.25
CELGENE CORP	56,686	105.34	5,971,303.24

ENDO INTERNATIONAL PLC	14,108	60.57	854,521.56
GILEAD SCIENCES INC	104,905	96.00	10,070,880.00
ILLUMINA INC	10,393	169.82	1,764,939.26
INCYTE CORP	11,132	99.59	1,108,635.88
ISIS PHARMACEUTICALS INC	9,019	38.04	343,082.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,302	124.81	536,932.62
JOHNSON & JOHNSON	197,782	93.04	18,401,637.28
LILLY (ELI) & CO	71,505	80.28	5,740,421.40
MALLINCKRODT PLC	8,200	57.96	475,272.00
MEDIVATION INC	11,768	39.15	460,717.20
MERCK & CO	201,689	48.65	9,812,169.85
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,879	282.43	530,685.97
MYLAN NV	28,817	39.80	1,146,916.60
PERRIGO CO PLC	10,560	154.90	1,635,744.00
PFIZER	439,346	31.02	13,628,512.92
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	2,028	71.47	144,941.16
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	6,593	68.86	453,993.98
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,456	451.82	2,465,129.92
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,546	119.84	3,420,952.64
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,226	136.97	441,865.22
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,550	99.83	1,752,016.50
WATERS CORP	5,852	117.20	685,854.40
ZOETIS INC	32,871	39.65	1,303,335.15
BANK OF AMERICA CORP	749,534	15.35	11,505,346.90
BB&T CORP	56,217	35.17	1,977,151.89
CIT GROUP INC	12,099	39.61	479,241.39
CITIGROUP	216,580	49.00	10,612,420.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,664	23.22	688,798.08
COMERICA INC	11,868	40.71	483,146.28
FIFTH THIRD BANCORP	56,599	18.65	1,055,571.35
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,126	61.77	625,483.02
HUDSON CITY BANCORP INC	33,541	9.50	318,639.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	60,051	10.44	626,932.44
JPMORGAN CHASE & CO	264,723	59.84	15,841,024.32
KEY CORP	62,338	12.77	796,056.26
M & T BANK CORP	8,310	120.10	998,031.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,048	17.90	591,559.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	21,837	15.53	339,128.61
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,154	87.85	3,263,978.90
REGIONS FINL CORP	93,833	8.83	828,545.39
SUNTRUST BANKS	35,813	37.58	1,345,852.54
US BANCORP	126,859	40.65	5,156,818.35

WELLS FARGO & CO	348,898	50.89	17,755,419.22
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,839	166.61	639,615.79
ALLY FINANCIAL INC	30,804	19.93	613,923.72
AMERICAN EXPRESS	65,430	73.10	4,782,933.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,569	106.45	1,337,970.05
BANK NEW YORK CO	80,497	38.44	3,094,304.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	83,237	128.81	10,721,757.97
BLACKROCK INC	8,875	293.52	2,604,990.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,238	71.55	2,807,478.90
CME GROUP INC	23,109	90.39	2,088,822.51
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,027	51.10	1,636,579.70
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,026	25.54	511,464.04
EATON VANCE CORP	7,881	33.27	262,200.87
FRANKLIN RESOURCES INC	27,900	36.36	1,014,444.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,821	171.86	4,781,317.06
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,040	227.79	1,831,431.60
INVESCO LTD	29,872	30.82	920,655.04
LEGG MASON INC	7,716	41.18	317,744.88
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,648	20.08	434,691.84
MCGRAW-HILL FINANCIAL	19,765	85.40	1,687,931.00
MOODY'S CORP	12,621	97.53	1,230,926.13
MORGAN STANLEY	105,938	31.01	3,285,137.38
NASDAQ INC	7,604	51.81	393,963.24
NAVIENT CORP	29,884	11.63	347,550.92
NORTHERN TRUST CORP	15,365	67.25	1,033,296.25
PRICE T ROWE GROUP INC	18,086	68.27	1,234,731.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,630	48.95	422,438.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	84,997	27.58	2,344,217.26
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,417	46.64	439,208.88
STATE STREET CORP	29,676	66.62	1,977,015.12
SYNCHRONY FINANCIAL	11,555	31.04	358,667.20
TD AMERITRADE HOLDING CORP	20,139	30.99	624,107.61
VOYA FINANCIAL INC	16,094	38.38	617,687.72
ACE LTD	23,508	101.59	2,388,177.72
AFLAC	31,363	57.72	1,810,272.36
ALLEGHANY CORP	1,109	463.63	514,165.67
ALLSTATE CORP	29,595	58.36	1,727,164.20
AMERICAN INT'L GROUP	95,373	55.72	5,314,183.56
AON PLC	20,347	88.40	1,798,674.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,789	73.25	643,794.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	11,411	40.78	465,340.58
ASSURANT INC	4,769	77.45	369,359.05

AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	7,302	53.99	394,234.98
CHUBB CORPORATION	16,578	121.83	2,019,697.74
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,121	53.27	592,415.67
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	172.04	505,969.64
FNF GROUP	18,683	34.75	649,234.25
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,014	45.05	1,307,080.70
LINCOLN NATIONAL CORP	17,658	46.92	828,513.36
LOEWS CORP	21,888	35.65	780,307.20
MARSH & MCLENNAN COS	38,821	51.79	2,010,539.59
METLIFE INC	68,046	46.34	3,153,251.64
PARTNERRE LTD	3,587	138.23	495,831.01
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,417	46.79	955,311.43
PROGRESSIVE CORP	40,801	30.44	1,241,982.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,576	74.99	2,442,874.24
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,249	106.15	344,881.35
TORCHMARK CORP	8,367	56.67	474,157.89
TRAVELERS COS INC/THE	22,954	99.47	2,283,234.38
UNUM GROUP	18,574	31.53	585,638.22
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	10,983	40.60	445,909.80
WR BERKLEY CORP	7,065	53.84	380,379.60
XL GROUP PLC	21,398	36.24	775,463.52
CBRE GROUP INC-A	21,139	31.31	661,862.09
JONES LANG LASALLE INC	3,112	143.50	446,572.00
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	37.15	350,027.30
WEYERHAEUSER CO	36,213	27.06	979,923.78
ACCENTURE PLC-CL A	44,937	96.60	4,340,914.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,536	30.66	1,089,533.76
ADOBE SYSTEMS INC	36,009	79.83	2,874,598.47
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,545	67.50	846,787.50
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4,344	251.20	1,091,212.80
ANSYS INC	5,989	86.92	520,563.88
AUTODESK INC	16,007	45.24	724,156.68
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,826	79.09	2,675,298.34
CA INC	24,426	26.83	655,349.58
CDK GLOBAL INC	9,538	46.92	447,522.96
CITRIX SYSTEMS INC	11,275	67.62	762,415.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,959	60.58	2,663,036.22
COMPUTER SCIENCES CORP	10,337	59.81	618,255.97
EBAY	78,992	24.08	1,902,127.36
ELECTRONIC ARTS INC	22,844	66.00	1,507,704.00
FACEBOOK INC-A	152,743	86.67	13,238,235.81
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	19,633	66.50	1,305,594.50

FIREEYE INC	7,918	31.23	247,279.14
FISERV INC	16,464	84.76	1,395,488.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,487	140.62	771,581.94
GARTNER INC	6,094	83.67	509,884.98
GOOGLE INC-CL A	20,610	622.61	12,831,992.10
GOOGLE INC-CL C	22,046	594.97	13,116,708.62
INTL BUSINESS MACHINES CORP	66,925	142.47	9,534,804.75
INTUIT INC	18,993	86.83	1,649,162.19
LINKEDIN CORP - A	7,652	186.61	1,427,939.72
MASTERCARD INC-CLASS A	71,942	88.76	6,385,571.92
MICROSOFT CORP	549,044	43.44	23,850,471.36
NETSUITE INC	2,264	83.65	189,383.60
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,524	16.04	281,084.96
ORACLE CORP	249,963	35.51	8,876,186.13
PAYCHEX INC	22,738	46.01	1,046,175.38
PAYPAL HOLDINGS INC	78,428	30.63	2,402,249.64
RACKSPACE HOSTING INC	8,040	25.19	202,527.60
RED HAT INC	12,854	70.49	906,078.46
SALESFORCE.COM INC	44,787	68.38	3,062,535.06
SERVICENOW INC	10,271	68.94	708,082.74
SPLUNK INC	8,873	54.44	483,046.12
SYMANTEC CORP	47,460	19.35	918,351.00
SYNOPSYS INC	11,010	45.96	506,019.60
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	3,378	77.58	262,065.24
TERADATA CORP	9,511	29.20	277,721.20
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	10,950	44.90	491,655.00
TWITTER INC	34,394	25.59	880,142.46
VANTIV INC - CL A	9,716	44.63	433,625.08
VERISIGN INC	7,494	68.19	511,015.86
VISA INC-CLASS A SHARES	140,034	68.53	9,596,530.02
VMWARE INC-CLASS A	5,459	77.41	422,581.19
WESTERN UNION CO	34,620	18.10	626,622.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,992	70.70	565,034.40
XEROX CORP	73,995	9.49	702,212.55
YAHOO	64,457	28.26	1,821,554.82
ZILLOW GROUP INC-A	3,100	28.75	89,125.00
ZILLOW GROUP INC-C	6,200	27.50	170,500.00
AMPHENOL CORPORATION	21,467	49.72	1,067,339.24
APPLE INC	411,408	109.06	44,868,156.48
ARROW ELECTRONICS INC	6,579	52.17	343,226.43
AVNET INC	9,057	40.94	370,793.58
CISCO SYSTEMS	363,870	25.64	9,329,626.80

CORNING	87,462	16.70	1,460,615.40
EMC CORP	139,592	23.13	3,228,762.96
F5 NETWORKS INC	5,350	115.00	615,250.00
FLEXTRONICS INTL LTD	38,641	10.34	399,547.94
FLIR SYSTEMS INC	9,284	27.45	254,845.80
HARRIS CORP	8,769	71.07	623,212.83
HEWLETT-PACKARD CO	130,581	24.65	3,218,821.65
JUNIPER NETWORKS INC	24,324	25.04	609,072.96
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,616	67.45	918,399.20
NETAPP INC	23,085	28.95	668,310.75
PALO ALTO NETWORKS INC	4,973	167.81	834,519.13
QUALCOMM	116,767	52.43	6,122,093.81
SANDISK CORP	15,286	49.09	750,389.74
SEAGATE TECHNOLOGY	23,147	41.78	967,081.66
TE CONNECTIVITY LTD	29,455	57.60	1,696,608.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	17,032	16.34	278,302.88
WESTERN DIGITAL CORP	16,063	69.37	1,114,290.31
AT&T INC	438,612	32.07	14,066,286.84
CENTURYLINK INC	39,157	24.69	966,786.33
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	82,647	4.68	386,787.96
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,961	41.64	872,816.04
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,972	103.61	929,588.92
SPRINT CORP	53,367	3.74	199,592.58
T-MOBILE US INC	19,816	39.56	783,920.96
VERIZON COMMUNICATIONS	291,030	43.53	12,668,535.90
AES CORP	44,856	9.46	424,337.76
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,521	57.74	492,002.54
AMEREN CORPORATION	17,147	41.69	714,858.43
AMERICAN ELECTRIC POWER	35,378	56.13	1,985,767.14
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,314	54.19	721,485.66
CALPINE CORP	25,284	14.30	361,561.20
CENTERPOINT ENERGY INC	30,517	17.53	534,963.01
CMS ENERGY CORP	18,893	34.50	651,808.50
CONSOLIDATED EDISON INC	20,321	65.90	1,339,153.90
DOMINION RESOURCES	42,626	69.29	2,953,555.54
DTE ENERGY COMPANY	12,439	78.23	973,102.97
DUKE ENERGY CORP	49,603	70.73	3,508,420.19
EDISON INTL	22,596	61.79	1,396,206.84
ENTERGY CORP	12,548	64.33	807,212.84
EVERSOURCE ENERGY	22,121	49.30	1,090,565.30
EXELON CORP	62,204	29.15	1,813,246.60
FIRSTENERGY CORP	29,330	30.83	904,243.90

