

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年1月30日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	SBI資産設計オープン（資産成長型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****(1)【ファンドの名称】**

SBI資産設計オープン（資産成長型）

愛称として「スゴ6」という名称を用いることがあります。

**(2)【内国投資信託受益証券の形態等】**

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

本ファンドについて、委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

本ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

**(3)【発行（売出）価額の総額】**

10兆円を上限とします。

**(4)【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

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

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**(5)【申込手数料】**

ありません。

**(6)【申込単位】**

(イ) 一般コース（収益の分配がなされた場合、税金を差し引いた後の分配金を受領するコースです。以下、「分配金受取りコース」と読み替えるものとします。）

1万口以上1万口単位

(ロ) 自動けいぞく投資（再投資）コース（税金を差し引いた後の分配金が自動的に無手数料で再投資されるコースです。以下、「分配金再投資コース」と読み替えるものとします。）

1万円以上1円単位

積立買付サービスの場合、買付単位は1千円以上1円単位となりますのでご注意ください。

分配金の再投資および確定拠出年金制度にもとづくお申込みの場合、1円以上1円単位です。

**(7)【申込期間】**

継続募集期間

平成25年1月31日から平成26年2月10日まで

継続募集を行う期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

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

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

振替受益権について

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとし、

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券（以下「J-REIT」「海外REIT」ということがあります。）に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

なお、信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

###### ファンドの特色

- 国内外の株式、公社債及び不動産投資信託証券の6資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。
  - 原則として、為替ヘッジは行いません。
- 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資 産	インデックス
国 内 株 式	東証株価指数(TOPIX) <sup>*1</sup>
外 国 株 式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース) <sup>*2</sup>
国 内 債 券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合) <sup>*3</sup>
外 国 債 券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) <sup>*4</sup>
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み) <sup>*5</sup>
海 外 R E I T	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) <sup>*6</sup>

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

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

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

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

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

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

本ファンドおよび「国内株式インデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証

または販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者または公衆に対し、本ファンドおよび「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

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

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

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

3「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI 総合）」とは、野村證券株式会社（野村證券(株)）が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。

NOMURA-BPI 総合は、野村證券(株)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、野村證券(株)が有しています。なお、野村證券(株)は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、CGMI社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

5「東証REIT指数（配当込み）」とは、東京証券取引所に上場しているJ-REIT（不動産投資信託証券）全銘柄を投資対象として算出した指数（市場における価格の変動と配当金の受取りを合わせた投資成果を表す指数）です。東京証券取引所に上場しているJ-REIT全銘柄の時価総額加重平均を2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数（配当込み）の商標は、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といいます。）の知的財産であり、指数値の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利および東証REIT指数（配当込み）の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数（配当込み）の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

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

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本ファンドが主要投資対象とする「J-REITインデックス マザーファンド」は、東証REIT指数（配当込み）の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額と東証REIT指数（配当込み）の指数値が著しく乖離することがあります。

本ファンドおよび「J-REITインデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証ま

たは販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、「J-REITインデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者または公衆に対し、本ファンドおよび「J-REITインデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

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

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

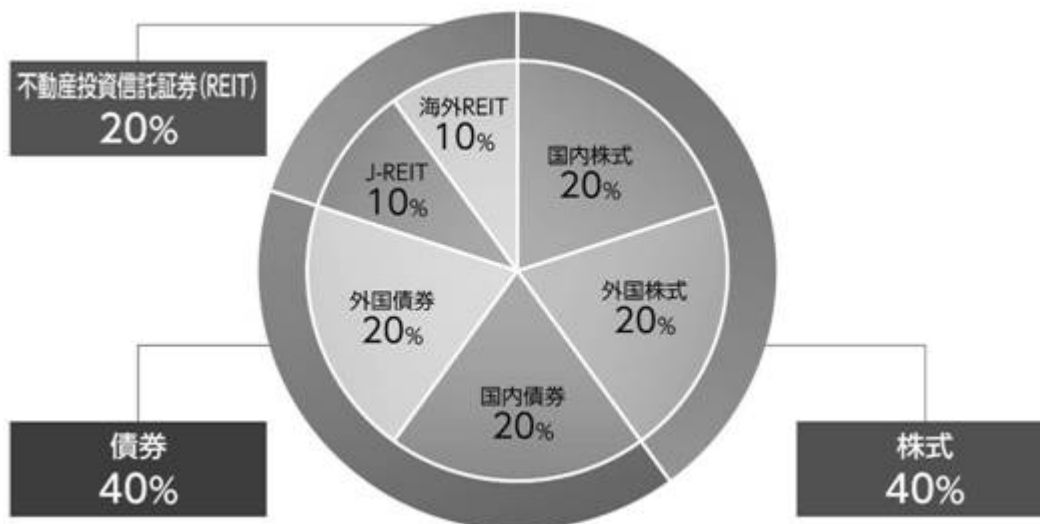
6「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、スタンダード&プアーズが発表している、日本を除く世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）および同様の制度にもとづく銘柄の浮動株修正時価総額にもとづいて算出される指数です。「円換算ベース」とは、ドルベースのインデックスをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「当社」といいます。）が独自に円換算したものです。

なお、本商品は、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（S&P）によって支持、保証、販売又は販売促進されるものではありません。S&P は、明示的にも暗示的にも、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または本商品に関する投資について、またS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）が市場全般のパフォーマンスに追随する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&P の当社に対する唯一の関係は、S&P 及びS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の登録商標についての利用許諾を与えることです。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）に関する決定、作成及び計算において、当社又は本商品の所有者の要求等を考慮に入れずに行います。S&P は本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&P は、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。

S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）の計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）に含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負いません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）又はそれらに含まれるデータの使用により、当社、本商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&P は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）又はそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行っていません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害（利益の損失を含む）について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&P が責任を負うことはありません。

3 . 株式40%、債券40%、不動産投資信託証券（REIT）20%を基本組入比率として運用します。

基本組入比率 (2012年11月末現在)
-------------------------



- ・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ・基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

#### 4. ノーロードファンドです。

- ・購入時手数料が無料のノーロードファンドです。（運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して年率0.714%（税込）です。）

#### 分配方針

- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
  - ・原則として、毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。
  - ・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### ! 主な投資制限

- ・株式への直接投資は行いません。
- ・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65%以下とします。

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

#### [ ファンドの商品分類 ]

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

#### 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産
	内外	( ) 資産複合

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	<b>グローバル (日本を含む)</b>	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	<b>なし</b>
<b>その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券、不動 産投信)資産配分固定 型))</b>	日々	アジア		
	その他 ( )	オセアニア		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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



## 〔区分における定義〕

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分固定型))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。)、実質的に複数資産(本ファンドにおいては、株式、債券、不動産投信)を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。本ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて複数資産(株式、債券、不動産投信)に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「資産複合」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券)」となっています。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(日本を含みます。)の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成20年1月9日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

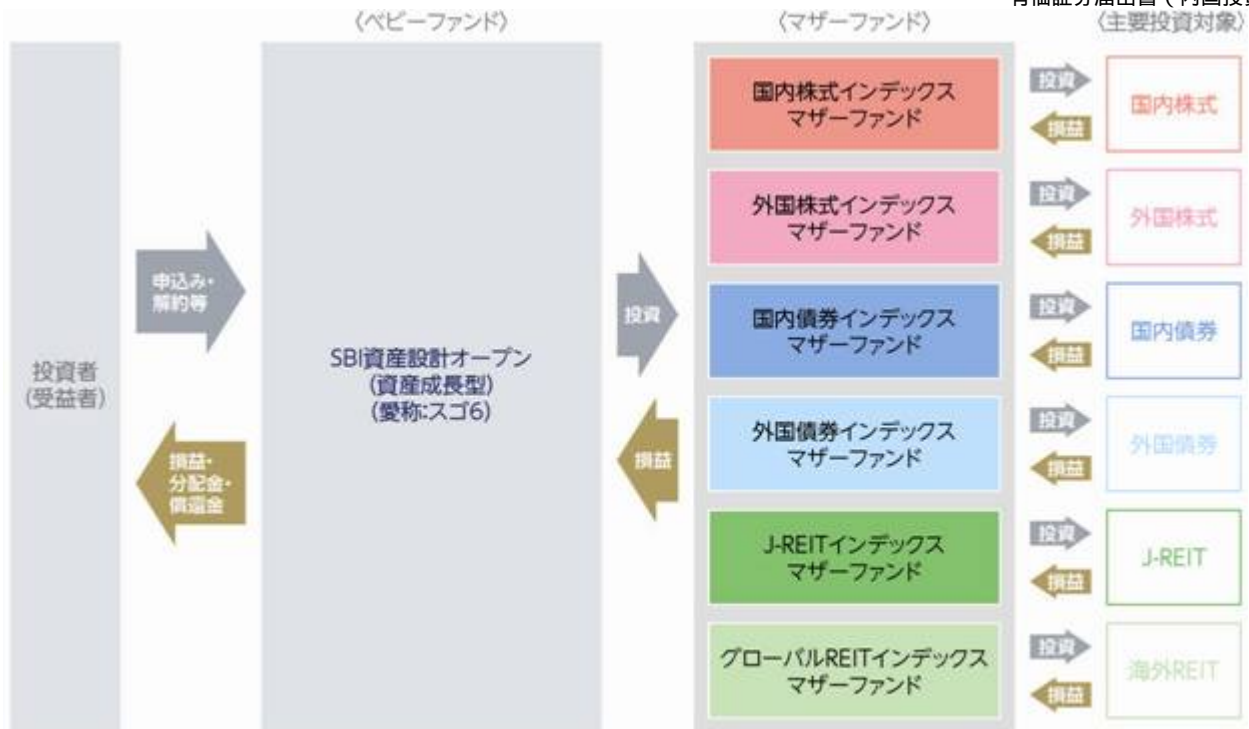
平成24年4月1日 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 J-REITインデックス マザーファンド」の名称を「J-REITインデックス マザーファンド」に、「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の名称を「グローバルREITインデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

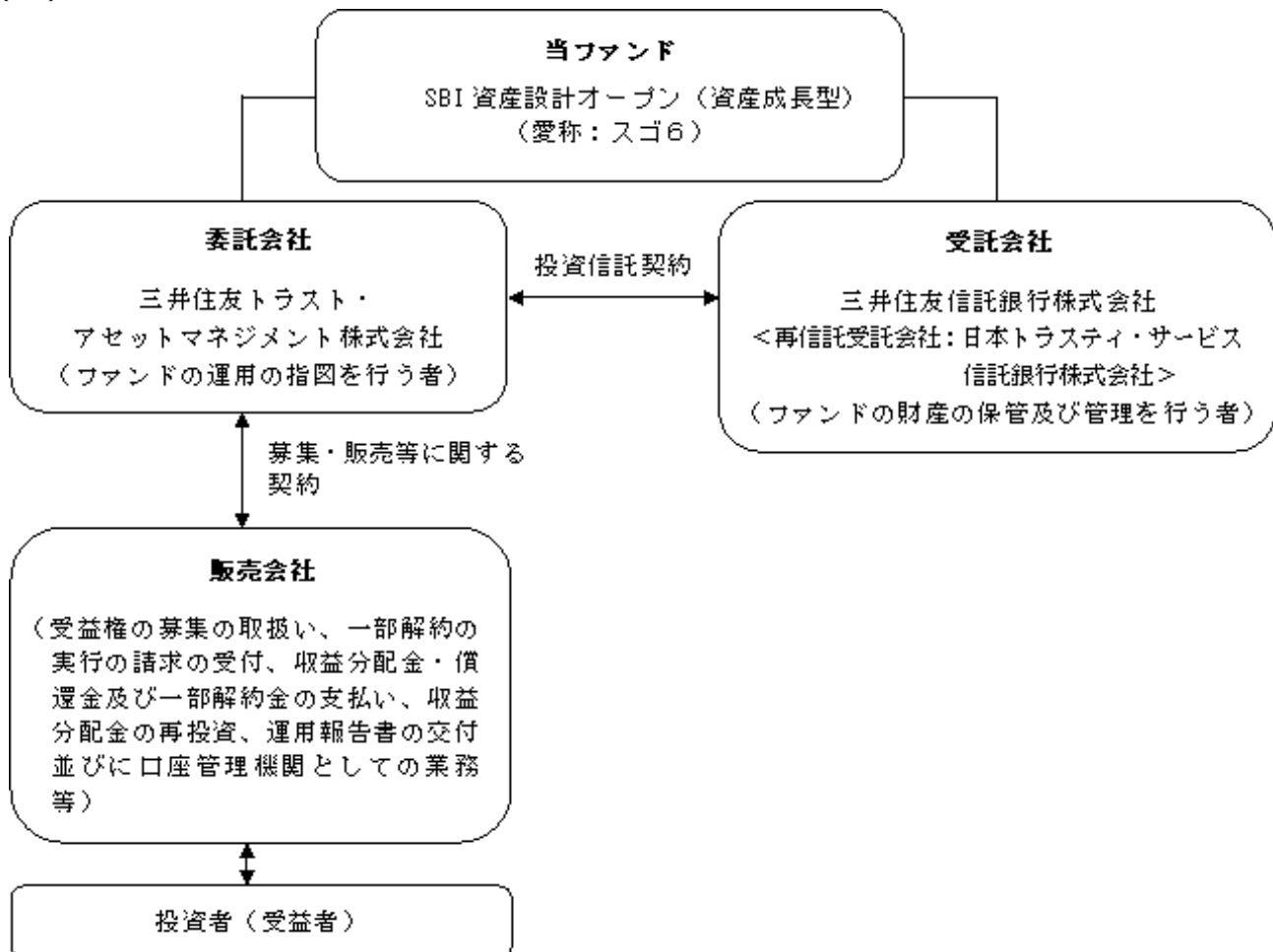
## (イ) ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式( )で運用します。

ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンド(SBI資産設計オープン(資産成長型))とし、その資金をマザーファンド(国内株式インデックス マザーファンド、外国株式インデックス マザーファンド、国内債券インデックス マザーファンド、外国債券インデックス マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、グローバルREITインデックス マザーファンド)に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



## (ロ) 当ファンドの関係法人図



## (ハ) 委託会社等の概況

資本金

平成24年11月30日現在 3億円

## 会社の沿革

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

## 大株主の状況(平成24年11月30日現在)

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### (イ) 基本方針

本ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」および「グローバルREIT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。）への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

#### (ロ) 運用方法

##### 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、主要投資対象の見直しおよび追加が行われる場合があります。

##### 投資態度

1)主として、各マザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

2)各マザーファンド受益証券への基本組入比率は以下のとおりとします。

マザーファンド受益証券	基本組入比率
国内債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
国内株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国債券インデックス マザーファンド受益証券	20%
外国株式インデックス マザーファンド受益証券	20%
J-REITインデックス マザーファンド受益証券	10%
グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券	10%

3)前記2)に定める各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

4)各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。なお、将来の市場構造および市場環境の変化等に応じ、投資対象の追加および見直しを行う場合があります。

5)実質組入外貨建資産については、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

6)株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の70%以下とします。

7)ただし、資金動向および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。

#### (参考)「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

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

## 3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、ならびに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。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

## (参考)「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### （参考）「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

##### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

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

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。

#### （参考）「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

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

### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## (参考)「J-REIT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、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）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。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引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。

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債（新株引受権証券と社債とが一体となった新株引受権付社債の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができます。

外貨建資産への投資は行いません。

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、ならびに投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の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指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引および外国の取引所における当該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。

## （参考）「グローバルREIT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、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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。

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。

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。

ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超



える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債（新株引受権証券と社債とが一体となった新株引受権付社債の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## (2)【投資対象】

(イ) 本ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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．金銭債権

ハ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を主として次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第7号から第11号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド

2. 国内株式インデックス マザーファンド

3. 外国債券インデックス マザーファンド

4. 外国株式インデックス マザーファンド

5. J-REITインデックス マザーファンド

6. グローバルREITインデックス マザーファンド

7. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号の証券の性質を有するもの

9. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債（新株引受権証券と社債とが一体となった新株引受権付社債の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

10. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

なお、第9号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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

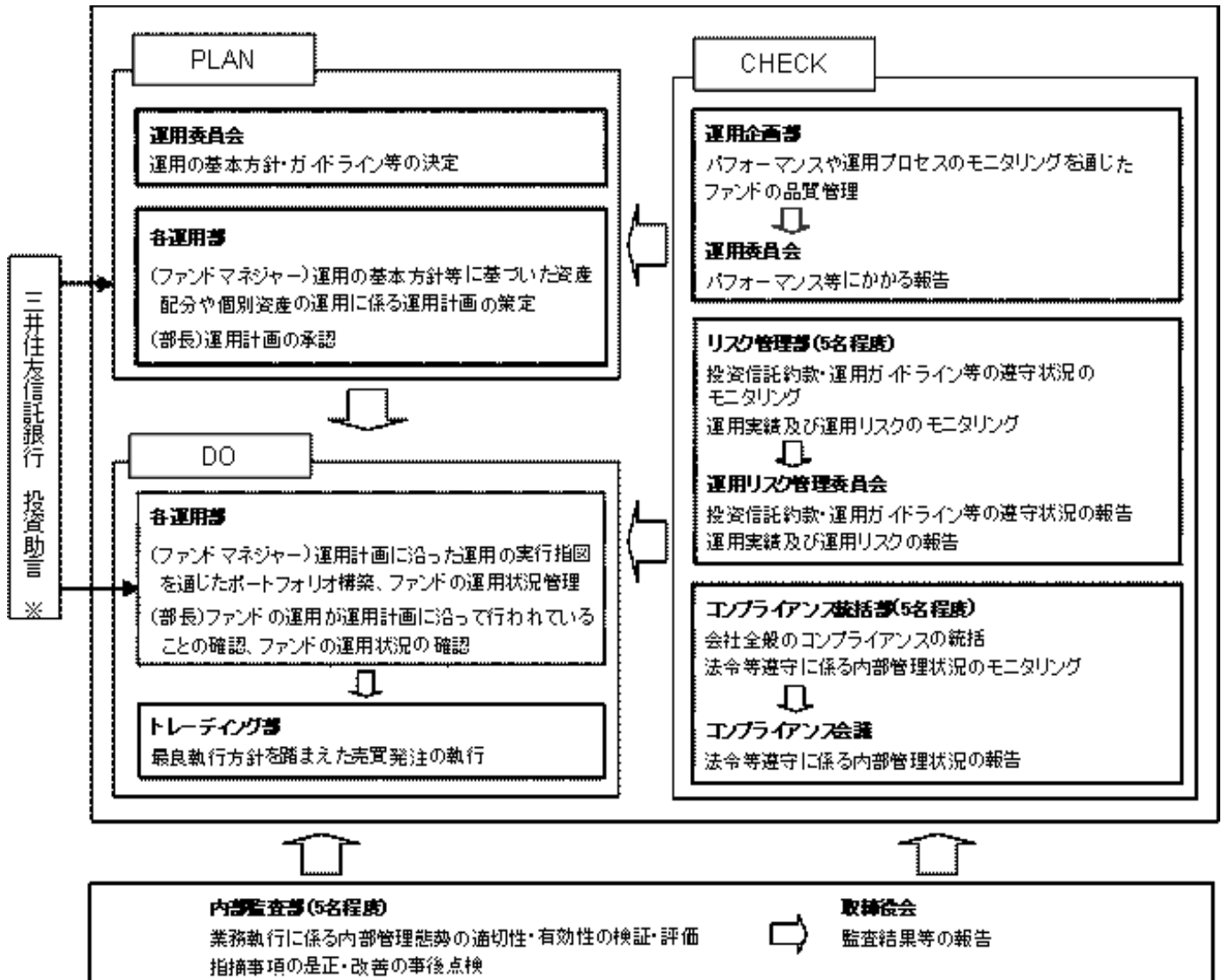
1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(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(ハ)に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年1月30日現在のものであり、今後変更されることがあります。



「J-REITインデックス マザーファンド」を除きます。

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

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

#### (4)【分配方針】

##### (イ) 分配方針

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

##### 分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）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、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

##### 留保益の運用方針

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

##### (ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

前記におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (5)【投資制限】

##### (イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への直接投資は行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

デリバティブへの直接投資は行いません。（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65%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わな

いものとします。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26条）

前記における「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マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（ロ）法律等で規制される取引等

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

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

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

< デリバティブ取引に係る投資制限 >（金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

### 3【投資リスク】

#### （イ）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

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。

##### リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

##### 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。

##### 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。

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

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リスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

純資産総額	信託報酬総額 (純資産総額に対して)	配分（純資産総額に対して）		
		委託者	指定販売会社	受託者
100億円以下の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.399% (税抜 0.38%)	年率0.273% (税抜 0.26%)	年率0.042% (税抜 0.04%)
100億円超300億円以下の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.336% (税抜 0.32%)	年率0.336% (税抜 0.32%)	年率0.042% (税抜 0.04%)
300億円超の部分	年率0.714% (税抜 0.68%)	年率0.273% (税抜 0.26%)	年率0.399% (税抜 0.38%)	年率0.042% (税抜 0.04%)

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

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

## (4)【その他の手数料等】

(イ) ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として当該基準価額から控除します。

「信託財産留保金」（以下「信託財産留保額」ということがあります。）とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。以下同じ。

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

(イ) 個人の受益者に対する課税

収益分配金に対する課税

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

徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%、住民税3%）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

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

一部解約金及び償還金に対する課税

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

損益通算について

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

#### （ロ）法人の受益者に対する課税

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

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

	税 率（所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

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

#### （ハ）個別元本について

追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「（二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

#### （二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元



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

（ホ）確定拠出年金の運用段階における課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、平成24年11月30日現在のもので、税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,668,282,878	98.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		59,666,353	1.26
合計(純資産総額)		4,727,949,231	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,022,827,512	0.9500	971,740,332	1.0119	1,034,999,159	21.89
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	466,627,702	1.8279	852,954,283	1.9128	892,565,468	18.88
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,367,837,364	0.5805	794,104,032	0.6273	858,044,378	18.15
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	586,992,007	1.2540	736,145,841	1.2544	736,322,773	15.57
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	668,269,638	0.8268	552,525,337	0.8653	578,253,717	12.23
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	702,916,832	0.7748	544,619,962	0.8082	568,097,383	12.02

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.74
合計	98.74

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

## c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成20年11月10日)	994,679,991	994,679,991	7,198	7,198
第2期計算期間末 (平成21年11月10日)	1,764,446,119	1,764,446,119	7,679	7,679
第3期計算期間末 (平成22年11月10日)	2,508,787,040	2,508,787,040	7,788	7,788
第4期計算期間末 (平成23年11月10日)	3,227,431,682	3,227,431,682	7,290	7,290
第5期計算期間末 (平成24年11月12日)	4,476,232,662	4,476,232,662	7,995	7,995
平成23年11月末日	3,228,177,367		7,181	
12月末日	3,353,410,654		7,287	
平成24年 1月末日	3,501,005,052		7,441	
2月末日	3,862,232,812		8,029	
3月末日	3,965,318,567		8,211	
4月末日	3,973,363,048		8,075	
5月末日	3,795,193,123		7,542	
6月末日	4,009,496,275		7,750	
7月末日	4,108,032,244		7,776	
8月末日	4,254,337,317		7,860	
9月末日	4,364,037,007		7,985	
10月末日	4,520,837,057		8,115	
11月末日	4,727,949,231		8,376	

## 【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20年 1月 9日～平成20年11月10日)	0
第2期計算期間(平成20年11月11日～平成21年11月10日)	0
第3期計算期間(平成21年11月11日～平成22年11月10日)	0
第4期計算期間(平成22年11月11日～平成23年11月10日)	0
第5期計算期間(平成23年11月11日～平成24年11月12日)	0

## 【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成20年 1月 9日～平成20年11月10日)	28.0
第2期計算期間(平成20年11月11日～平成21年11月10日)	6.7
第3期計算期間(平成21年11月11日～平成22年11月10日)	1.4
第4期計算期間(平成22年11月11日～平成23年11月10日)	6.4
第5期計算期間(平成23年11月11日～平成24年11月12日)	9.7

(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20年 1月 9日～平成20年11月10日)	1,620,495,479	238,628,571	1,381,866,908
第2期計算期間 (平成20年11月11日～平成21年11月10日)	1,146,528,947	230,541,088	2,297,854,767
第3期計算期間 (平成21年11月11日～平成22年11月10日)	1,325,647,358	402,047,721	3,221,454,404
第4期計算期間 (平成22年11月11日～平成23年11月10日)	1,745,390,853	539,609,788	4,427,235,469
第5期計算期間 (平成23年11月11日～平成24年11月12日)	1,886,342,012	715,055,600	5,598,521,881

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

(参考情報)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## (1)投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	168,628,668,300	76.88
	ポーランド	102,985,000	0.05
	小計	168,731,653,300	76.93
地方債証券	日本	14,393,931,278	6.56
特殊債券	日本	20,449,052,806	9.32
	アメリカ	208,374,000	0.09
	韓国	100,982,000	0.05
	スウェーデン	99,404,000	0.05
	小計	20,857,812,806	9.51
社債券	日本	13,197,890,860	6.02
	オランダ	403,788,000	0.18
	オーストラリア	304,833,000	0.14
	アメリカ	205,894,000	0.09
	スウェーデン	100,658,000	0.05
	韓国	100,020,000	0.05
	イギリス	100,010,000	0.05
	小計	14,413,093,860	6.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		945,811,109	0.43
合計(純資産総額)		219,342,302,353	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a . 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,640,000,000	100.42	2,651,253,800	100.87	2,662,968,000	0.8	2022/09/20	1.21
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	2,490,000,000	107.05	2,665,630,500	106.63	2,655,087,000	1.7	2017/03/20	1.21
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	2,540,000,000	100.97	2,564,872,000	100.82	2,560,980,400	0.5	2014/12/20	1.17
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,330,000,000	106.97	2,492,505,300	107.26	2,499,204,600	1.5	2018/09/20	1.14
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,290,000,000	107.46	2,460,921,100	107.30	2,457,192,900	1.7	2017/09/20	1.12
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	2,210,000,000	99.98	2,209,626,600	100.18	2,213,978,000	0.2	2017/06/20	1.01
日本	国債証券	第106回利付国債(5年)	2,140,000,000	100.07	2,141,647,200	100.14	2,143,038,800	0.2	2017/09/20	0.98
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	1,980,000,000	101.64	2,012,472,000	103.38	2,047,042,800	1.0	2021/12/20	0.93
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,020,000,000	100.94	2,038,988,000	101.01	2,040,583,800	0.4	2016/09/20	0.93
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,860,000,000	105.68	1,965,664,400	106.45	1,980,100,200	1.3	2019/12/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	1,940,000,000	101.09	1,961,159,300	100.92	1,957,945,000	0.5	2015/03/20	0.89
日本	国債証券	第101回利付国債(5年)	1,820,000,000	100.90	1,836,434,600	101.04	1,839,019,000	0.4	2016/12/20	0.84
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	1,710,000,000	106.61	1,823,133,600	106.62	1,823,270,400	1.5	2017/12/20	0.83
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	1,750,000,000	103.22	1,806,350,000	102.51	1,794,047,500	1.5	2014/09/20	0.82
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	1,680,000,000	106.81	1,794,522,000	106.29	1,785,789,600	1.9	2016/06/20	0.81
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,610,000,000	104.38	1,680,624,000	105.61	1,700,433,700	1.2	2020/12/20	0.78
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	1,650,000,000	100.05	1,650,914,800	101.12	1,668,480,000	0.8	2022/06/20	0.76
日本	国債証券	第84回利付国債(5年)	1,650,000,000	101.23	1,670,295,000	100.93	1,665,361,500	0.7	2014/06/20	0.76
日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	1,590,000,000	104.44	1,660,717,300	103.90	1,652,025,900	1.5	2015/09/20	0.75
日本	国債証券	第89回利付国債(5年)	1,610,000,000	100.89	1,624,388,300	100.77	1,622,445,300	0.4	2015/06/20	0.74
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	1,600,000,000	100.39	1,606,356,000	100.63	1,610,224,000	0.3	2017/03/20	0.73
日本	国債証券	第82回利付国債(5年)	1,590,000,000	101.43	1,612,872,100	101.03	1,606,488,300	0.9	2014/03/20	0.73
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	1,550,000,000	101.86	1,578,830,000	103.55	1,605,133,500	1.0	2021/09/20	0.73
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	1,510,000,000	105.81	1,597,847,200	106.21	1,603,906,900	1.3	2018/12/20	0.73
日本	国債証券	第85回利付国債(5年)	1,580,000,000	101.34	1,601,208,000	101.08	1,597,111,400	0.7	2014/09/20	0.73
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,480,000,000	106.27	1,572,929,200	107.23	1,587,078,000	1.4	2020/03/20	0.72
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,500,000,000	101.40	1,521,045,000	103.20	1,548,030,000	1.0	2022/03/20	0.71
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	1,390,000,000	107.14	1,489,265,700	107.69	1,497,016,100	1.5	2019/06/20	0.68
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1,430,000,000	102.88	1,471,217,000	104.14	1,489,216,300	1.0	2020/09/20	0.68
日本	国債証券	第93回利付国債(5年)	1,440,000,000	101.31	1,458,999,400	101.21	1,457,467,200	0.5	2015/12/20	0.66