	MDU RESOURCES GROUP INC	12,385	16.66	206,334.10
	NEXTERA ENERGY INC	31,883	96.79	3,085,955.57
	NRG ENERGY INC	25,186	14.47	364,441.42
	OGE ENERGY CORP	12,751	26.54	338,411.54
	PEPCO HOLDINGS INC	16,437	24.16	397,117.92
	PG&E CORP	34,729	52.01	1,806,255.29
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,330	63.22	526,622.60
	PPL CORPORATION	46,162	32.21	1,486,878.02
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	34,913	40.91	1,428,290.83
	SCANA CORP	10,178	54.78	557,550.84
	SEMPRA ENERGY	17,041	94.46	1,609,692.86
	SOUTHERN CO	65,269	44.29	2,890,764.01
	WEC ENERGY GROUP INC	22,005	51.12	1,124,895.60
	XCEL ENERGY INC	35,219	34.70	1,222,099.30
	ALTERA CORPORATION	21,988	49.65	1,091,704.20
	ANALOG DEVICES	21,812	54.05	1,178,938.60
	APPLIED MATERIALS	85,527	14.55	1,244,417.85
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,714	119.67	2,239,504.38
	BROADCOM CORP-CL A	39,952	50.52	2,018,375.04
	FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	7,708	34.92	269,163.36
	INTEL CORP	339,374	29.24	9,923,295.76
	KLA-TENCOR CORP	10,702	48.18	515,622.36
	LAM RESEARCH CORP	11,195	62.86	703,717.70
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,891	38.73	654,188.43
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,286	9.05	274,088.30
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,025	32.13	675,533.25
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,894	41.67	620,632.98
	MICRON TECHNOLOGY	75,291	14.38	1,082,684.58
	NVIDIA CORP	37,929	23.71	899,296.59
	QORVO INC	10,609	43.57	462,234.13
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,268	82.85	1,099,253.80
	TEXAS INSTRUMENTS	74,739	47.53	3,552,344.67
	XILINX INC	18,324	40.96	750,551.04
	アメリカドル 小計	22,527,588		1,215,703,707.05 (145,835,816,697)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	32.47	285,411.30
	ARC RESOURCES LTD	21,371	17.48	373,565.08
	BAYTEX ENERGY CORP	17,204	3.96	68,127.84
	CAMECO CORP	28,709	15.91	456,760.19
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,135	26.23	2,023,251.05
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	6.22	180,255.60
	CENOVUS ENERGY INC	59,243	20.42	1,209,742.06

CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,454	15.03	577,963.62
ENBRIDGE	60,169	48.53	2,920,001.57
ENCANA CORP	57,917	8.47	490,556.99
ENERPLUS CORP	14,969	6.36	95,202.84
HUSKY ENERGY INC	22,657	20.89	473,304.73
IMPERIAL OIL	21,387	41.88	895,687.56
INTER PIPELINE LTD	25,744	24.71	636,134.24
KEYERA CORP	11,240	36.02	404,864.80
MEG ENERGY CORP	11,150	8.26	92,099.00
PEMBINA PIPELINE CORP	25,731	31.96	822,362.76
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	26.86	246,359.92
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,235	25.03	231,152.05
SUNCOR ENERGY	104,463	35.50	3,708,436.50
TOURMALINE OIL CORP	11,584	30.01	347,635.84
TRANSCANADA CORP	49,707	41.38	2,056,875.66
VERESEN INC	23,263	10.03	233,327.89
VERMILION ENERGY INC	7,138	42.25	301,580.50
AGNICO EAGLE MINES	13,800	33.09	456,642.00
AGRIUM INC	9,859	118.45	1,167,798.55
BARRICK GOLD CORP	89,275	8.34	744,553.50
ELDORADO GOLD CORP	45,613	4.04	184,276.52
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,991	4.65	260,358.15
FRANCO-NEVADA CORP	10,197	57.44	585,715.68
GOLDCORP INC	59,518	16.37	974,309.66
KINROSS GOLD CORP	81,986	2.26	185,288.36
METHANEX CORP	6,468	43.17	279,223.56
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	58,698	27.25	1,599,520.50
SILVER WHEATON CORP	28,647	15.87	454,627.89
TECK RESOURCES LTD-CL B	37,266	6.31	235,148.46
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,327	43.71	189,133.17
YAMANA GOLD INC	59,651	2.20	131,232.20
BOMBARDIER B	157,835	1.69	266,741.15
CAE INC	18,429	13.70	252,477.30
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	19.55	229,986.20
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,132	37.54	455,435.28
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,934	74.42	4,311,448.28
CP RAILWAY LIMITED	10,996	185.50	2,039,758.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,782	61.70	1,775,849.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,659	39.82	703,181.38
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,433	46.60	719,177.80
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,558	25.58	781,673.64
THOMSON REUTERS CORP	25,460	52.69	1,341,487.40

	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	119.23	644,915.07
	DOLLARAMA INC	8,315	88.09	732,468.35
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,496	60.04	1,770,939.84
	EMPIRE CO LTD 'A'	11,499	26.84	308,633.16
	JEAN COUTU GROUP INC A	5,514	19.85	109,452.90
	LOBLAW COMPANIES LTD	16,203	68.27	1,106,178.81
	METRO INC	19,179	36.05	691,402.95
	WESTON (GEORGE) LTD	3,518	106.63	375,124.34
	SAPUTO INC	16,769	28.96	485,630.24
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	23,471	212.06	4,977,260.26
	BANK MONTREAL	46,810	70.73	3,310,871.30
	BANK NOVA SCOTIA	87,726	58.01	5,088,985.26
	CANADIAN IMPERIAL BANK	28,004	93.65	2,622,574.60
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,678	41.87	991,397.86
	ROYAL BANK OF CANADA	103,729	72.00	7,468,488.00
	TORONTO-DOMINION BANK	133,315	51.43	6,856,390.45
	CI FINANCIAL CORP	18,671	29.37	548,367.27
	IGM FINANCIAL INC	7,685	33.40	256,679.00
	ONEX CORP	5,970	76.49	456,645.30
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,554	595.19	924,925.26
	GREAT-WEST LIFECO INC	22,628	31.66	716,402.48
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	39.12	270,749.52
	INTACT FINANCIAL CORP	9,906	93.68	927,994.08
	MANULIFE FINANCIAL CORP	142,781	20.31	2,899,882.11
	POWER CORP OF CANADA	28,343	27.40	776,598.20
	POWER FINANCIAL CORP	16,605	30.30	503,131.50
	SUN LIFE FINANCIAL INC	42,970	42.56	1,828,803.20
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	60,418	40.12	2,423,970.16
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,916	18.42	127,392.72
	CGI GROUP INC - CL A	17,086	47.28	807,826.08
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,448	551.30	798,282.40
	OPEN TEXT CORP	8,064	59.25	477,792.00
	BCE INC	10,313	54.40	561,027.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	25,886	46.31	1,198,780.66
	TELUS CORP	16,454	42.47	698,801.38
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	38.38	201,149.58
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	34.95	253,981.65
	FORTIS INC	21,187	36.30	769,088.10
	TRANSALTA CORP	15,621	5.99	93,569.79
	カナダドル 小計	2,756,260		95,518,256.65 (8,533,601,049)
ユーロ	ENI	182,966	13.69	2,504,804.54

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	8.49	219,469.67
NESTE OIL OYJ	9,335	21.08	196,781.80
OMV AG	9,889	21.25	210,190.69
REPSOL SA	74,777	10.23	764,968.71
SAIPEM	22,904	7.11	162,961.96
TECHNIP S.A.	7,230	41.54	300,370.35
TENARIS SA	34,866	10.87	378,993.42
TOTAL SA	154,199	39.18	6,042,287.81
VOPAK	4,507	34.61	155,987.27
AIR LIQUIDE	24,736	103.00	2,547,808.00
AKZO NOBEL	17,228	56.21	968,385.88
ARCELORMITTAL	75,111	4.69	352,871.47
ARKEMA	4,293	56.54	242,726.22
BASF SE	65,779	66.66	4,384,828.14
CRH	58,420	22.97	1,341,907.40
EVONIK INDUSTRIES AG	10,337	29.52	305,148.24
FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	38.57	163,073.96
HEIDELBERGCEMENT AG	10,108	60.25	609,007.00
IMERYS SA	3,000	57.00	171,000.00
K+S AG	14,355	29.40	422,108.77
KONINKLIJKE DSM NV	13,482	40.56	546,829.92
LANXESS	5,814	41.38	240,612.39
LINDE AG	13,402	142.50	1,909,785.00
OCI NV	5,400	22.71	122,634.00
SOLVAY SA	4,469	90.48	404,355.12
STORA ENSO OYJ R	36,014	6.69	240,933.66
SYMRISE AG	8,131	52.45	426,470.95
THYSSEN KRUPP	26,520	15.61	414,109.80
UMICORE	6,892	33.75	232,639.46
UPM KYMMENE CORP	38,348	13.29	509,644.92
VOESTALPINE AG	7,829	29.94	234,439.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	14,261	25.49	363,512.89
AIRBUS GROUP SE	42,522	52.26	2,222,199.72
ALSTOM RGPT	16,356	27.34	447,173.04
ANDRITZ AG	5,242	39.81	208,684.02
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	38.79	227,037.87
BOUYGUES ORD	13,925	31.47	438,219.75
BRENTAG AG	11,535	46.78	539,664.97
CNH INDUSTRIAL NV	65,726	5.70	374,638.20
FERROVIAL SA	31,764	20.98	666,408.72
FINMECCANICA SPA	28,941	10.91	315,746.31
GEA GROUP AG	13,801	32.14	443,633.14

KONE OYJ-B	23,752	32.63	775,027.76
KONINKLIJKE PHILIPS	65,209	20.78	1,355,369.06
LEGRAND SA	18,733	46.60	872,957.80
MAN SE	2,329	90.20	210,075.80
METSO OYJ	6,575	18.61	122,360.75
OSRAM LICHT AG	5,675	44.69	253,644.12
PRYSMIAN SPA	14,715	18.17	267,371.55
REXEL SA	18,266	10.92	199,556.05
SAFRAN SA	20,383	66.79	1,361,380.57
SAINT-GOBAIN	33,361	38.00	1,267,884.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,019	48.96	1,959,530.33
SIEMENS	56,767	79.00	4,484,593.00
THALES SA	7,875	60.46	476,122.50
VINCI S.A.	34,479	56.18	1,937,030.22
WARTSILA OYJ	9,741	34.70	338,012.70
ZARDOYA OTIS SA	13,496	9.06	122,273.76
ZODIAC AEROSPACE	13,148	19.40	255,071.20
BUREAU VERITAS SA	19,558	18.59	363,583.22
EDENRED	13,303	14.43	191,962.29
RANDSTAD HOLDING NV	9,588	51.96	498,192.48
SOCIETE BIC SA	1,899	136.10	258,453.90
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	34,142	13.81	471,671.73
ADP	2,382	98.96	235,722.72
AENA SA	4,899	97.30	476,672.70
ATLANTIA SPA	29,543	24.22	715,531.46
BOLLORE	61,805	4.31	266,750.38
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,731	11.69	172,279.04
DEUTSCHE POST AG-REG	67,417	24.40	1,645,311.88
FRAPORT AG	2,319	53.27	123,533.13
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	30,159	11.95	360,400.05
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	60,245	7.68	463,043.07
TNT EXPRESS	38,784	6.83	264,972.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,900	76.37	1,825,243.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	59.50	213,069.50
CONTINENTAL AG	7,670	183.00	1,403,610.00
DAIMLER AG	68,927	63.26	4,360,322.02
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	66,864	11.08	740,853.12
MICHELIN	13,073	79.38	1,037,734.74
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,697	28.20	217,055.40
PEUGEOT SA	31,342	12.64	396,319.59
PIRELLI & CO	19,856	14.96	297,045.76
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,908	37.54	409,486.32

RENAULT SA	13,521	62.72	848,037.12
VALEO SA	5,679	114.25	648,825.75
VOLKSWAGEN AG-PFD	11,739	95.20	1,117,552.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,594	103.30	267,960.20
ADIDAS AG	14,723	70.58	1,039,149.34
CHRISTIAN DIOR	4,038	159.20	642,849.60
HERMES INTERNATIONAL	1,961	311.10	610,067.10
HUGO BOSS AG	4,852	97.47	472,924.44
KERING	5,366	140.25	752,581.50
LUXOTTICA GROUP SPA	12,039	59.65	718,126.35
LVMH	20,068	145.55	2,920,897.40
ACCOR	14,931	40.10	598,733.10
SODEXO	7,055	71.34	503,303.70
ALTICE NV -A	17,433	18.92	329,919.52
ALTICE NV -B	5,811	19.97	116,074.72
AXEL SPRINGER SE	2,489	50.19	124,922.91
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,976	27.03	323,711.28
JC DECAUX SA	4,674	32.17	150,385.95
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	116.05	153,534.15
LAGADERE S.C.A	9,057	23.93	216,779.29
NUMERICABLE-SFR	7,526	41.07	309,092.82
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	16,172	43.26	699,681.58
PUBLICIS GROUPE	13,383	59.13	791,336.79
RELX NV	71,956	14.15	1,018,177.40
RTL GROUP	2,486	76.00	188,936.00
SES	22,954	27.09	621,938.63
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	50.93	163,994.60
VIVENDI	83,735	20.45	1,712,380.75
WOLTERS KLUWER	22,399	27.09	606,788.91
INDITEX	78,610	28.93	2,274,580.35
CARREFOUR	38,705	25.27	978,075.35
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	45.56	167,998.15
COLRUYT SA	4,415	41.63	183,818.52
DELHAIZE GROUP	7,450	77.61	578,194.50
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.18	239,665.80
JERONIMO MARTINS	20,234	11.24	227,430.16
KONINKLIJKE AHOLD NV	62,997	17.10	1,077,563.68
METRO STAMM	13,712	23.63	324,083.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV	57,541	93.55	5,382,960.55
DANONE (GROUPE)	41,751	54.18	2,262,069.18
HEINEKEN HOLDING NV	7,613	61.85	470,864.05
HEINEKEN NV	16,177	69.52	1,124,625.04

KERRY GROUP PLC-A	11,778	64.61	760,976.58
PERNOD-RICARD	14,803	88.29	1,306,956.87
REMY COINTREAU	1,575	55.27	87,050.25
BEIERSDORF AG	7,534	76.43	575,823.62
HENKEL AG & CO KGAA	7,463	77.01	574,725.63
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,471	89.21	1,112,537.91
LOREAL	18,113	148.80	2,695,214.40
UNILEVER NV-CVA	116,743	34.81	4,064,407.54
ESSILOR INTERNATIONAL	14,283	105.50	1,506,856.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,305	68.80	1,052,984.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	26,443	59.50	1,573,358.50
BAYER	59,112	112.55	6,653,055.60
GRIFOLS SA	11,364	36.46	414,388.26
MERCK KGAA	9,216	77.34	712,765.44
ORION OYJ-CLASS B	7,975	33.46	266,843.50
QIAGEN N.V.	14,956	22.60	338,080.38
SANOFI	84,117	83.09	6,989,281.53
UCB (GROUPE)	9,374	69.36	650,180.64
BANCO BILBAO VIZCAYA	458,597	7.50	3,440,853.29
BANCO DE SABADELL SA	352,757	1.64	578,874.23
BANCO SANTANDER SA	1,044,045	4.66	4,867,337.79
BANKINTER SA	46,530	6.48	301,793.58
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.04	101,505.28
BNP PARIBAS	77,319	50.90	3,935,537.10
CAIXABANK	184,750	3.40	629,443.25
COMMERZBANK AG	77,118	9.27	715,038.09
CREDIT AGRICOLE SA	74,240	10.10	750,195.20
ERSTE GROUP BANK AG	20,524	25.68	527,056.32
ING GROEP NV-CVA	282,592	12.42	3,509,792.64
INTESA SANPAOLO	928,149	3.06	2,845,704.83
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	2.82	183,560.00
KBC GROEP NV	17,988	55.38	996,175.44
NATIXIS	69,996	4.81	337,310.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,197	10.90	100,247.30
SOCIETE GENERALE	53,264	38.73	2,063,181.04
UNICREDIT SPA	351,961	5.39	1,897,069.79
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	65,534	6.29	412,208.86
DEUTSCHE BANK NAMEN	101,094	23.51	2,376,719.94
DEUTSCHE BOERSE	13,777	74.97	1,032,861.69
EURAZEO	2,763	57.54	158,983.02
EXOR SPA	7,381	37.05	273,466.05
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,247	66.23	413,738.81

MEDIOBANCA	41,923	8.66	363,053.18
WENDEL	1,898	101.90	193,406.20
AEGON	131,858	4.97	656,125.40
AGEAS	13,863	36.44	505,237.03
ALLIANZ SE-REG	33,348	137.30	4,578,680.40
ASSICURAZIONI GENERALI	86,452	15.83	1,368,535.16
AXA	143,565	21.08	3,026,350.20
CNP ASSURANCES	11,830	12.26	145,094.95
DELTA LLOYD NV	13,360	7.36	98,409.76
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,957	89.50	354,151.50
MAPFRE SA	90,939	2.30	209,432.51
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,261	164.85	2,021,225.85
NN GROUP NV	15,034	25.28	380,059.52
SAMPO OYJ-A SHS	31,815	42.39	1,348,637.85
SCOR SE	10,368	31.08	322,237.44
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	95,080	1.92	182,553.60
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	25,500	23.78	606,390.00
VONOVIA SE	33,154	28.33	939,252.82
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,922	37.31	1,228,319.82
ATOS SE	6,536	66.83	436,800.88
CAP GEMINI SA	11,005	77.54	853,327.70
DASSAULT SYSTEMES SA	9,516	64.20	610,927.20
GEMALTO	6,158	56.96	350,759.68
SAP SE	70,432	56.78	3,999,128.96
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,947	44.48	353,522.29
ALCATEL-LUCENT	209,497	3.16	663,895.99
INGENICO GROUP	3,848	104.60	402,500.80
NOKIA OYJ	256,784	5.89	1,512,457.76
DEUTSCHE TELEKOM	227,738	15.52	3,534,493.76
ELISA A	10,064	29.94	301,316.16
ILIAD SA	1,701	179.85	305,924.85
KPN (KON.)	228,559	3.27	747,387.93
ORANGE	143,323	13.42	1,924,111.27
PROXIMUS	10,096	30.57	308,685.20
TELECOM ITALIA ORD	744,942	1.07	803,047.47
TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.89	370,255.58
TELEFONICA	318,679	10.69	3,408,271.90
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	5.43	204,129.12
E.ON SE	139,487	7.31	1,020,486.89
ELECTRICITE DE FRANCE	15,766	15.47	243,978.85
ENAGAS	15,285	25.04	382,812.82
ENDESA	24,774	18.67	462,530.58

	ENEL	508,928	3.86	1,966,497.79
	ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.62	200,242.25
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	159,451	3.17	505,619.12
	ENGIE	101,605	14.17	1,439,742.85
	FORTUM OYJ	33,469	13.42	449,153.98
	GAS NATURAL SDG SA	26,546	17.12	454,600.25
	IBERDROLA SA	389,295	5.86	2,282,825.88
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,102	71.58	579,941.16
	RWE STAMM	36,844	9.74	358,860.56
	SNAM SPA	150,885	4.44	669,929.40
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,770	15.64	324,946.65
	TERNA SPA	113,720	4.23	481,035.60
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,358	19.77	659,487.66
	ASML HOLDING NV	25,001	75.44	1,886,075.44
	INFINEON TECHNOLOGIES	80,647	9.55	770,743.37
	STMICROELECTRONICS	42,509	5.80	246,679.72
	ユーロ 小計	15,863,148		220,391,158.37 (29,746,194,645)
イギリスポンド	AMEC FOSTER WHEELER PLC	26,190	7.04	184,508.55
	BG GROUP	244,857	9.49	2,325,162.07
	BP PLC	1,305,121	3.26	4,257,304.70
	PETROFAC LTD	16,711	7.62	127,421.37
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	278,357	15.37	4,278,347.09
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	174,787	15.43	2,696,963.41
	TULLOW OIL PLC	67,219	1.66	111,986.85
	ANGLO AMERICAN PLC	98,685	5.43	535,958.23
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	4.91	124,980.30
	BHP BILLITON PLC	151,979	9.79	1,487,874.41
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	26.56	230,142.40
	FRESNILLO PLC	17,743	5.96	105,836.99
	GLENCORE PLC	772,635	0.80	620,039.58
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,209	24.10	366,536.90
	MONDI PLC	27,264	13.31	362,883.84
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,987	38.44	230,140.28
	REXAM PLC	44,988	5.17	232,587.96
	RIO TINTO PLC REG	90,790	21.49	1,951,531.05
	ASHTREAD GROUP PLC	32,745	9.08	297,324.60
	BAE SYSTEMS PLC	220,702	4.36	964,247.03
	BUNZL PLC	24,824	17.39	431,689.36
	COBHAM PLC	72,398	2.77	200,542.46
	IMI PLC	17,506	9.44	165,344.17
	MEGGITT PLC	50,990	4.64	236,644.59

MELROSE INDUSTRIES PLC	64,431	2.61	168,422.63
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	128,458	6.51	836,261.58
SMITHS GROUP PLC	29,684	9.94	295,207.38
TRAVIS PERKINS PLC	18,555	19.27	357,554.85
WEIR GROUP PLC/THE	13,390	11.44	153,181.60
WOLSELEY LTD	18,291	36.56	668,718.96
AGGREKO PLC	19,830	8.76	173,710.80
BABCOCK INTL GROUP PLC	19,693	8.91	175,563.09
CAPITA GROUP PLC	47,099	11.90	560,478.10
EXPERIAN PLC	69,123	10.31	712,658.13
G4S PLC	100,693	2.27	228,975.88
INTERTEK GROUP PLC	10,210	23.46	239,526.60
EASYJET PLC	11,633	17.44	202,879.52
ROYAL MAIL PLC	60,548	4.51	273,434.76
NEW GKN	123,433	2.55	315,371.31
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,214	6.37	466,739.25
BURBERRY GROUP PLC	32,866	13.16	432,516.56
PERSIMMON PLC	22,640	19.99	452,573.60
TAYLOR WIMPAY PLC	233,248	1.93	450,401.88
CARNIVAL PLC	13,621	33.12	451,127.52
COMPASS GROUP PLC	115,480	10.15	1,172,122.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,502	22.09	386,619.18
MERLIN ENTERTAINME	48,554	3.65	177,659.08
TUI AG-DI	35,476	11.92	422,873.92
WHITBREAD PLC	12,809	45.77	586,267.93
WILLIAM HILL	55,917	3.45	193,081.40
ITV PLC	269,479	2.43	655,372.92
PEARSON	57,783	10.99	635,035.17
RELX PLC	78,856	10.95	863,473.20
SKY PLC	72,378	10.18	736,808.04
WPP PLC	90,562	13.25	1,199,946.50
DIXONS CARPHONE PLC	66,738	4.11	274,426.65
KINGFISHER PLC	165,161	3.47	574,595.11
MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,812	4.88	570,509.80
NEXT PLC	10,193	74.70	761,417.10
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,094	7.40	133,986.07
MORRISON SUPERMARKETS	168,125	1.56	262,443.12
SAINSBURY (J) PLC	86,863	2.29	199,176.85
TESCO	566,424	1.71	970,284.31
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,939	32.05	799,294.95
BRITISH AMERICAN TOBACCO	133,236	35.21	4,691,239.56
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,999	13.67	191,366.33