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.93
地方債証券	6.56
特殊債券	9.51
社債券	6.57
合計	99.57

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	119,262,312,740	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,746,943,076	2.25
合計(純資産総額)		122,009,255,816	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,423,600	3,078.59	4,382,680,724	3,535.00	5,032,426,000	4.12
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,281,400	349.15	2,891,450,810	377.00	3,122,087,800	2.56
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	934,900	2,553.61	2,387,369,989	2,732.00	2,554,146,800	2.09
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	827,100	2,333.02	1,929,640,842	2,654.00	2,195,123,400	1.80
日本	株式	キャノン	電気機器	688,400	3,268.76	2,250,214,384	2,883.00	1,984,657,200	1.63
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,071,600	118.10	1,661,855,960	132.00	1,857,451,200	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	460,400	3,421.83	1,575,410,532	3,685.00	1,696,574,000	1.39
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	434,700	3,271.31	1,422,038,457	3,770.00	1,638,819,000	1.34
日本	株式	ファナック	電気機器	115,400	13,846.88	1,597,929,952	13,900.00	1,604,060,000	1.31
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	498,700	2,351.55	1,172,717,985	3,090.00	1,540,983,000	1.26
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	550,500	2,237.70	1,231,853,850	2,470.00	1,359,735,000	1.11
日本	株式	三菱商事	卸売業	853,400	1,557.23	1,328,940,082	1,561.00	1,332,157,400	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,593,000	458.31	1,188,397,830	476.00	1,234,268,000	1.01
日本	株式	三菱地所	不動産業	765,000	1,254.36	959,585,400	1,589.00	1,215,585,000	1.00
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,399,900	756.48	1,058,996,352	799.00	1,118,520,100	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	206,400	4,651.17	960,001,488	5,410.00	1,116,624,000	0.92

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	457,500	2,373.35	1,085,807,625	2,402.00	1,098,915,000	0.90
日本	株式	三井物産	卸売業	944,000	1,125.77	1,062,726,880	1,139.00	1,075,216,000	0.88
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	257,600	3,089.67	795,898,992	4,170.00	1,074,192,000	0.88
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,011	125,165.68	1,127,867,942	118,900.00	1,071,407,900	0.88
日本	株式	信越化学工業	化学	208,100	4,076.47	848,313,407	4,850.00	1,009,285,000	0.83
日本	株式	小松製作所	機械	541,200	1,947.06	1,053,748,872	1,847.00	999,596,400	0.82
日本	株式	KDDI	情報・通信業	154,300	4,941.29	762,441,047	6,100.00	941,230,000	0.77
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	4,905,000	174.84	857,590,200	189.00	927,045,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	423,600	1,787.17	757,045,212	2,114.00	895,490,400	0.73
日本	株式	三井不動産	不動産業	516,000	1,355.85	699,618,600	1,719.00	887,004,000	0.73
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,237,000	264.15	590,903,550	341.00	762,817,000	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	273,800	2,385.39	653,119,782	2,709.00	741,724,200	0.61
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	363,700	1,704.79	620,032,123	1,989.00	723,399,300	0.59
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	872,500	879.94	767,747,650	824.00	718,940,000	0.59

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
株式	97.75
合計	97.75

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

#### c . 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.62
		建設業	2.52
		食料品	4.08
		繊維製品	0.84
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.72
		医薬品	5.17
		石油・石炭製品	0.76
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.98
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	1.05
		金属製品	0.69
		機械	4.93
		電気機器	11.60
輸送用機器	10.75		
精密機器	1.40		

その他製品	1.46
電気・ガス業	2.42
陸運業	4.12
海運業	0.28
空運業	0.61
倉庫・運輸関連業	0.23
情報・通信業	6.30
卸売業	5.19
小売業	4.17
銀行業	9.71
証券、商品先物取引業	1.22
保険業	2.27
その他金融業	0.91
不動産業	2.92
サービス業	2.12
合計	97.75

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	290	2,118,446,350	2,264,900,000	2,264,900,000	1.86

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

### 外国債券インデックス マザーファンド

#### (1)投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	87,928,197,586	41.21
	フランス	20,242,277,917	9.49
	イタリア	19,336,656,128	9.06
	ドイツ	18,506,149,448	8.67
	イギリス	16,646,586,364	7.80
	スペイン	9,042,509,475	4.24
	カナダ	5,956,713,697	2.79
	オランダ	5,589,433,189	2.62
	ベルギー	5,399,915,953	2.53
	オーストリア	3,518,689,079	1.65



オーストラリア	3,316,763,945	1.55
メキシコ	2,059,548,988	0.97
デンマーク	1,879,340,361	0.88
アイルランド	1,605,878,604	0.75
ポーランド	1,569,031,315	0.74
南アフリカ	1,297,585,049	0.61
フィンランド	1,281,654,146	0.60
スウェーデン	1,218,223,138	0.57
マレーシア	1,120,045,317	0.52
スイス	900,377,144	0.42
シンガポール	857,283,045	0.40
ノルウェー	532,985,835	0.25
小計	209,805,845,723	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	3,566,666,438	1.67
合計(純資産総額)	213,372,512,161	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2) 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	8,620.99	3,224,253,498	8,536.30	3,192,579,305	2.625	2014/07/31	1.50
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	22,900,000	8,271.66	1,894,212,061	8,339.35	1,909,711,538	0.875	2017/02/28	0.90
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	8,411.84	1,901,077,474	8,358.92	1,889,116,121	1.750	2014/01/31	0.89
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	21,700,000	8,673.53	1,882,157,387	8,635.10	1,873,818,192	2.500	2015/03/31	0.88
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/14	22,000,000	8,432.05	1,855,052,532	8,377.20	1,842,984,176	1.750	2014/03/31	0.86
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	9,634.34	1,734,181,746	9,728.00	1,751,041,639	3.625	2021/02/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	20,000,000	8,554.35	1,710,871,656	8,531.49	1,706,299,214	1.500	2016/07/31	0.80
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	8,652.43	1,661,267,365	8,595.65	1,650,366,034	2.375	2015/02/28	0.77
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	8,275.80	1,605,506,604	8,281.61	1,606,632,946	0.750	2017/06/30	0.75
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	8,604.29	1,376,687,705	8,519.95	1,363,192,000	2.625	2014/06/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	8,544.58	1,281,687,900	8,523.16	1,278,474,133	1.750	2015/07/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	15,100,000	8,458.36	1,277,212,360	8,401.90	1,268,687,277	1.875	2014/04/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/13	15,000,000	8,423.71	1,263,557,035	8,358.92	1,253,838,133	2.000	2013/11/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,958.78	1,254,229,599	8,950.75	1,253,106,362	2.750	2016/11/30	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/15/13	15,000,000	8,271.34	1,240,702,218	8,257.87	1,238,680,834	0.750	2013/12/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	13,500,000	8,974.88	1,211,609,319	9,092.22	1,227,450,760	2.625	2020/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	9,340.57	1,195,593,209	9,357.82	1,197,802,057	3.125	2019/05/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	8,204.19	1,148,587,804	8,198.84	1,147,838,672	0.250	2015/07/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	9,201.61	1,150,201,462	9,079.07	1,134,884,029	4.250	2015/08/15	0.53

アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	8,570.86	1,122,783,236	8,543.04	1,119,138,520	1.875	2015/06/30	0.52
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,800,000	10,662.99	1,044,973,142	11,081.51	1,085,988,925	4.250	2014/08/01	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/40	10,000,000	10,604.97	1,060,497,680	10,738.47	1,073,847,107	4.250	2040/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	8,577.18	1,080,725,642	8,515.45	1,072,947,712	2.125	2014/11/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,586.03	1,073,253,995	8,515.45	1,064,432,254	2.375	2014/08/31	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	8,919.32	1,070,318,903	8,771.76	1,052,611,532	4.250	2014/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	12,500,000	8,314.35	1,039,294,739	8,371.74	1,046,468,504	1.750	2022/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,500,000	8,964.21	1,030,885,208	9,089.01	1,045,236,950	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	11,500,000	8,671.05	997,170,842	8,634.14	992,926,798	2.000	2016/01/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	11,500,000	8,343.07	959,453,781	8,383.61	964,115,653	1.000	2016/09/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/18	10,000,000	9,619.58	961,958,607	9,622.15	962,215,642	3.750	2018/11/15	0.45

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.33
合計	98.33

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

#### c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 外国株式インデックス マザーファンド

#### (1) 投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	72,227,843,078	52.10
	イギリス	13,517,863,267	9.75
	カナダ	7,156,120,081	5.16
	スイス	5,910,256,750	4.26
	フランス	5,385,266,854	3.88
	ドイツ	5,286,266,906	3.81
	オーストラリア	4,950,509,199	3.57
	スウェーデン	1,881,985,644	1.36
	オランダ	1,861,956,797	1.34
	スペイン	1,787,273,828	1.29
	香港	1,616,036,940	1.17

	イタリア	1,314,647,749	0.95
	シンガポール	1,050,966,714	0.76
	アイルランド	891,128,795	0.64
	デンマーク	713,078,955	0.51
	ベルギー	704,498,330	0.51
	バミューダ	578,579,280	0.42
	ジャージー	544,053,373	0.39
	アンティル	539,960,384	0.39
	フィンランド	479,972,949	0.35
	ノルウェー	459,143,777	0.33
	イスラエル	364,790,142	0.26
	ルクセンブルク	257,569,858	0.19
	オーストリア	175,641,931	0.13
	ケイマン	139,004,718	0.10
	パナマ	99,694,386	0.07
	ポルトガル	87,665,816	0.06
	ニュージーランド	77,806,092	0.06
	マン島	37,267,375	0.03
	ギリシャ	31,764,115	0.02
	ガーンジー	31,463,277	0.02
	リベリア	29,709,360	0.02
	モーリシャス	21,705,932	0.02
	小計	130,211,492,652	93.93
投資信託受益証券	オーストラリア	59,693,142	0.04
	シンガポール	23,809,462	0.02
	香港	12,276,284	0.01
	小計	95,778,888	0.07
投資証券	アメリカ	2,000,449,513	1.44
	オーストラリア	411,707,314	0.30
	フランス	186,315,017	0.13
	イギリス	168,708,976	0.12
	香港	71,624,730	0.05
	シンガポール	59,615,013	0.04
	カナダ	32,685,514	0.02
	オランダ	16,688,420	0.01
	小計	2,947,794,497	2.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,366,647,030	3.87
合計(純資産総額)		138,621,713,067	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
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	65,800	46,338.67	3,049,084,722	48,398.24	3,184,604,402	2.30
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	323,971	6,738.76	2,183,165,148	7,236.41	2,344,388,409	1.69
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	741,059	1,577.52	1,169,039,247	1,735.19	1,285,882,316	0.93
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	226,331	4,862.06	1,100,436,621	5,400.32	1,222,262,089	0.88
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	76,202	15,946.88	1,215,184,363	15,728.44	1,198,538,859	0.86
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	137,750	8,130.70	1,120,004,090	8,687.47	1,196,699,653	0.86
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	529,591	2,387.22	1,264,254,675	2,213.13	1,172,055,848	0.85
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	407,419	2,769.08	1,128,178,412	2,786.33	1,135,204,434	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	193,552	5,134.14	993,723,529	5,707.33	1,104,667,071	0.80
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	193,498	5,144.81	995,511,993	5,684.34	1,099,909,659	0.79
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,293,809	671.87	869,276,628	832.06	1,076,539,447	0.78
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	524,247	1,819.77	954,013,786	2,040.68	1,069,821,416	0.77
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,416	48,596.15	894,946,742	56,818.00	1,046,360,413	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	352,156	2,618.80	922,228,527	2,723.09	958,955,721	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	266,650	2,751.02	733,559,483	3,384.98	902,606,623	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	285,036	3,090.17	880,811,292	3,118.09	888,769,725	0.64
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	118,334	7,014.69	830,076,373	7,417.89	877,789,731	0.63
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	161,443	4,436.23	716,199,619	5,103.75	823,965,437	0.59
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	49,309	13,526.49	666,978,124	16,130.16	795,362,355	0.57
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	213,783	3,094.28	661,504,803	3,671.58	784,922,498	0.57
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	130,642	5,378.85	702,705,028	5,816.55	759,886,979	0.55
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,336,410	526.95	704,234,613	567.86	758,900,824	0.55
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,451,245	226.59	782,027,268	211.17	728,831,226	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	201,201	3,408.80	685,854,210	3,614.10	727,160,775	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	260,793	2,653.24	691,947,358	2,750.07	717,199,656	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	274,124	2,154.00	590,465,179	2,614.70	716,752,242	0.52
オースト ラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	226,309	2,743.15	620,800,302	2,930.77	663,259,786	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	109,229	5,635.07	615,513,541	5,773.85	630,672,648	0.45

アメリカ	株式	QUALCOMM	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	119,590	4,707.11	562,924,289	5,202.30	622,143,296	0.45
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	349,085	1,885.19	658,094,832	1,779.80	621,304,066	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	93.93
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.13
合計	96.13

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

#### c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.78
		素材	6.56
		資本財	7.03
		商業・専門サービス	0.91
		運輸	1.65
		自動車・自動車部品	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.41
		消費者サービス	1.61
		メディア	2.64
		小売	2.95
		食品・生活必需品小売り	2.25
		食品・飲料・タバコ	6.84
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	2.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.01
		銀行	7.46
		各種金融	4.55
		保険	4.10
		不動産	0.75
		ソフトウェア・サービス	5.91
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.43		
電気通信サービス	3.68		
公益事業	3.37		
半導体・半導体製造装置	1.33		
合計			93.93

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	107	37,901,056.50	37,869,975	3,109,882,347	2.24
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	25	3,510,392.50	3,504,000	289,920,960	0.21
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	54	3,660,238	3,684,960	326,229,508	0.24
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	216	5,509,552	5,570,640	593,551,692	0.43
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	37	4,150,534	4,152,325	355,729,682	0.26
	FTSE 100	ロンドン国際金融 先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	88	5,153,360	5,170,000	681,095,800	0.49

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

## J-REITインデックス マザーファンド

## (1)投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	7,869,989,100	97.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		175,997,447	2.19
合計(純資産総額)		8,045,986,547	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

## a . 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,169	848,069.04	991,392,716	863,000.00	1,008,847,000	12.54
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,125	785,743.07	883,960,955	810,000.00	911,250,000	11.33
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,964	143,187.83	567,596,561	150,000.00	594,600,000	7.39
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,573	232,885.37	366,328,691	243,800.00	383,497,400	4.77
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,011	95,629.27	383,569,019	93,500.00	375,028,500	4.66
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,097	163,465.23	342,786,600	172,900.00	362,571,300	4.51
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	461	705,524.06	325,246,593	692,000.00	319,012,000	3.96

日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	434	677,694.89	294,119,583	705,000.00	305,970,000	3.80
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	582	471,587.47	274,463,912	493,500.00	287,217,000	3.57
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	542	377,510.01	204,610,430	412,500.00	223,575,000	2.78
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	371	543,856.82	201,770,882	588,000.00	218,148,000	2.71
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	282	710,128.01	200,256,099	721,000.00	203,322,000	2.53
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	755	250,471.46	189,105,958	266,400.00	201,132,000	2.50
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	391	519,261.68	203,031,318	511,000.00	199,801,000	2.48
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	306	600,893.08	183,873,285	630,000.00	192,780,000	2.40
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	441	379,665.11	167,432,315	421,000.00	185,661,000	2.31
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	268	607,657.77	162,852,283	637,000.00	170,716,000	2.12
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	360	429,857.29	154,748,627	461,000.00	165,960,000	2.06
日本	投資証券	ケネディクス不動産投資法人	546	265,281.86	144,843,899	273,500.00	149,331,000	1.86
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	323	405,073.40	130,838,711	444,000.00	143,412,000	1.78
日本	投資証券	福岡リート投資法人	235	581,690.17	136,697,192	605,000.00	142,175,000	1.77
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	2,537	46,670.88	118,404,035	54,500.00	138,266,500	1.72
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	288	472,802.43	136,167,100	463,000.00	133,344,000	1.66
日本	投資証券	プレミア投資法人	375	282,604.14	105,976,554	300,000.00	112,500,000	1.40
日本	投資証券	トップリート投資法人	296	356,070.59	105,396,895	369,500.00	109,372,000	1.36
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	261	360,482.24	94,085,867	378,500.00	98,788,500	1.23
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,026	22,449.09	90,380,066	24,090.00	96,986,340	1.21
日本	投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	185	460,591.51	85,209,430	499,000.00	92,315,000	1.15
日本	投資証券	M I D リート投資法人	350	198,390.38	69,436,636	205,600.00	71,960,000	0.89
日本	投資証券	平和不動産リート投資法人	1,327	53,648.25	71,191,230	54,000.00	71,658,000	0.89

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	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。

#### c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	東証REIT指数先物	東京証券取引所	買建	円	165	168,492,700	175,560,000	175,560,000	2.18

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

る方法で評価しております。

### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### (1)投資状況

(平成24年11月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	8,092,492,605	63.89
	オーストラリア	1,526,953,386	12.06
	イギリス	758,573,922	5.99
	フランス	689,230,297	5.44
	シンガポール	516,459,954	4.08
	カナダ	397,827,376	3.14
	香港	298,430,704	2.36
	オランダ	153,661,897	1.21
	ベルギー	69,336,244	0.55
	ニュージーランド	40,500,340	0.32
	ドイツ	20,751,954	0.16
	イタリア	10,790,082	0.09
	イスラエル	2,531,224	0.02
	小計	12,577,539,985	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		88,746,395	0.70
合計(純資産総額)		12,666,286,380	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### (2)投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成24年11月30日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	69,751	12,476.66	870,260,178	12,420.64	866,352,758	6.84
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	479,500	895.18	429,239,821	894.39	428,862,306	3.39
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	21,064	18,009.74	379,357,250	19,253.58	405,557,514	3.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	33,206	11,961.96	397,208,878	11,601.91	385,253,143	3.04
アメリカ	投資証券	HCP INC	104,167	3,626.48	377,760,192	3,692.93	384,682,105	3.04
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	68,051	5,230.32	355,929,036	5,221.18	355,307,173	2.81
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	69,444	4,649.26	322,863,387	4,578.18	317,927,826	2.51
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	106,266	2,741.82	291,363,117	2,793.72	296,877,704	2.34
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	34,781	8,462.92	294,349,122	8,391.84	291,876,684	2.30
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	58,690	4,816.67	282,690,485	4,845.90	284,405,941	2.25
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,328	10,829.05	241,791,192	10,925.24	243,938,865	1.93
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	38,995	6,344.75	247,413,561	6,227.98	242,860,111	1.92



香港	投資証券	LINK REIT	527,000	420.59	221,655,230	446.26	235,179,020	1.86
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	166,640	1,169.52	194,889,079	1,206.34	201,024,964	1.59
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	179,970	1,038.69	186,933,750	1,055.23	189,911,074	1.50
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	644,425	265.47	171,077,393	255.29	164,519,511	1.30
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	103,259	1,550.02	160,054,167	1,569.31	162,045,711	1.28
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	512,102	293.72	150,419,608	293.84	150,480,199	1.19
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	27,982	5,039.66	141,019,989	5,282.77	147,822,738	1.17
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	205,081	685.77	140,640,110	715.34	146,704,324	1.16
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	93,895	1,554.93	146,000,955	1,560.27	146,502,490	1.16
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	30,534	4,598.51	140,411,182	4,598.71	140,417,316	1.11
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	346,920	379.14	131,531,439	395.79	137,309,340	1.08
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	20,679	6,023.32	124,556,364	6,108.08	126,309,102	1.00
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,705	8,508.33	125,115,012	8,416.47	123,764,320	0.98
オーストラリア	投資証券	GPT GROUP	375,869	298.15	112,068,549	299.84	112,702,440	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	57,390	1,923.65	110,398,377	1,890.40	108,490,193	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,275	5,377.07	103,643,067	5,424.84	104,563,929	0.83
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	163,493	615.91	100,697,986	616.54	100,800,497	0.80
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	30,783	3,154.26	97,097,862	3,230.60	99,447,584	0.79

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.30
合計	99.30

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

#### c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。


投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(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：2008年1月9日  
作成基準日：2012年11月30日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	8,376円
純資産総額	47億円

**〈基準価額の騰落率〉**

1ヶ月	3.22%
3ヶ月	6.56%
6ヶ月	11.06%
1年	16.64%
3年	13.10%
5年	-
設定来	-16.24%

※上記は作成基準日からの期間です。

**分配の推移(1万口当たり、税引前)**

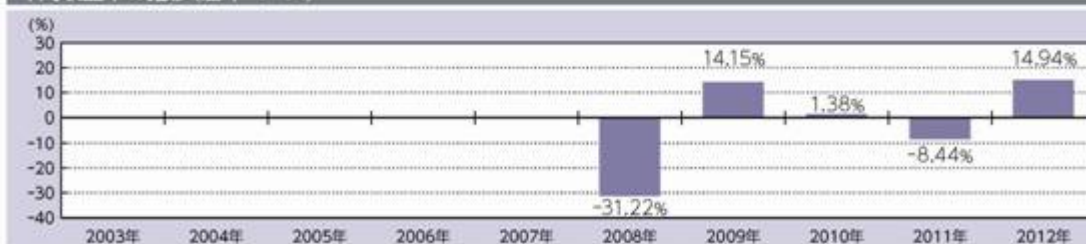
設定来分配金合計額:0円

決算期	2008年11月	2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11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
外国株式 インデックス マザーファンド	21.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.5%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.4%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.9%	T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	-	2.625%	2014/7/31	0.3%
		T 0.875% 02/28/17	アメリカ	国債証券	-	0.875%	2017/2/28	0.2%
国内株式 インデックス マザーファンド	18.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.7%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
国内債券 インデックス マザーファンド	15.6%	第325回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	0.8%	2022/9/20	0.2%
		第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.7%	2017/3/20	0.2%
グローバル REITインデックス マザーファンド	12.2%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		WESTFIELD GROUP	オーストラリア	投資証券	-	-	-	0.4%
J-REIT インデックス マザーファンド	12.0%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.5%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.4%

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2012年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンド内には、ベンチマークはありません。

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

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

確定拠出年金によるお申込みは、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締結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。）からの取得申込みに限ります。

#### （イ）申込手続

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

取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。ただし、自動けいぞく投資（再投資）契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、取得の申込みを受け付けません。ニューヨーク、ロンドンの銀行および取引所の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

#### <お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

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

本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

申込みには、「一般コース」と「自動けいぞく投資（再投資）コース」があり、「自動けいぞく投資（再投資）コース」を選択した場合には、取得申込者は指定販売会社との間で「自動けいぞく投資（再投資）契約」を別途締結します。なお、指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、指定販売会社によって取扱いコースが異なる場合があります。取扱いコースの詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記 に記載されている先と同じです。

なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、）を行うものとし

ます。

自動けいぞく投資（再投資）契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

（ロ）申込単位

一般コース

1万口以上1万口単位

自動けいぞく投資（再投資）コース

1万円以上1円単位

積立買付サービスの場合、買付単位は1千円以上1円単位となりますのでご注意ください。

分配金の再投資および確定拠出年金制度にもとづくお申込みの場合、1円以上1円単位です。

（ハ）申込手数料

ありません。

## 2【換金（解約）手続等】

（イ）受益権の買取請求

本ファンドのご換金の方法は、ご解約の請求のほか受益権の買取の方法によることができます。ただし、受益権の買取は、指定販売会社によっては行わない場合がありますので、詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

（ロ）受益権のご解約の請求

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

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者にご解約の請求をすることができます。

ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、ご解約の請求を受け付けないものとします。ニューヨーク、ロンドンの銀行および取引所の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。なお、解約単位は、以下のとおりです。

1)一般コース：1万口単位

2)自動けいぞく投資（再投資）コース：1円単位

（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位。）

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

委託者は、前記のご解約の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として控除した価額（解約価額）とします。

解約価額 = 解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保金

= 解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - (解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.15%)

ご解約の受取金額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた額（解約代金）となります。解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、前記 によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

前記 により、ご解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日のご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご解約の請求を受け付けたものとして、前記 の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

#### （八）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### （イ）基準価額の算出方法

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

##### [主要な投資対象の評価方法]

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

##### 1) 株式および不動産投資信託証券

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

##### 2) 公社債

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

(a) 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

(b) 価格情報会社の提供する価額

(c) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

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

(ロ) 基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

(ハ) 基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当りに換算した価額で行われます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成20年1月9日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

(4) 【計算期間】

原則として、毎年11月11日から翌年11月10日（第1計算期間は平成20年1月9日から平成20年11月10日）までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

(イ) 信託の終了

- (a) 委託者は、信託期間中において、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (d) 前記(c)の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (e) 前記(c)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- (f) 前記(c)から(e)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(c)から(e)までの手続を行うことが困難な場合にも適用しません。委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する

委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「（ロ）投資信託約款の変更等（b）」の書面決議で否決された場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### （ロ）投資信託約款の変更等

- (a) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本規定に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- (b) 委託者は、前記(a)の事項（前記(a)の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (c) 前記(b)の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 前記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 前記(b)から(e)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 前記(a)から(f)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- 委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

#### （ハ）指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

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

#### （ニ）運用報告書

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



（ホ）信託事務処理の再信託

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

（ヘ）公告

委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

（ト）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

#### 4【受益者の権利等】

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

（イ）収益分配金請求権

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

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

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は委託者に帰属するものとします。

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として、取得申込者とします。）

に、原則として、決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。「自動けいぞく投資（再投資）コース」をお申込みの場合は、分配金は、税金を差し引いた後、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

（ハ）換金（解約）請求権

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

（ニ）反対者の買取請求権

投資信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。



（ホ）帳簿閲覧・謄写請求権

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

なお、受益者には、受益者集会の権利はありません。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成23年11月11日から平成24年11月12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】

SBI資産設計オープン（資産成長型）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成23年11月10日現在)	第5期 (平成24年11月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	65,059,737	75,833,485
親投資信託受益証券	3,176,318,667	4,418,948,503
未収入金	-	1,740,000
未収利息	84	139
流動資産合計	3,241,378,488	4,496,522,127
資産合計	3,241,378,488	4,496,522,127
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,751,450	4,946,219
未払受託者報酬	649,597	890,462
未払委託者報酬	10,393,497	14,247,313
その他未払費用	152,262	205,471
流動負債合計	13,946,806	20,289,465
負債合計	13,946,806	20,289,465
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,427,235,469	5,598,521,881
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,199,803,787	1,122,289,219
（分配準備積立金）	145,700,199	232,170,631
元本等合計	3,227,431,682	4,476,232,662
純資産合計	3,227,431,682	4,476,232,662
負債純資産合計	3,241,378,488	4,496,522,127

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 (自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日)	第5期 (自 平成23年11月11日 至 平成24年11月12日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	31,154	38,450
有価証券売買等損益	200,501,279	373,869,836
営業収益合計	200,470,125	373,908,286
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,219,041	1,644,782
委託者報酬	19,504,618	26,316,275
その他費用	152,262	205,471
営業費用合計	20,875,921	28,166,528
営業利益又は営業損失（ ）	221,346,046	345,741,758
経常利益又は経常損失（ ）	221,346,046	345,741,758
当期純利益又は当期純損失（ ）	221,346,046	345,741,758
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（ ）	1,284,222	36,625,296
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	712,667,364	1,199,803,787
剰余金増加額又は欠損金減少額	118,022,981	189,509,511
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	118,022,981	189,509,511
剰余金減少額又は欠損金増加額	382,529,136	421,111,405
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	382,529,136	421,111,405
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,199,803,787	1,122,289,219

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第5期（自 平成23年 11月11日 至 平成24年 11月12日） 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年11月11日から翌年11月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成23年 11月11日から平成24年 11月12日までとなっております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (平成23年11月10日現在)	第5期 (平成24年11月12日現在)
1. 期首元本額	3,221,454,404円	4,427,235,469円
期中追加設定元本額	1,745,390,853円	1,886,342,012円
期中一部解約元本額	539,609,788円	715,055,600円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	4,427,235,469口	5,598,521,881口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,199,803,787円	元本の欠損 1,122,289,219円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7290円 (7,290円)	0.7995円 (7,995円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第4期 自 平成22年11月11日 至 平成23年11月10日	第5期 自 平成23年11月11日 至 平成24年11月12日
費用控除後の配当等収益額	A	62,850,681円 (83,695,448円)	105,520,458円 (115,098,061円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	- 円
収益調整金額	C	127,903,388円	221,640,656円
分配準備積立金額	D	82,849,518円	126,650,173円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	273,603,587円	453,811,287円
当ファンドの期末残存口数	F	4,427,235,469口	5,598,521,881口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	618.00円	810.59円

10,000口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	- 円	- 円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第4期 (平成23年11月10日現在)	第5期 (平成24年11月12日現在)
	計算期間(自平成22年11月11日至平成23年11月10日)の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間(自平成23年11月11日至平成24年11月12日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	197,241,355	372,177,616
合計	197,241,355	372,177,616