DIAGEO	180,026	17.18	3,092,846.68
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	68,673	33.34	2,289,557.82
SABMILLER PLC	69,637	37.00	2,576,569.00
TATE & LYLE	29,189	5.77	168,566.47
RECKITT BENCKISER PLC	46,035	58.20	2,679,237.00
UNILEVER PLC	92,030	26.03	2,395,540.90
SMITH & NEPHEW PLC	62,775	11.22	704,335.50
ASTRAZENECA	90,369	41.29	3,731,787.85
GLAXOSMITHKLINE	347,785	12.37	4,303,839.37
SHIRE PLC	42,481	44.31	1,882,333.11
BARCLAYS	1,221,961	2.39	2,920,486.79
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,419,653	4.85	6,893,125.14
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,165,025	0.73	3,055,462.34
ROYAL BANK OF SCOTLAND	229,139	3.08	707,122.95
STANDARD CHARTERED PLC	187,165	6.24	1,168,096.76
3I GROUP PLC	74,066	4.57	338,481.62
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	58,338	2.93	170,930.34
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,469	11.79	241,329.51
ICAP PLC	43,892	4.47	196,197.24
INVESTEC PLC	36,474	4.96	180,983.98
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	23,357	23.63	551,925.91
SCHRODERS PLC	7,932	27.16	215,433.12
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	14.55	236,510.25
AVIVA PIC	297,285	4.28	1,273,568.94
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94,822	3.66	347,617.45
LEGAL & GENERAL GROUP	421,591	2.30	971,345.66
OLD MUTUAL PLC	352,004	1.82	640,999.28
PRUDENTIAL	187,754	13.30	2,498,066.97
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	70,206	3.91	275,137.31
ST JAMES' S PLACE PLC	37,294	8.29	309,353.73
STANDARD LIFE PLC	141,626	3.75	531,805.63
SAGE GROUP PLC	80,156	4.91	393,886.58
BT GROUP PLC	599,623	4.13	2,477,942.04
INMARSAT PLC	33,632	9.75	328,080.16
VODAFONE GROUP PLC	1,895,378	2.04	3,873,204.94
CENTRICA PLC	347,128	2.22	773,401.18
NATIONAL GRID PLC	268,349	9.00	2,417,556.14
SEVERN TRENT PLC	15,457	21.36	330,161.52
SSE PLC	69,212	14.37	994,576.44
UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,451	9.05	456,833.80
ARM HOLDINGS PLC	98,798	9.19	907,953.62
	20,721,302		107,101,492.42

イギリスポンド 小計				(19,477,477,411)
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	12.14	276,743.44
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	393.50	187,699.50
	GIVAUDAN-REG	651	1,550.00	1,009,050.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	28,448	50.50	1,436,624.00
	SIKA AG-BR	138	2,952.00	407,376.00
	SYNGENTA AG	6,705	304.90	2,044,354.50
	ABB LTD	158,155	16.92	2,675,982.60
	GEBERIT AG-REG	2,683	292.30	784,240.90
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,352	141.00	190,632.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,860	139.70	399,542.00
	SULZER AG-REG	1,607	95.95	154,191.65
	ADECCO	12,082	69.30	837,282.60
	SGS SA	406	1,674.00	679,644.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,072	123.50	502,892.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	37,577	73.70	2,769,424.90
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,199	352.00	774,048.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	67.35	265,224.30
	DUFREY AG-REG	2,999	111.20	333,488.80
	ARYZTA AG	5,619	41.26	231,839.94
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,033.00	136,356.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	62	5,570.00	345,340.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	68,290.00	478,030.00
	NESTLE SA - REGISTERED	230,102	71.20	16,383,262.40
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,452	122.30	422,179.60
	ACTELION LTD-REG	7,281	120.80	879,544.80
	LONZA GROUP AG-REG	3,988	126.50	504,482.00
	NOVARTIS	162,383	87.35	14,184,155.05
	ROCHE HOLDING GENUSS	50,151	251.40	12,607,961.40
	CREDIT SUISSE GROUP AG	114,059	23.22	2,648,449.98
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,269	42.50	691,432.50
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	56.05	106,270.80
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,221	322.50	393,772.50	
UBS GROUP AG	266,462	17.76	4,732,365.12	
BALOISE HOLDING AG	3,877	110.00	426,470.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,458	212.70	522,816.60	
SWISS RE LTD	25,911	82.30	2,132,475.30	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,018	233.90	2,577,110.20	
SWISS PRIME SITE-REG	5,038	70.80	356,690.40	
SWISSCOM	1,834	479.00	878,486.00	
スイスフラン 小計		1,202,365		77,367,931.78 (9,559,581,650)

スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	14,191	103.50	1,468,768.50	
	BOLIDEN AB	18,196	127.40	2,318,170.40	
	ALFA LAVAL AB	19,284	135.10	2,605,268.40	
	ASSA ABLOY AB-B	70,136	148.30	10,401,168.80	
	ATLAS COPCO A	47,043	195.60	9,201,610.80	
	ATLAS COPCO B	29,087	181.90	5,290,925.30	
	SANDVIK AB	79,113	69.25	5,478,575.25	
	SKANSKA B	28,530	161.70	4,613,301.00	
	SKF AB-B	27,040	154.00	4,164,160.00	
	VOLVO B	107,905	78.75	8,497,518.75	
	SECURITAS B	22,844	100.60	2,298,106.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	18,170	225.60	4,099,152.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	27,758	53.55	1,486,440.90	
	HENNES & MAURITZ B	68,398	299.10	20,457,841.80	
	ICA GRUPPEN AB	5,730	280.50	1,607,265.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	248.50	3,083,885.00	
	SCA SV CELLULOSA B	41,445	230.20	9,540,639.00	
	GETINGE AB-B SHS	12,725	183.50	2,335,037.50	
	NORDEA BANK AB	222,952	91.95	20,500,436.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	108,437	87.65	9,504,503.05	
	SVENSKA HANDELSBK A	106,324	119.00	12,652,556.00	
	SWEDBANK AB-A	64,426	184.00	11,854,384.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,792	143.70	1,838,210.40	
	INVESTOR AB-B SHS	32,558	284.00	9,246,472.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,104	234.30	4,241,767.20		
ERICSSON (LM) B	219,832	79.25	17,421,686.00		
HEXAGON AB-B SHS	18,602	249.00	4,631,898.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	500.00	2,164,500.00		
TELE2 AB-B SHS	21,310	78.80	1,679,228.00		
TELIASONERA AB	182,966	44.49	8,140,157.34		
スウェーデンクローナ 小計		1,662,637		202,823,633.19	(2,900,377,954)
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LTD	23,438	49.51	1,160,415.38	
	STATOIL ASA	78,540	120.30	9,448,362.00	
	SUBSEA 7 SA	18,360	63.70	1,169,532.00	
	NORSK HYDRO	83,896	27.57	2,313,012.72	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,470	336.60	4,534,002.00	
	ORKLA	60,218	61.85	3,724,483.30	
	DNB ASA	70,441	107.70	7,586,495.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,481	112.00	1,509,872.00	
	TELENOR ASA	53,105	158.60	8,422,453.00	
		414,949		39,868,628.10	

ノルウェークローネ 小計				(564,539,773)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	17,281	282.20	4,876,698.20
	VESTAS WIND SYSEMS	15,987	336.50	5,379,625.50
	ISS A/S	9,103	221.20	2,013,583.60
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	245	9,760.00	2,391,200.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	508	10,050.00	5,105,400.00
	DSV A/S	11,156	242.90	2,709,792.40
	PANDORA A/S	8,093	771.00	6,239,703.00
	CARLSBERG AS-B	8,005	498.50	3,990,492.50
	COLOPLAST-B	8,335	464.70	3,873,274.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	544.50	808,038.00
	NOVO NORDISK A/S-B	140,075	357.30	50,048,797.50
	DANSKE BANK A/S	50,272	199.00	10,004,128.00
	TRYG A/S	9,828	127.30	1,251,104.40
	TDC A/S	52,498	34.41	1,806,456.18
デンマーククローネ 小計		332,870		100,498,293.78 (1,818,014,134)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	20,629	30.21	623,202.09
	ORIGIN ENERGY LIMITED	84,565	6.10	515,846.50
	SANTOS	60,506	4.28	258,965.68
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	53,718	28.17	1,513,236.06
	WORLEYPARSONS LTD	15,026	5.86	88,052.36
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.14	195,174.41
	AMCOR	88,019	12.89	1,134,564.91
	BHP BILLITON LTD	230,444	21.61	4,979,894.84
	BORAL LIMITED	46,867	5.12	239,959.04
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	1.67	151,098.26
	ILUKA RESOURCES LTD	28,555	6.15	175,613.25
	INCITEC PIVOT LTD	110,188	3.84	423,121.92
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	17.00	500,616.00
	NEWCREST MINING LIMITED	58,258	12.55	731,137.90
	ORICA LTD	29,211	14.86	434,075.46
	RIO TINTO LTD	31,029	46.52	1,443,469.08
	SOUTH32 LTD	354,855	1.38	491,474.17
	CIMIC GROUP LIMITED	5,336	23.45	125,129.20
	BRAMBLES LTD	116,593	9.70	1,130,952.10
	SEEK LTD	21,328	11.90	253,803.20
	ASCIANO GROUP	64,054	8.25	528,445.50
	AURIZON HOLDINGS LTD	159,487	4.93	786,270.91
QANTAS AIRWAYS LIMITED	36,374	3.71	134,947.54	
TRANSURBAN GROUP	140,834	9.89	1,392,848.26	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	32,069	8.42	270,020.98	

	CROWN RESORTS LTD	21,269	9.80	208,436.20
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	35.43	115,608.09
	TABCORP HOLDINGS	62,731	4.63	290,444.53
	TATTS GROUP LTD	93,361	3.71	346,369.31
	REA GROUP LTD	3,593	43.47	156,187.71
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.79	116,777.48
	WESFARMERS LTD	79,463	38.32	3,045,022.16
	WOOLWORTHS LTD	90,378	24.23	2,189,858.94
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	8.89	337,855.56
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	6.39	246,347.28
	COCHLEAR LIMITED	3,856	81.76	315,266.56
	HEALTHSCOPE LTD	88,599	2.50	221,497.50
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,773	57.89	623,648.97
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,730	18.20	450,086.00
	CSL LIMITED	33,087	87.80	2,905,038.60
	AUST AND NZ BANKING GROUP	198,527	26.38	5,237,142.26
	BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	11.39	277,654.03
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,205	9.72	303,312.60
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	121,510	70.15	8,523,926.50
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	187,643	29.20	5,479,175.60
	WESTPAC BANKING	223,581	29.10	6,506,207.10
	ASX LTD	12,620	37.08	467,949.60
	MACQUARIE GROUP LIMITED	21,772	75.00	1,632,900.00
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	20,227	6.56	132,689.12
	AMP LTD	217,702	5.42	1,179,944.84
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	175,295	4.74	830,898.30
	MEDIBANK PRIVATE LTD	214,512	2.38	510,538.56
	QBE INSURANCE GROUP	100,546	12.70	1,276,934.20
	SUNCORP GROUP LIMITED	95,154	11.99	1,140,896.46
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,817	10.48	322,962.16
	TELSTRA CORP	308,815	5.49	1,695,394.35
	TPG TELECOM LTD	20,000	10.14	202,800.00
	AGL ENERGY LTD	50,606	16.23	821,335.38
	AUSNET SERVICES	120,230	1.34	161,709.35
	オーストラリアドル 小計	4,875,939		66,794,734.92 (5,614,765,417)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	6.76	314,678.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,160	5.01	306,411.60
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.30	160,716.80
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,449	2.99	434,892.51
	CONTACT ENERGY LTD	58,963	4.86	286,560.18
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	2.10	232,142.40

	MIGHTY RIVER POWER	61,741	2.57	158,983.07	
	ニュージーランドドル 小計	506,423		1,894,384.56 (144,787,811)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	194,496	98.60	19,177,305.60	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	9.85	975,150.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	14.38	1,236,680.00	
	MTR CORP	94,000	33.35	3,134,900.00	
	LI & FUNG	378,800	5.55	2,102,340.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	93,500	28.50	2,664,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	28.80	1,339,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	19.86	3,495,360.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	9.27	622,944.00	
	SANDS CHINA LTD	174,000	24.25	4,219,500.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	6.76	662,480.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	5.47	722,040.00	
	WYNN MACAU LTD	102,800	8.87	911,836.00	
	WH GROUP LTD	476,500	3.84	1,829,760.00	
	BANK EAST ASIA	84,760	25.30	2,144,428.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	262,500	22.40	5,880,000.00	
	HANG SENG BANK	54,100	139.50	7,546,950.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	4.65	595,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,300	177.70	14,447,010.00	
	AIA GROUP LTD	863,200	39.35	33,966,920.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	188,996	55.35	10,460,928.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	17.14	2,965,220.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	86,360	45.85	3,959,606.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	31.45	1,258,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	21.40	823,900.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	399,500	7.49	2,992,255.00	
	SINO LAND CO	235,400	11.54	2,716,516.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,000	98.95	11,874,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	84.35	3,416,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	21.50	1,487,800.00	
	WHARF HOLDINGS	99,000	43.15	4,271,850.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	65,000	33.30	2,164,500.00	
	PCCW LTD	232,000	3.95	916,400.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	68.10	2,792,100.00	
	CLP HOLDINGS	133,000	65.15	8,664,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	491,679	14.44	7,099,844.76	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	98,500	71.50	7,042,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	48.80	673,440.00	
		6,258,091		183,254,988.96	