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	585,300,886	734,025,841	
	国内株式インデックス マザーファンド	1,314,800,056	762,584,032	
	外国債券インデックス マザーファンド	465,293,951	850,464,283	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,020,263,508	969,250,332	
	J-REITインデックス マザーファンド	704,942,876	546,260,234	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	672,830,792	556,363,781	
親投資信託受益証券 小計		4,763,432,069	4,418,948,503	
合計		4,763,432,069	4,418,948,503	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)



## &lt;参考&gt;

「SBI資産設計オープン（資産成長型）」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成24年11月12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。

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	660,708,838
国債証券	164,877,769,600
地方債証券	13,969,224,933
特殊債券	20,234,197,833
社債券	14,213,741,550
派生商品評価勘定	449,370
未収利息	672,957,499
前払費用	40,561,212
差入委託証拠金	390,000
流動資産合計	214,670,000,835
資産合計	214,670,000,835
負債の部	
流動負債	
前受金	810,000
未払金	100,000,000
未払解約金	61,128,670
流動負債合計	161,938,670
負債合計	161,938,670
純資産の部	
元本等	
元本	171,045,390,624
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	43,462,671,541
元本等合計	214,508,062,165
純資産合計	214,508,062,165
負債純資産合計	214,670,000,835

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 計算期間の期首元本額	147,545,043,246円
計算期間中の追加設定元本額	44,287,776,265円
計算期間中の一部解約元本額	20,787,428,887円
計算日の元本額	171,045,390,624円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	585,300,886円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,612,940円
SMT 国内債券インデックス・オープン	2,445,267,488円
世界経済インデックスファンド	74,219,258円
マイセレクション25	172,370,683円
マイセレクション50	143,483,631円
マイセレクション75	42,533,241円
DCマイセレクション25	8,977,665,448円
DCマイセレクション50	10,502,430,828円
DCマイセレクション75	2,729,862,358円
DC日本債券インデックス・オープン	374,793,472円
DC日本債券インデックス・オープンS	39,295,795,918円
DC日本債券インデックス・オープンP	12,673,424,518円
DCマイセレクションS25	2,546,120,640円

DCマイセレクションS50	2,927,242,106円
DCマイセレクションS75	509,944,869円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	37,501,635円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	515,296,966円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	244,779,075円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,889,042円
DC世界経済インデックスファンド	21,087,279円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	18,544,979,418円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	63,260,742円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	491,770,446円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	62,166,111円
国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）	10,057,650円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	7,384,306円
マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	2,442,714円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,955,991,732円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	3,001,414,823円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	9,036,211,623円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	811,299,251円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	14,660,330,143円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,540,759,416円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,283,339,302円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,619,834,773円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	5,033,866,679円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,238,723,406円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,967,469,462円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,665,230,933円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,615,125,709円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	287,202,868円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,570,904,455円
日本債券ファンド・シリーズ1	7,047,984,374円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,285,961,663円
コア投資戦略ファンド（成長型）	348,115,424円
2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、 次の有価証券を差し入れております。  国債証券 105,407,000円  なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んで おります。
3. 計算日における受益権総数	171,045,390,624口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2541円 (12,541円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成24年11月12日現在
--	---------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年11月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	<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> <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
--------------------	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	359,403,400	
地方債証券	25,239,218	
特殊債券	65,375,681	
社債券	30,226,600	
合計	480,244,899	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
- 債券関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	288,710,630	-	289,160,000	449,370
	合計	288,710,630	-	289,160,000	449,370

## (注)1. 時価の算定方法

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

- 2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (3) 附属明細表(平成24年11月12日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第311回利付国債(2年)	780,000,000	780,881,400	
	第312回利付国債(2年)	860,000,000	860,043,000	
	第313回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,060,000	
	第314回利付国債(2年)	300,000,000	300,018,000	
	第315回利付国債(2年)	540,000,000	540,037,800	
	第316回利付国債(2年)	850,000,000	850,059,500	
	第317回利付国債(2年)	730,000,000	730,051,100	
	第318回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,060,084,800	
	第319回利付国債(2年)	850,000,000	850,068,000	
	第320回利付国債(2年)	1,110,000,000	1,110,099,900	
	第321回利付国債(2年)	600,000,000	600,000,000	
	第78回利付国債(5年)	390,000,000	393,443,700	
	第79回利付国債(5年)	170,000,000	171,127,100	
	第80回利付国債(5年)	480,000,000	483,710,400	
	第81回利付国債(5年)	1,270,000,000	1,282,026,900	
	第82回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,607,187,900	
	第83回利付国債(5年)	560,000,000	567,184,800	
	第84回利付国債(5年)	1,650,000,000	1,665,906,000	
	第85回利付国債(5年)	1,380,000,000	1,395,400,800	
	第86回利付国債(5年)	300,000,000	302,796,000	
	第87回利付国債(5年)	2,140,000,000	2,158,147,200	
	第88回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,857,424,800	
	第89回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,622,719,000	
	第90回利付国債(5年)	220,000,000	221,168,200	
	第91回利付国債(5年)	200,000,000	201,732,000	
	第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,267,333,200	
	第93回利付国債(5年)	1,440,000,000	1,457,784,000	
	第94回利付国債(5年)	910,000,000	924,050,400	
	第95回利付国債(5年)	620,000,000	630,019,200	
	第96回利付国債(5年)	900,000,000	911,538,000	
	第97回利付国債(5年)	1,270,000,000	1,282,496,800	
	第99回利付国債(5年)	2,020,000,000	2,040,099,000	
	第100回利付国債(5年)	100,000,000	100,612,000	
第101回利付国債(5年)	1,820,000,000	1,838,527,600		
第102回利付国債(5年)	930,000,000	935,682,300		
第103回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,609,312,000		
第104回利付国債(5年)	130,000,000	130,195,000		
第105回利付国債(5年)	2,210,000,000	2,212,011,100		
第106回利付国債(5年)	1,240,000,000	1,240,297,600		

第1回利付国債（40年）	150,000,000	164,812,500	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	313,287,000	
第3回利付国債（40年）	340,000,000	353,780,200	
第4回利付国債（40年）	490,000,000	507,409,700	
第5回利付国債（40年）	220,000,000	215,028,000	
第256回利付国債（10年）	1,930,000,000	1,957,637,600	
第257回利付国債（10年）	660,000,000	668,725,200	
第258回利付国債（10年）	210,000,000	213,397,800	
第259回利付国債（10年）	940,000,000	957,737,800	
第260回利付国債（10年）	790,000,000	808,960,000	
第261回利付国債（10年）	510,000,000	523,866,900	
第262回利付国債（10年）	480,000,000	493,814,400	
第263回利付国債（10年）	410,000,000	421,389,800	
第264回利付国債（10年）	1,750,000,000	1,795,377,500	
第265回利付国債（10年）	530,000,000	545,592,600	
第266回利付国債（10年）	470,000,000	482,845,100	
第267回利付国債（10年）	590,000,000	604,885,700	
第268回利付国債（10年）	760,000,000	784,981,200	
第269回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,388,056,500	
第270回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,216,827,800	
第271回利付国債（10年）	560,000,000	576,027,200	
第272回利付国債（10年）	530,000,000	549,572,900	
第273回利付国債（10年）	1,590,000,000	1,653,234,300	
第274回利付国債（10年）	530,000,000	552,917,200	
第275回利付国債（10年）	280,000,000	291,242,000	
第276回利付国債（10年）	480,000,000	502,238,400	
第277回利付国債（10年）	410,000,000	430,360,600	
第278回利付国債（10年）	720,000,000	760,550,400	
第279回利付国債（10年）	440,000,000	467,715,600	
第280回利付国債（10年）	1,680,000,000	1,786,780,800	
第281回利付国債（10年）	750,000,000	800,355,000	
第282回利付国債（10年）	1,260,000,000	1,335,511,800	
第283回利付国債（10年）	680,000,000	723,350,000	
第284回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,446,156,000	
第285回利付国債（10年）	2,490,000,000	2,655,460,500	
第286回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,224,474,000	
第287回利付国債（10年）	540,000,000	582,476,400	
第288回利付国債（10年）	2,290,000,000	2,456,139,500	
第289回利付国債（10年）	1,710,000,000	1,821,731,400	
第290回利付国債（10年）	870,000,000	924,235,800	
第291回利付国債（10年）	420,000,000	443,961,000	
第292回利付国債（10年）	620,000,000	668,471,600	
第293回利付国債（10年）	710,000,000	771,166,500	

第294回利付国債（10年）	810,000,000	875,310,300	
第295回利付国債（10年）	300,000,000	320,877,000	
第296回利付国債（10年）	2,130,000,000	2,282,167,200	
第297回利付国債（10年）	720,000,000	768,117,600	
第298回利付国債（10年）	1,160,000,000	1,230,574,400	
第299回利付国債（10年）	970,000,000	1,029,752,000	
第300回利付国債（10年）	730,000,000	784,056,500	
第301回利付国債（10年）	1,290,000,000	1,386,995,100	
第302回利付国債（10年）	200,000,000	213,748,000	
第303回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,261,608,800	
第304回利付国債（10年）	550,000,000	584,556,500	
第305回利付国債（10年）	1,660,000,000	1,764,945,200	
第306回利付国債（10年）	1,480,000,000	1,584,473,200	
第308回利付国債（10年）	600,000,000	637,932,000	
第309回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,414,975,500	
第310回利付国債（10年）	1,330,000,000	1,382,827,600	
第311回利付国債（10年）	160,000,000	163,872,000	
第312回利付国債（10年）	1,410,000,000	1,486,238,700	(注)
第313回利付国債（10年）	1,250,000,000	1,326,912,500	
第314回利付国債（10年）	680,000,000	710,688,400	
第315回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,199,348,400	
第316回利付国債（10年）	620,000,000	646,926,600	
第317回利付国債（10年）	500,000,000	521,225,000	
第318回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,705,456,500	
第319回利付国債（10年）	600,000,000	624,264,000	
第320回利付国債（10年）	1,980,000,000	2,043,023,400	
第321回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,544,880,000	
第322回利付国債（10年）	1,050,000,000	1,072,176,000	
第323回利付国債（10年）	930,000,000	947,149,200	
第324回利付国債（10年）	1,650,000,000	1,664,833,500	
第325回利付国債（10年）	1,740,000,000	1,751,988,600	
第1回利付国債（30年）	40,000,000	48,093,600	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	182,376,000	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	134,809,200	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	133,546,600	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	55,031,000	
第6回利付国債（30年）	190,000,000	214,665,800	
第7回利付国債（30年）	180,000,000	199,924,200	
第8回利付国債（30年）	50,000,000	51,244,000	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	229,384,800	
第10回利付国債（30年）	120,000,000	108,296,400	
第11回利付国債（30年）	90,000,000	90,413,100	
第12回利付国債（30年）	120,000,000	128,775,600	



第13回利付国債（30年）	220,000,000	231,869,000	
第14回利付国債（30年）	300,000,000	337,113,000	
第15回利付国債（30年）	280,000,000	319,421,200	
第16回利付国債（30年）	220,000,000	251,037,600	
第17回利付国債（30年）	210,000,000	235,695,600	
第18回利付国債（30年）	300,000,000	331,023,000	
第19回利付国債（30年）	180,000,000	198,603,000	
第20回利付国債（30年）	230,000,000	262,004,500	
第21回利付国債（30年）	220,000,000	242,294,800	
第22回利付国債（30年）	220,000,000	250,670,200	
第23回利付国債（30年）	230,000,000	261,868,800	
第24回利付国債（30年）	340,000,000	387,141,000	
第25回利付国債（30年）	280,000,000	307,930,000	
第26回利付国債（30年）	540,000,000	604,044,000	
第27回利付国債（30年）	450,000,000	511,992,000	
第28回利付国債（30年）	430,000,000	489,198,100	
第29回利付国債（30年）	670,000,000	748,838,900	
第30回利付国債（30年）	540,000,000	591,948,000	
第31回利付国債（30年）	660,000,000	709,064,400	
第32回利付国債（30年）	680,000,000	744,348,400	
第33回利付国債（30年）	680,000,000	699,386,800	
第34回利付国債（30年）	780,000,000	835,419,000	
第35回利付国債（30年）	840,000,000	861,268,800	
第36回利付国債（30年）	980,000,000	1,003,186,800	
第37回利付国債（30年）	280,000,000	279,731,200	
第24回利付国債（20年）	20,000,000	21,237,200	
第25回利付国債（20年）	60,000,000	63,228,000	
第26回利付国債（20年）	20,000,000	21,629,000	
第27回利付国債（20年）	50,000,000	54,535,500	
第28回利付国債（20年）	20,000,000	22,295,400	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	67,005,600	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	88,202,400	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	89,031,200	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	55,978,000	
第33回利付国債（20年）	140,000,000	159,678,400	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	57,231,000	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	11,357,400	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	79,489,200	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	79,825,900	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	22,632,200	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	563,165,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	111,818,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	354,545,400	

第42回利付国債（20年）	80,000,000	91,542,400	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	163,934,400	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	195,403,100	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	331,385,900	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	192,151,000	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	101,906,100	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	150,419,100	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	157,701,600	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	244,296,800	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	111,952,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	124,129,500	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	90,352,800	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	227,608,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	156,861,600	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	168,064,500	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	266,738,400	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	333,477,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	218,450,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	372,053,500	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	245,287,200	
第62回利付国債（20年）	250,000,000	249,877,500	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	220,182,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	355,315,200	
第65回利付国債（20年）	300,000,000	332,958,000	
第66回利付国債（20年）	230,000,000	252,799,900	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	144,198,600	
第68回利付国債（20年）	140,000,000	159,804,400	
第69回利付国債（20年）	350,000,000	395,678,500	
第70回利付国債（20年）	380,000,000	441,943,800	
第71回利付国債（20年）	220,000,000	251,086,000	
第72回利付国債（20年）	560,000,000	632,626,400	
第73回利付国債（20年）	350,000,000	391,149,500	
第74回利付国債（20年）	150,000,000	169,360,500	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	146,680,300	
第76回利付国債（20年）	240,000,000	265,190,400	
第77回利付国債（20年）	160,000,000	178,660,800	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	187,535,500	
第79回利付国債（20年）	210,000,000	234,147,900	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	247,904,800	
第81回利付国債（20年）	160,000,000	178,115,200	
第82回利付国債（20年）	540,000,000	607,629,600	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	326,000,600	
第84回利付国債（20年）	460,000,000	511,202,600	

第 8 5 回利付国債（20年）	240,000,000	269,337,600	
第 8 6 回利付国債（20年）	310,000,000	355,563,800	
第 8 7 回利付国債（20年）	310,000,000	351,726,000	
第 8 8 回利付国債（20年）	560,000,000	641,760,000	
第 8 9 回利付国債（20年）	320,000,000	362,707,200	
第 9 0 回利付国債（20年）	560,000,000	634,032,000	
第 9 1 回利付国債（20年）	290,000,000	332,021,000	
第 9 2 回利付国債（20年）	960,000,000	1,072,588,800	
第 9 3 回利付国債（20年）	280,000,000	308,736,400	
第 9 4 回利付国債（20年）	500,000,000	557,800,000	
第 9 5 回利付国債（20年）	460,000,000	524,804,800	
第 9 6 回利付国債（20年）	280,000,000	311,880,800	
第 9 7 回利付国債（20年）	420,000,000	472,932,600	
第 9 8 回利付国債（20年）	320,000,000	355,846,400	
第 9 9 回利付国債（20年）	700,000,000	777,049,000	
第 1 0 0 回利付国債（20年）	600,000,000	673,386,000	
第 1 0 1 回利付国債（20年）	160,000,000	184,044,800	
第 1 0 2 回利付国債（20年）	280,000,000	321,608,000	
第 1 0 3 回利付国債（20年）	180,000,000	204,136,200	
第 1 0 4 回利付国債（20年）	260,000,000	287,718,600	
第 1 0 5 回利付国債（20年）	540,000,000	596,376,000	
第 1 0 6 回利付国債（20年）	270,000,000	302,130,000	
第 1 0 7 回利付国債（20年）	190,000,000	209,537,700	
第 1 0 8 回利付国債（20年）	520,000,000	558,558,000	
第 1 0 9 回利付国債（20年）	200,000,000	214,298,000	
第 1 1 0 回利付国債（20年）	620,000,000	682,719,200	
第 1 1 1 回利付国債（20年）	200,000,000	222,748,000	
第 1 1 2 回利付国債（20年）	500,000,000	549,725,000	
第 1 1 3 回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,316,304,000	
第 1 1 4 回利付国債（20年）	410,000,000	448,974,600	
第 1 1 5 回利付国債（20年）	620,000,000	688,423,200	
第 1 1 6 回利付国債（20年）	380,000,000	421,249,000	
第 1 1 7 回利付国債（20年）	700,000,000	765,177,000	
第 1 1 8 回利付国債（20年）	900,000,000	968,715,000	
第 1 1 9 回利付国債（20年）	380,000,000	397,252,000	
第 1 2 1 回利付国債（20年）	960,000,000	1,016,208,000	
第 1 2 2 回利付国債（20年）	160,000,000	166,875,200	
第 1 2 3 回利付国債（20年）	610,000,000	663,509,200	
第 1 2 4 回利付国債（20年）	280,000,000	300,140,400	
第 1 2 5 回利付国債（20年）	380,000,000	418,566,200	
第 1 2 6 回利付国債（20年）	300,000,000	320,886,000	
第 1 2 7 回利付国債（20年）	260,000,000	273,975,000	
第 1 2 8 回利付国債（20年）	470,000,000	494,101,600	

	第129回利付国債（20年）	570,000,000	590,143,800	
	第130回利付国債（20年）	420,000,000	433,734,000	
	第131回利付国債（20年）	450,000,000	457,510,500	
	第132回利付国債（20年）	330,000,000	334,824,600	
	第133回利付国債（20年）	650,000,000	669,994,000	
	第134回利付国債（20年）	370,000,000	380,648,600	
	第135回利付国債（20年）	180,000,000	182,253,600	
	第136回利付国債（20年）	530,000,000	527,657,400	
	第137回利付国債（20年）	290,000,000	293,013,100	
	第138回利付国債（20年）	810,000,000	791,418,600	
	第139回利付国債（20年）	400,000,000	397,332,000	
	第140回利付国債（20年）	730,000,000	736,000,600	
	第9回ポーランド共和国円貨債券	100,000,000	103,026,000	
	国債証券 小計	156,900,000,000	164,877,769,600	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	113,968,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,868,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	107,322,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	103,116,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,996,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,315,000	
	第23回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,911,000	
	第611回東京都公募公債	40,000,000	41,081,200	
	第618回東京都公募公債	100,000,000	102,733,000	
	第622回東京都公募公債	100,000,000	102,953,000	
	第633回東京都公募公債	129,000,000	136,791,600	
	第639回東京都公募公債	50,000,000	53,158,000	
	第649回東京都公募公債	102,000,000	109,314,420	
	第650回東京都公募公債	140,000,000	150,845,800	
	第674回東京都公募公債	100,000,000	106,484,000	
	第678回東京都公募公債	100,000,000	106,548,000	
	第683回東京都公募公債	100,000,000	105,934,000	
	第691回東京都公募公債	100,000,000	105,390,000	
	平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,403,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	117,623,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	108,159,000	
	平成21年度第1回北海道公募公債（5年）	100,000,000	101,400,000	
	平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	105,806,000	
	第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	112,328,000	
	第16回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,137,000	
	第124回神奈川県公募公債	10,000,000	10,152,400	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	106,657,000	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	107,156,000	
	第167回神奈川県公募公債	140,000,000	150,334,800	

第172回神奈川県公募公債	200,000,000	212,520,000	
第47回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,389,000	
第53回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	202,228,000	
第72回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,337,000	
第262回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,471,000	
第271回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,761,000	
第284回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,231,000	
第291回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,386,000	
第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,568,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,110,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	106,135,000	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	204,368,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	210,008,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	107,567,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,801,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	107,654,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,681,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,172,518	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	108,177,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	111,325,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,507,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,394,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,320,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,609,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,490,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,358,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	102,539,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	103,114,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,430,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	203,761,680	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	107,578,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,609,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	104,584,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	106,758,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	106,950,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	107,615,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,935,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,155,600	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	102,732,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,346,000	
第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	102,267,126	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,346,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,815,000	

第 2 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,638,000	
第 2 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,958,000	
第 3 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,483,000	
第 3 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,709,000	
第 3 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,424,000	
第 4 0 回共同発行市場公募地方債	120,000,000	128,464,800	
第 4 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,819,000	
第 4 6 回共同発行市場公募地方債	136,500,000	145,589,535	
第 5 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,760,000	
第 5 5 回共同発行市場公募地方債	158,400,000	170,847,072	
第 5 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,324,000	
第 6 7 回共同発行市場公募地方債	165,700,000	177,116,730	
第 7 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	216,196,000	
第 7 7 回共同発行市場公募地方債	110,000,000	118,248,900	
第 7 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,494,000	
第 8 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,980,000	
第 8 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,834,000	
第 8 9 回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,146,670	
第 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,398,000	
第 9 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,291,000	
第 9 5 回共同発行市場公募地方債	250,000,000	263,940,000	
第 9 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,622,000	
第 1 0 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,776,000	
平成 2 2 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	103,445,000	
平成 1 6 年度第 8 回大阪市公募公債	100,000,000	102,649,000	
平成 1 7 年度第 1 0 回大阪市公募公債	100,000,000	104,090,000	
平成 1 9 年度第 7 回大阪市公募公債	100,000,000	107,269,000	
平成 2 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	104,613,000	
第 5 回名古屋市公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	109,601,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	108,519,000	
第 1 2 回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,115,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都市公募公債	102,000,000	106,345,200	
平成 1 7 年度第 1 3 回神戸市公募公債	100,000,000	104,633,000	
第 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	112,503,000	
平成 1 7 年度第 1 回横浜市公募公債	100,000,000	102,705,000	
平成 2 1 年度第 1 回横浜市公募公債	200,000,000	215,358,000	
平成 2 1 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	107,729,000	
平成 1 7 年度第 6 回札幌市公募公債	100,000,000	104,162,000	
第 8 1 回川崎市公募公債	100,000,000	107,479,000	
第 8 2 回川崎市公募公債	100,000,000	107,346,000	
平成 2 3 年度第 1 回北九州市公募公債（ 5 年 ）	100,000,000	100,576,000	
平成 1 5 年度第 6 回福岡市公募公債	124,600,000	126,427,882	
平成 2 1 年度第 4 回福岡市公募公債（ 5 年 ）	100,000,000	101,021,000	

	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	104,704,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	103,175,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）	100,000,000	106,691,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	112,021,000	
	地方債証券 小計	13,204,990,000	13,969,224,933	
特殊債券	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,335,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	113,291,740	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,443,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	201,648,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,623,000	
	第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,238,000	
	第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,781,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,702,000	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,867,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,988,000	
	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	221,418,000	
	第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,929,000	
	第21回道路債券	100,000,000	112,825,000	
	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,223,000	
	第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,525,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,739,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,003,000	
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	231,613,050	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,096,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,249,000	
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,243,000	
	第42回道路債券	100,000,000	111,998,000	
	第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,330,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,173,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,632,000	
	第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,403,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,626,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,879,000	
	第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,824,300	
	第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	117,780,990	
	第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,479,000	
	第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	195,454,660	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,011,000	
	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	318,276,000	
	第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	138,000,000	146,397,300	
	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	106,074,000	

第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,753,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,426,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,712,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,356,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,939,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,850,000	
第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,941,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,508,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	101,988,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	116,408,820	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	105,049,800	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	49,378,080	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	148,062,200	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	187,034,540	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	217,289,380	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,300,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,667,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	339,729,000	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,128,100	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,924,000	
第6回地方公共団体金融機構債券（5年）	100,000,000	100,771,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	112,719,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	112,975,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,884,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,316,000	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,745,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,570,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,648,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,958,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	103,948,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,872,440	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,195,000	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,284,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	107,842,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	109,019,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,981,000	
第836回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,151,300	



第 8 3 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,981,000	
第 8 4 0 回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,305,630	
第 8 4 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,676,000	
第 8 5 5 回政府保証公営企業債券	140,000,000	144,649,400	
第 8 5 9 回政府保証公営企業債券	131,000,000	136,702,430	
第 8 6 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,314,000	
第 8 6 6 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,865,000	
第 8 6 7 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,246,000	
第 8 7 2 回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,710,000	
第 8 7 4 回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,614,000	
第 8 7 5 回政府保証公営企業債券	112,000,000	119,502,880	
第 8 7 6 回政府保証公営企業債券	122,000,000	131,426,940	
第 3 回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	109,692,940	
第 5 回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,827,200	
第 7 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,195,000	
第 8 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,529,000	
第 1 9 0 回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,691,000	
第 1 9 3 回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	106,648,880	
第 2 0 0 回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,328,000	
第 1 4 5 回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,083,000	
第 1 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,260,000	
第 5 回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	107,109,490	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	106,959,000	
第 1 8 2 回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,254,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,070,000	
第 3 2 2 回東京交通債券	10,000,000	10,893,100	
第 3 4 4 回東京交通債券	100,000,000	107,186,000	
第 3 4 6 回東京交通債券	20,000,000	20,386,200	
第 8 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,104,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,652,000	58,394,022	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	38,239,000	40,772,333	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	39,638,000	42,586,274	
第 3 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	110,255,000	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,886,000	59,119,357	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	44,510,000	47,271,845	
第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	33,209,000	34,983,356	
第 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,915,000	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	68,940,000	74,179,440	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	45,928,000	48,513,287	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	36,131,000	38,790,602	
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	52,160,000	55,415,827	
第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,685,000	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	35,943,000	38,544,913	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	57,331,000	60,959,478	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,425,000	61,518,019	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,822,000	61,823,098	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,332,000	72,330,727	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,858,000	74,368,705	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,208,000	72,411,915	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,124,000	78,552,167	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,787,000	80,312,999	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,582,000	83,980,497	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,370,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,067,000	84,431,452	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,367,000	57,349,573	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,289,000	89,722,322	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,119,000	56,949,423	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,677,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,716,000	56,975,979	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,644,000	96,617,519	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,855,000	52,620,743	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,678,000	97,053,081	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,313,000	98,048,406	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,917,000	58,028,171	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,208,000	195,426,431	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,150,000	98,111,832	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,795,000	57,339,014	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,140,000	98,588,685	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,106,000	98,606,678	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,586,000	99,247,910	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,143,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,302,000	198,997,113	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,312,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,528,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,448,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,249,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,593,000	
第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	182,057,320	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	111,496,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	153,981,030	
い第704号商工債	100,000,000	101,404,000	
い第705号商工債	100,000,000	101,567,000	
い第718号商工債	100,000,000	101,061,000	
い第721号商工債	150,000,000	151,366,500	
い第722号商工債	100,000,000	100,806,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,786,000	

	い第729号商工債	100,000,000	101,634,000	
	い第707号農林債	250,000,000	254,080,000	
	い第710号農林債	100,000,000	101,320,000	
	い第715号農林債	100,000,000	100,991,000	
	い第721号農林債	100,000,000	100,976,000	
	い第722号農林債	100,000,000	100,859,000	
	い第723号農林債	200,000,000	201,772,000	
	い第740号農林債	100,000,000	100,906,000	
	第233回信金中金債(5年)	100,000,000	101,676,000	
	第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,444,000	
	第243回信金中金債(5年)	100,000,000	101,141,000	
	第247回信金中金債(5年)	100,000,000	100,911,000	
	第258回信金中金債(5年)	100,000,000	101,158,000	
	第267回信金中金債(5年)	200,000,000	201,622,000	
	第139号商工債(3年)	100,000,000	100,196,000	
	第5回S B A B銀行A B ( p u b l ) 円貨債券	100,000,000	99,308,000	
	第10回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	100,822,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	104,428,000	
	第22回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	205,918,000	
	第28回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	102,081,000	
	第33回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	102,686,000	
	第43回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,052,000	
	第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,191,000	
	第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,732,000	
	特殊債券 小計	19,239,957,000	20,234,197,833	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・ブブリクト円貨社債	100,000,000	100,545,000	
	第9回J P モルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,209,000	
	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	103,330,000	
	第9回現代キャピタル・サービズ・インク円貨社債	100,000,000	99,986,000	
	第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,731,000	
	第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,542,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,455,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	203,500,000	
	第17回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	199,964,000	
	第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	99,924,000	
	第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,071,000	
	第13回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	101,106,000	
	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	106,772,000	
	第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,223,000	

第5回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,369,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	108,106,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,092,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,446,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,542,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	103,977,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,948,000	
第5回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	100,818,000	
第8回昭和シェル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,289,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,316,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,892,000	
第15回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,630,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,431,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	106,307,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	101,169,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,904,000	
第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	85,063,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	95,616,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	96,426,000	
第24回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	105,982,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,240,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,192,000	
第51回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,062,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,999,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,251,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	101,794,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,972,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,640,000	
第53回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	102,546,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,408,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,204,000	
第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,423,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,404,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,549,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,138,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,533,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,677,000	
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,957,000	
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	100,666,000	

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	114,256,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,983,000	
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	105,020,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	108,267,000	
第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,702,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,777,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,511,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,380,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,054,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	109,384,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,838,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,195,000	
第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,594,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,879,000	
第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,192,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,617,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,448,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,855,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,099,000	
第133回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,827,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,472,000	
第9回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,560,000	
第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,114,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,537,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,359,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,202,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,358,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,416,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,024,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,671,000	
第30回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,725,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,918,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,652,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,107,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,021,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,744,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,524,530	

第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,108,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,499,200	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,203,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,828,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,562,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,378,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,634,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,641,000	
第17回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,142,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,821,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,443,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	107,882,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,751,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,469,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	106,249,200	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,132,500	
第501回東京電力株式会社社債	30,000,000	29,853,600	
第505回東京電力株式会社社債	30,000,000	29,730,300	
第510回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,168,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	94,186,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,755,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,162,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,205,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	87,296,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,741,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	84,569,000	
第405回中部電力株式会社社債	50,000,000	54,424,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	54,886,500	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,849,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,395,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,345,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,466,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,862,000	
第248回北陸電力株式会社社債	100,000,000	111,894,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,578,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	109,849,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,704,000	
第257回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,116,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,864,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,203,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,018,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,581,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	34,165,720	

第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,928,000	
第286回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,055,000	
第4回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,961,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	210,794,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,622,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,179,000	
第38回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,088,000	
社債券 小計	13,880,000,000	14,213,741,550	
合計	203,224,947,000	213,294,933,916	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,658,838,914
株式	111,090,950,490
派生商品評価勘定	366,850
未収配当金	1,201,740,205
未収利息	3,061
前払金	14,946,000
差入委託証拠金	65,175,000
流動資産合計	114,032,020,520
資産合計	114,032,020,520
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,848,625
未払金	17,050
未払解約金	47,791,266
流動負債合計	100,656,941
負債合計	100,656,941
純資産の部	
元本等	
元本	196,416,477,753
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,485,114,174
元本等合計	113,931,363,579
純資産合計	113,931,363,579
負債純資産合計	114,032,020,520

## (2)注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。



2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 計算期間の期首元本額	197,377,667,906円
計算期間中の追加設定元本額	34,453,433,952円
計算期間中の一部解約元本額	35,414,624,105円
計算日の元本額	196,416,477,753円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	3,416,192,789円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,314,800,056円
SBI資産設計オープン（分配型）	33,052,017円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,890,096,530円
世界経済インデックスファンド	172,656,045円
マイセクション25	117,816,293円
マイセクション50	266,076,502円
マイセクション75	262,059,216円
日本株式インデックス・オープン	17,483,108,546円
DCマイセクション25	6,427,597,692円
DCマイセクション50	19,464,910,579円
DCマイセクション75	16,430,730,201円
DC日本株式インデックス・オープン	3,597,900,167円
DCマイセクションS25	1,831,757,284円
DCマイセクションS50	5,395,309,923円
DCマイセクションS75	3,171,605,507円
DC日本株式インデックス・オープンス	1,116,866,833円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	25,771,466円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	440,012,068円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	411,026,929円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	166,364,147円
DC世界経済インデックスファンド	55,784,206円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	586,506,217円

国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	391,990,201円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	902,890,000円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	392,866,609円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	3,202,800,226円
国内バランス30VA2（適格機関投資家専用）	16,939,367円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	45,488,011円
マイセクション50VA2（適格機関投資家専用）	4,344,825円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	2,065,976,291円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	7,730,092,869円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	19,763,052,086円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	6,083,624,336円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	13,284,808,051円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	2,557,225,208円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	13,569,156,008円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	6,333,690,392円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	4,804,224,263円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	3,117,966,545円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	5,983,961,330円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,855,922,260円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,586,812,656円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	204,437,901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）	7,986,089,144円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,741,706,855円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,712,411,106円
2. 計算日における受益権総数	196,416,477,753口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 82,485,114,174円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5800円 (5,800円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成24年11月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（株価変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p> <p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>
--------------------------	---

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	751,113,911
合計	751,113,911

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,887,976,775	-	2,835,495,000	52,481,775
合計		2,887,976,775	-	2,835,495,000	52,481,775

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (3) 附属明細表(平成24年11月12日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	53,000	175.00	9,275,000	
日本水産	134,600	148.00	19,920,800	
マルハニチロホールディングス	240,000	126.00	30,240,000	
サカタのタネ	18,500	1,025.00	18,962,500	
ホクト	12,700	1,628.00	20,675,600	
住石ホールディングス	36,700	70.00	2,569,000	
日鉄鉱業	32,000	326.00	10,432,000	
三井松島産業	82,000	123.00	10,086,000	
国際石油開発帝石	1,521	431,000.00	655,551,000	
日本海洋掘削	3,100	2,246.00	6,962,600	
関東天然瓦斯開発	13,000	422.00	5,486,000	
石油資源開発	17,800	2,755.00	49,039,000	
ショーボンドホールディングス	11,100	2,279.00	25,296,900	
ミライト・ホールディングス	35,800	580.00	20,764,000	
ダイセキ環境ソリューション	19	111,900.00	2,126,100	

間組	42,300	175.00	7,402,500
東急建設	53,680	139.00	7,461,520
コムシスホールディングス	60,700	926.00	56,208,200
ミサワホーム	16,400	1,136.00	18,630,400
高松コンストラクショングループ	9,600	1,150.00	11,040,000
東建コーポレーション	4,890	3,400.00	16,626,000
ヤマウラ	9,500	218.00	2,071,000
大成建設	633,000	208.00	131,664,000
大林組	376,000	326.00	122,576,000
清水建設	384,000	239.00	91,776,000
長谷工コーポレーション	782,000	50.00	39,100,000
松井建設	17,000	278.00	4,726,000
鹿島建設	551,000	206.00	113,506,000
鉄建建設	76,000	96.00	7,296,000
安藤建設	41,000	89.00	3,649,000
太平工業	26,000	252.00	6,552,000
西松建設	169,000	116.00	19,604,000
三井住友建設	174,300	50.00	8,715,000
前田建設工業	81,000	310.00	25,110,000
ナカノフドー建設	22,500	138.00	3,105,000
奥村組	112,000	238.00	26,656,000
大和小田急建設	6,000	147.00	882,000
東鉄工業	16,600	853.00	14,159,800
イチケン	25,000	141.00	3,525,000
戸田建設	146,000	190.00	27,740,000
熊谷組	91,000	70.00	6,370,000
青木あすなろ建設	7,500	459.00	3,442,500
北野建設	32,000	186.00	5,952,000
植木組	28,000	149.00	4,172,000
三井ホーム	17,000	389.00	6,613,000
矢作建設工業	18,800	312.00	5,865,600
ピーエス三菱	7,900	317.00	2,504,300
大東建託	47,500	7,710.00	366,225,000
新日本建設	22,200	173.00	3,840,600
N I P P O	29,000	858.00	24,882,000
東亜道路工業	29,000	206.00	5,974,000
前田道路	36,000	1,003.00	36,108,000
日本道路	40,000	277.00	11,080,000
東亜建設工業	114,000	108.00	12,312,000
五洋建設	153,000	176.00	26,928,000
大林道路	20,000	196.00	3,920,000
福田組	23,000	308.00	7,084,000
住友林業	86,400	677.00	58,492,800

日本基礎技術	17,700	277.00	4,902,900	
日成ビルド工業	51,000	153.00	7,803,000	
巴コーポレーション	17,000	240.00	4,080,000	
パナホーム	47,000	483.00	22,701,000	
大和ハウス工業	312,000	1,168.00	364,416,000	
ライト工業	30,700	328.00	10,069,600	
積水ハウス	376,000	769.00	289,144,000	
日特建設	15,500	256.00	3,968,000	
北陸電気工事	10,000	222.00	2,220,000	
ユアテック	20,000	239.00	4,780,000	
西部電気工業	12,000	333.00	3,996,000	
四電工	12,000	278.00	3,336,000	
中電工	18,100	702.00	12,706,200	
関電工	57,000	345.00	19,665,000	
きんでん	83,000	446.00	37,018,000	
東京エネシス	16,000	355.00	5,680,000	
トーエネック	19,000	429.00	8,151,000	
住友電設	10,200	705.00	7,191,000	
日本電設工業	23,000	667.00	15,341,000	
協和エクシオ	44,900	760.00	34,124,000	
新日本空調	11,900	418.00	4,974,200	
N D S	21,000	245.00	5,145,000	
九電工	22,000	338.00	7,436,000	
三機工業	29,000	362.00	10,498,000	
日揮	126,000	2,618.00	329,868,000	
中外炉工業	47,000	209.00	9,823,000	
ヤマト	12,000	267.00	3,204,000	
太平電業	17,000	473.00	8,041,000	
高砂熱学工業	36,000	582.00	20,952,000	
三晃金属工業	23,000	190.00	4,370,000	
朝日工業社	14,000	240.00	3,360,000	
大気社	18,000	1,601.00	28,818,000	
ダイダン	17,000	456.00	7,752,000	
日比谷総合設備	15,400	859.00	13,228,600	
東芝プラントシステム	21,000	1,041.00	21,861,000	
東洋エンジニアリング	71,000	315.00	22,365,000	
千代田化工建設	90,000	1,202.00	108,180,000	
新興プランテック	25,700	610.00	15,677,000	
日本製粉	77,000	333.00	25,641,000	
日清製粉グループ本社	113,500	969.00	109,981,500	
日東富士製粉	10,000	289.00	2,890,000	
昭和産業	51,000	262.00	13,362,000	
鳥越製粉	9,900	615.00	6,088,500	

協同飼料	43,000	90.00	3,870,000	
中部飼料	11,500	488.00	5,612,000	
日本配合飼料	34,000	96.00	3,264,000	
東洋精糖	22,000	83.00	1,826,000	
日本甜菜製糖	64,000	150.00	9,600,000	
三井製糖	49,000	244.00	11,956,000	
森永製菓	122,000	174.00	21,228,000	
中村屋	29,000	385.00	11,165,000	
江崎グリコ	45,000	862.00	38,790,000	
名糖産業	5,500	991.00	5,450,500	
不二家	72,000	194.00	13,968,000	
山崎製パン	92,000	939.00	86,388,000	
モロゾフ	19,000	276.00	5,244,000	
亀田製菓	7,000	1,884.00	13,188,000	
カルビー	11,300	7,260.00	82,038,000	
森永乳業	107,000	259.00	27,713,000	
ヤクルト本社	73,200	3,460.00	253,272,000	
明治ホールディングス	37,100	3,520.00	130,592,000	
雪印メグミルク	24,500	1,312.00	32,144,000	
プリマハム	72,000	143.00	10,296,000	
日本ハム	95,000	1,110.00	105,450,000	
伊藤ハム	69,000	330.00	22,770,000	
丸大食品	60,000	276.00	16,560,000	
米久	11,000	650.00	7,150,000	
S Foods	8,000	734.00	5,872,000	
サッポロホールディングス	208,000	211.00	43,888,000	
アサヒグループホールディングス	251,500	1,778.00	447,167,000	
キリンホールディングス	535,000	993.00	531,255,000	
宝ホールディングス	98,000	581.00	56,938,000	
オエノンホールディングス	33,000	197.00	6,501,000	
養命酒製造	9,000	699.00	6,291,000	
三国コカ・コーラボトリング	13,000	670.00	8,710,000	
コカ・コーラウエスト	42,400	1,200.00	50,880,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	15,600	993.00	15,490,800	
ダイトードリンコ	6,300	3,345.00	21,073,500	
伊藤園	34,800	1,446.00	50,320,800	
キーコーヒー	10,900	1,517.00	16,535,300	
ユニカフェ	3,400	398.00	1,353,200	
ジャパンフーズ	1,900	860.00	1,634,000	
日清オイリオグループ	54,000	288.00	15,552,000	
不二製油	30,400	1,126.00	34,230,400	
J - オイルミルズ	52,000	205.00	10,660,000	
キッコーマン	102,000	1,111.00	113,322,000	

味の素	330,000	1,140.00	376,200,000
キューピー	63,700	1,257.00	80,070,900
ハウス食品	44,400	1,268.00	56,299,200
カゴメ	44,900	1,599.00	71,795,100
焼津水産化学工業	5,900	721.00	4,253,900
アリアケジャパン	11,400	1,639.00	18,684,600
ニチレイ	140,000	414.00	57,960,000
東洋水産	58,000	2,120.00	122,960,000
日清食品ホールディングス	48,900	3,095.00	151,345,500
永谷園	12,000	791.00	9,492,000
フジッコ	13,000	1,010.00	13,130,000
ロック・フィールド	6,500	1,401.00	9,106,500
日本たばこ産業	554,700	2,214.00	1,228,105,800
ケンコーマヨネーズ	4,300	792.00	3,405,600
わらべや日洋	7,700	1,548.00	11,919,600
なとり	5,700	860.00	4,902,000
ミヨシ油脂	42,000	95.00	3,990,000
片倉工業	14,800	667.00	9,871,600
グンゼ	87,000	195.00	16,965,000
東洋紡	495,000	89.00	44,055,000
ユニチカ	320,000	36.00	11,520,000
富士紡ホールディングス	53,000	370.00	19,610,000
日清紡ホールディングス	75,000	478.00	35,850,000
倉敷紡績	120,000	124.00	14,880,000
シキボウ	71,000	101.00	7,171,000
日本毛織	37,000	542.00	20,054,000
トーア紡コーポレーション	53,000	54.00	2,862,000
ダイドーリミテッド	13,200	459.00	6,058,800
帝国繊維	12,000	599.00	7,188,000
帝人	444,000	161.00	71,484,000
東レ	905,000	447.00	404,535,000
サカイオーベックス	32,000	105.00	3,360,000
住江織物	29,000	148.00	4,292,000
日本フェルト	6,500	393.00	2,554,500
イチカワ	9,000	141.00	1,269,000
日本バイリーン	16,000	342.00	5,472,000
芦森工業	33,000	101.00	3,333,000
アツギ	98,000	116.00	11,368,000
ダイニック	22,000	145.00	3,190,000
セーレン	31,500	469.00	14,773,500
東海染工	16,000	82.00	1,312,000
小松精練	20,000	358.00	7,160,000
ワコールホールディングス	70,000	858.00	60,060,000



ホギメディカル	7,400	4,010.00	29,674,000	
レナウン	25,300	99.00	2,504,700	
クラウドディア	1,700	1,010.00	1,717,000	
T S Iホールディングス	60,600	468.00	28,360,800	
三陽商会	63,000	228.00	14,364,000	
オンワードホールディングス	78,000	561.00	43,758,000	
ルック	21,000	432.00	9,072,000	
ゴールドウイン	28,000	517.00	14,476,000	
デサント	30,000	460.00	13,800,000	
ヤマトインターナショナル	7,100	347.00	2,463,700	
特種東海製紙	68,000	202.00	13,736,000	
王子ホールディングス	517,000	227.00	117,359,000	
三菱製紙	166,000	68.00	11,288,000	
北越紀州製紙	72,500	420.00	30,450,000	
中越パルプ工業	44,000	129.00	5,676,000	
巴川製紙所	18,000	139.00	2,502,000	
大王製紙	49,000	433.00	21,217,000	
日本製紙グループ本社	56,400	922.00	52,000,800	
レンゴー	94,000	381.00	35,814,000	
トモク	37,000	220.00	8,140,000	
ザ・バック	8,300	1,371.00	11,379,300	
クラレ	199,100	923.00	183,769,300	
旭化成	729,000	439.00	320,031,000	
共和レザー	6,800	240.00	1,632,000	
コープケミカル	17,000	88.00	1,496,000	
昭和電工	727,000	113.00	82,151,000	
住友化学	804,000	206.00	165,624,000	
日本化成	22,000	100.00	2,200,000	
住友精化	22,000	272.00	5,984,000	
日産化学工業	83,000	873.00	72,459,000	
ラサ工業	41,000	68.00	2,788,000	
クレハ	82,000	299.00	24,518,000	
テイカ	20,000	219.00	4,380,000	
石原産業	210,000	55.00	11,550,000	
片倉チッカリン	7,000	184.00	1,288,000	
日本曹達	70,000	345.00	24,150,000	
東ソー	313,000	153.00	47,889,000	
トクヤマ	170,000	135.00	22,950,000	
セントラル硝子	104,000	233.00	24,232,000	
東亜合成	137,000	330.00	45,210,000	
ダイソー	47,000	209.00	9,823,000	
関東電化工業	28,000	123.00	3,444,000	
電気化学工業	234,000	250.00	58,500,000	

信越化学工業	209,700	4,465.00	936,310,500	
日本カーバイド工業	34,000	195.00	6,630,000	
堺化学工業	44,000	201.00	8,844,000	
エア・ウォーター	96,000	992.00	95,232,000	
大陽日酸	154,000	459.00	70,686,000	
日本化学工業	43,000	99.00	4,257,000	
日本パーカライズング	28,000	1,130.00	31,640,000	
高圧ガス工業	17,000	401.00	6,817,000	
チタン工業	14,000	207.00	2,898,000	
四国化成工業	17,000	418.00	7,106,000	
戸田工業	17,000	227.00	3,859,000	
ステラ ケミファ	5,100	1,400.00	7,140,000	
保土谷化学工業	26,000	140.00	3,640,000	
日本触媒	85,000	758.00	64,430,000	
大日精化工業	42,000	313.00	13,146,000	
カネカ	146,000	377.00	55,042,000	
三菱瓦斯化学	184,000	440.00	80,960,000	
三井化学	496,000	158.00	78,368,000	
J S R	115,300	1,374.00	158,422,200	
東京応化工業	22,600	1,516.00	34,261,600	
大阪有機化学工業	7,800	335.00	2,613,000	
三菱ケミカルホールディングス	731,000	312.00	228,072,000	
日本合成化学工業	24,000	602.00	14,448,000	
ダイセル	139,000	462.00	64,218,000	
住友ベークライト	91,000	293.00	26,663,000	
積水化学工業	240,000	616.00	147,840,000	
日本ゼオン	101,000	580.00	58,580,000	
アイカ工業	32,800	1,389.00	45,559,200	
宇部興産	560,000	178.00	99,680,000	
積水樹脂	16,000	771.00	12,336,000	
タキロン	27,000	267.00	7,209,000	
旭有機材工業	41,000	182.00	7,462,000	
日立化成工業	50,600	1,043.00	52,775,800	
ニチバン	12,000	246.00	2,952,000	
リケンテクノス	19,000	199.00	3,781,000	
大倉工業	28,000	219.00	6,132,000	
積水化成品工業	30,000	173.00	5,190,000	
群栄化学工業	31,000	191.00	5,921,000	
タイガースポリマー	5,800	265.00	1,537,000	
日本カーリット	9,300	385.00	3,580,500	
日本化薬	82,000	882.00	72,324,000	
日本精化	9,700	523.00	5,073,100	
A D E K A	50,300	628.00	31,588,400	

日油	91,000	361.00	32,851,000
ハリマ化成グループ	9,900	350.00	3,465,000
花王	310,100	2,168.00	672,296,800
第一工業製薬	21,000	190.00	3,990,000
三洋化成工業	37,000	412.00	15,244,000
大日本塗料	67,000	84.00	5,628,000
日本ペイント	101,000	646.00	65,246,000
関西ペイント	132,000	815.00	107,580,000
中国塗料	36,000	410.00	14,760,000
日本特殊塗料	9,000	316.00	2,844,000
藤倉化成	13,600	312.00	4,243,200
太陽ホールディングス	9,500	2,181.00	20,719,500
D I C	414,000	133.00	55,062,000
サカタインクス	24,000	361.00	8,664,000
東洋インキ S C ホールディングス	105,000	285.00	29,925,000
富士フイルムホールディングス	249,800	1,274.00	318,245,200
資生堂	208,000	1,075.00	223,600,000
ライオン	135,000	416.00	56,160,000
高砂香料工業	38,000	380.00	14,440,000
マンダム	12,600	2,103.00	26,497,800
ミルボン	5,700	2,548.00	14,523,600
ファンケル	29,400	857.00	25,195,800
コーセー	21,000	1,716.00	36,036,000
ドクターシーラボ	79	260,800.00	20,603,200
ポーラ・オルビスホールディングス	13,900	2,398.00	33,332,200
ノエビアホールディングス	6,800	1,126.00	7,656,800
エステー	7,200	881.00	6,343,200
コニシ	8,500	1,188.00	10,098,000
長谷川香料	14,800	980.00	14,504,000
星光 P M C	4,800	286.00	1,372,800
小林製薬	17,700	4,120.00	72,924,000
荒川化学工業	9,100	597.00	5,432,700
メック	8,400	214.00	1,797,600
日本高純度化学	31	179,300.00	5,558,300
J C U	1,700	2,750.00	4,675,000
アース製薬	8,400	2,939.00	24,687,600
イハラケミカル工業	20,000	366.00	7,320,000
北興化学工業	11,000	216.00	2,376,000
大成ラミック	3,300	2,281.00	7,527,300
クミアイ化学工業	24,000	348.00	8,352,000
日本農薬	27,000	352.00	9,504,000
アキレス	95,000	106.00	10,070,000
有沢製作所	18,300	251.00	4,593,300

日東電工	96,400	3,770.00	363,428,000
レック	3,600	957.00	3,445,200
きもと	10,400	527.00	5,480,800
藤森工業	9,000	1,928.00	17,352,000
前澤化成工業	8,200	800.00	6,560,000
J S P	7,600	1,000.00	7,600,000
エフピコ	5,800	5,650.00	32,770,000
天馬	9,300	736.00	6,844,800
信越ポリマー	23,000	251.00	5,773,000
東リ	30,000	158.00	4,740,000
ニフコ	26,100	1,679.00	43,821,900
日本バルカー工業	49,000	205.00	10,045,000
ユニ・チャーム	64,600	4,140.00	267,444,000
協和発酵キリン	140,000	809.00	113,260,000
武田薬品工業	438,000	3,650.00	1,598,700,000
アステラス製薬	259,600	4,020.00	1,043,592,000
大日本住友製薬	82,800	910.00	75,348,000
塩野義製薬	170,400	1,326.00	225,950,400
田辺三菱製薬	97,300	1,097.00	106,738,100
わかもと製薬	13,000	210.00	2,730,000
あすか製薬	14,000	407.00	5,698,000
日本新薬	24,000	963.00	23,112,000
中外製薬	135,800	1,593.00	216,329,400
科研製薬	46,000	1,253.00	57,638,000
エーザイ	143,900	3,365.00	484,223,500
ロート製薬	49,000	1,062.00	52,038,000
小野薬品工業	57,200	4,455.00	254,826,000
久光製薬	36,300	3,985.00	144,655,500
有機合成薬品工業	8,000	218.00	1,744,000
持田製薬	44,000	1,069.00	47,036,000
参天製薬	42,300	3,320.00	140,436,000
扶桑薬品工業	39,000	279.00	10,881,000
日本ケミファ	16,000	531.00	8,496,000
ツムラ	31,900	2,726.00	86,959,400
日医工	16,900	1,640.00	27,716,000
キッセイ薬品工業	21,700	1,425.00	30,922,500
生化学工業	22,300	880.00	19,624,000
栄研化学	8,300	1,068.00	8,864,400
日水製薬	4,700	812.00	3,816,400
鳥居薬品	7,000	1,860.00	13,020,000
東和薬品	6,000	5,010.00	30,060,000
富士製薬工業	2,900	1,250.00	3,625,000
沢井製薬	7,700	9,400.00	72,380,000

ゼリア新薬工業	17,000	1,242.00	21,114,000	
第一三共	368,700	1,192.00	439,490,400	
キョーリン製薬ホールディングス	31,200	1,765.00	55,068,000	
大幸薬品	5,400	728.00	3,931,200	
ダイト	3,300	1,440.00	4,752,000	
大塚ホールディングス	232,100	2,422.00	562,146,200	
大正製薬ホールディングス	28,100	5,940.00	166,914,000	
日本コークス工業	94,500	94.00	8,883,000	
昭和シェル石油	104,500	468.00	48,906,000	
コスモ石油	323,000	147.00	47,481,000	
ニチレキ	14,000	383.00	5,362,000	
東燃ゼネラル石油	176,000	703.00	123,728,000	
ユシロ化学工業	6,300	752.00	4,737,600	
ビーピー・カストロール	4,800	349.00	1,675,200	
AOCホールディングス	27,100	270.00	7,317,000	
MORESCO	2,200	691.00	1,520,200	
出光興産	13,900	6,630.00	92,157,000	
JXホールディングス	1,297,800	408.00	529,502,400	
横浜ゴム	131,000	518.00	67,858,000	
東洋ゴム工業	97,000	198.00	19,206,000	
ブリヂストン	366,500	1,770.00	648,705,000	
住友ゴム工業	91,200	838.00	76,425,600	
藤倉ゴム工業	6,500	251.00	1,631,500	
オカモト	42,000	294.00	12,348,000	
フコク	4,900	676.00	3,312,400	
ニッタ	11,500	1,248.00	14,352,000	
東海ゴム工業	21,600	721.00	15,573,600	
三ツ星ベルト	30,000	446.00	13,380,000	
バンドー化学	40,000	243.00	9,720,000	
日東紡績	86,000	252.00	21,672,000	
旭硝子	576,000	553.00	318,528,000	
日本板硝子	533,000	68.00	36,244,000	
石塚硝子	15,000	129.00	1,935,000	
日本山村硝子	48,000	163.00	7,824,000	
日本電気硝子	207,000	414.00	85,698,000	
オハラ	4,500	602.00	2,709,000	
住友大阪セメント	207,000	257.00	53,199,000	
太平洋セメント	646,000	170.00	109,820,000	
デイ・シイ	14,500	226.00	3,277,000	
日本ヒューム	11,000	409.00	4,499,000	
日本コンクリート工業	20,000	237.00	4,740,000	
東海カーボン	101,000	255.00	25,755,000	
日本カーボン	62,000	149.00	9,238,000	

東洋炭素	5,800	1,465.00	8,497,000	
ノリタケカンパニーリミテド	62,000	185.00	11,470,000	
TOTO	180,000	537.00	96,660,000	
日本碍子	152,000	808.00	122,816,000	
日本特殊陶業	101,000	875.00	88,375,000	
MARUWA	2,600	2,127.00	5,530,200	
品川リフラクトリーズ	32,000	159.00	5,088,000	
黒崎播磨	26,000	177.00	4,602,000	
東京窯業	15,000	148.00	2,220,000	
ニッカトー	4,000	404.00	1,616,000	
フジインコーポレーテッド	10,600	1,695.00	17,967,000	
ニチアス	52,000	376.00	19,552,000	
ニチハ	13,200	885.00	11,682,000	
新日鐵住金	4,942,000	167.00	825,314,000	
神戸製鋼所	1,624,000	66.00	107,184,000	
合同製鐵	66,000	114.00	7,524,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	298,500	1,071.00	319,693,500	
日新製鋼ホールディングス	49,600	487.00	24,155,200	
東京製鐵	65,700	249.00	16,359,300	
共英製鋼	10,900	1,132.00	12,338,800	
大和工業	24,200	2,125.00	51,425,000	
東京鐵鋼	23,000	262.00	6,026,000	
大阪製鐵	5,900	1,277.00	7,534,300	
淀川製鋼所	83,000	245.00	20,335,000	
東洋鋼鈹	25,000	198.00	4,950,000	
住友鋼管	8,000	513.00	4,104,000	
丸一鋼管	39,100	1,677.00	65,570,700	
モリ工業	18,000	211.00	3,798,000	
大同特殊鋼	181,000	301.00	54,481,000	
日本高周波鋼業	46,000	72.00	3,312,000	
日本冶金工業	93,500	67.00	6,264,500	
山陽特殊製鋼	58,000	208.00	12,064,000	
愛知製鋼	62,000	274.00	16,988,000	
日立金属	83,000	680.00	56,440,000	
日本金属	30,000	100.00	3,000,000	
大平洋金属	75,000	248.00	18,600,000	
日本電工	46,000	175.00	8,050,000	
栗本鐵工所	51,000	265.00	13,515,000	
日本鑄鉄管	13,000	175.00	2,275,000	
三菱製鋼	73,000	136.00	9,928,000	
日亜鋼業	16,000	206.00	3,296,000	
日本精線	8,000	278.00	2,224,000	
シンニッタン	9,100	316.00	2,875,600	