香港ドル 小計				(2,836,787,229)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,300	6.75	758,025.00
	NOBLE GROUP LTD	297,563	0.40	119,025.20
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	3.45	196,650.00
	SEMBCORP MARINE LTD	60,900	2.26	137,634.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	2.96	322,640.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.13	150,290.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.80	406,000.00
	SINGAPORE AIRLINES	32,833	10.70	351,313.10
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	0.74	314,500.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	97,700	3.83	374,191.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	26.95	161,700.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.31	129,890.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	116,700	2.52	294,084.00
	DBS GROUP	128,600	16.37	2,105,182.00
	OCBC BANK	220,100	8.74	1,923,674.00
	UNITED OVERSEAS BANK	90,900	18.55	1,686,195.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	55,000	7.19	395,450.00
	CAPITALAND LTD	205,500	2.74	563,070.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	7.73	185,520.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	249,000	2.03	505,470.00
UOL GROUP LIMITED	32,500	6.00	195,000.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	582,643	3.55	2,068,382.65	
STARHUB LTD	38,000	3.44	130,720.00	
シンガポールドル 小計		3,638,239		13,474,605.95 (1,133,079,614)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	435	845.40	367,749.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	19.71	645,620.76
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	945.10	152,161.10
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	59,539	226.00	13,455,814.00
	BANK HAPOALIM BM	80,056	19.59	1,568,297.04
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	94,989	14.62	1,388,739.18
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	45.81	375,642.00
	AZRIELI GROUP	1,780	155.00	275,900.00
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	215.50	723,649.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	7.50	837,247.50
イスラエルシェケル 小計		392,907		19,790,819.58 (604,213,721)
合 計		81,152,718		228,769,237,105 (228,769,237,105)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	182,595.00	
	アメリカドル 小計		329,000	182,595.00 (21,904,096)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	74,495	633,207.50	
		LEND LEASE GROUP	44,009	537,349.89	
		SYDNEY AIRPORT	70,759	418,893.28	
	オーストラリアドル 小計		189,263	1,589,450.67 (133,609,223)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	187,000	1,703,570.00	
	香港ドル 小計		187,000	1,703,570.00 (26,371,263)	
投資信託受益証券合計			705,263	181,884,582 (181,884,582)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,115	430,632.45	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	30,408	2,645,800.08	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,023	682,724.25	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,140	1,579,483.40	
		BOSTON PROPERTIES	10,612	1,246,591.64	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,835	299,568.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,979	438,081.33	
		COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	7,973	140,563.99	
		CROWN CASTLE INTL CORP	24,087	1,867,465.11	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	9,665	614,017.45	
		DUKE REALTY CORP	26,052	498,114.24	
		EQUINIX INC	3,960	1,065,160.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	26,298	1,934,217.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,774	1,047,511.08	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,671	587,675.31	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,879	659,592.01	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	40,144	1,026,482.08	
		HCP INC	31,928	1,191,233.68	
		HEALTH CARE REIT INC	25,401	1,710,249.33	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	52,693	810,945.27	
		IRON MOUNTAIN INC	14,074	427,286.64	
		KIMCO REALTY CORP	29,179	702,630.32	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	9,708	302,889.60	
		MACERICH CO/THE	9,059	694,553.53	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,594	457,151.42	
PROLOGIS INC	36,172	1,401,303.28			

	PUBLIC STORAGE	10,592	2,216,481.92
	REALTY INCOME CORP	16,219	764,077.09
	REGENCY CENTERS CORP	6,051	373,891.29
	SIMON PROPERTY GROUP	22,304	4,068,918.72
	SL GREEN REALTY CORP	7,346	800,346.70
	UDR INC	18,412	629,690.40
	VENTAS INC	22,897	1,279,484.36
	VEREIT INC	67,784	519,903.28
	VORNADO REALTY TRUST	11,805	1,069,887.15
	アメリカドル 小計	720,833	36,184,606.00 (4,340,705,335)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,455	191,558.30
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	265,324.73
	カナダドル 小計	19,938	456,883.03 (40,817,929)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,310	177,685.20
	GECINA SA	2,522	270,610.60
	ICADE	2,845	168,993.00
	KLEPIERRE	13,726	546,226.17
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,974	1,589,723.30
	ユーロ 小計	28,377	2,753,238.27 (371,604,569)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	66,079	542,838.98
	HAMMERSON PLC	51,215	313,691.87
	INTU PROPERTIES PLC	73,489	236,193.64
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,520	697,456.80
	SEGRO PLC	48,938	206,763.05
	イギリスポンド 小計	296,241	1,996,944.34 (363,164,297)
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	74,090	523,075.40
	FEDERATION CENTRES	254,887	675,450.55
	GOODMAN GROUP	119,536	681,355.20
	GPT GROUP	136,015	599,826.15
	MIRVAC GROUP	241,410	409,189.95
	SCENTRE GROUP	389,348	1,483,415.88
	STOCKLAND	150,322	577,236.48
	WESTFIELD CORP	144,920	1,412,970.00
	オーストラリアドル 小計	1,510,528	6,362,519.61 (534,833,398)
香港ドル	LINK REIT	163,000	6,748,200.00
	香港ドル 小計	163,000	6,748,200.00 (104,462,136)

シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,300	315,324.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	143,000	189,475.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	141,000	266,490.00	
	SUNTEC REIT	173,000	257,770.00	
シンガポールドル 小計		595,300	1,029,059.00	(86,533,571)
投資証券合計		3,334,217	5,842,121,235	(5,842,121,235)
合計			6,024,005,817	(6,024,005,817)

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	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601銘柄	97.1%			62.1%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 35銘柄			2.9%	1.8%
カナダドル	株式 88銘柄	99.5%			3.6%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	98.8%			12.7%
	投資証券 5銘柄			1.2%	0.2%
イギリスポンド	株式 107銘柄	98.2%			8.3%
	投資証券 5銘柄			1.8%	0.2%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%			4.1%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 59銘柄	89.4%			2.4%
	投資信託受 益証券 3銘柄		2.1%		0.1%
	投資証券 8銘柄			8.5%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 38銘柄	95.6%			1.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.9%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.5%	0.0%

シンガポールドル	株式 23銘柄	92.9%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成27年 9月30日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	307,156,038
コール・ローン	2,856,750,640
国債証券	214,688,968,784
派生商品評価勘定	10,085,511
未収入金	171,230
未収利息	1,820,165,755
前払費用	136,141,466
差入委託証拠金	82,516,141
流動資産合計	219,901,955,565
資産合計	219,901,955,565
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,998,907
前受金	8,492,884
未払金	2,979,130
未払解約金	610,941,308
流動負債合計	633,412,229
負債合計	633,412,229
純資産の部	
元本等	
元本	77,672,917,030
剰余金	
剰余金又は欠損金()	141,595,626,306
元本等合計	219,268,543,336
純資産合計	219,268,543,336
負債純資産合計	219,901,955,565

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 9月30日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 9月30日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,672,917,030口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8230円 (1万口当たり純資産額) (28,230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27年 9月30日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 9月30日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成27年 9月30日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年10月 1日
期首元本額	95,373,091,380円
期中追加設定元本額	41,956,777,710円
期中一部解約元本額	59,656,952,060円
期末元本額	77,672,917,030円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,096,988,286円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	169,912,921円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	1,182,109,591円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	777,129,217円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,368,577,220円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,019,611円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	4,970,945,478円
世界経済インデックスファンド	1,565,630,088円
マイセレクション25	6,432,577円

区分	平成27年 9月30日現在
マイセレクション50	4,480,433円
マイセレクション75	3,417,778円
DCマイセレクション25	1,133,696,419円
DCマイセレクション50	963,779,845円
DCマイセレクション75	681,958,597円
DC外国債券インデックス・オープン	1,390,524,233円
DCマイセレクションS25	441,290,770円
DCマイセレクションS50	364,207,968円
DCマイセレクションS75	177,931,650円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	48,590,251円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	35,697,550円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	14,121,297円
DC世界経済インデックスファンド	1,500,976,258円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	502,361,186円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	206,398,876円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,443,233円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,829,473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）	122,675,366円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	363,723,437円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	541,372,330円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,882,080,467円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	849,805,544円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	4,584,196,243円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	940,252,728円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,290,749,193円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,340,284,904円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,664,882,657円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,007,909,466円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,163,332,968円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	349,923,253円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	490,554,967円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,844,762,524円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,473,542,010円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	597,087,647円
外国債券ファンド・シリーズ1	281,437,662円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,769,239,782円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,874,918,320円
分散投資コア戦略ファンドA	388,010,422円
分散投資コア戦略ファンドS	716,552,373円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	33,008,731円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	417,975,767円
コア投資戦略ファンド（切替型）	501,781,203円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	124,015,910円

区分	平成27年 9月30日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	82,014,907円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	295,748,133円
SMT インデックスバランス・オープン	133,930,703円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	20,225,150,355円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	688,546,252円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成27年 9月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	52,719,963
合計	52,719,963

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,506,119,918	-	1,514,612,802	8,492,884
合計		1,506,119,918	-	1,514,612,802	8,492,884

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成27年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,167,924,680	-	2,158,518,400	9,406,280
	アメリカドル	961,027,570	-	958,240,700	2,786,870
	カナダドル	85,017,490	-	83,951,400	1,066,090

	ユーロ	930,399,770	-	927,243,900	3,155,870
	イギリスポンド	191,479,850	-	189,082,400	2,397,450
	合計	2,167,924,680	-	2,158,518,400	9,406,280

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.5% 03/31/17	1,000,000.00	999,882.81	
		T 0.5% 07/31/17	2,000,000.00	1,996,171.88	
		T 0.625% 04/30/18	10,000,000.00	9,946,289.10	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	7,000,273.42	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	999,570.31	
		T 0.625% 10/15/16	5,500,000.00	5,513,750.00	
		T 0.625% 11/15/16	5,600,000.00	5,614,437.52	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,990,917.95	
		T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	10,022,656.30	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,045,937.56	
		T 0.75% 02/28/18	4,400,000.00	4,396,218.77	
		T 0.75% 04/15/18	3,000,000.00	2,994,550.77	
		T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	6,016,054.68	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,901,246.10	
		T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,052,929.70	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,514,072.24	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,025,878.90	
		T 0.875% 04/30/17	11,600,000.00	11,659,812.50	
		T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,024,804.70	
		T 0.875% 07/15/17	4,000,000.00	4,018,906.24	
T 0.875% 08/15/17	8,800,000.00	8,840,906.27			
T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,225,390.61			

T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,982,500.00	
T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	3,031,771.49	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	905,589.84	
T 1.25% 01/31/20	8,520,000.00	8,509,682.79	
T 1.25% 02/29/20	7,000,000.00	6,984,003.88	
T 1.25% 10/31/18	6,500,000.00	6,553,701.18	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,507,197.24	
T 1.25% 11/30/18	6,550,000.00	6,601,043.95	
T 1.375% 01/31/20	5,000,000.00	5,018,750.00	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,120,835.94	
T 1.375% 03/31/20	4,880,000.00	4,894,487.50	
T 1.375% 04/30/20	10,000,000.00	10,026,562.50	
T 1.375% 05/31/20	1,550,000.00	1,553,148.43	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,229,218.75	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,949,511.70	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	3,032,812.50	
T 1.5% 01/31/19	2,000,000.00	2,029,296.88	
T 1.5% 01/31/22	4,500,000.00	4,451,132.83	
T 1.5% 02/28/19	2,000,000.00	2,028,554.68	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,462,132.79	
T 1.5% 05/31/19	8,000,000.00	8,105,468.72	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,897,535.17	
T 1.5% 10/31/19	3,550,000.00	3,588,897.45	
T 1.5% 11/30/19	5,000,000.00	5,052,343.75	
T 1.625% 03/31/19	3,000,000.00	3,054,492.18	
T 1.625% 04/30/19	5,000,000.00	5,089,648.45	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,462,734.37	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,626,708.97	
T 1.625% 11/15/22	7,150,000.00	7,081,991.20	
T 1.75% 02/28/22	2,500,000.00	2,509,082.02	
T 1.75% 03/31/22	7,000,000.00	7,020,371.12	
T 1.75% 04/30/22	5,750,000.00	5,763,364.26	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,807,199.21	
T 1.75% 05/15/23	7,000,000.00	6,942,441.37	
T 1.75% 10/31/20	4,000,000.00	4,061,015.64	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,322,484.38	
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,085,619.11	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	870,519.53	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,561,328.12	
T 1.875% 11/30/21	5,400,000.00	5,470,347.63	
T 1% 03/15/18	2,800,000.00	2,813,890.63	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,410,117.18	

T 1% 05/31/18	5,000,000.00	5,016,796.90	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,954,121.06	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,948,757.85	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,966,718.76	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,236,015.62	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,095,742.18	
T 2.125% 05/15/25	9,450,000.00	9,512,938.51	
T 2.125% 06/30/21	1,000,000.00	1,030,234.38	
T 2.125% 06/30/22	3,500,000.00	3,591,806.64	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,278,949.23	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,725,595.69	
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,851,238.30	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,632,548.81	
T 2.25% 07/31/18	5,300,000.00	5,500,199.22	
T 2.25% 11/15/24	8,150,000.00	8,306,314.47	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,160,468.76	
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,759,316.38	
T 2.5% 02/15/45	6,080,000.00	5,625,900.00	
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,755,031.29	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,227,148.45	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,819,472.67	
T 2.625% 11/15/20	2,000,000.00	2,114,531.26	
T 2.75% 02/15/19	4,600,000.00	4,855,515.64	
T 2.75% 02/15/24	9,100,000.00	9,676,214.82	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	3,978,199.21	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,288,593.76	
T 2.75% 11/15/23	6,900,000.00	7,349,173.85	
T 2.75% 11/15/42	4,200,000.00	4,111,242.19	
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,418,701.18	
T 2.75% 12/31/17	9,100,000.00	9,509,322.27	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,098,656.25	
T 2.875% 05/15/43	9,300,000.00	9,318,527.36	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,551,171.87	
T 2% 02/15/23	1,100,000.00	1,114,824.21	
T 2% 02/15/25	8,400,000.00	8,371,617.15	
T 2% 02/28/21	4,000,000.00	4,100,000.00	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,890,695.32	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,352,343.77	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,951,937.50	
T 2% 10/31/21	6,200,000.00	6,329,449.24	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,449,828.12	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,648,564.46	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,623,798.81	

T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,052,578.13	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,766,728.54	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,354,394.55	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,747,601.58	
T 3.125% 08/15/44	10,250,000.00	10,779,917.00	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,691,445.34	
T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	2,967,398.44	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,621,748.06	
T 3.375% 05/15/44	7,500,000.00	8,270,947.27	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,065,156.25	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,265,351.56	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,656,953.12	
T 3.625% 02/15/21	5,500,000.00	6,100,488.29	
T 3.625% 02/15/44	6,500,000.00	7,510,166.04	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,948,748.05	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,313,476.56	
T 3.75% 08/15/41	2,200,000.00	2,594,453.13	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,428,906.25	
T 3.75% 11/15/43	2,300,000.00	2,721,277.33	
T 3.875% 08/15/40	2,700,000.00	3,230,771.48	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	9,837,695.36	
T 3% 05/15/42	3,950,000.00	4,072,511.73	
T 3% 08/31/16	6,750,000.00	6,912,421.87	
T 3% 09/30/16	5,500,000.00	5,644,160.17	
T 3% 11/15/44	6,200,000.00	6,362,628.90	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,593,712.90	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	759,304.68	
T 4.25% 11/15/17	2,550,000.00	2,740,303.72	
T 4.25% 11/15/40	1,000,000.00	1,266,542.97	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,290,175.78	
T 4.375% 05/15/40	3,500,000.00	4,511,513.67	
T 4.375% 05/15/41	2,800,000.00	3,625,835.94	
T 4.375% 11/15/39	2,700,000.00	3,478,675.78	
T 4.5% 02/15/36	1,840,000.00	2,420,498.43	
T 4.5% 05/15/17	4,800,000.00	5,107,218.76	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,312,890.63	
T 4.5% 08/15/39	250,000.00	327,534.18	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,283,691.40	
T 4.625% 02/15/40	1,650,000.00	2,201,364.26	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,399,658.20	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	703,222.65	
T 5.25% 02/15/29	400,000.00	537,835.93	

	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,742,380.86	
	T 5.375% 02/15/31	1,600,000.00	2,224,656.25	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,638,093.75	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,325,513.67	
	T 6.125% 11/15/27	350,000.00	497,232.42	
	T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,637,173.82	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	2,184,090.82	
	T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,239,062.50	
	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,333,947.27	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,655,843.75	
	アメリカドル 小計	732,870,000.00	760,324,317.06	(91,208,505,074)
カナダドル	CAN 0.75% 09/01/20	1,400,000.00	1,397,921.00	
	CAN 1.25% 02/01/18	850,000.00	864,556.25	
	CAN 1.25% 03/01/18	1,990,000.00	2,025,173.25	
	CAN 1.25% 08/01/17	2,250,000.00	2,280,622.50	
	CAN 1.25% 09/01/18	500,000.00	510,375.00	
	CAN 1.5% 02/01/17	2,500,000.00	2,533,287.50	
	CAN 1.5% 03/01/20	1,450,000.00	1,501,873.75	
	CAN 1.5% 06/01/23	1,650,000.00	1,684,476.75	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,681,358.25	
	CAN 1.75% 03/01/19	1,400,000.00	1,454,901.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	886,677.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,550,000.00	1,664,940.25	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,700,000.00	1,865,877.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,300,000.00	1,439,301.50	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,950,000.00	3,010,784.75	
	CAN 2.75% 12/01/48	800,000.00	902,688.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	370,000.00	435,756.40	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,200,000.00	1,353,726.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,350,000.00	1,521,463.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,740,000.00	2,243,886.60	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	3,007,368.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,970,000.00	2,664,996.30	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,922,121.25	
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,481,312.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,550,000.00	2,289,063.25	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,480,000.00	2,298,358.60	
CAN 5% 06/01/37	1,690,000.00	2,521,784.20		
CAN 8.0% 06/01/27	360,000.00	603,050.40		
	カナダドル 小計	42,350,000.00	48,047,701.25	(4,292,581,629)
	MBONO 10% 11/20/36	12,000,000.00	16,337,940.00	

メキシコペソ	MBONO 10% 12/05/24	8,100,000.00	10,334,587.50	
	MBONO 4.75% 06/14/18	21,150,000.00	21,232,062.00	
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,159,809.00	
	MBONO 5% 12/11/19	11,300,000.00	11,250,280.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	11,800,000.00	12,247,574.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	17,000,000.00	17,812,515.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	27,300,000.00	28,427,217.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,700,000.00	16,050,268.50	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,550,000.00	25,078,869.75	
	MBONO 7.75% 11/13/42	9,300,000.00	10,262,178.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	9,700,000.00	10,435,405.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,600,000.00	18,431,790.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	16,500,000.00	19,565,122.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	5,750,000.00	6,376,635.00	
	MBONO 8% 06/11/20	14,500,000.00	16,185,697.50	
	MBONO 8% 12/07/23	26,450,000.00	29,835,864.50	
メキシコペソ 小計		265,500,000.00	292,023,815.75	(2,058,767,901)
ユーロ	BGB 0.8% 06/22/25	1,220,000.00	1,208,233.10	
	BGB 1.25% 06/22/18	780,000.00	809,827.20	
	BGB 1% 06/22/31	580,000.00	540,815.20	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,500,000.00	1,692,480.00	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,740,000.00	2,015,389.80	
	BGB 3.25% 09/28/16	100,000.00	103,425.00	
	BGB 3.5% 06/28/17	1,520,000.00	1,618,047.60	
	BGB 3.75% 06/22/45	820,000.00	1,176,757.40	
	BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,951,725.00	
	BGB 3% 06/22/34	920,000.00	1,130,017.60	
	BGB 3% 09/28/19	1,230,000.00	1,377,218.70	
	BGB 4.0% 03/28/17	1,910,000.00	2,029,852.50	
	BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,942,148.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,890,000.00	2,865,466.80	
	BGB 4.25% 09/28/21	2,300,000.00	2,845,180.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	2,400,000.00	3,031,044.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	2,097,863.00	
	BGB 4% 03/28/18	1,400,000.00	1,545,957.00	
	BGB 4% 03/28/22	1,110,000.00	1,370,966.55	
	BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,504,937.50	
	BGB 5.5% 03/28/28	1,850,000.00	2,776,702.00	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,116,685.50	
	BGB 5% 03/28/35	1,900,000.00	2,978,535.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,568,550.00	
	BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,678,228.00	

BTPS 0.25% 05/15/18	2,500,000.00	2,497,612.50	
BTPS 0.75% 01/15/18	2,600,000.00	2,631,460.00	
BTPS 1.05% 12/01/19	500,000.00	508,305.00	
BTPS 1.15% 05/15/17	800,000.00	813,192.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	2,200,000.00	2,217,721.00	
BTPS 1.5% 08/01/19	2,400,000.00	2,485,212.00	
BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,220,634.00	
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,649,300.00	
BTPS 2.5% 05/01/19	2,000,000.00	2,143,320.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,450,000.00	2,618,682.50	
BTPS 2.75% 11/15/16	500,000.00	515,080.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,200,000.00	1,312,896.00	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,200,000.00	2,555,916.00	
BTPS 3.5% 06/01/18	1,100,000.00	1,193,599.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,138,280.00	
BTPS 3.5% 12/01/18	3,200,000.00	3,515,072.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	4,700,000.00	5,396,704.50	
BTPS 3.75% 05/01/21	750,000.00	861,821.25	
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,605,500.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	3,300,000.00	3,870,108.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,280,833.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	5,800,000.00	6,702,915.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,027,651.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	2,400,000.00	2,638,848.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	1,650,000.00	1,919,733.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	1,600,000.00	1,820,080.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	3,450,000.00	4,236,513.75	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,800,000.00	3,508,442.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,500,221.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	1,800,000.00	2,013,111.00	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,770,000.00	4,045,530.45	
BTPS 4.75% 06/01/17	1,700,000.00	1,830,024.50	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,532,825.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	2,400,000.00	2,902,476.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,750,000.00	3,572,648.75	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,366,867.50	
BTPS 4% 02/01/17	4,950,000.00	5,207,919.75	
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	3,508,236.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,200,000.00	2,539,086.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,450,000.00	3,459,559.25	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,334,992.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	2,700,000.00	3,713,121.00	

BTPS 5.5% 09/01/22	1,550,000.00	1,978,776.50
BTPS 5.5% 11/01/22	2,950,000.00	3,771,280.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,050,000.00	3,032,247.25
BTPS 5% 03/01/22	2,250,000.00	2,781,832.50
BTPS 5% 03/01/25	3,500,000.00	4,501,700.00
BTPS 5% 08/01/34	2,500,000.00	3,452,787.50
BTPS 5% 09/01/40	2,650,000.00	3,739,348.75
BTPS 6.5% 11/01/27	2,800,000.00	4,137,224.00
BTPS 6% 05/01/31	4,200,000.00	6,272,532.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	2,147,649.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,253,780.00
DBR 0.5% 02/15/25	1,200,000.00	1,197,894.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	3,003,343.75
DBR 1.5% 05/15/23	1,950,000.00	2,131,574.25
DBR 1.5% 05/15/24	3,390,000.00	3,708,982.05
DBR 1.5% 09/04/22	1,450,000.00	1,580,652.25
DBR 1.75% 02/15/24	2,970,000.00	3,311,639.10
DBR 1.75% 07/04/22	2,700,000.00	2,988,630.00
DBR 1% 08/15/24	2,150,000.00	2,255,167.25
DBR 1% 08/15/25	1,150,000.00	1,196,621.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,783,250.00
DBR 2.25% 09/04/21	2,000,000.00	2,257,450.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,376,580.50
DBR 2.5% 07/04/44	1,800,000.00	2,334,591.00
DBR 2.5% 08/15/46	1,200,000.00	1,562,262.00
DBR 2% 01/04/22	2,300,000.00	2,572,136.00
DBR 2% 08/15/23	1,100,000.00	1,246,201.00
DBR 3.25% 01/04/20	4,700,000.00	5,372,523.00
DBR 3.25% 07/04/21	2,300,000.00	2,723,361.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,900,000.00	2,764,319.50
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,980,340.00
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,783,708.00
DBR 3.75% 01/04/19	4,150,000.00	4,684,001.25
DBR 3% 07/04/20	2,300,000.00	2,635,041.00
DBR 4.0% 01/04/18	2,650,000.00	2,905,340.75
DBR 4.0% 01/04/37	2,850,000.00	4,359,702.00
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,454,320.00
DBR 4.25% 07/04/18	2,400,000.00	2,696,736.00
DBR 4.25% 07/04/39	1,650,000.00	2,684,071.50
DBR 4.75% 07/04/28	1,550,000.00	2,300,564.25
DBR 4.75% 07/04/34	2,270,000.00	3,683,267.95
DBR 4.75% 07/04/40	1,850,000.00	3,244,853.75
DBR 5.5% 01/04/31	2,200,000.00	3,619,759.00

DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,441,110.50	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,376,216.00	
DBR 6.25% 01/04/30	850,000.00	1,466,284.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,572,279.25	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,800,000.00	3,659,305.00	
FRTR 0.5% 11/25/19	3,400,000.00	3,461,744.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	3,760,000.00	4,090,936.40	
FRTR 1.75% 11/25/24	3,200,000.00	3,465,040.00	
FRTR 1% 05/25/18	3,500,000.00	3,603,267.50	
FRTR 1% 05/25/19	3,250,000.00	3,369,778.75	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,583,800.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	4,965,862.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	3,600,000.00	4,043,196.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	3,500,000.00	4,002,232.50	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,130,000.00	4,611,124.35	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,807,967.50	
FRTR 3.25% 05/25/45	2,050,000.00	2,682,722.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,200,000.00	6,109,064.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,050,000.00	5,827,977.75	
FRTR 3.5% 04/25/26	3,850,000.00	4,809,939.75	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,550,000.00	4,831,918.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	4,050,000.00	4,831,974.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	3,750,000.00	4,314,450.00	
FRTR 3% 04/25/22	4,400,000.00	5,143,116.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	4,700,000.00	5,416,750.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,250,000.00	3,548,203.75	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,419,577.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	3,600,000.00	4,631,850.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,900,000.00	4,518,519.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,950,000.00	4,493,838.25	
FRTR 4% 04/25/18	4,480,000.00	4,954,745.60	
FRTR 4% 04/25/55	1,750,000.00	2,702,262.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,430,000.00	2,240,288.05	
FRTR 4% 10/25/38	2,780,000.00	3,970,423.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,490,000.00	5,312,984.05	
FRTR 5.75% 10/25/32	2,970,000.00	4,867,384.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,278,025.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,580,176.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,595,405.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,506,724.80	
IRISH 0.8% 03/15/22	1,500,000.00	1,516,207.50	
IRISH 2.4% 05/15/30	570,000.00	617,506.65	

IRISH 2% 02/18/45	590,000.00	563,414.60
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,070,707.50
IRISH 3.9% 03/20/23	550,000.00	671,016.50
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,279,355.00
IRISH 4.5% 04/18/20	1,750,000.00	2,085,177.50
IRISH 4.5% 10/18/18	890,000.00	1,013,287.25
IRISH 5.4% 03/13/25	1,400,000.00	1,919,722.00
IRISH 5.5% 10/18/17	920,000.00	1,027,322.60
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	923,797.50
NETHER 0.25% 01/15/20	1,400,000.00	1,415,141.00
NETHER 0.25% 07/15/25	1,050,000.00	998,030.25
NETHER 0.5% 04/15/17	500,000.00	505,725.00
NETHER 1.25% 01/15/18	2,350,000.00	2,427,937.75
NETHER 1.25% 01/15/19	2,100,000.00	2,193,828.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,750,000.00	1,918,402.50
NETHER 2.25% 07/15/22	1,900,000.00	2,144,549.00
NETHER 2.5% 01/15/17	2,250,000.00	2,330,167.50
NETHER 2.5% 01/15/33	1,200,000.00	1,441,956.00
NETHER 2.75% 01/15/47	960,000.00	1,268,040.00
NETHER 2% 07/15/24	1,700,000.00	1,900,379.00
NETHER 3.25% 07/15/21	1,850,000.00	2,175,868.25
NETHER 3.5% 07/15/20	1,950,000.00	2,271,642.75
NETHER 3.75% 01/15/23	2,030,000.00	2,518,955.95
NETHER 3.75% 01/15/42	1,950,000.00	2,986,678.50
NETHER 4.0% 07/15/18	1,400,000.00	1,562,386.00
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,657,907.00
NETHER 4% 01/15/37	1,530,000.00	2,304,180.00
NETHER 4% 07/15/19	2,000,000.00	2,308,440.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,590,000.00	2,426,968.05
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	302,508.00
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,126,386.50
OBL 0.25% 10/11/19	1,450,000.00	1,472,127.00
OBL 0.5% 02/23/18	2,900,000.00	2,951,823.00
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,427,468.00
OBL 0.5% 04/12/19	1,990,000.00	2,037,670.45
OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	456,941.25
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,042,525.00
OBL 1.25% 10/14/16	4,750,000.00	4,824,005.00
OBL 1% 10/12/18	2,150,000.00	2,229,324.25
RAGB 0.25% 10/18/19	600,000.00	606,867.00
RAGB 1.2% 10/20/25	470,000.00	484,121.15
RAGB 1.65% 10/21/24	780,000.00	843,125.40
RAGB 1.75% 10/20/23	1,850,000.00	2,024,011.00

RAGB 1.95% 06/18/19	800,000.00	860,056.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	584,760.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	720,000.00	980,974.80	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,099,707.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	850,000.00	1,028,742.25	
RAGB 3.5% 09/15/21	1,770,000.00	2,112,114.45	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,000,000.00	1,216,065.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	430,000.00	721,357.25	
RAGB 3.9% 07/15/20	1,450,000.00	1,716,263.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,450,000.00	2,168,873.75	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,400,000.00	1,523,522.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,300,000.00	2,654,372.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	1,350,000.00	1,499,877.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	950,000.00	1,324,523.25	
RAGB 4% 09/15/16	1,200,000.00	1,248,372.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	910,000.00	1,438,710.00	
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	557,260.00	
RFGB 0.75% 04/15/31	300,000.00	278,070.00	
RFGB 1.125% 09/15/18	440,000.00	456,618.80	
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	697,489.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	590,000.00	638,648.45	
RFGB 2.625% 07/04/42	440,000.00	561,781.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	661,622.50	
RFGB 2% 04/15/24	480,000.00	533,289.60	
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	689,886.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	827,368.50	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,170,000.00	1,264,676.40	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,224,662.25	
RFGB 4% 07/04/25	750,000.00	976,702.50	
SPGB 0.5% 10/31/17	1,700,000.00	1,710,089.50	
SPGB 1.4% 01/31/20	2,800,000.00	2,878,610.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	2,300,000.00	2,257,392.50	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,000,000.00	943,350.00	
SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,093,450.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,000,000.00	1,023,945.00	
SPGB 2.75% 04/30/19	3,050,000.00	3,286,786.75	
SPGB 2.75% 10/31/24	2,750,000.00	2,965,613.75	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,542,387.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	2,550,000.00	2,676,467.25	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,800,000.00	3,255,266.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	2,400,000.00	2,650,380.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,384,226.00	

	SPGB 4.25% 10/31/16	1,850,000.00	1,934,693.00	
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,382,130.75	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,000,000.00	1,208,020.00	
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,830,000.00	3,106,108.95	
	SPGB 4.6% 07/30/19	2,850,000.00	3,281,205.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,900,000.00	2,372,834.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,228,768.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	3,050,000.00	3,786,880.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,150,000.00	2,567,831.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,800,000.00	2,421,918.00	
	SPGB 4% 04/30/20	2,900,000.00	3,313,612.50	
	SPGB 5.15% 10/31/28	2,530,000.00	3,340,409.60	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,070,000.00	1,509,887.70	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,000,000.00	2,538,690.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,050,000.00	3,780,688.50	
	SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,512,992.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,950,000.00	2,807,044.50	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,800,000.00	3,582,124.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,680,000.00	2,308,857.60	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,500,000.00	2,133,502.50	
	ユーロ 小計	545,810,000.00	648,570,735.50 (87,537,592,170)	
イギリスボ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	3,480,000.00	3,527,745.60	
	UKT 1.75% 01/22/17	2,600,000.00	2,643,862.00	
	UKT 1.75% 07/22/19	3,000,000.00	3,085,320.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,850,000.00	2,908,938.00	
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,025,455.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	3,000,000.00	3,159,840.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	3,150,000.00	3,440,902.50	
	UKT 2% 07/22/20	3,300,000.00	3,425,895.00	
	UKT 2% 09/07/25	1,380,000.00	1,411,615.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	3,100,000.00	3,606,028.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,220,000.00	2,702,938.80	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,220,000.00	2,983,158.30	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,090,000.00	2,787,746.50	
	UKT 3.75% 09/07/19	550,000.00	609,455.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,980,786.25	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,566,125.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,550,000.00	3,334,673.25	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,330,000.00	2,997,463.45	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,570,000.00	2,092,715.80	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,690,000.00	2,126,915.70	
UKT 4.25% 12/07/40	2,000,000.00	2,688,550.00		

	UKT 4.25% 12/07/46	2,100,000.00	2,941,071.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,600,000.00	2,296,904.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,800,000.00	2,687,499.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	2,300,000.00	2,587,603.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,450,000.00	3,278,124.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,100,000.00	2,966,932.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,950,000.00	4,586,246.25	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,500,000.00	3,366,000.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,900,000.00	2,698,247.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,440,000.00	2,090,296.80	
	UKT 4% 03/07/22	2,050,000.00	2,387,993.75	
	UKT 4% 09/07/16	2,200,000.00	2,272,028.00	
	UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,270,303.25	
	UKT 5% 03/07/25	1,900,000.00	2,462,010.50	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,100,000.00	1,631,080.00	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,737,660.00	
	UKT 8% 06/07/21	1,200,000.00	1,644,006.00	
	イギリスポンド 小計	85,120,000.00	102,010,136.50	(18,551,563,423)
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	320,000.00	365,625.60	
	SWISS 2% 04/28/21	400,000.00	458,278.00	
	SWISS 3% 01/08/18	1,970,000.00	2,144,443.50	
	SWISS 4% 02/11/23	1,140,000.00	1,512,666.00	
	SWISS 4% 04/08/28	490,000.00	730,445.45	
	スイスフラン 小計	4,320,000.00	5,211,458.55	(643,927,818)
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	6,500,000.00	7,015,157.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	6,900,000.00	8,066,755.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,350,000.00	7,249,437.25	
	SGB 3.5% 06/01/22	10,210,000.00	12,377,685.10	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,340,097.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	9,350,000.00	10,808,085.75	
	SGB 5% 12/01/20	10,150,000.00	12,757,941.00	
	スウェーデンクローナ 小計	57,110,000.00	67,615,159.10	(966,896,775)
ノルウェークローネ	NGB 1.75% 03/13/25	2,500,000.00	2,563,400.00	
	NGB 2% 05/24/23	5,740,000.00	6,041,694.40	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,100,000.00	9,329,256.00	
	NGB 3% 03/14/24	5,550,000.00	6,265,034.25	
	NGB 4.25% 05/19/17	7,400,000.00	7,848,625.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	8,300,000.00	9,447,599.50	
	ノルウェークローネ 小計	37,590,000.00	41,495,609.15	