新家工業	25,000	102.00	2,550,000	
大紀アルミニウム工業所	20,000	191.00	3,820,000	
日本軽金属ホールディングス	245,700	70.00	17,199,000	
三井金属鉱業	298,000	160.00	47,680,000	
東邦亜鉛	66,000	260.00	17,160,000	
三菱マテリアル	684,000	215.00	147,060,000	
住友金属鉱山	302,000	1,041.00	314,382,000	
DOWAホールディングス	129,000	496.00	63,984,000	
古河機械金属	196,000	66.00	12,936,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,500	1,454.00	16,721,000	
東邦チタニウム	19,900	650.00	12,935,000	
住友軽金属工業	285,000	65.00	18,525,000	
古河スカイ	40,000	188.00	7,520,000	
古河電気工業	368,000	143.00	52,624,000	
住友電気工業	412,900	817.00	337,339,300	
フジクラ	188,000	218.00	40,984,000	
昭和電線ホールディングス	150,000	55.00	8,250,000	
タツタ電線	22,000	799.00	17,578,000	
日立電線	92,000	107.00	9,844,000	
沖電線	13,000	121.00	1,573,000	
カナレ電気	1,700	1,283.00	2,181,100	
平河ヒューテック	2,900	626.00	1,815,400	
リョービ	66,000	165.00	10,890,000	
アサヒホールディングス	17,600	1,328.00	23,372,800	
稲葉製作所	5,200	968.00	5,033,600	
三協・立山ホールディングス	162,000	172.00	27,864,000	
トーカロ	7,000	1,259.00	8,813,000	
アルファC O	4,600	851.00	3,914,600	
SUMCO	73,000	518.00	37,814,000	
川田テクノロジーズ	3,300	1,019.00	3,362,700	
東洋製罐	83,000	826.00	68,558,000	
ホッカンホールディングス	31,000	222.00	6,882,000	
コロナ	5,400	974.00	5,259,600	
横河ブリッジホールディングス	23,000	557.00	12,811,000	
駒井ハルテック	27,000	187.00	5,049,000	
高田機工	13,000	150.00	1,950,000	
三和ホールディングス	108,000	330.00	35,640,000	
文化シャッター	31,000	339.00	10,509,000	
東洋シャッター	4,500	418.00	1,881,000	
LIXILグループ	162,800	1,648.00	268,294,400	
日本ファイルコン	9,500	382.00	3,629,000	
ノーリツ	22,900	1,311.00	30,021,900	
長府製作所	11,200	1,716.00	19,219,200	

リンナイ	18,800	5,530.00	103,964,000	
ダイニチ工業	6,600	798.00	5,266,800	
日東精工	19,000	200.00	3,800,000	
三洋工業	17,000	142.00	2,414,000	
岡部	23,700	494.00	11,707,800	
東プレ	23,000	656.00	15,088,000	
高周波熱錬	16,600	425.00	7,055,000	
東京製綱	79,000	88.00	6,952,000	
パイオラックス	5,200	1,650.00	8,580,000	
日本発條	85,200	628.00	53,505,600	
中央発條	16,000	272.00	4,352,000	
三益半導体工業	10,400	615.00	6,396,000	
アタカ大機	8,000	303.00	2,424,000	
日本製鋼所	180,000	463.00	83,340,000	
三浦工業	17,400	1,891.00	32,903,400	
タクマ	40,000	411.00	16,440,000	
ツガミ	31,000	499.00	15,469,000	
オークマ	76,000	455.00	34,580,000	
東芝機械	58,000	341.00	19,778,000	
アマダ	179,000	396.00	70,884,000	
アイダエンジニアリング	27,500	495.00	13,612,500	
牧野フライス製作所	55,000	380.00	20,900,000	
オーエスジー	48,100	975.00	46,897,500	
ダイジェット工業	15,000	135.00	2,025,000	
旭ダイヤモンド工業	28,800	667.00	19,209,600	
森精機製作所	61,800	481.00	29,725,800	
ディスコ	13,000	3,895.00	50,635,000	
日東工器	6,800	1,754.00	11,927,200	
豊和工業	69,000	72.00	4,968,000	
大阪機工	45,000	92.00	4,140,000	
東洋機械金属	10,100	177.00	1,787,700	
津田駒工業	28,000	96.00	2,688,000	
島精機製作所	15,300	1,042.00	15,942,600	
日阪製作所	15,000	625.00	9,375,000	
やまびこ	5,100	990.00	5,049,000	
ペガサスミシン製造	15,600	166.00	2,589,600	
ナプテスコ	57,800	1,565.00	90,457,000	
三井海洋開発	9,700	1,540.00	14,938,000	
レオン自動機	11,000	170.00	1,870,000	
S M C	34,900	12,370.00	431,713,000	
新川	9,900	335.00	3,316,500	
ホソカワミクロン	20,000	462.00	9,240,000	
ユニオンツール	6,400	1,225.00	7,840,000	



オイレス工業	12,200	1,550.00	18,910,000	
サトーホールディングス	12,200	1,191.00	14,530,200	
日本エアータック	4,100	337.00	1,381,700	
日精樹脂工業	9,400	310.00	2,914,000	
ワイエイシイ	5,900	413.00	2,436,700	
小松製作所	545,400	1,698.00	926,089,200	
住友重機械工業	320,000	299.00	95,680,000	
日立建機	59,700	1,321.00	78,863,700	
日工	16,000	292.00	4,672,000	
巴工業	4,400	1,332.00	5,860,800	
井関農機	112,000	189.00	21,168,000	
TOWA	12,200	429.00	5,233,800	
丸山製作所	26,000	153.00	3,978,000	
北川鉄工所	51,000	126.00	6,426,000	
クボタ	624,000	795.00	496,080,000	
荏原実業	2,800	1,207.00	3,379,600	
三菱化工機	36,000	126.00	4,536,000	
月島機械	19,000	667.00	12,673,000	
帝国電機製作所	3,900	1,131.00	4,410,900	
新東工業	23,700	520.00	12,324,000	
澁谷工業	7,400	827.00	6,119,800	
アイチ コーポレーション	19,400	307.00	5,955,800	
小森コーポレーション	28,600	490.00	14,014,000	
鶴見製作所	9,000	590.00	5,310,000	
住友精密工業	20,000	309.00	6,180,000	
酒井重工業	23,000	235.00	5,405,000	
荏原製作所	220,000	302.00	66,440,000	
石井鐵工所	18,000	131.00	2,358,000	
西島製作所	14,000	536.00	7,504,000	
ダイキン工業	152,400	2,192.00	334,060,800	
オルガノ	20,000	480.00	9,600,000	
トーヨーカネツ	63,000	173.00	10,899,000	
栗田工業	64,500	1,751.00	112,939,500	
椿本チエイン	60,000	389.00	23,340,000	
大同工業	25,000	123.00	3,075,000	
日本コンベヤ	36,000	71.00	2,556,000	
木村化工機	11,600	242.00	2,807,200	
アネスト岩田	18,000	303.00	5,454,000	
ダイフク	51,500	394.00	20,291,000	
加藤製作所	28,000	202.00	5,656,000	
油研工業	23,000	129.00	2,967,000	
タダノ	54,000	601.00	32,454,000	
フジテック	33,000	501.00	16,533,000	

CKD	31,400	430.00	13,502,000	
キトー	74	63,500.00	4,699,000	
平和	24,400	1,284.00	31,329,600	
理想科学工業	8,000	1,432.00	11,456,000	
SANKYO	33,800	3,350.00	113,230,000	
日本金銭機械	10,600	636.00	6,741,600	
マースエンジニアリング	6,300	1,881.00	11,850,300	
福島工業	3,100	1,552.00	4,811,200	
オーイズミ	6,100	305.00	1,860,500	
ダイコク電機	4,900	1,911.00	9,363,900	
アマノ	33,800	650.00	21,970,000	
サンデン	66,000	255.00	16,830,000	
マックス	18,000	910.00	16,380,000	
グローリー	33,300	1,726.00	57,475,800	
大和冷機工業	18,000	344.00	6,192,000	
セガサミーホールディングス	120,000	1,343.00	161,160,000	
日本ピストンリング	41,000	126.00	5,166,000	
リケン	41,000	263.00	10,783,000	
TPR	13,000	826.00	10,738,000	
ホシザキ電機	24,400	2,171.00	52,972,400	
大豊工業	8,700	712.00	6,194,400	
日本精工	249,000	431.00	107,319,000	
NTN	246,000	136.00	33,456,000	
ジェイテクト	119,000	574.00	68,306,000	
不二越	107,000	237.00	25,359,000	
日本トムソン	41,000	254.00	10,414,000	
THK	74,300	1,245.00	92,503,500	
ユーシン精機	5,600	1,389.00	7,778,400	
前澤給装工業	4,200	1,031.00	4,330,200	
イーグル工業	16,000	534.00	8,544,000	
前澤工業	12,600	173.00	2,179,800	
日本ピラー工業	12,000	463.00	5,556,000	
キッツ	46,100	345.00	15,904,500	
日立工機	29,900	563.00	16,833,700	
マキタ	68,000	3,090.00	210,120,000	
日立造船	442,000	97.00	42,874,000	
三菱重工業	1,872,000	321.00	600,912,000	
IHI	764,000	161.00	123,004,000	
イビデン	68,000	960.00	65,280,000	
コニカミノルタホールディングス	295,000	510.00	150,450,000	
ブラザー工業	144,400	692.00	99,924,800	
ミネベア	152,000	280.00	42,560,000	
日立製作所	2,613,000	407.00	1,063,491,000	

東芝	2,204,000	272.00	599,488,000	
三菱電機	1,117,000	562.00	627,754,000	
富士電機	337,000	155.00	52,235,000	
東洋電機製造	22,000	208.00	4,576,000	
安川電機	123,000	571.00	70,233,000	
シンフォニアテクノロジー	67,000	135.00	9,045,000	
明電舎	111,000	248.00	27,528,000	
オリジン電気	16,000	335.00	5,360,000	
デンヨー	11,000	808.00	8,888,000	
東芝テック	70,000	385.00	26,950,000	
芝浦メカトロニクス	20,000	133.00	2,660,000	
マブチモーター	16,600	3,300.00	54,780,000	
日本電産	60,400	5,080.00	306,832,000	
東光高岳ホールディングス	5,700	1,130.00	6,441,000	
ダイヘン	61,000	201.00	12,261,000	
ヤーマン	900	1,150.00	1,035,000	
JVCケンウッド	67,600	252.00	17,035,200	
第一精工	3,500	1,186.00	4,151,000	
日新電機	22,000	467.00	10,274,000	
大崎電気工業	15,000	402.00	6,030,000	
オムロン	124,400	1,659.00	206,379,600	
日東工業	16,400	1,142.00	18,728,800	
I D E C	14,600	635.00	9,271,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	215,000	295.00	63,425,000	
サクサホールディングス	28,000	134.00	3,752,000	
メルコホールディングス	7,000	1,477.00	10,339,000	
テクノメディカ	8	455,000.00	3,640,000	
日本電気	1,445,000	139.00	200,855,000	
富士通	1,077,000	272.00	292,944,000	
沖電気工業	406,000	75.00	30,450,000	
岩崎通信機	49,000	56.00	2,744,000	
電気興業	29,000	370.00	10,730,000	
サンケン電気	57,000	252.00	14,364,000	
ナカヨ通信機	11,000	237.00	2,607,000	
アイホン	6,500	1,318.00	8,567,000	
ルネサスエレクトロニクス	28,900	273.00	7,889,700	
セイコーエプソン	76,300	439.00	33,495,700	
ワコム	205	229,700.00	47,088,500	
アルバック	22,200	437.00	9,701,400	
アクセル	5,600	1,880.00	10,528,000	
ナナオ	9,500	1,202.00	11,419,000	
日本信号	28,200	433.00	12,210,600	
京三製作所	24,000	256.00	6,144,000	

能美防災	15,000	499.00	7,485,000	
ホーチキ	10,000	396.00	3,960,000	
日本無線	24,000	194.00	4,656,000	
パナソニック	1,275,800	390.00	497,562,000	
シャープ	578,000	154.00	89,012,000	
アンリツ	60,000	1,025.00	61,500,000	
富士通ゼネラル	27,000	708.00	19,116,000	
日立国際電気	26,000	518.00	13,468,000	
ソニー	696,700	856.00	596,375,200	
T D K	62,900	2,768.00	174,107,200	
帝国通信工業	27,000	125.00	3,375,000	
ミツミ電機	42,600	367.00	15,634,200	
タムラ製作所	43,000	167.00	7,181,000	
アルプス電気	81,900	420.00	34,398,000	
パイオニア	135,800	163.00	22,135,400	
日本電波工業	9,400	847.00	7,961,800	
日本トリム	1,450	2,100.00	3,045,000	
ローランド ディー . ジー .	5,000	837.00	4,185,000	
フォスター電機	11,400	1,373.00	15,652,200	
クラリオン	59,000	116.00	6,844,000	
S M K	33,000	191.00	6,303,000	
ヨコオ	8,800	365.00	3,212,000	
東光	56,000	184.00	10,304,000	
ホシデン	30,400	442.00	13,436,800	
ヒロセ電機	19,400	8,310.00	161,214,000	
日本航空電子工業	26,000	619.00	16,094,000	
T O A	12,000	561.00	6,732,000	
ユニデン	33,000	166.00	5,478,000	
アルパイン	21,800	632.00	13,777,600	
スミダコーポレーション	7,000	378.00	2,646,000	
アイコム	6,200	1,643.00	10,186,600	
リオン	2,500	536.00	1,340,000	
船井電機	11,300	910.00	10,283,000	
横河電機	111,800	784.00	87,651,200	
新電元工業	36,000	220.00	7,920,000	
アズビル	31,300	1,561.00	48,859,300	
日本光電工業	22,200	2,751.00	61,072,200	
チノー	20,000	195.00	3,900,000	
共和電業	13,000	238.00	3,094,000	
日本電子材料	4,900	353.00	1,729,700	
堀場製作所	22,100	2,259.00	49,923,900	
アドバンテスト	76,100	944.00	71,838,400	
小野測器	13,000	349.00	4,537,000	

エスペック	11,600	621.00	7,203,600	
パナソニック デバイスSUNX	9,900	301.00	2,979,900	
キーエンス	27,400	20,750.00	568,550,000	
日置電機	5,900	1,298.00	7,658,200	
シスメックス	39,300	3,480.00	136,764,000	
メガチップス	9,200	1,703.00	15,667,600	
OBARA GROUP	8,000	839.00	6,712,000	
日本電産コパル電子	11,600	369.00	4,280,400	
ミヤチテクノス	5,100	440.00	2,244,000	
東京電波	3,400	416.00	1,414,400	
澤藤電機	7,000	182.00	1,274,000	
コーセル	16,300	1,014.00	16,528,200	
日立メディコ	8,000	939.00	7,512,000	
新日本無線	8,000	146.00	1,168,000	
オブテックス	7,100	855.00	6,070,500	
千代田インテグレ	5,400	808.00	4,363,200	
スタンレー電気	86,900	1,065.00	92,548,500	
岩崎電気	41,000	106.00	4,346,000	
ウシオ電機	67,800	825.00	55,935,000	
岡谷電機産業	6,100	307.00	1,872,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	9,800	141.00	1,381,800	
日本セラミック	7,300	1,028.00	7,504,400	
日本デジタル研究所	9,400	806.00	7,576,400	
古河電池	8,000	352.00	2,816,000	
双信電機	5,600	282.00	1,579,200	
山一電機	12,100	128.00	1,548,800	
図研	6,500	484.00	3,146,000	
日本電子	41,000	161.00	6,601,000	
カシオ計算機	106,500	549.00	58,468,500	
ファナック	116,300	12,600.00	1,465,380,000	
日本シイエムケイ	24,200	254.00	6,146,800	
エンプラス	4,900	3,050.00	14,945,000	
ローム	59,000	2,203.00	129,977,000	
浜松ホトニクス	43,600	2,637.00	114,973,200	
三井ハイテック	16,300	557.00	9,079,100	
新光電気工業	37,600	463.00	17,408,800	
京セラ	92,900	7,150.00	664,235,000	
太陽誘電	54,400	605.00	32,912,000	
村田製作所	117,200	3,935.00	461,182,000	
ユーシン	15,700	332.00	5,212,400	
双葉電子工業	20,700	836.00	17,305,200	
北陸電気工業	45,000	82.00	3,690,000	
ニチコン	35,200	479.00	16,860,800	

日本ケミコン	65,000	106.00	6,890,000	
K O A	14,100	555.00	7,825,500	
市光工業	27,000	108.00	2,916,000	
小糸製作所	56,000	998.00	55,888,000	
ミツバ	21,000	477.00	10,017,000	
スター精密	19,600	731.00	14,327,600	
大日本スクリーン製造	115,000	398.00	45,770,000	
キャノン電子	10,300	1,708.00	17,592,400	
キャノン	693,600	2,453.00	1,701,400,800	
リコー	336,000	650.00	218,400,000	
M U T O Hホールディングス	15,000	164.00	2,460,000	
東京エレクトロン	93,900	3,380.00	317,382,000	
トヨタ紡織	39,000	742.00	28,938,000	
鬼怒川ゴム工業	21,000	427.00	8,967,000	
ユニプレス	19,600	1,672.00	32,771,200	
豊田自動織機	101,700	2,224.00	226,180,800	
モリタホールディングス	20,000	689.00	13,780,000	
三櫻工業	14,200	450.00	6,390,000	
デンソー	275,900	2,338.00	645,054,200	
東海理化電機製作所	26,100	955.00	24,925,500	
三井造船	432,000	95.00	41,040,000	
佐世保重工業	73,000	71.00	5,183,000	
川崎重工業	869,000	168.00	145,992,000	
日本車輛製造	41,000	312.00	12,792,000	
日本輸送機	15,000	210.00	3,150,000	
近畿車輛	19,000	259.00	4,921,000	
日産自動車	1,410,600	688.00	970,492,800	
いすゞ自動車	647,000	439.00	284,033,000	
トヨタ自動車	1,434,500	3,085.00	4,425,432,500	
日野自動車	139,000	617.00	85,763,000	
三菱自動車工業	2,575,000	68.00	175,100,000	
エフテック	3,900	1,030.00	4,017,000	
武蔵精密工業	11,900	1,521.00	18,099,900	
日産車体	38,000	865.00	32,870,000	
新明和工業	45,000	445.00	20,025,000	
極東開発工業	20,700	692.00	14,324,400	
日信工業	22,700	1,147.00	26,036,900	
トビー工業	83,000	154.00	12,782,000	
ティラド	38,000	168.00	6,384,000	
曙ブレーキ工業	51,900	332.00	17,230,800	
タチエス	14,600	1,343.00	19,607,800	
N O K	54,000	1,114.00	60,156,000	
フタバ産業	34,000	298.00	10,132,000	

カヤバ工業	85,000	268.00	22,780,000
シロキ工業	25,000	174.00	4,350,000
大同メタル工業	16,000	492.00	7,872,000
プレス工業	47,000	292.00	13,724,000
カルソニックカンセイ	76,000	305.00	23,180,000
太平洋工業	22,700	444.00	10,078,800
ケーヒン	23,100	970.00	22,407,000
河西工業	14,000	296.00	4,144,000
アイシン精機	102,200	2,127.00	217,379,400
富士機工	13,000	212.00	2,756,000
マツダ	1,768,000	106.00	187,408,000
ダイハツ工業	118,000	1,337.00	157,766,000
今仙電機製作所	8,200	820.00	6,724,000
本田技研工業	942,000	2,358.00	2,221,236,000
スズキ	233,400	1,835.00	428,289,000
富士重工業	353,000	793.00	279,929,000
ヤマハ発動機	169,800	750.00	127,350,000
ショーワ	26,400	739.00	19,509,600
T B K	11,000	385.00	4,235,000
エクセディ	15,200	1,579.00	24,000,800
豊田合成	31,600	1,581.00	49,959,600
愛三工業	11,500	583.00	6,704,500
ヨロズ	8,200	1,107.00	9,077,400
エフ・シー・シー	18,300	1,394.00	25,510,200
シマノ	45,000	5,050.00	227,250,000
タカタ	20,200	1,381.00	27,896,200
テイ・エス テック	23,600	1,300.00	30,680,000
日本電産トーソク	5,300	513.00	2,718,900
テルモ	85,600	3,225.00	276,060,000
クリエートメディック	3,400	795.00	2,703,000
日機装	39,000	841.00	32,799,000
島津製作所	133,000	495.00	65,835,000
J M S	17,000	269.00	4,573,000
モリテックス	2,400	296.00	710,400
長野計器	7,800	582.00	4,539,600
ブイ・テクノロジー	23	129,400.00	2,976,200
東京計器	36,000	126.00	4,536,000
愛知時計電機	12,000	275.00	3,300,000
東京精密	20,000	1,183.00	23,660,000
マニー	3,400	2,976.00	10,118,400
ニコン	208,500	1,856.00	386,976,000
トプコン	22,500	479.00	10,777,500
オリンパス	131,700	1,244.00	163,834,800

理研計器	9,000	472.00	4,248,000	
タムロン	8,600	2,092.00	17,991,200	
HOYA	271,500	1,527.00	414,580,500	
ノーリツ鋼機	10,000	306.00	3,060,000	
エー・アンド・デイ	10,100	253.00	2,555,300	
日本電産コパル	8,700	636.00	5,533,200	
シチズンホールディングス	133,600	357.00	47,695,200	
リズム時計工業	50,000	161.00	8,050,000	
大研医器	1,400	1,446.00	2,024,400	
松風	5,400	810.00	4,374,000	
セイコーホールディングス	71,000	200.00	14,200,000	
ニプロ	59,400	518.00	30,769,200	
パラマウントベッドホールディングス	9,600	2,746.00	26,361,600	
SHO-BI	4,100	372.00	1,525,200	
永大産業	15,000	324.00	4,860,000	
ダンロップスポーツ	6,000	1,020.00	6,120,000	
バンダイナムコホールディングス	115,500	1,174.00	135,597,000	
共立印刷	18,000	235.00	4,230,000	
フランスベッドホールディングス	70,000	163.00	11,410,000	
パイロットコーポレーション	97	142,600.00	13,832,200	
トッパン・フォームズ	19,900	739.00	14,706,100	
フジシールインターナショナル	13,600	1,680.00	22,848,000	
タカラトミー	38,200	452.00	17,266,400	
廣濟堂	9,500	268.00	2,546,000	
タカノ	5,000	381.00	1,905,000	
プロネクサス	13,000	452.00	5,876,000	
ホクシン	7,900	167.00	1,319,300	
ウッドワン	23,000	213.00	4,899,000	
大建工業	47,000	172.00	8,084,000	
凸版印刷	315,000	454.00	143,010,000	
大日本印刷	340,000	570.00	193,800,000	
図書印刷	21,000	121.00	2,541,000	
共同印刷	37,000	192.00	7,104,000	
日本写真印刷	17,700	629.00	11,133,300	
光村印刷	11,000	234.00	2,574,000	
宝印刷	6,300	568.00	3,578,400	
アシックス	104,000	1,044.00	108,576,000	
ツツミ	5,600	1,809.00	10,130,400	
ローランド	11,300	518.00	5,853,400	
小松ウオール工業	4,200	1,050.00	4,410,000	
ヤマハ	82,100	691.00	56,731,100	
河合楽器製作所	42,000	147.00	6,174,000	
クリナップ	12,100	536.00	6,485,600	



ピジョン	8,400	3,550.00	29,820,000	
兼松日産農林	17,000	123.00	2,091,000	
キングジム	9,300	642.00	5,970,600	
リンテック	23,900	1,404.00	33,555,600	
イトーキ	25,200	446.00	11,239,200	
任天堂	63,900	9,500.00	607,050,000	
三菱鉛筆	9,200	1,325.00	12,190,000	
タカラスタンダード	51,000	593.00	30,243,000	
コクヨ	58,000	615.00	35,670,000	
ナカバヤシ	25,000	165.00	4,125,000	
グロープライド	54,000	96.00	5,184,000	
岡村製作所	43,000	566.00	24,338,000	
美津濃	55,000	364.00	20,020,000	
アデランス	13,900	1,111.00	15,442,900	
東京電力	947,200	121.00	114,611,200	
中部電力	341,600	962.00	328,619,200	
関西電力	455,600	612.00	278,827,200	
中国電力	154,400	955.00	147,452,000	
北陸電力	109,400	787.00	86,097,800	
東北電力	279,000	616.00	171,864,000	
四国電力	100,500	849.00	85,324,500	
九州電力	246,600	622.00	153,385,200	
北海道電力	104,500	649.00	67,820,500	
沖縄電力	6,700	2,385.00	15,979,500	
電源開発	69,300	1,929.00	133,679,700	
東京瓦斯	1,341,000	408.00	547,128,000	
大阪瓦斯	1,083,000	321.00	347,643,000	
東邦瓦斯	284,000	466.00	132,344,000	
北海道瓦斯	20,000	223.00	4,460,000	
西部瓦斯	126,000	199.00	25,074,000	
静岡瓦斯	29,000	565.00	16,385,000	
東武鉄道	634,000	413.00	261,842,000	
相鉄ホールディングス	179,000	268.00	47,972,000	
東京急行電鉄	657,000	404.00	265,428,000	
京浜急行電鉄	287,000	729.00	209,223,000	
小田急電鉄	358,000	822.00	294,276,000	
京王電鉄	312,000	593.00	185,016,000	
京成電鉄	167,000	693.00	115,731,000	
富士急行	30,000	507.00	15,210,000	
新京成電鉄	14,000	355.00	4,970,000	
東日本旅客鉄道	208,000	5,240.00	1,089,920,000	
西日本旅客鉄道	97,100	3,355.00	325,770,500	
東海旅客鉄道	92,800	6,610.00	613,408,000	

西日本鉄道	144,000	333.00	47,952,000	
ハマキョウレックス	3,200	2,365.00	7,568,000	
サカイ引越センター	2,000	1,673.00	3,346,000	
近畿日本鉄道	1,009,000	308.00	310,772,000	
阪急阪神ホールディングス	705,000	422.00	297,510,000	
南海電気鉄道	233,000	354.00	82,482,000	
京阪電気鉄道	250,000	374.00	93,500,000	
名糖運輸	4,600	581.00	2,672,600	
名古屋鉄道	390,000	214.00	83,460,000	
日本通運	442,000	275.00	121,550,000	
ヤマトホールディングス	211,000	1,185.00	250,035,000	
山九	136,000	285.00	38,760,000	
丸運	6,000	182.00	1,092,000	
丸全昭和運輸	37,000	228.00	8,436,000	
センコー	45,000	319.00	14,355,000	
トナミホールディングス	23,000	169.00	3,887,000	
日本梱包運輸倉庫	36,000	913.00	32,868,000	
日本石油輸送	13,000	182.00	2,366,000	
福山通運	68,000	406.00	27,608,000	
セイノーホールディングス	86,000	440.00	37,840,000	
神奈川中央交通	13,000	445.00	5,785,000	
日立物流	19,400	1,165.00	22,601,000	
日本郵船	886,000	153.00	135,558,000	
商船三井	551,000	185.00	101,935,000	
川崎汽船	508,000	100.00	50,800,000	
NSユナイテッド海運	48,000	84.00	4,032,000	
乾汽船	14,300	180.00	2,574,000	
飯野海運	57,100	222.00	12,676,200	
共栄タンカー	21,000	158.00	3,318,000	
日本航空	94,300	3,810.00	359,283,000	
全日本空輸	2,194,000	167.00	366,398,000	
パスコ	10,000	225.00	2,250,000	
日新	42,000	190.00	7,980,000	
三菱倉庫	79,000	1,010.00	79,790,000	
三井倉庫	52,000	241.00	12,532,000	
住友倉庫	75,000	333.00	24,975,000	
澁澤倉庫	29,000	218.00	6,322,000	
東陽倉庫	18,000	174.00	3,132,000	
日本トランスシティ	26,000	253.00	6,578,000	
ケイヒン	20,000	88.00	1,760,000	
安田倉庫	8,700	496.00	4,315,200	
東洋埠頭	32,000	123.00	3,936,000	
宇徳	9,000	211.00	1,899,000	

上組	124,000	626.00	77,624,000	
サンリツ	2,900	484.00	1,403,600	
キムラユニティー	2,500	722.00	1,805,000	
キューソー流通システム	3,100	925.00	2,867,500	
郵船ロジスティクス	8,800	656.00	5,772,800	
近鉄エクスプレス	10,000	2,234.00	22,340,000	
東海運	6,000	213.00	1,278,000	
エーアイティー	900	1,136.00	1,022,400	
N E C ネットスアイ	10,400	1,452.00	15,100,800	
システナ	118	71,800.00	8,472,400	
新日鉄住金ソリューションズ	7,400	1,536.00	11,366,400	
コア	4,200	724.00	3,040,800	
ソフトクリエイティブホールディングス	1,200	1,186.00	1,423,200	
デジタルハーツ	2,100	667.00	1,400,700	
I T ホールディングス	36,600	994.00	36,380,400	
ネオス	22	60,800.00	1,337,600	
電算システム	1,200	1,136.00	1,363,200	
グリー	56,900	1,380.00	78,522,000	
コーエーテックホールディングス	21,800	675.00	14,715,000	
三菱総合研究所	4,300	1,668.00	7,172,400	
ボルテージ	1,800	850.00	1,530,000	
K L a b	3,400	536.00	1,822,400	
ネクソン	90,400	690.00	62,376,000	
ドワンゴ	57	129,100.00	7,358,700	
ベリサーブ	7	135,900.00	951,300	
マクロミル	10,700	948.00	10,143,600	
ティーガイア	13,700	791.00	10,836,700	
G M O ペイメントゲートウェイ	3,600	1,318.00	4,744,800	
ザッパラス	61	72,100.00	4,398,100	
インターネットイニシアティブ	12,900	2,181.00	28,134,900	
ソネットエンタテインメント	9	530,000.00	4,770,000	
S R A ホールディングス	5,300	855.00	4,531,500	
朝日ネット	9,000	377.00	3,393,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,600	1,764.00	4,586,400	
フェイス	377	8,580.00	3,234,660	
野村総合研究所	62,400	1,585.00	98,904,000	
サイバネットシステム	92	21,300.00	1,959,600	
インターゲ	3,300	1,684.00	5,557,200	
シンプレクス・ホールディングス	206	22,880.00	4,713,280	
クレスコ	2,600	502.00	1,305,200	
フジ・メディア・ホールディングス	1,066	114,500.00	122,057,000	
オービック	3,800	16,000.00	60,800,000	
T D C ソフトウェアエンジニアリング	2,200	717.00	1,577,400	

ヤフー	8,072	26,720.00	215,683,840	
トレンドマイクロ	43,800	2,021.00	88,519,800	
日本オラクル	22,000	3,290.00	72,380,000	
アルファシステムズ	3,600	946.00	3,405,600	
フューチャーアーキテクト	133	30,800.00	4,096,400	
シーエーシー	6,800	662.00	4,501,600	
ソフトバンク・テクノロジー	2,600	790.00	2,054,000	
トーセ	2,800	498.00	1,394,400	
オービックビジネスコンサルタント	3,500	4,230.00	14,805,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	13,000	3,950.00	51,350,000	
アイティフォー	12,400	280.00	3,472,000	
東計電算	2,000	1,166.00	2,332,000	
エクスネット	10	114,000.00	1,140,000	
大塚商会	9,900	6,300.00	62,370,000	
サイボウズ	184	24,300.00	4,471,200	
ソフトブレーン	165	10,610.00	1,750,650	
アグレックス	3,000	750.00	2,250,000	
電通国際情報サービス	6,800	674.00	4,583,200	
ウェザーニューズ	2,900	2,748.00	7,969,200	
C I J	11,100	323.00	3,585,300	
WOWOW	34	183,300.00	6,232,200	
ネットワンシステムズ	40,200	799.00	32,119,800	
アルゴグラフィックス	4,000	1,030.00	4,120,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	20,800	1,615.00	33,592,000	
日本ユニシス	30,500	586.00	17,873,000	
兼松エレクトロニクス	7,000	880.00	6,160,000	
東京放送ホールディングス	59,500	760.00	45,220,000	
日本テレビホールディングス	100,600	997.00	100,298,200	
テレビ朝日	27,900	1,027.00	28,653,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	957	34,150.00	32,681,550	
テレビ東京ホールディングス	8,000	868.00	6,944,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	9,800	644.00	6,311,200	
イー・アクセス	1,202	53,600.00	64,427,200	
NECモバイリング	4,000	3,270.00	13,080,000	
日本電信電話	464,000	3,660.00	1,698,240,000	
K D D I	155,500	6,060.00	942,330,000	
光通信	12,100	4,280.00	51,788,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,080	114,900.00	1,043,292,000	
GMOインターネット	36,800	493.00	18,142,400	
学研ホールディングス	33,000	217.00	7,161,000	
ゼンリン	14,600	989.00	14,439,400	
昭文社	6,700	517.00	3,463,900	
角川グループホールディングス	9,500	2,549.00	24,215,500	

インプレスホールディングス	9,100	123.00	1,119,300	
アイネット	4,800	558.00	2,678,400	
松竹	73,000	770.00	56,210,000	
東宝	78,700	1,308.00	102,939,600	
東映	46,000	423.00	19,458,000	
A O I P r o .	5,000	553.00	2,765,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	681	229,800.00	156,493,800	
D T S	10,500	1,050.00	11,025,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,000	1,029.00	41,160,000	
シーイーシー	7,200	443.00	3,189,600	
カブコン	21,200	1,471.00	31,185,200	
ジャステック	6,400	541.00	3,462,400	
S C S K	26,200	1,363.00	35,710,600	
日本システムウエア	4,200	305.00	1,281,000	
アイネス	15,000	475.00	7,125,000	
T K C	10,200	1,509.00	15,391,800	
富士ソフト	15,700	1,692.00	26,564,400	
N S D	21,800	760.00	16,568,000	
コナミ	49,800	1,897.00	94,470,600	
福井コンピュータホールディングス	1,600	436.00	697,600	
J B C Cホールディングス	9,300	530.00	4,929,000	
ソフトバンク	502,300	2,768.00	1,390,366,400	
ハウスイ	9,000	98.00	882,000	
高千穂交易	4,600	841.00	3,868,600	
伊藤忠食品	2,700	2,864.00	7,732,800	
エレマテック	5,200	1,014.00	5,272,800	
J A L U X	3,100	821.00	2,545,100	
あらた	25,000	310.00	7,750,000	
トーメンデバイス	1,700	1,630.00	2,771,000	
東京エレクトロン デバイス	22	130,700.00	2,875,400	
双日	694,200	97.00	67,337,400	
アルフレッサ ホールディングス	28,500	3,425.00	97,612,500	
横浜冷凍	27,300	540.00	14,742,000	
神栄	14,000	99.00	1,386,000	
山下医科器械	900	1,015.00	913,500	
ラサ商事	4,800	353.00	1,694,400	
アルコニックス	3,100	1,182.00	3,664,200	
あい ホールディングス	17,700	485.00	8,584,500	
ダイワボウホールディングス	100,000	150.00	15,000,000	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	20,700	750.00	15,525,000	
八洲電機	8,000	332.00	2,656,000	
U K Cホールディングス	6,500	1,443.00	9,379,500	
T O K A Iホールディングス	43,100	329.00	14,179,900	

ミタチ産業	2,600	359.00	933,400
シップヘルスケアホールディングス	15,700	2,589.00	40,647,300
富士興産	3,900	441.00	1,719,900
協栄産業	13,000	129.00	1,677,000
小野建	9,600	608.00	5,836,800
佐鳥電機	8,100	421.00	3,410,100
エコートレーディング	2,800	688.00	1,926,400
伯東	6,700	719.00	4,817,300
コンドーテック	8,500	441.00	3,748,500
中山福	6,300	608.00	3,830,400
ナガイレーベン	14,600	1,115.00	16,279,000
三菱食品	12,100	1,904.00	23,038,400
松田産業	8,000	993.00	7,944,000
メディバルホールディングス	110,200	982.00	108,216,400
アドヴァン	5,600	800.00	4,480,000
S P K	2,600	1,311.00	3,408,600
アズワン	7,200	1,611.00	11,599,200
スズデン	3,600	437.00	1,573,200
尾家産業	3,600	800.00	2,880,000
シモジマ	6,800	905.00	6,154,000
ドウシシャ	5,800	2,257.00	13,090,600
高速	6,600	637.00	4,204,200
黒田電気	14,700	949.00	13,950,300
丸文	9,800	327.00	3,204,600
ハピネット	6,700	577.00	3,865,900
トーメンエレクトロニクス	5,600	969.00	5,426,400
エクセル	4,800	650.00	3,120,000
マルカキカイ	3,600	958.00	3,448,800
ガリバーインターナショナル	3,710	3,055.00	11,334,050
日本エム・ディ・エム	10,200	236.00	2,407,200
進和	6,500	866.00	5,629,000
エスケイジャパン	2,700	239.00	645,300
ダイトエレクトロン	5,100	323.00	1,647,300
シークス	7,000	1,001.00	7,007,000
田中商事	3,700	410.00	1,517,000
オーハシテクニカ	5,900	538.00	3,174,200
マクニカ	5,700	1,506.00	8,584,200
白銅	3,600	735.00	2,646,000
伊藤忠商事	879,200	786.00	691,051,200
丸紅	904,000	516.00	466,464,000
高島	21,000	251.00	5,271,000
F & A アクアホールディングス	8,400	900.00	7,560,000
長瀬産業	62,400	826.00	51,542,400

蝶理	7,000	856.00	5,992,000
豊田通商	122,800	1,723.00	211,584,400
三共生興	18,800	267.00	5,019,600
兼松	234,000	91.00	21,294,000
ツカモトコーポレーション	18,000	120.00	2,160,000
三井物産	951,300	1,075.00	1,022,647,500
日本紙パルプ商事	57,000	235.00	13,395,000
日立ハイテクノロジーズ	33,400	1,663.00	55,544,200
カメイ	13,000	655.00	8,515,000
東都水産	20,000	118.00	2,360,000
スターゼン	37,000	230.00	8,510,000
山善	42,300	505.00	21,361,500
椿本興業	12,000	225.00	2,700,000
住友商事	650,400	1,013.00	658,855,200
内田洋行	24,000	209.00	5,016,000
三菱商事	859,900	1,437.00	1,235,676,300
第一実業	25,000	342.00	8,550,000
キヤノンマーケティングジャパン	36,700	1,137.00	41,727,900
西華産業	40,000	220.00	8,800,000
佐藤商事	9,900	472.00	4,672,800
菱洋エレクトロ	13,000	767.00	9,971,000
東京産業	11,000	246.00	2,706,000
ユアサ商事	113,000	141.00	15,933,000
神鋼商事	28,000	137.00	3,836,000
阪和興業	110,000	252.00	27,720,000
カナデン	11,000	461.00	5,071,000
菱電商事	16,000	447.00	7,152,000
フルサト工業	6,000	693.00	4,158,000
岩谷産業	122,000	302.00	36,844,000
すてきナイスグループ	45,000	154.00	6,930,000
昭光通商	39,000	119.00	4,641,000
ニチモウ	16,000	169.00	2,704,000
極東貿易	13,000	121.00	1,573,000
イワキ	17,000	163.00	2,771,000
三愛石油	26,000	344.00	8,944,000
稲畑産業	27,200	493.00	13,409,600
G S Iクレオス	29,000	102.00	2,958,000
明和産業	8,800	306.00	2,692,800
東邦ホールディングス	35,300	1,643.00	57,997,900
サンゲツ	19,500	1,997.00	38,941,500
ミツウロコグループホールディングス	17,800	465.00	8,277,000
シナネン	24,000	336.00	8,064,000
伊藤忠エネクス	24,400	399.00	9,735,600

サンリオ	27,800	2,744.00	76,283,200	
サンワテクノス	5,400	555.00	2,997,000	
リョーサン	18,000	1,323.00	23,814,000	
新光商事	12,100	650.00	7,865,000	
トーホー	23,000	305.00	7,015,000	
三信電気	15,800	566.00	8,942,800	
東陽テクニカ	16,000	913.00	14,608,000	
モスフードサービス	14,400	1,533.00	22,075,200	
加賀電子	11,000	729.00	8,019,000	
ソーダニッカ	11,000	345.00	3,795,000	
立花エレテック	6,700	625.00	4,187,500	
P a l t a c	11,600	1,166.00	13,525,600	
ヤマタネ	51,000	101.00	5,151,000	
丸紅建材リース	10,000	129.00	1,290,000	
日鐵商事	25,000	180.00	4,500,000	
トラスコ中山	12,600	1,331.00	16,770,600	
オートボックスセブン	13,600	3,140.00	42,704,000	
加藤産業	15,900	1,413.00	22,466,700	
イノテック	9,500	319.00	3,030,500	
イエローハット	10,400	1,189.00	12,365,600	
富士エレクトロニクス	5,700	1,050.00	5,985,000	
J Kホールディングス	9,300	409.00	3,803,700	
日伝	5,000	2,000.00	10,000,000	
北沢産業	8,500	152.00	1,292,000	
杉本商事	6,000	748.00	4,488,000	
因幡電機産業	13,000	2,154.00	28,002,000	
住金物産	57,000	190.00	10,830,000	
ミスミグループ本社	40,900	2,029.00	82,986,100	
江守商事	2,500	807.00	2,017,500	
アルテック	5,400	187.00	1,009,800	
タキヒヨー	17,000	404.00	6,868,000	
スズケン	42,400	2,439.00	103,413,600	
ジェコス	7,600	511.00	3,883,600	
ローソン	41,700	5,640.00	235,188,000	
サンエー	4,200	2,984.00	12,532,800	
麒麟堂	4,000	539.00	2,156,000	
ダイユーエイト	2,200	541.00	1,190,200	
カワチ薬品	7,700	1,713.00	13,190,100	
エービーシー・マート	13,100	3,460.00	45,326,000	
ハードオフコーポレーション	5,400	534.00	2,883,600	
アスクル	7,600	1,167.00	8,869,200	
ゲオホールディングス	189	86,800.00	16,405,200	
ポイント	10,160	2,875.00	29,210,000	



シー・ヴィ・エス・ベイエリア	14,000	73.00	1,022,000	
くらコーポレーション	6,500	1,098.00	7,137,000	
キャンドウ	58	107,200.00	6,217,600	
パル	3,200	4,025.00	12,880,000	
エディオン	47,700	308.00	14,691,600	
サーラコーポレーション	9,500	480.00	4,560,000	
あみやき亭	19	198,500.00	3,771,500	
ひらまつ	38	85,500.00	3,249,000	
ゲンキー	1,100	1,728.00	1,900,800	
大黒天物産	1,900	2,345.00	4,455,500	
ハニーズ	9,690	1,225.00	11,870,250	
アルペン	8,400	1,454.00	12,213,600	
ビックカメラ	419	39,150.00	16,403,850	
DCMホールディングス	57,100	513.00	29,292,300	
Monotaro	7,400	2,103.00	15,562,200	
J・フロントリテイリング	260,000	369.00	95,940,000	
ドトール・日レスホールディングス	19,300	990.00	19,107,000	
マツモトキヨシホールディングス	18,600	1,857.00	34,540,200	
ブロンコビリー	700	2,129.00	1,490,300	
スタートトゥデイ	22,900	812.00	18,594,800	
物語コーポレーション	1,400	1,910.00	2,674,000	
ココカラファイン	11,500	2,507.00	28,830,500	
三越伊勢丹ホールディングス	219,000	709.00	155,271,000	
ウエルシアホールディングス	3,900	2,726.00	10,631,400	
クリエイトSDホールディングス	4,600	2,100.00	9,660,000	
丸善CHIホールディングス	6,400	214.00	1,369,600	
ブックオフコーポレーション	6,100	636.00	3,879,600	
あさひ	6,400	1,181.00	7,558,400	
日本調剤	1,400	2,070.00	2,898,000	
コスモス薬品	4,900	7,600.00	37,240,000	
セブン&アイ・ホールディングス	461,000	2,332.00	1,075,052,000	
ツルハホールディングス	9,100	5,720.00	52,052,000	
サンマルクホールディングス	3,600	2,951.00	10,623,600	
フェリシモ	3,200	996.00	3,187,200	
トリドール	9,500	1,097.00	10,421,500	
クスリのアオキ	1,600	4,290.00	6,864,000	
メディカルシステムネットワーク	6,100	424.00	2,586,400	
総合メディカル	2,700	2,910.00	7,857,000	
はるやま商事	4,600	394.00	1,812,400	
カッパ・クリエイトホールディングス	8,100	1,710.00	13,851,000	
ライトオン	8,200	568.00	4,657,600	
良品計画	11,700	5,100.00	59,670,000	
三城ホールディングス	13,600	430.00	5,848,000	

コナカ	13,000	615.00	7,995,000
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,259.00	1,510,800
G - 7ホールディングス	3,300	405.00	1,336,500
イオン北海道	6,900	358.00	2,470,200
コジマ	16,300	253.00	4,123,900
ヒマラヤ	3,200	621.00	1,987,200
コーナン商事	14,400	935.00	13,464,000
エコス	3,800	510.00	1,938,000
ワタミ	13,000	1,675.00	21,775,000
マルシェ	2,700	722.00	1,949,400
ドン・キホーテ	29,400	3,160.00	92,904,000
メガネトップ	18,900	909.00	17,180,100
西松屋チェーン	21,700	632.00	13,714,400
ゼンショーホールディングス	42,000	960.00	40,320,000
幸楽苑	6,800	1,161.00	7,894,800
ハークスレイ	3,100	672.00	2,083,200
サイゼリヤ	16,300	1,125.00	18,337,500
ポプラ	3,800	517.00	1,964,600
ユナイテッドアローズ	13,400	2,028.00	27,175,200
ハイデイ日高	5,800	1,310.00	7,598,000
京都きもの友禅	7,300	915.00	6,679,500
コロワイド	36,500	680.00	24,820,000
壱番屋	4,400	2,542.00	11,184,800
トップカルチャー	4,000	356.00	1,424,000
スギホールディングス	17,600	2,698.00	47,484,800
スクロール	14,400	238.00	3,427,200
ファミリーマート	33,900	3,600.00	122,040,000
木曽路	13,500	1,595.00	21,532,500
千趣会	19,900	499.00	9,930,100
タカキュー	8,500	256.00	2,176,000
ケーヨー	19,000	435.00	8,265,000
上新電機	24,000	817.00	19,608,000
日本瓦斯	15,200	1,161.00	17,647,200
ベスト電器	34,500	107.00	3,691,500
マルエツ	23,000	259.00	5,957,000
ロイヤルホールディングス	18,400	1,005.00	18,492,000
東天紅	8,000	181.00	1,448,000
いなげや	12,300	961.00	11,820,300
島忠	25,000	1,694.00	42,350,000
チヨダ	13,000	2,133.00	27,729,000
ライフコーポレーション	7,500	1,204.00	9,030,000
カスミ	22,600	509.00	11,503,400
リンガーハット	10,000	1,029.00	10,290,000

MrMax	11,000	306.00	3,366,000
テンアライド	8,300	269.00	2,232,700
AOKIホールディングス	9,700	1,864.00	18,080,800
オークワ	17,000	1,010.00	17,170,000
コメリ	17,000	1,898.00	32,266,000
青山商事	30,400	1,358.00	41,283,200
しまむら	12,800	8,040.00	102,912,000
CFSコーポレーション	7,700	337.00	2,594,900
高島屋	149,000	482.00	71,818,000
松屋	22,900	751.00	17,197,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	72,000	752.00	54,144,000
ニッセンホールディングス	19,900	308.00	6,129,200
パルコ	21,100	814.00	17,175,400
丸井グループ	143,600	517.00	74,241,200
原信ナルスホールディングス	6,100	1,402.00	8,552,200
ダイエー	63,750	147.00	9,371,250
イズミヤ	43,000	381.00	16,383,000
イオン	388,500	854.00	331,779,000
ユニー	106,500	543.00	57,829,500
イズミ	27,600	1,898.00	52,384,800
東武ストア	15,000	257.00	3,855,000
平和堂	22,500	1,037.00	23,332,500
フジ	12,300	1,650.00	20,295,000
ヤオコー	5,600	3,010.00	16,856,000
ゼビオ	15,000	1,531.00	22,965,000
ケーズホールディングス	27,500	2,120.00	58,300,000
Olympic	6,500	701.00	4,556,500
日産東京販売ホールディングス	16,000	315.00	5,040,000
アインファーマシーズ	6,100	4,700.00	28,670,000
元気寿司	3,400	1,013.00	3,444,200
ヤマダ電機	50,270	3,045.00	153,072,150
アークランドサカモト	7,200	1,090.00	7,848,000
ニトリホールディングス	21,850	6,110.00	133,503,500
グルメ杵屋	8,000	510.00	4,080,000
愛眼	8,800	284.00	2,499,200
吉野家ホールディングス	299	101,400.00	30,318,600
松屋フーズ	5,300	1,440.00	7,632,000
サガミチェーン	13,000	641.00	8,333,000
プレナス	12,300	1,297.00	15,953,100
ミニストップ	8,200	1,356.00	11,119,200
アークス	18,800	1,644.00	30,907,200
パロー	23,700	1,246.00	29,530,200
ベルク	5,400	1,125.00	6,075,000

大庄	5,200	1,002.00	5,210,400	
ファーストリテイリング	22,100	16,830.00	371,943,000	
サンドラッグ	21,000	2,899.00	60,879,000	
東京デリカ	3,600	1,125.00	4,050,000	
ヤマザワ	2,900	1,301.00	3,772,900	
やまや	2,300	1,024.00	2,355,200	
ペルーナ	13,750	588.00	8,085,000	
島根銀行	2,500	1,036.00	2,590,000	
新生銀行	954,000	126.00	120,204,000	
あおぞら銀行	400,000	227.00	90,800,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,345,000	350.00	2,920,750,000	
りそなホールディングス	1,133,500	327.00	370,654,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,304,000	234.00	539,136,000	
三井住友フィナンシャルグループ	833,400	2,371.00	1,975,991,400	
第四銀行	142,000	257.00	36,494,000	
北越銀行	112,000	149.00	16,688,000	
西日本シティ銀行	387,000	180.00	69,660,000	
千葉銀行	425,000	464.00	197,200,000	
横浜銀行	701,000	378.00	264,978,000	
常陽銀行	416,000	372.00	154,752,000	
群馬銀行	249,000	375.00	93,375,000	
武蔵野銀行	17,800	2,477.00	44,090,600	
千葉興業銀行	21,100	403.00	8,503,300	
筑波銀行	45,800	255.00	11,679,000	
東京都民銀行	20,800	625.00	13,000,000	
七十七銀行	173,000	303.00	52,419,000	
青森銀行	82,000	231.00	18,942,000	
秋田銀行	76,000	211.00	16,036,000	
山形銀行	67,000	333.00	22,311,000	
岩手銀行	7,900	3,285.00	25,951,500	
東邦銀行	93,000	262.00	24,366,000	
東北銀行	56,000	114.00	6,384,000	
みちのく銀行	55,000	151.00	8,305,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	447,000	304.00	135,888,000	
静岡銀行	323,000	816.00	263,568,000	
十六銀行	138,000	259.00	35,742,000	
スルガ銀行	107,000	943.00	100,901,000	
八十二銀行	203,000	404.00	82,012,000	
山梨中央銀行	67,000	314.00	21,038,000	
大垣共立銀行	147,000	272.00	39,984,000	
福井銀行	95,000	145.00	13,775,000	
北國銀行	128,000	281.00	35,968,000	
清水銀行	3,700	2,184.00	8,080,800	

滋賀銀行	104,000	508.00	52,832,000	
南都銀行	110,000	381.00	41,910,000	
百五銀行	100,000	340.00	34,000,000	
京都銀行	197,000	680.00	133,960,000	
三重銀行	46,000	166.00	7,636,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	772,000	121.00	93,412,000	
広島銀行	325,000	285.00	92,625,000	
山陰合同銀行	65,000	552.00	35,880,000	
中国銀行	85,000	1,084.00	92,140,000	
鳥取銀行	35,000	149.00	5,215,000	
伊予銀行	118,000	596.00	70,328,000	
百十四銀行	121,000	295.00	35,695,000	
四国銀行	80,000	190.00	15,200,000	
阿波銀行	91,000	470.00	42,770,000	
鹿児島銀行	77,000	491.00	37,807,000	
大分銀行	65,000	264.00	17,160,000	
宮崎銀行	73,000	189.00	13,797,000	
肥後銀行	91,000	460.00	41,860,000	
佐賀銀行	67,000	174.00	11,658,000	
十八銀行	70,000	197.00	13,790,000	
沖縄銀行	8,200	3,250.00	26,650,000	
琉球銀行	22,900	990.00	22,671,000	
八千代銀行	5,700	1,492.00	8,504,400	
セブン銀行	371,600	223.00	82,866,800	
みずほフィナンシャルグループ	14,178,600	122.00	1,729,789,200	
紀陽ホールディングス	439,000	108.00	47,412,000	
山口フィナンシャルグループ	110,000	682.00	75,020,000	
長野銀行	38,000	145.00	5,510,000	
名古屋銀行	100,000	249.00	24,900,000	
北洋銀行	166,000	199.00	33,034,000	
愛知銀行	4,000	4,055.00	16,220,000	
第三銀行	62,000	137.00	8,494,000	
中京銀行	45,000	168.00	7,560,000	
東日本銀行	48,000	172.00	8,256,000	
大光銀行	39,000	188.00	7,332,000	
愛媛銀行	65,000	204.00	13,260,000	
トマト銀行	43,000	136.00	5,848,000	
みなと銀行	100,000	143.00	14,300,000	
京葉銀行	91,000	346.00	31,486,000	
関西アーバン銀行	154,000	97.00	14,938,000	
栃木銀行	55,000	275.00	15,125,000	
北日本銀行	3,200	2,110.00	6,752,000	
東和銀行	118,000	75.00	8,850,000	

福島銀行	136,000	50.00	6,800,000	
大東銀行	70,000	70.00	4,900,000	
トモニホールディングス	84,600	315.00	26,649,000	
フィデアホールディングス	63,400	156.00	9,890,400	
池田泉州ホールディングス	90,900	476.00	43,268,400	
S B Iホールディングス	140,900	574.00	80,876,600	
ジャフコ	15,500	1,782.00	27,621,000	
大和証券グループ本社	1,093,000	305.00	333,365,000	
野村ホールディングス	2,254,300	284.00	640,221,200	
岡三証券グループ	95,000	297.00	28,215,000	
丸三証券	35,200	281.00	9,891,200	
東洋証券	46,000	136.00	6,256,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,000	294.00	37,338,000	
水戸証券	38,000	136.00	5,168,000	
いちよし証券	25,600	420.00	10,752,000	
松井証券	65,400	525.00	34,335,000	
だいこう証券ビジネス	7,100	290.00	2,059,000	
マネックスグループ	1,275	13,230.00	16,868,250	
カブドットコム証券	45,100	221.00	9,967,100	
極東証券	15,200	617.00	9,378,400	
岩井コスモホールディングス	12,600	265.00	3,339,000	
N K S Jホールディングス	244,800	1,398.00	342,230,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	329,300	1,302.00	428,748,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	105,600	1,370.00	144,672,000	
第一生命保険	5,894	86,400.00	509,241,600	
東京海上ホールディングス	426,900	1,981.00	845,688,900	
T & Dホールディングス	378,000	801.00	302,778,000	
クレディセゾン	96,500	1,723.00	166,269,500	
芙蓉総合リース	10,800	2,091.00	22,582,800	
興銀リース	17,300	1,971.00	34,098,300	
東京センチュリーリース	26,300	1,577.00	41,475,100	
日本証券金融	45,800	349.00	15,984,200	
大阪証券金融	27,700	175.00	4,847,500	
ポケットカード	17,800	324.00	5,767,200	
リコーリース	8,300	1,818.00	15,089,400	
イオンクレジットサービス	40,900	1,669.00	68,262,100	
アコム	22,690	2,259.00	51,256,710	
ジャックス	66,000	308.00	20,328,000	
オリエントコーポレーション	233,000	157.00	36,581,000	
日立キャピタル	22,100	1,555.00	34,365,500	
オリックス	57,360	7,970.00	457,159,200	
三菱UFJリース	28,000	3,420.00	95,760,000	
アサックス	19	79,000.00	1,501,000	

NECキャピタルソリューション	6,100	1,092.00	6,661,200
日本駐車場開発	1,200	4,395.00	5,274,000
ヒューリック	129,900	608.00	78,979,200
東京建物不動産販売	5,700	256.00	1,459,200
三栄建築設計	2,800	698.00	1,954,400
野村不動産ホールディングス	53,300	1,413.00	75,312,900
常和ホールディングス	2,900	1,415.00	4,103,500
パーク24	57,400	1,345.00	77,203,000
三井不動産	520,000	1,617.00	840,840,000
三菱地所	771,000	1,528.00	1,178,088,000
平和不動産	22,600	922.00	20,837,200
東京建物	217,000	307.00	66,619,000
ダイビル	31,800	658.00	20,924,400
東急不動産	243,000	446.00	108,378,000
京阪神ビルディング	18,700	361.00	6,750,700
住友不動産	264,000	2,137.00	564,168,000
東宝不動産	9,700	421.00	4,083,700
大京	170,000	200.00	34,000,000
テーオーシー	38,000	417.00	15,846,000
東京楽天地	18,000	294.00	5,292,000
フジ住宅	15,400	402.00	6,190,800
空港施設	13,400	363.00	4,864,200
明和地所	5,500	338.00	1,859,000
住友不動産販売	3,970	3,490.00	13,855,300
ゴールドクレスト	8,800	1,182.00	10,401,600
東栄住宅	7,500	831.00	6,232,500
日本エスリード	5,700	643.00	3,665,100
東急リバブル	11,700	1,004.00	11,746,800
飯田産業	10,400	673.00	6,999,200
日神不動産	7,900	396.00	3,128,400
アーネストワン	18,200	1,161.00	21,130,200
タカラレーベン	13,500	870.00	11,745,000
サンヨーハウジング名古屋	57	81,300.00	4,634,100
イオンモール	50,300	2,028.00	102,008,400
フージャースコーポレーション	174	58,400.00	10,161,600
タクトホーム	59	83,600.00	4,932,400
トーセイ	218	32,550.00	7,095,900
エヌ・ティ・ティ都市開発	702	65,900.00	46,261,800
サンフロンティア不動産	158	36,000.00	5,688,000
ランドビジネス	74	19,330.00	1,430,420
グランディハウス	2,400	636.00	1,526,400
日本空港ビルデング	38,100	854.00	32,537,400
日本工営	39,000	255.00	9,945,000