			(587,577,825)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	5,500,000.00	5,917,092.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,950,000.00	6,466,311.25	
	DGB 2.5% 11/15/16	6,550,000.00	6,756,521.50	
	DGB 3% 11/15/21	10,400,000.00	12,078,144.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	14,450,000.00	24,013,154.50	
	DGB 4% 11/15/17	6,500,000.00	7,074,632.50	
	DGB 4% 11/15/19	11,100,000.00	12,881,328.00	
	DGB 7% 11/10/24	4,650,000.00	7,288,572.75	
デンマーククローネ 小計		65,100,000.00	82,475,757.00	(1,491,986,444)
ポーランド ズロチ	POLGB 1.5% 04/25/20	1,100,000.00	1,059,613.50	
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,144,764.00	
	POLGB 3.25% 07/25/19	2,800,000.00	2,908,374.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	2,990,000.00	3,092,392.55	
	POLGB 3.75% 04/25/18	1,800,000.00	1,881,477.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,720,000.00	2,845,351.20	
	POLGB 4.75% 10/25/16	2,500,000.00	2,580,412.50	
	POLGB 4% 10/25/23	3,150,000.00	3,426,522.75	
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,386,774.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,180,000.00	2,473,449.80	
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	2,929,095.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,400,000.00	1,814,631.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	2,890,000.00	3,454,749.35	
	POLGB 5.75% 10/25/21	1,850,000.00	2,178,939.25	
ポーランドズロチ 小計		35,180,000.00	38,176,546.40	(1,216,304,768)
オーストラ リアドル	ACGB 1.75% 11/21/20	900,000.00	884,695.50	
	ACGB 2.75% 04/21/24	2,940,000.00	2,991,935.10	
	ACGB 2.75% 06/21/35	530,000.00	496,845.85	
	ACGB 2.75% 10/21/19	1,020,000.00	1,053,083.70	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,450,000.00	2,587,004.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,240,000.00	1,288,192.60	
	ACGB 3.25% 10/21/18	620,000.00	646,284.90	
	ACGB 3.75% 04/21/37	900,000.00	975,784.50	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,300,000.00	2,634,650.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,800,000.00	1,877,247.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,600,000.00	2,883,660.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,100,000.00	1,315,242.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,800,000.00	2,157,687.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,890,000.00	4,334,160.20	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,140,000.00	2,318,861.20	
ACGB 5.5% 04/21/23	2,650,000.00	3,212,701.00		

	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,973,750.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,400,000.00	2,914,188.00	
	ACGB 6% 02/15/17	3,050,000.00	3,219,015.75	
	オーストラリアドル 小計	36,830,000.00	40,764,988.80 (3,426,704,958)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	600,000.00	585,567.00	
	SIGB 1.625% 10/01/19	110,000.00	109,205.80	
	SIGB 2.25% 06/01/21	280,000.00	279,868.40	
	SIGB 2.375% 04/01/17	650,000.00	660,598.25	
	SIGB 2.375% 06/01/25	200,000.00	196,246.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	922,932.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	520,000.00	506,581.40	
	SIGB 2.75% 07/01/23	250,000.00	254,566.25	
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	200,921.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	300,211.50	
	SIGB 2% 07/01/20	150,000.00	149,581.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	800,000.00	836,880.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	930,000.00	980,647.80	
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	428,082.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	710,000.00	764,169.45	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	817,596.00	
	SIGB 3% 09/01/24	770,000.00	797,435.10	
SIGB 4% 09/01/18	630,000.00	675,048.15		
	シンガポールドル 小計	9,200,000.00	9,466,137.60 (796,007,510)	
マレーシアリンギット	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,434,557.50	
	MGS 3.314% 10/31/17	1,000,000.00	998,600.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,750,000.00	1,656,278.75	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,375,223.50	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,515,272.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	800,000.00	717,100.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,150,000.00	2,137,820.25	
	MGS 3.654% 10/31/19	1,600,000.00	1,579,232.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	1,300,000.00	1,186,562.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,700,000.00	2,722,977.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,488,772.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	750,000.00	710,055.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	540,000.00	524,529.00	
	MGS 4.012% 09/15/17	800,000.00	809,652.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	1,400,000.00	1,391,292.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,400,000.00	1,284,703.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,650,000.00	1,646,700.00	
MGS 4.181% 07/15/24	1,550,000.00	1,529,803.50		

	MGS 4.24% 02/07/18	2,700,000.00	2,735,586.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	1,000,000.00	1,010,190.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,636,777.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,092,888.50	
	MGS 4.935% 09/30/43	650,000.00	648,963.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,045,760.00	
	マレーシアリングット 小計	34,390,000.00	33,879,295.00 (914,063,379)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	25,400,000.00	28,877,641.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	7,720,000.00	5,687,131.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	7,300,000.00	5,407,730.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	8,020,000.00	7,514,379.10	
	SAGB 7.25% 01/15/20	7,700,000.00	7,479,741.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	7,000,000.00	6,746,495.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,300,000.00	13,598,927.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	6,200,000.00	6,298,859.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	10,450,000.00	9,787,574.50	
	SAGB 8.75% 01/31/44	5,050,000.00	4,822,977.25	
	SAGB 8.75% 02/28/48	13,200,000.00	12,600,126.00	
	SAGB 8% 12/21/18	7,000,000.00	7,049,245.00	
	南アフリカランド 小計	121,340,000.00	115,870,826.85 (996,489,110)	
	合計		214,688,968,784 (214,688,968,784)	

有価証券明細表注記

- 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。
- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 159銘柄	100.0%	42.5%
カナダドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 17銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 257銘柄	100.0%	40.8%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.6%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%

ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	19銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	24銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【DCマイセレクションS75】

【純資産額計算書】

(平成27年10月30日現在)

資産総額	10,086,545,908円
負債総額	7,695,825円
純資産総額(-)	10,078,850,083円
発行済口数	7,635,356,549口
1口当たり純資産額(/)	1.3200円
(1万口当たり純資産額)	(13,200円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年10月30日現在)

資産総額	156,258,007,939円
負債総額	2,436,094,726円
純資産総額(-)	153,821,913,213円
発行済口数	116,040,354,491口
1口当たり純資産額(/)	1.3256円
(1万口当たり純資産額)	(13,256円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(平成27年10月30日現在)

資産総額	329,906,906,645円
負債総額	2,825,690,382円
純資産総額(-)	327,081,216,263円
発行済口数	244,879,018,041口
1口当たり純資産額(/)	1.3357円
(1万口当たり純資産額)	(13,357円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年10月30日現在）

資産総額	274,027,498,800円
負債総額	958,289,780円
純資産総額（ - ）	273,069,209,020円
発行済口数	132,228,806,973口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0651円
（1万口当たり純資産額）	（20,651円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（平成27年10月30日現在）

資産総額	225,486,235,042円
負債総額	256,177,305円
純資産総額（ - ）	225,230,057,737円
発行済口数	79,744,850,654口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8244円
（1万口当たり純資産額）	（28,244円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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27年10月30日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成27年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年10月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	431	7,703,213
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	29	100,930
単位型公社債投資信託	0	0
合計	460	7,804,143

3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）の財務諸表について、有限責任あずさ監査法人により監査を受けておりま

す。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		10,457,599		12,314,170
前払費用		114,325		125,306
未収委託者報酬		2,735,763		4,518,944
未収運用受託報酬		15,268		-
繰延税金資産		144,183		116,728
その他		3,448		8,789
流動資産合計		13,470,589		17,083,939
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	67,359	1	57,461
器具備品	1	87,378	1	116,879
有形固定資産合計		154,737		174,341
無形固定資産				
ソフトウェア		203,360		197,641
その他		4,686		7,648
無形固定資産合計		208,046		205,290
投資その他の資産				
投資有価証券		69,583		60,277
長期前払費用		34,773		5,425
長期貸付金		28,838		25,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		117,743		114,415
その他		553		463
貸倒引当金		28,838		25,838
投資その他の資産合計		247,653		205,581
固定資産合計		610,437		585,213
資産合計		14,081,027		17,669,152

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日現在)		当事業年度 (平成27年3月31日現在)	
負債の部				
流動負債				
預り金		13,353		13,868

未払金	1,723,999	2,578,595
未払手数料	1,169,997	1,896,826
その他未払金	554,001	681,769
未払費用	44,167	52,291
未払法人税等	1,467,469	924,882
未払消費税等	129,007	354,256
賞与引当金	94,659	94,769
その他	14,376	56,222
流動負債合計	3,487,033	4,074,887
固定負債		
資産除去債務	12,492	12,707
退職給付引当金	313,992	342,831
固定負債合計	326,485	355,538
負債合計	3,813,518	4,430,425
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	62,500	65,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	7,452,293	10,419,991
利益剰余金合計	9,614,793	12,585,491
株主資本合計	10,264,793	13,235,491
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,715	3,235
評価・換算差額等合計	2,715	3,235
純資産合計	10,267,508	13,238,726
負債・純資産合計	14,081,027	17,669,152

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	22,773,831	28,159,652
運用受託報酬	55,511	8,732
営業収益合計	22,829,342	28,168,384

営業費用		
支払手数料	10,451,296	12,922,655
広告宣伝費	76,961	130,384
公告費	-	880
調査費	5,091,105	5,994,577
調査費	259,236	279,702
委託調査費	4,830,390	5,712,946
図書費	1,479	1,928
営業雑経費	1,264,334	1,299,065
通信費	17,246	17,456
印刷費	327,214	330,921
協会費	22,524	23,182
諸会費	773	105
情報機器関連費	837,859	857,009
その他営業雑経費	58,716	70,390
営業費用合計	16,883,698	20,347,563
一般管理費		
給料	2,201,964	2,185,555
役員報酬	102,330	89,055
給料・手当	1,846,450	1,839,000
賞与	253,183	257,499
退職給付費用	72,029	71,270
役員退職慰労金	1,070	-
福利費	207,122	212,286
交際費	2,758	4,491
旅費交通費	45,973	55,788
租税公課	42,862	42,868
不動産賃借料	130,938	130,938
寄付金	3,385	-
減価償却費	119,445	129,285
諸経費	1 219,615	1 212,345
一般管理費合計	3,047,165	3,044,830
営業利益	2,898,479	4,775,990

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
営業外収益		
受取利息	7,464	6,802
収益分配金	3,234	4,617
投資有価証券売却益	553	1,846
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	1,775	1,936
営業外収益合計	16,027	18,203

営業外費用

長期前払費用償却	1	23,222	1	27,866
支払補償費		14,648		7,656
投資有価証券売却損		284		117
その他		2,112		3,283
営業外費用合計		40,268		38,924
経常利益		2,874,238		4,755,269
特別損失				
外国税関連費用		-	2	56,222
特別損失合計		-		56,222
税引前当期純利益		2,874,238		4,699,047
法人税、住民税及び事業税		1,623,332		1,667,610
法人税等調整額		502,474		30,739
法人税等合計		1,120,857		1,698,349
当期純利益		1,753,381		3,000,697

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	

当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

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。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)		当事業年度 (平成27年3月31日)	
建 物	35,517	千円	45,415	千円
器具備品	188,630	"	218,270	"
計	224,147	"	263,685	"

(損益計算書関係)

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
諸経費	73,276	千円	37,614	千円
長期前払費用償却	23,222	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月

23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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27年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
----	-------	------------	--------	-------------	-----	-------

平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日
----------------------	------	--------	-------	--------	------------	------------

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
（2）未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	69,583	69,583	-
（4）未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
（5）未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(*) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日) (単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

当事業年度(自平成26年4月1日 至平成27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
34,635	1,846	117

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

(単位:千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)

(1) 退職給付債務	313,992	342,831
(2) 退職給付引当金	313,992	342,831

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) 退職給付費用	72,029	71,270

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

2. 金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,998千円、当事業年度で14,089千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	102,368 千円	64,846 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	10,277 "	8,356 "
賞与引当金損金算入限度超過額	33,736 "	31,368 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	111,906 "	110,871 "
外国税関連費用損金不算入額	- "	18,609 "
その他	13,094 "	5,855 "
繰延税金資産 合計	271,384 "	239,908 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	1,503 "	1,546 "
投資有価証券売却益益金不算入額	7,953 "	7,217 "
繰延税金負債 合計	9,457 "	8,763 "
繰延税金資産(負債)の純額	261,926 "	231,144 "

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第2号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ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35.64%から、平成27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等については33.10%に、平成28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等については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)が20,769千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が20,769千円増加しております。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

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

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・レアルコース）	3,178,319千円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

親会社	三井住友トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接)100%	役員の兼任	経営指導料の支払	73,276	-	-
-----	----------------------	---------	---------	------	----------	-------	----------	--------	---	---

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 経営指導料
 取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

- (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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用の支払	2,631,233	その他未払金	239,120

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
 投信販売代行手数料
 ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。
 投資助言費用
 各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	3,422,502円93銭	4,412,908円85銭
1株当たり当期純利益金額	584,460円49銭	1,000,232円56銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,753,381千円	3,000,697千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以

下同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年12月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円(平成27年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (平成27年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・

償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日 : 平成12年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（平成27年3月末日現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成26年12月26日	有価証券届出書
平成26年12月26日	有価証券報告書
平成27年 6月30日	有価証券届出書
平成27年 6月30日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、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27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成27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の平成26年10月1日から平成27年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCマイセレクションS75の平成27年9月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。