ネクスト	6,100	639.00	3,897,900	
日本M&Aセンター	6,000	2,523.00	15,138,000	
ノバレーゼ	30	52,900.00	1,587,000	
アコーディア・ゴルフ	512	53,500.00	27,392,000	
タケエイ	1,400	1,890.00	2,646,000	
パソナグループ	116	47,500.00	5,510,000	
リンクアンドモチベーション	60	30,550.00	1,833,000	
GCAサヴィアングループ	64	95,300.00	6,099,200	
エス・エム・エス	34	155,000.00	5,270,000	
テンプホールディングス	15,900	995.00	15,820,500	
クックパッド	2,300	2,361.00	5,430,300	
学情	5,100	254.00	1,295,400	
スタジオアリス	5,400	1,220.00	6,588,000	
シミックホールディングス	4,400	1,135.00	4,994,000	
NECフィールドディング	9,500	910.00	8,645,000	
総合警備保障	42,500	1,099.00	46,707,500	
カカクコム	16,200	2,810.00	45,522,000	
ルネサンス	5,600	544.00	3,046,400	
ツクイ	5,600	1,728.00	9,676,800	
エムスリー	276	150,400.00	41,510,400	
ベストブライダル	34	86,300.00	2,934,200	
ディー・エヌ・エー	57,500	2,596.00	149,270,000	
博報堂DYホールディングス	16,170	4,755.00	76,888,350	
ぐるなび	8,100	873.00	7,071,300	
一休	73	44,500.00	3,248,500	
ジャパンベストレスキューシステム	15	76,600.00	1,149,000	
ジェイコムホールディングス	2,100	710.00	1,491,000	
PGMホールディングス	171	64,000.00	10,944,000	
JPホールディングス	3,700	974.00	3,603,800	
イーピーエス	69	218,700.00	15,090,300	
アミューズ	3,600	1,533.00	5,518,800	
ドリームインキュベータ	42	65,900.00	2,767,800	
ケネディクス	1,112	12,100.00	13,455,200	
電通	106,100	1,762.00	186,948,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	562	7,930.00	4,456,660	
ぴあ	3,400	1,054.00	3,583,600	
イオンファンタジー	3,800	1,108.00	4,210,400	
みらかホールディングス	30,500	3,265.00	99,582,500	
アルプス技研	4,700	631.00	2,965,700	
サニックス	17,000	239.00	4,063,000	
ダイオーズ	2,200	504.00	1,108,800	
日本空調サービス	2,900	712.00	2,064,800	
オリエンタルランド	34,700	10,570.00	366,779,000	



ダスキン	32,200	1,501.00	48,332,200	
明光ネットワークジャパン	10,600	830.00	8,798,000	
ファルコSDホールディングス	6,300	907.00	5,714,100	
秀英予備校	4,100	284.00	1,164,400	
田谷	1,800	682.00	1,227,600	
ラウンドワン	38,000	402.00	15,276,000	
リゾートトラスト	19,900	1,468.00	29,213,200	
ビー・エム・エル	6,900	2,042.00	14,089,800	
ワタベウェディング	3,500	620.00	2,170,000	
もしもしホットライン	19,300	1,172.00	22,619,600	
東急コミュニティ	3,000	2,825.00	8,475,000	
リソー教育	1,189	6,150.00	7,312,350	
ウェアハウス	3,700	202.00	747,400	
ユー・エス・エス	13,040	8,480.00	110,579,200	
東京個別指導学院	5,900	143.00	843,700	
テー・オー・ダブリュー	3,900	513.00	2,000,700	
セントラルスポーツ	3,600	1,162.00	4,183,200	
フルキャストホールディングス	110	13,550.00	1,490,500	
リゾートソリューション	13,000	160.00	2,080,000	
リロ・ホールディング	4,000	2,708.00	10,832,000	
エイチ・アイ・エス	9,500	2,447.00	23,246,500	
共立メンテナンス	6,100	1,694.00	10,333,400	
イチネンホールディングス	13,600	438.00	5,956,800	
建設技術研究所	6,500	477.00	3,100,500	
スペース	6,300	692.00	4,359,600	
燦ホールディングス	2,600	1,229.00	3,195,400	
スバル興業	8,000	246.00	1,968,000	
東京テアトル	44,000	100.00	4,400,000	
よみうりランド	23,000	261.00	6,003,000	
東京都競馬	90,000	115.00	10,350,000	
カナモト	14,000	914.00	12,796,000	
東京ドーム	89,000	246.00	21,894,000	
トランス・コスモス	15,300	840.00	12,852,000	
乃村工藝社	25,000	291.00	7,275,000	
藤田観光	30,000	253.00	7,590,000	
日本管財	4,300	1,458.00	6,269,400	
トーカイ	5,200	2,000.00	10,400,000	
白洋舎	14,000	207.00	2,898,000	
セコム	121,300	3,965.00	480,954,500	
セントラル警備保障	5,200	787.00	4,092,400	
丹青社	12,000	237.00	2,844,000	
メイテック	18,100	1,837.00	33,249,700	
アサツー ディ・ケイ	19,200	1,723.00	33,081,600	

応用地質	12,300	950.00	11,685,000	
船井総合研究所	12,000	524.00	6,288,000	
進学会	5,700	282.00	1,607,400	
ベネッセホールディングス	35,500	3,460.00	122,830,000	
イオンディライト	11,300	1,638.00	18,509,400	
ナック	2,600	1,770.00	4,602,000	
ニチイ学館	22,800	607.00	13,839,600	
ダイセキ	17,200	1,016.00	17,475,200	
合計	171,297,663	-	111,090,950,490	

#### B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

#### 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	76,503,141
コール・ローン	1,149,635,660
国債証券	201,791,758,266
派生商品評価勘定	5,147,773
未収入金	26,954,005
未収利息	2,131,178,915
前払費用	150,045,185
差入委託証拠金	28,145,398
流動資産合計	205,359,368,343
資産合計	205,359,368,343
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,492,492
未払金	5,182,900
未払解約金	62,209,047
流動負債合計	68,884,439
負債合計	68,884,439
純資産の部	
元本等	
元本	112,317,300,900
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,973,183,004
元本等合計	205,290,483,904
純資産合計	205,290,483,904
負債純資産合計	205,359,368,343

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年11月12日現在
--	---------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 計算期間の期首元本額	121,402,583,483円
計算期間中の追加設定元本額	12,026,887,231円
計算期間中の一部解約元本額	21,112,169,814円
計算日の元本額	112,317,300,900円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	6,955,408,212円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	320,041,648円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	2,629,946,055円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	465,293,951円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,407,898円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,182,092,867円
世界経済インデックスファンド	378,256,546円
マイセレクション25	20,160,783円

マイセレクション50	12,703,596円
マイセレクション75	8,710,736円
DCマイセレクション25	1,052,931,549円
DCマイセレクション50	916,796,172円
DCマイセレクション75	538,423,985円
DC外国債券インデックス・オープン	1,124,194,602円
DCマイセレクションS25	302,764,022円
DCマイセレクションS50	255,301,610円
DCマイセレクションS75	103,492,137円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,202,589円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	32,590,245円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	21,209,505円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	6,587,132円
DC世界経済インデックスファンド	111,447,652円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	7,043,379,090円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	4,214,610,063円
マイセレクション50V A1（適格機関投資家専用）	43,124,097円
マイセレクション75V A1（適格機関投資家専用）	13,129,794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）	552,407,073円
マイセレクション50V A 2（適格機関投資家専用）	215,662円
バランス30V A 1（適格機関投資家専用）	1,578,802,160円
バランス50V A 1（適格機関投資家専用）	2,519,222,494円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,781,095,440円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,158,463,641円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	10,145,608,367円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,354,326,523円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,423,269,401円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,138,087,075円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	5,456,231,834円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,523,454,452円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	3,458,536,334円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	604,202,610円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	828,328,769円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	5,383,265,939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）	894,403,872円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	297,942,392円
外国債券ファンド・シリーズ1	1,270,652,341円
コア投資戦略ファンド（安定型）	453,986,038円
コア投資戦略ファンド（成長型）	226,433,236円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	617,873,644円
2. 計算日における受益権総数	112,317,300,900口
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8278円 （18,278円）

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	<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> <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
--------------------	--

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,273,950,810	
合計	2,273,950,810	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの
- 債券関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	813,894,233	-	819,038,194	5,143,961
合計		813,894,233	-	819,038,194	5,143,961

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## 通貨関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	524,838,600	-	524,568,000	270,600
	カナダドル	55,584,200	-	55,587,000	2,800
	イギリスポンド	95,205,000	-	94,755,000	450,000
	ユーロ	465,922,880	-	465,152,000	770,880
	計	1,141,550,680	-	1,140,062,000	1,488,680
合計		1,141,550,680	-	1,140,062,000	1,488,680

## (注) 時価の算定方法

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は

当該仲値によって評価しております。

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成24年11月12日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 12/31/13	3,000,000.00	2,996,835.90	
		T 0.25% 04/30/14	9,000,000.00	9,001,755.00	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,973,202.60	
		T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,979,062.40	
		T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	9,994,531.00	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,519,768.50	
		T 0.375% 06/15/15	10,000,000.00	10,014,840.00	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,540,203.80	
		T 0.75% 12/15/13	15,000,000.00	15,086,715.00	
		T 0.875% 02/28/17	22,900,000.00	23,239,034.50	
		T 1% 01/15/14	3,900,000.00	3,935,497.80	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,427,070.40	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	9,016,173.00	
		T 1% 09/30/16	11,500,000.00	11,733,588.00	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,995,937.60	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,130,023.70	
		T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,724,835.30	
		T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,529,593.20	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	4,022,179.20	
		T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	2,060,156.00	
		T 1.5% 03/31/19	11,000,000.00	11,396,176.00	
		T 1.5% 07/31/16	20,000,000.00	20,771,880.00	
T 1.5% 12/31/13	8,650,000.00	8,775,693.15			
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,522,851.00			



T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	23,018,461.60	
T 1.75% 03/31/14	22,000,000.00	22,458,898.00	
T 1.75% 05/15/22	12,500,000.00	12,754,887.50	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,575,385.00	
T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	7,966,358.40	
T 1.875% 04/30/14	15,100,000.00	15,460,980.60	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,633,720.20	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,383,786.00	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,178,359.00	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,649,805.00	
T 2% 01/31/16	11,500,000.00	12,093,871.50	
T 2% 02/15/22	10,000,000.00	10,460,160.00	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,517,938.40	
T 2% 11/30/13	15,000,000.00	15,280,080.00	
T 2.125% 02/29/16	4,800,000.00	5,072,625.60	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,479,822.60	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	13,074,465.60	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,633,928.00	
T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,412,473.80	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	6,218,533.00	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,158,282.00	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	20,112,000.00	
T 2.375% 03/31/16	9,600,000.00	10,234,128.00	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,350,936.00	
T 2.375% 06/30/18	10,250,000.00	11,152,881.50	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	12,972,650.00	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,247,032.00	
T 2.5% 03/31/15	21,700,000.00	22,835,018.50	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,073,203.00	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,790,671.80	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,504,690.00	
T 2.625% 06/30/14	16,000,000.00	16,618,128.00	
T 2.625% 07/31/14	37,400,000.00	38,917,916.40	
T 2.625% 08/15/20	13,500,000.00	14,954,409.00	
T 2.625% 11/15/20	11,500,000.00	12,734,456.00	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,727,223.10	
T 2.75% 02/15/19	5,300,000.00	5,903,701.80	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,204,935.60	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,785,936.00	
T 2.75% 08/15/42	8,000,000.00	8,025,624.00	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,536,796.50	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,262,184.00	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,343,625.00	

T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,493,785.50	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	8,454,376.00	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,528,535.80	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,879,806.00	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,233,024.50	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	14,590,003.20	
T 3.125% 05/15/21	10,150,000.00	11,636,812.60	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,380,217.50	
T 3.125% 11/15/41	9,300,000.00	10,087,598.40	
T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,716,911.30	
T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,722,967.00	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,892,108.50	
T 3.375% 11/15/19	8,300,000.00	9,624,107.30	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,520,486.50	
T 3.5% 02/15/39	6,000,000.00	7,010,154.00	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	6,071,365.90	
T 3.625% 02/15/21	18,000,000.00	21,351,096.00	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,579,758.30	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	8,517,033.00	
T 3.75% 11/15/18	10,000,000.00	11,715,620.00	
T 3.875% 08/15/40	8,800,000.00	10,937,440.80	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,708,024.80	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,798,500.00	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,902,764.80	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,337,283.90	
T 4.25% 05/15/39	2,500,000.00	3,293,750.00	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	12,838,596.00	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,841,312.50	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,306,789.70	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,311,187.50	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,415,244.20	
T 4.25% 11/15/40	10,000,000.00	13,200,000.00	
T 4.375% 02/15/38	2,800,000.00	3,745,655.20	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	6,589,735.60	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,694,376.00	
T 4.375% 11/15/39	6,500,000.00	8,733,361.00	
T 4.5% 02/15/36	3,900,000.00	5,286,024.90	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,513,853.40	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,726,718.00	
T 4.5% 08/15/39	4,500,000.00	6,157,264.50	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,483,262.30	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,860,545.00	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,604,519.10	

	T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	2,109,024.00	
	T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,620,192.60	
	T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,552,738.20	
	T 5.0% 05/15/37	500,000.00	727,383.00	
	T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,747,708.40	
	T 5.25% 02/15/29	1,900,000.00	2,697,703.60	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,841,734.70	
	T 5.375% 02/15/31	2,010,000.00	2,946,219.81	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,738,125.60	
	T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	3,245,686.40	
	T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,174,813.20	
	T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	3,375,960.66	
	T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,982,003.36	
	T 6.25% 08/15/23	4,900,000.00	7,134,478.40	
	T 6.5% 11/15/26	600,000.00	930,468.60	
	T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,569,297.00	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,859,115.60	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,970,688.80	
	T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,516,443.40	
	T 8.0% 11/15/21	2,560,000.00	4,010,600.96	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,090,937.50	
	アメリカドル小計	988,420,000.00	1,078,291,871.34 (85,734,986,690)	
カナダドル	CAN 0.75% 05/01/14	1,300,000.00	1,293,968.00	
	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,554.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	908,388.00	
	CAN 1.5% 11/01/13	3,000,000.00	3,012,930.00	
	CAN 2% 03/01/14	2,900,000.00	2,934,829.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,438,472.00	
	CAN 2% 12/01/14	5,300,000.00	5,397,202.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	1,800,000.00	1,861,974.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,181,800.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,100,000.00	3,273,414.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,054,130.00	
	CAN 3.0% 06/01/14	5,150,000.00	5,301,770.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,300,000.00	2,601,530.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,350,000.00	2,679,611.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,350,000.00	1,724,652.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,300,000.00	3,772,065.00	
	CAN 4% 06/01/16	4,000,000.00	4,387,200.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,687,592.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,850,000.00	3,854,767.50	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	2,019,937.50	

	CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,253,830.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,756,208.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,700,000.00	4,038,444.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,160,000.00	3,237,084.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,400,000.00	3,766,728.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	950,000.00	1,656,686.00	
	CAN 9% 06/01/25	650,000.00	1,162,486.00	
	カナダドル小計	62,810,000.00	72,457,252.50 (5,759,627,001)	
オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	950,000.00	907,449.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	550,000.00	529,281.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,389,284.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,300,000.00	3,654,915.00	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,000,000.00	3,102,090.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,000,000.00	1,152,880.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	3,000,000.00	3,218,100.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,000,000.00	1,060,070.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,800,000.00	3,196,228.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,400,000.00	2,719,584.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	1,500,000.00	1,818,015.00	
	ACGB 5.5% 12/15/13	2,500,000.00	2,570,825.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,750,000.00	3,323,320.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,550,000.00	3,125,866.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,631,872.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,100,000.00	2,277,702.00	
ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,265,748.00		
	オーストラリアドル小計	35,100,000.00	38,943,230.50 (3,217,879,136)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	4,400,000.00	4,458,168.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	839,504.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	1,900,000.00	1,902,850.00	
	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,367,249.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,500,000.00	4,618,575.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	5,250,000.00	5,536,650.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,550,000.00	1,744,804.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,643,368.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,350,000.00	3,960,805.50	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,200,000.00	3,798,304.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,050,000.00	2,480,151.50	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	3,087,922.50	
	UKT 4% 09/07/16	5,700,000.00	6,470,811.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	3,650,000.00	4,506,764.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,114,935.00	

	UKT 4.25% 09/07/39	1,750,000.00	2,156,315.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,300,000.00	2,881,164.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,450,000.00	4,247,019.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,950,000.00	3,647,911.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	3,099,425.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,100,000.00	3,892,298.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,400,000.00	4,137,052.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,550,000.00	3,267,060.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,500,000.00	4,498,375.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,050,000.00	5,061,811.50	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,850,000.00	3,209,470.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	3,100,000.00	4,113,328.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	3,550,000.00	4,721,961.50	
	UKT 5% 03/07/18	2,800,000.00	3,414,880.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,900,000.00	3,867,005.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,350,000.00	5,811,170.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,960,000.00	2,941,078.00	
	UKT 8% 06/07/21	2,600,000.00	3,996,928.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,995,000.00	3,702,568.75	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	2,073,180.00	
	<b>イギリスポンド小計</b>	<b>105,755,000.00</b>	<b>127,270,862.25 (16,087,036,988)</b>	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	115,254.00	
	SWISS 3% 01/08/18	4,200,000.00	4,848,144.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	600,000.00	662,232.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,400,000.00	3,239,760.00	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	439,419.00	
	SWISS 4.25% 01/06/14	850,000.00	893,817.50	
	<b>スイスフラン小計</b>	<b>8,450,000.00</b>	<b>10,198,626.50 (855,460,790)</b>	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/14	800,000.00	800,320.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	850,000.00	874,650.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	400,000.00	434,420.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	450,000.00	489,600.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	650,000.00	720,200.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	350,000.00	377,475.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,336,500.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	500,000.00	560,250.00	
	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	402,150.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	950,000.00	1,107,747.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	750,000.00	871,125.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,100,000.00	1,319,450.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,372,345.00	

	S1GB 3.75% 09/01/16	900,000.00	1,018,530.00	
	S1GB 4% 09/01/18	900,000.00	1,078,650.00	
シンガポールドル小計		11,500,000.00	12,763,412.50 (829,111,276)	
マレーシア リンギット	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,564,356.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	398,616.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	3,000,000.00	3,024,900.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,000,000.00	1,005,870.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,143,079.40	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,533,475.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,800,000.00	4,877,136.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,126,213.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,150,000.00	1,177,071.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	600,000.00	619,140.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,900,535.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,770,707.50	
	MGS 4.262% 09/15/16	7,000,000.00	7,297,500.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,100,000.00	3,288,108.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	300,000.00	323,169.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,359,800.00	
	MGS 5.094% 04/30/14	2,050,000.00	2,112,648.00	
MGS 5.248% 09/15/28	1,800,000.00	2,123,028.00		
マレーシアリンギット小計		40,250,000.00	41,645,352.40 (1,080,280,441)	
スウェーデン クローナ	SGB 3% 07/12/16	9,450,000.00	10,210,725.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	7,400,000.00	9,635,466.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,050,000.00	10,757,373.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	13,000,000.00	14,731,730.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,500,000.00	13,741,005.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	5,900,000.00	6,509,116.00	
	SGB 5% 12/01/20	13,500,000.00	17,373,150.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	15,300,000.00	16,664,913.00	
スウェーデンクローナ小計		85,100,000.00	99,623,478.00 (1,175,557,040)	
ノルウェー クローネ	NGB 3.75% 05/25/21	6,250,000.00	7,189,562.50	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,700,000.00	9,739,650.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,200,000.00	8,436,240.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,700,000.00	11,650,695.00	
ノルウェークローネ小計		32,850,000.00	37,016,147.50 (513,043,804)	
デンマーク クローネ	DGB 2% 11/15/14	2,200,000.00	2,295,040.00	
	DGB 2.5% 11/15/16	2,000,000.00	2,189,800.00	
	DGB 3% 11/15/21	17,000,000.00	19,760,460.00	
	DGB 4% 11/15/15	15,300,000.00	17,163,999.00	

	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,594,380.00	
	DGB 4% 11/15/19	15,600,000.00	19,111,560.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	20,550,000.00	31,308,952.50	
	DGB 5% 11/15/13	20,100,000.00	21,151,230.00	
	DGB 7% 11/10/24	4,750,000.00	7,753,662.50	
デンマーククローネ小計		107,300,000.00	132,329,084.00 (1,794,382,379)	
メキシコペソ	MBONO 5% 06/15/17	13,000,000.00	12,991,550.00	
	MBONO 6% 06/18/15	79,900,000.00	82,204,316.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	45,727,920.00	
	MBONO 8% 12/07/23	13,100,000.00	15,930,648.00	
	MBONO 8% 12/19/13	43,700,000.00	45,233,433.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	65,900,000.00	82,804,009.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	34,550,000.00	43,093,524.00	
メキシコペソ小計		288,850,000.00	327,985,400.00 (1,977,751,962)	
ポーランドズロチ	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,187,150.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,400,000.00	8,714,832.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	6,000,000.00	6,405,600.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,487,968.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,700,000.00	5,937,861.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,700,000.00	5,171,316.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	6,900,000.00	7,094,442.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,550,000.00	1,803,425.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,600,000.00	6,352,080.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,149,300.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	9,600,000.00	10,277,568.00	
	ポーランドズロチ小計		56,550,000.00	60,581,542.00 (1,476,372,178)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,700,000.00	25,836,084.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,850,000.00	10,697,703.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,000,000.00	8,647,320.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	6,900,000.00	5,508,339.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	16,100,000.00	16,241,841.00	
	SAGB 7% 02/28/31	6,900,000.00	6,150,591.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	15,800,000.00	16,522,218.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	2,500,000.00	2,611,825.00	
	SAGB 8% 12/21/18	14,800,000.00	16,186,908.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	15,500,000.00	17,048,295.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	2,500,000.00	2,536,375.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	10,300,000.00	11,050,870.00	
	南アフリカランド小計		131,850,000.00	139,038,369.00 (1,270,810,692)
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,800,000.00	4,167,840.00	

BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	969,102.00	
BGB 3.75% 09/28/15	2,550,000.00	2,796,661.50	
BGB 3.75% 09/28/20	4,700,000.00	5,332,150.00	
BGB 4% 03/28/14	2,000,000.00	2,106,300.00	
BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,637,410.00	
BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,579,260.00	
BGB 4% 03/28/32	150,000.00	170,464.50	
BGB 4.0% 03/28/17	3,500,000.00	3,965,150.00	
BGB 4.0% 03/28/19	2,200,000.00	2,533,080.00	
BGB 4.25% 03/28/41	1,950,000.00	2,331,654.00	
BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,691,575.00	
BGB 4.25% 09/28/21	550,000.00	645,771.50	
BGB 4.25% 09/28/22	1,950,000.00	2,282,085.00	
BGB 4.5% 03/28/26	1,650,000.00	1,979,917.50	
BGB 5% 03/28/35	3,000,000.00	3,899,190.00	
BGB 5.5% 03/28/28	3,550,000.00	4,735,593.50	
BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	1,997,374.50	
BGB 8.0% 03/28/15	1,550,000.00	1,833,464.00	
BKO 0.25% 03/14/14	3,300,000.00	3,312,375.00	
BKO 0.25% 12/13/13	4,100,000.00	4,112,300.00	
BTNS 1.75% 02/25/17	1,100,000.00	1,150,413.00	
BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,304,940.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	3,350,000.00	3,557,700.00	
BTNS 2.5% 01/12/14	5,750,000.00	5,915,312.50	
BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,572,155.00	
BTNS 2.5% 07/25/16	5,900,000.00	6,336,305.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,395,850.00	
BTPS 2.25% 11/01/13	2,400,000.00	2,412,192.00	
BTPS 3% 04/01/14	2,500,000.00	2,534,875.00	
BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,834,390.00	
BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	4,940,670.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,816,604.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,750,000.00	3,829,312.50	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	3,622,920.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,252,756.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,050,000.00	6,200,947.50	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,000,000.00	7,139,510.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	7,551,440.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	3,900,000.00	3,979,170.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,323,760.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,400,000.00	3,612,180.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	3,432,205.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,550,551.00	



BTPS 4.25% 02/01/19	5,000,000.00	5,064,150.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	2,951,711.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	9,800,000.00	10,140,550.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	3,250,000.00	3,275,447.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,250,000.00	3,358,712.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,050,000.00	7,157,371.50	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,900,000.00	5,014,905.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,900,000.00	2,735,570.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,000,000.00	6,176,280.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,076,280.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	6,300,000.00	6,262,389.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,055,320.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,160,556.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,043,160.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,450,000.00	4,421,965.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,300,430.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,400,000.00	3,158,872.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,600,000.00	3,349,368.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	5,040,000.00	5,382,720.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,800,000.00	4,780,704.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,204,853.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	3,072,300.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,330,000.00	5,615,155.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	4,500,000.00	5,020,650.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,272,020.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,057,760.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,100,000.00	2,129,295.00	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,575,472.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,773,888.00	
DBR 2.25% 09/04/20	3,900,000.00	4,271,670.00	
DBR 2.25% 09/04/21	4,000,000.00	4,367,000.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,566,304.00	
DBR 2.5% 07/04/44	700,000.00	747,775.00	
DBR 3% 07/04/20	5,100,000.00	5,873,925.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,300,000.00	2,683,755.00	
DBR 3.25% 07/04/15	5,300,000.00	5,753,309.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,525,600.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,720,850.00	
DBR 3.5% 01/04/16	5,400,000.00	5,984,820.00	
DBR 3.5% 07/04/19	4,100,000.00	4,834,843.00	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,756,422.50	
DBR 3.75% 01/04/17	7,200,000.00	8,254,800.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,700,000.00	4,393,306.00	

DBR 4% 07/04/16	4,400,000.00	5,019,520.00	
DBR 4.0% 01/04/18	3,000,000.00	3,547,590.00	
DBR 4.0% 01/04/37	4,200,000.00	5,656,686.00	
DBR 4.25% 01/04/14	4,500,000.00	4,720,050.00	
DBR 4.25% 07/04/14	7,700,000.00	8,239,770.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,782,880.00	
DBR 4.25% 07/04/18	5,000,000.00	6,035,500.00	
DBR 4.25% 07/04/39	2,800,000.00	3,982,440.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,100,000.00	4,280,170.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,500,000.00	5,093,725.00	
DBR 4.75% 07/04/40	3,200,000.00	4,919,776.00	
DBR 5.5% 01/04/31	3,200,000.00	4,866,560.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,470,000.00	2,192,064.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	677,796.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,983,760.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,700,000.00	2,744,820.00	
DBR 6.5% 07/04/27	2,000,000.00	3,200,260.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,050,000.00	5,353,757.50	
FRTR 2.75% 10/25/27	700,000.00	709,401.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,500,000.00	7,046,520.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,401,000.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	7,200,000.00	7,902,216.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,607,745.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,542,112.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,359,360.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,650,000.00	6,286,077.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,910,995.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,600,000.00	7,607,292.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,200,000.00	7,147,670.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,391,108.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,100,000.00	4,751,080.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,700,000.00	3,236,760.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,600,000.00	1,924,448.00	
FRTR 4% 10/25/14	2,900,000.00	3,119,820.00	
FRTR 4% 10/25/38	5,000,000.00	5,892,500.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,000,000.00	7,095,480.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,692,137.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,050,000.00	3,594,577.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	7,600,000.00	9,082,000.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,400,000.00	4,346,560.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,200,000.00	4,141,600.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,010,000.00	7,049,008.80	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,480,000.00	6,134,150.40	

FRTR 5.75% 10/25/32	4,300,000.00	6,193,634.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,907,344.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,593,900.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,647,049.60	
IRISH 4% 01/15/14	550,000.00	564,784.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,700,000.00	1,700,340.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	1,500,000.00	1,601,700.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,000,000.00	3,958,920.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,000,000.00	1,024,100.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,126,700.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	2,050,000.00	2,091,574.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	400,000.00	438,232.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,250,000.00	1,353,600.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	2,300,000.00	2,336,455.00	
NETHER 1% 01/15/14	1,100,000.00	1,112,870.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	200,000.00	205,290.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,113,200.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,275,245.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	650,000.00	670,722.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,481,382.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,300,000.00	4,656,814.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,900,000.00	3,324,125.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,050,000.00	3,546,235.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,150,000.00	2,562,477.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	2,845,986.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,248,800.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,750,000.00	3,592,600.00	
NETHER 4% 07/15/16	3,100,000.00	3,511,928.00	
NETHER 4% 07/15/19	3,150,000.00	3,740,625.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,850,000.00	3,345,900.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,700,000.00	3,186,891.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	3,016,608.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,082,221.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,424,960.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,065,100.00	
OBL 1.75% 10/09/15	2,100,000.00	2,205,210.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,690,750.00	
OBL 2.25% 04/11/14	2,900,000.00	2,993,090.00	
OBL 2.5% 02/27/15	2,200,000.00	2,327,050.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,983,350.00	
OBL 2.75% 04/08/16	5,500,000.00	5,997,750.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	300,000.00	325,959.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,112,630.00	

RAGB 3.4% 10/20/14	800,000.00	851,944.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	750,000.00	858,750.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,000,000.00	3,267,450.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,693,920.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	400,000.00	466,440.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,850,000.00	3,361,717.50	
RAGB 4% 09/15/16	2,650,000.00	3,013,262.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,150,000.00	2,719,857.50	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,357,036.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	700,000.00	820,771.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,450,000.00	1,739,057.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,250,000.00	3,886,025.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,700,000.00	2,218,755.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,700,000.00	2,538,916.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	799,080.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	630,840.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	500,000.00	539,665.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,250,000.00	1,322,000.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,440,875.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	465,520.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,450,000.00	1,676,345.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,350,000.00	1,657,840.50	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,553,370.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,940,240.00	
SPGB 2.5% 10/31/13	2,300,000.00	2,298,045.00	
SPGB 3% 04/30/15	700,000.00	693,056.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	7,650,000.00	7,488,967.50	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	975,650.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,108,295.00	
SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,258,625.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,750,000.00	4,640,512.50	
SPGB 4% 04/30/20	4,700,000.00	4,316,715.00	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,600,414.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	2,900,000.00	2,793,425.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	2,021,656.00	
SPGB 4.25% 01/31/14	5,000,000.00	5,087,250.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	1,950,000.00	1,946,158.50	
SPGB 4.3% 10/31/19	1,600,000.00	1,516,960.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,000,000.00	7,174,650.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,300,000.00	3,207,864.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,800,000.00	1,548,234.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,800,000.00	1,378,710.00	
SPGB 4.75% 07/30/14	2,700,000.00	2,775,951.00	

	SPGB 4.8% 01/31/24	3,200,000.00	2,871,424.00	
	SPGB 4.85% 10/31/20	4,100,000.00	3,919,805.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,500,000.00	1,966,075.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,358,350.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	3,945,730.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,350,000.00	2,178,379.50	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	2,857,552.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,250,444.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	3,250,000.00	3,134,885.00	
	ユーロ小計	721,810,000.00	791,253,415.30 (80,019,457,889)	
	国債証券合計		201,791,758,266 (201,791,758,266)	
	合計		201,791,758,266 (201,791,758,266)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 131銘柄	100.0%	42.5%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.9%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 18銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 225銘柄	100.0%	39.7%

(注)組入債券時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する債券の比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,946,614,996
コール・ローン	35,984,673
株式	125,284,472,244
投資信託受益証券	78,161,853
投資証券	2,837,164,879
派生商品評価勘定	3,393,373
未収入金	1,894,332
未収配当金	222,876,697
未収利息	66
差入委託証拠金	644,372,057
流動資産合計	131,054,935,170
資産合計	131,054,935,170
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,191,052
未払解約金	54,156,953
流動負債合計	131,348,005
負債合計	131,348,005
純資産の部	
元本等	
元本	137,810,442,940
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,886,855,775
元本等合計	130,923,587,165
純資産合計	130,923,587,165
負債純資産合計	131,054,935,170

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年11月12日現在
--	---------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 計算期間の期首元本額	141,686,047,892円
計算期間中の追加設定元本額	23,016,109,425円
計算期間中の一部解約元本額	26,891,714,377円
計算日の元本額	137,810,442,940円



計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,020,263,508円
SBI資産設計オープン（分配型）	26,779,040円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,727,326,070円
世界経済インデックスファンド	743,949,624円
マイセレクション25	19,642,669円
マイセレクション50	70,050,854円
マイセレクション75	80,586,851円
外国株式インデックス・オープン	1,287,143,490円
DCマイセレクション25	1,071,070,393円
DCマイセレクション50	5,417,637,671円
DCマイセレクション75	5,251,717,964円
DC外国株式インデックス・オープン	5,360,078,730円
DCマイセレクションS25	307,217,933円
DCマイセレクションS50	1,507,213,387円
DCマイセレクションS75	1,016,443,705円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,198,733円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	139,785,364円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	130,564,802円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	52,789,857円
DC世界経済インデックスファンド	218,238,237円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	9,526,147,831円
マイセレクション50V A1（適格機関投資家専用）	254,146,570円
マイセレクション75V A1（適格機関投資家専用）	121,030,983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）	543,671,481円
マイセレクション50V A 2（適格機関投資家専用）	1,306,106円
バランス30V A 1（適格機関投資家専用）	1,337,675,559円
バランス50V A 1（適格機関投資家専用）	4,958,669,919円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,124,754,586円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,732,348,828円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,832,992,359円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,434,071,854円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	8,585,885,882円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	19,367,038,008円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,810,842,791円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,504,194,038円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,464,915,974円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	530,059,562円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,209,349,605円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	7,582,046,396円
外国株式ファンド・シリーズ1	6,674,345,588円
コア投資戦略ファンド（安定型）	459,460,943円
コア投資戦略ファンド（成長型）	298,789,195円

2. 計算日における受益権総数	137,810,442,940口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 6,886,855,775円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9500円 (9,500円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（株価変動リスク、為替変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (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. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	8,166,827,964	
投資信託受益証券	7,544,658	
投資証券	130,121,633	
合計	8,304,494,255	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,802,211,828	-	2,728,201,630	74,010,198
	合計	2,802,211,828	-	2,728,201,630	74,010,198

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## 通貨関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	10,336,196	-	10,335,000	1,196
	カナダドル	4,768,200	-	4,768,800	600
	スイスフラン	2,516,430	-	2,516,400	30
	ユーロ	9,109,115	-	9,101,700	7,415
	計	26,729,941	-	26,721,900	8,041
	売 建				
	アメリカドル	28,785,600	-	28,620,000	165,600
	イギリスポンド	5,110,560	-	5,055,600	54,960
	計	33,896,160	-	33,675,600	220,560
合計	60,626,101	-	60,397,500	212,519	

## (注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (3)附属明細表(平成24年11月12日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	35,894	70.65	2,535,911.10	
	APACHE CORP	27,878	78.56	2,190,095.68	
	BAKER HUGHES	31,782	40.71	1,293,845.22	
	CABOT OIL & GAS CORP	15,273	47.55	726,231.15	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,894	50.97	912,057.18	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	48,078	17.04	819,249.12	
	CHEVRON CORP	141,850	105.84	15,013,404.00	
	CIMAREX ENERGY CO	6,241	59.06	368,593.46	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	12,718	20.66	262,753.88	
	CONCHO RESOURCES INC	7,186	82.73	594,497.78	
	CONOCOPHILLIPS	86,433	55.67	4,811,725.11	

CONSOL ENERGY INC	16,065	32.95	529,341.75	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	69.94	218,282.74	
CORE LABORATORIES N.V.	3,400	97.52	331,568.00	
DENBURY RESOURCES INC	28,336	14.96	423,906.56	
DEVON ENERGY CORPORATION	27,854	53.83	1,499,380.82	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,048	65.04	328,321.92	
ENERGEN CORP	5,220	43.43	226,704.60	
ENSCO PLC-CL A	16,700	55.62	928,854.00	
EOG RESOURCES INC	19,375	114.52	2,218,825.00	
EQT CORPORATION	10,892	58.65	638,815.80	
EXXON MOBIL	336,371	87.21	29,334,914.91	
FMC TECHNOLOGIES INC	17,331	40.85	707,971.35	
HALLIBURTON CO	66,822	30.56	2,042,080.32	
HELMERICH & PAYNE	7,824	45.92	359,278.08	
HESS CORP	22,253	50.73	1,128,894.69	
HOLLYFRONTIER CORP	13,989	40.75	570,051.75	
KINDER MORGAN INC	40,746	32.58	1,327,504.68	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	7,243	73.74	534,098.82	
MARATHON OIL CORP	51,151	30.44	1,557,036.44	
MARATHON PETROLEUM CORP	24,537	53.12	1,303,405.44	
MURPHY OIL CORP	13,392	58.37	781,691.04	
NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	13.13	261,615.25	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,838	68.97	2,126,896.86	
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,799	25.19	246,836.81	
NOBLE CORP	18,267	35.24	643,729.08	
NOBLE ENERGY INC	12,810	95.01	1,217,078.10	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,376	76.65	4,474,520.40	
PEABODY ENERGY CORP	19,769	26.17	517,354.73	
PHILLIPS 66	42,766	47.41	2,027,536.06	
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,532	103.90	886,474.80	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,070	34.94	316,905.80	
QEP RESOURCES INC	12,861	28.55	367,181.55	
RANGE RESOURCES CORP	11,781	66.30	781,080.30	
ROWAN COMPANIES PLC	8,660	31.48	272,616.80	
SCHLUMBERGER	95,934	68.37	6,559,007.58	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	25,390	34.20	868,338.00	
SPECTRA ENERGY CORP	47,282	27.44	1,297,418.08	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,100	19.47	216,117.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	11,111	21.54	239,330.94	
VALERO ENERGY CORP	40,323	29.59	1,193,157.57	
WEATHERFORD INTL LTD	55,109	10.75	592,421.75	
WHITING PETROLEUM CORP	8,534	44.02	375,666.68	
WILLIAMS COS	45,008	32.07	1,443,406.56	

AIR PRODUCTS&CHEMICALS	15,272	79.73	1,217,636.56	
AIRGAS INC	4,822	88.01	424,384.22	
ALBEMARLE CORP	6,300	54.21	341,523.00	
ALCOA	77,459	8.43	652,979.37	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,356	26.77	196,920.12	
BALL CORP	10,706	43.85	469,458.10	
CELANESE CORP-SERIES A	11,037	38.50	424,924.50	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,672	196.04	915,898.88	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,062	36.44	366,659.28	
CROWN HOLDINGS INC	10,807	37.63	406,667.41	
DOW CHEMICAL CO	86,115	29.36	2,528,336.40	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	67,673	43.34	2,932,947.82	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,033	57.53	634,728.49	
ECOLAB INC	21,169	69.87	1,479,078.03	
FMC CORP	10,160	53.22	540,715.20	
FREEMONT-MCMOR-B	68,277	38.35	2,618,422.95	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,909	62.59	369,844.31	
INT'L PAPER CO	30,161	34.85	1,051,110.85	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,904	50.85	1,164,668.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,355	86.13	288,966.15	
MEADWESTVACO CORP	12,416	29.52	366,520.32	
MONSANTO CO	38,397	86.43	3,318,652.71	
MOSAIC CO/THE	21,552	51.57	1,111,436.64	
NEWMONT MINING CORP	35,983	48.07	1,729,702.81	
NUCOR CORP	22,975	40.54	931,406.50	
OWENS-ILLINOIS INC	10,981	19.19	210,725.39	
PPG INDUSTRIES INC	11,025	117.38	1,294,114.50	
PRAXAIR INC	21,442	107.40	2,302,870.80	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,115	63.58	325,211.70	
SEALED AIR CORP	13,274	16.68	221,410.32	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,297	140.84	886,869.48	
SIGMA-ALDRICH	8,552	69.56	594,877.12	
UNITED STATES STEEL CORP	10,928	21.10	230,580.80	
VULCAN MATERIALS CO	9,355	46.34	433,510.70	
WALTER ENERGY INC	4,175	33.10	138,192.50	
3 M COMPANY	47,415	88.81	4,210,926.15	
AGCO CORP	6,928	44.32	307,048.96	
AMETEK INC	17,456	36.04	629,114.24	
BOEING CO	51,408	73.25	3,765,636.00	
CATERPILLAR	47,033	84.95	3,995,453.35	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	11,471	76.37	876,040.27	
CUMMINS INC	13,249	97.10	1,286,477.90	
DANAHER CORP	42,505	52.02	2,211,110.10	

DEERE&CO	27,175	84.29	2,290,580.75
DOVER CORP	13,294	60.46	803,755.24
EATON CORP	23,127	49.05	1,134,379.35
EMERSON ELECTRIC CO	52,792	50.15	2,647,518.80
FASTENAL CO	20,350	42.31	861,008.50
FLOWSERVE CORP	3,850	135.27	520,789.50
FLUOR CORP	11,944	52.16	622,999.04
GENERAL DYNAMICS CORP	22,038	64.45	1,420,349.10
GENERAL ELECTRIC CO	762,159	21.00	16,005,339.00
GRAINGER (WW) INC	4,264	194.61	829,817.04
HONEYWELL INTL INC	53,530	60.83	3,256,229.90
ILLINOIS TOOL WORKS	30,875	60.44	1,866,085.00
INGERSOLL-RAND PLC	21,572	45.86	989,291.92
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,367	39.00	365,313.00
JOY GLOBAL INC	7,782	57.56	447,931.92
KBR INC	10,314	26.95	277,962.30
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,220	74.47	537,673.40
LOCKHEED MARTIN CORP	20,089	89.98	1,807,608.22
MASCO CORP	26,116	15.29	399,313.64
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,396	65.60	1,141,177.60
PACCAR INC	24,655	43.01	1,060,411.55
PALL CORP	8,379	59.13	495,450.27
PARKER HANNIFIN CORP	11,001	79.09	870,069.09
PENTAIR LTD	14,875	44.41	660,598.75
PRECISION CASTPARTS CORP	10,540	171.33	1,805,818.20
QUANTA SERVICES INC	15,088	26.09	393,645.92
RAYTHEON COMPANY	23,940	56.06	1,342,076.40
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,389	77.12	801,199.68
ROCKWELL COLLIN	9,886	53.58	529,691.88
ROPER INDUSTRIES INC	7,050	108.60	765,630.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	28.21	174,902.00
SPX CORP	3,711	66.24	245,816.64
STANLEY BLACK&DECKER	11,728	68.73	806,065.44
TEXTRON	20,275	23.86	483,761.50
TRANSDIGM GROUP INC	3,400	137.32	466,888.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	62,252	75.84	4,721,191.68
URS CORP	5,746	35.07	201,512.22
XYLEM INC	13,023	24.71	321,798.33
ADT CORPORATION	16,744	43.06	720,996.64
AVERY DENNISON CORP	7,757	32.98	255,825.86
CINTAS CORP	8,506	40.65	345,768.90
DUN & BRADSTREET CORP	3,250	81.33	264,322.50
EQUIFAX INC	8,390	50.37	422,604.30

IHS INC-CLASS A	4,025	88.26	355,246.50	
IRON MOUNTAIN INC	9,646	34.20	329,893.20	
MANPOWER GROUP	5,455	36.43	198,725.65	
NIELSEN HOLDINGS NV	8,925	28.79	256,950.75	
PITNEY BOWES INC	14,548	11.90	173,121.20	
REPUBLIC SERVICES INC	22,810	26.75	610,167.50	
ROBERT HALF INTL INC	9,411	26.74	251,650.14	
STERICYCLE INC	6,006	92.41	555,014.46	
TYCO INTERNATIONAL LTD	33,488	27.56	922,929.28	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,132	49.07	497,177.24	
WASTE MANAGEMENT INC	31,839	31.82	1,013,116.98	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,877	61.48	730,197.96	
CSX CORP	74,699	19.88	1,485,016.12	
DELTA AIR LINES INC	15,452	10.19	157,455.88	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,376	36.73	564,760.48	
FEDEX CORP	21,649	89.73	1,942,564.77	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	14.34	268,831.98	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,771	58.66	397,186.86	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,011	76.91	616,126.01	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,431	58.00	1,358,998.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	9.06	117,662.22	
UNION PACIFIC CORP	34,398	120.25	4,136,359.50	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	21.05	113,480.55	
UNITED PARCEL SERVICE B	52,181	72.25	3,770,077.25	
AUTOLIV INC	6,506	56.67	368,695.02	
BORGWARNER INC	8,264	63.23	522,532.72	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	22,500	32.25	725,625.00	
FORD MOTOR COMPANY	257,914	10.93	2,819,000.02	
GENERAL MOTORS CO	56,968	25.04	1,426,478.72	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,889	11.53	206,260.17	
HARLEY-DAVIDSON	16,785	45.29	760,192.65	
JOHNSON CONTROLS INC	49,533	25.52	1,264,082.16	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,654	47.23	361,498.42	
COACH INC	20,973	53.86	1,129,605.78	
DR HORTON INC	20,778	20.60	428,026.80	
FOSSIL INC	3,699	80.72	298,583.28	
GARMIN LTD	8,514	37.01	315,103.14	
HASBRO INC	8,070	37.22	300,365.40	
LEGGETT & PLATT INC	9,883	26.72	264,073.76	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,282	67.73	493,209.86	
MATTEL INC	24,713	35.98	889,173.74	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,220	84.53	356,716.60	
NEWELL RUBBERMAID	21,025	20.34	427,648.50	



NIKE B	26,811	92.31	2,474,923.41
PVH CORP	4,900	108.88	533,512.00
RALPH LAUREN CORPORATION	4,511	151.27	682,378.97
TOLL BROTHERS INC	10,462	31.99	334,679.38
VF CORP	6,422	152.93	982,116.46
WHIRLPOOL CORP	5,627	96.61	543,624.47
APOLLO GROUP INC-CLA	8,140	18.75	152,625.00
BLOCK H & R INC	20,508	17.77	364,427.16
CARNIVAL CORPORATION	32,551	39.16	1,274,697.16
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,299	259.52	596,636.48
DARDEN RESTAURANTS INC	9,164	51.61	472,954.04
INT'L GAME TECHNOLOGY	21,660	13.50	292,410.00
LAS VEGAS SANDS CORP	29,372	43.50	1,277,682.00
MARRIOTT INTL A	19,482	35.54	692,390.28
MCDONALD'S CORP	73,227	84.74	6,205,255.98
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,272	34.44	353,767.68
STARBUCKS CORP	54,894	50.96	2,797,398.24
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,301	51.75	740,076.75
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	10,700	51.37	549,659.00
WYNN RESORTS LTD	5,848	108.35	633,630.80
YUM BRANDS INC	33,485	71.97	2,409,915.45
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,601	14.79	201,158.79
CBS CORP-CL B	44,078	34.88	1,537,440.64
CHARTER COMMUNICATION-A	2,800	68.72	192,416.00
COMCAST CORP-CL A	152,549	36.12	5,510,069.88
COMCAST CORP-SPECIAL A	41,598	35.10	1,460,089.80
DIRECTV	47,223	48.83	2,305,899.09
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,066	56.45	568,225.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	7,403	52.55	389,027.65
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,229	35.86	546,111.94
INTERPUBLIC GROUP OF COS	32,060	9.96	319,317.60
LIBERTY GLOBAL INC-A	10,034	57.83	580,266.22
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,461	54.07	457,486.27
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	7,586	106.02	804,267.72
MCGRAW-HILL COS	18,178	50.77	922,897.06
NEWS CORP -CLASS A	117,002	24.42	2,857,188.84
NEWS CORP -CLASS B	31,956	24.74	790,591.44
OMNICOM GROUP	19,903	47.01	935,640.03
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,475	60.10	389,147.50
SIRIUS XM RADIO INC	265,155	2.75	729,176.25
THE WALT DISNEY CO	122,467	47.06	5,763,297.02
TIME WARNER CABLE-A	22,503	93.10	2,095,029.30
TIME WARNER INC	69,229	44.67	3,092,459.43

VIACOM INC-CLASS B	34,389	49.16	1,690,563.24
VIRGIN MEDIA INC	19,009	31.96	607,527.64
WASHINGTON POST -CL B	351	339.23	119,069.73
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,225	31.52	196,212.00
ADVANCE AUTO PARTS	5,336	78.41	418,395.76
AMAZON.COM	26,000	226.31	5,884,060.00
AUTOZONE INC	2,505	376.89	944,109.45
BED BATH & BEYOND INC	16,808	57.08	959,400.64
BEST BUY COMPANY INC	21,408	15.30	327,542.40
CARMAX INC	16,087	34.04	547,601.48
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,800	49.35	335,580.00
DOLLAR GENERAL CORP	15,736	46.99	739,434.64
DOLLAR TREE INC	16,766	37.74	632,748.84
EXPEDIA INC	6,577	57.74	379,755.98
FAMILY DOLLAR STORES	7,337	66.50	487,910.50
GAMESTOP CORP-CLASS A	9,282	22.11	205,225.02
GAP	23,065	33.62	775,445.30
GENUINE PARTS CO	11,340	61.78	700,585.20
HOME DEPOT	110,393	60.96	6,729,557.28
J.C. PENNEY CO INC	11,122	20.64	229,558.08
KOHL'S CORP	16,448	51.66	849,703.68
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	38,140	19.98	762,037.20
LIMITED	18,307	46.48	850,909.36
LOWES COMPANIES	84,843	31.47	2,670,009.21
MACY'S INC	30,110	38.93	1,172,182.30
NETFLIX INC	3,854	77.90	300,226.60
NORDSTROM INC	12,073	54.79	661,479.67
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,307	89.27	830,835.89
PETSMART INC	7,860	65.99	518,681.40
PRICELINE.COM INC	3,639	625.87	2,277,540.93
ROSS STORES INC	16,306	55.22	900,417.32
SEARS CANADA INC	1,300	12.28	15,967.64
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,037	62.51	189,842.87
STAPLES INC	50,510	11.15	563,186.50
TARGET (DAYTON HUDSON)	45,292	62.02	2,809,009.84
TIFFANY & CO	9,010	60.99	549,519.90
TJX COMPANIES INC	53,390	40.73	2,174,574.70
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,100	92.20	470,220.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,200	88.34	371,028.00
URBAN OUTFITTERS INC	8,259	35.31	291,625.29
COSTCO WHOLESALE CORP	31,175	95.46	2,975,965.50
CVS CAREMARK CORPORATION	92,226	46.36	4,275,597.36
KROGER CO	38,329	24.70	946,726.30

SAFEWAY INC	17,252	16.60	286,383.20
SYSCO CORP	42,441	30.00	1,273,230.00
WALGREEN CO	62,093	32.66	2,027,957.38
WAL-MART STORES	133,842	72.31	9,678,115.02
WHOLE FOODS MKT INC	12,601	91.57	1,153,873.57
ALTRIA GROUP INC	146,391	31.48	4,608,388.68
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,061	25.39	1,220,268.79
BEAM INC	9,955	54.50	542,547.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,652	64.15	555,025.80
BUNGE LIMITED	10,331	71.49	738,563.19
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,847	35.48	491,291.56
COCA-COLA CO	292,136	36.29	10,601,615.44
COCA-COLA ENTERPRISES	21,620	30.33	655,734.60
CONAGRA	29,113	27.77	808,468.01
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,392	35.42	438,924.64
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	43.51	646,341.05
GENERAL MILLS INC	46,821	39.37	1,843,342.77
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,107	23.81	216,837.67
HEINZ (H.J) CO	23,211	57.47	1,333,936.17
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,998	70.35	773,709.30
HORMEL FOODS CORP	9,753	29.61	288,786.33
JM SMUCKER CO	8,011	84.33	675,567.63
KELLOGG CO	17,609	53.48	941,729.32
KRAFT FOODS GROUP INC	40,372	43.66	1,762,641.52
LORILLARD INC	9,427	112.59	1,061,385.93
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,331	62.00	516,522.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,410	65.70	946,737.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,947	41.18	450,797.46
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,118	26.02	3,151,490.36
MONSTER BEVERAGE CORP	10,498	45.26	475,139.48
PEPSICO INC	112,529	68.85	7,747,621.65
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,734	85.42	10,483,938.28
RALCORP HOLDINGS INC	3,686	70.98	261,632.28
REYNOLDS AMERICAN INC	25,084	41.39	1,038,226.76
TYSON FOODS INC	20,771	16.81	349,160.51
AVON PRODUCTS INC	30,401	14.28	434,126.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,912	50.76	503,133.12
CLOROX COMPANY	8,819	72.78	641,846.82
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,360	103.87	3,568,973.20
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,636	76.22	353,355.92
ESTEE LAUDER CO-CL A	17,091	57.49	982,561.59
HERBALIFE LTD	8,060	46.26	372,855.60
KIMBERLY-CLARK CORP	28,249	83.13	2,348,339.37

PROCTER & GAMBLE CO	197,052	67.01	13,204,454.52	
AETNA INC	25,423	42.12	1,070,816.76	
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,173	40.47	735,461.31	
BARD C R INC	5,844	94.73	553,602.12	
BAXTER INTERNATIONAL	40,000	64.27	2,570,800.00	
BECTON DICKINSON & CO	14,568	75.23	1,095,950.64	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	105,353	5.15	542,567.95	
CARDINAL HEALTH	25,100	40.00	1,004,000.00	
CAREFUSION CORP	16,318	27.05	441,401.90	
CERNER CORP	10,427	78.59	819,457.93	
CIGNA CORP	20,786	51.65	1,073,596.90	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	9,997	42.91	428,971.27	
COVIDIEN PLC	34,655	55.59	1,926,471.45	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	6,779	112.43	762,162.97	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,064	38.68	389,275.52	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,327	87.70	730,277.90	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	58,003	53.35	3,094,460.05	
HCA HOLDINGS INC	12,675	32.62	413,458.50	
HENRY SCHEIN INC	6,541	77.10	504,311.10	
HOLOGIC INC	19,192	20.32	389,981.44	
HUMANA INC	11,932	68.77	820,563.64	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,807	529.60	1,486,587.20	
LABORATORY CRP OF AMER	7,026	84.44	593,275.44	
MCKESSON CORP	16,918	92.94	1,572,358.92	
MEDTRONIC	74,602	41.16	3,070,618.32	
OMNICARE INC	8,245	34.17	281,731.65	
PATTERSON COMPANIES INC	6,826	34.24	233,722.24	
QUEST DIAGNOSTICS	11,548	57.17	660,199.16	
ST JUDE MEDICAL INC	22,527	37.01	833,724.27	
STRYKER CORP	22,089	52.53	1,160,335.17	
UNITED HEALTHCARE CORP	74,674	52.90	3,950,254.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,199	68.84	564,419.16	
WELLPOINT INC	23,758	56.16	1,334,249.28	
ZIMMER HOLDINGS INC	12,980	64.69	839,676.20	
ABBOTT LABORATORIES	113,153	64.84	7,336,840.52	
AGILENT TECHNOLOGIES	25,215	36.91	930,685.65	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,779	90.80	1,251,133.20	
ALLERGAN INC	22,094	90.44	1,998,181.36	
AMGEN	55,953	85.17	4,765,517.01	
BIOGEN IDEC INC	16,429	138.05	2,268,023.45	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,496	32.23	3,915,816.08	
CELGENE CORP	31,881	71.50	2,279,491.50	
FOREST LABORATORIES INC	19,262	33.15	638,535.30	

GILEAD SCIENCES INC	54,521	65.01	3,544,410.21	
HOSPIRA INC	12,012	29.95	359,759.40	
ILLUMINA INC	8,915	48.83	435,319.45	
JOHNSON & JOHNSON	197,498	69.87	13,799,185.26	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,615	46.39	585,209.85	
LILLY (ELI) & CO	75,167	47.47	3,568,177.49	
MERCK & CO	218,783	44.05	9,637,391.15	
MYLAN INC	31,016	25.87	802,383.92	
PERRIGO CO	6,408	105.57	676,492.56	
PFIZER	538,647	24.17	13,019,097.99	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,400	140.74	759,996.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26,592	60.69	1,613,868.48	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,245	45.01	686,177.45	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	12,303	11.67	143,576.01	
WATERS CORP	6,509	82.97	540,051.73	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	9,211	85.11	783,948.21	
BB&T CORP	50,609	27.55	1,394,277.95	
CIT GROUP INC	13,444	36.90	496,083.60	
COMERICA INC	14,367	28.44	408,597.48	
FIFTH THIRD BANCORP	66,796	14.16	945,831.36	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,400	33.89	216,896.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	8.03	264,596.53	
KEY CORP	67,310	8.29	557,999.90	
M & T BANK CORP	8,259	99.09	818,384.31	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,808	12.89	410,005.12	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	24,989	11.60	289,872.40	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,276	56.26	2,153,407.76	
REGIONS FINL CORP	102,530	6.45	661,318.50	
SUNTRUST BANKS	38,903	26.56	1,033,263.68	
US BANCORP	136,295	32.10	4,375,069.50	
WELLS FARGO & CO	363,156	32.35	11,748,096.60	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,700	125.57	464,609.00	
AMERICAN EXPRESS	74,491	55.83	4,158,832.53	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,727	58.05	912,952.35	
BANK NEW YORK CO	85,776	24.11	2,068,059.36	
BANK OF AMERICA CORP	775,179	9.43	7,309,937.97	
BLACKROCK INC	9,573	186.83	1,788,523.59	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,618	58.37	2,195,762.66	
CITIGROUP	210,878	35.93	7,576,846.54	
CME GROUP INC	22,685	54.31	1,232,022.35	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,448	41.08	1,579,443.84	
EATON VANCE CORP	7,818	28.64	223,907.52	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,821	128.90	1,394,826.90	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,570	116.15	3,899,155.50	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,158	130.30	672,087.40	
INVESCO LTD	32,353	23.90	773,236.70	
JPMORGAN CHASE & CO	273,850	40.62	11,123,787.00	
LEGG MASON INC	9,201	25.00	230,025.00	
LEUCADIA NATIONAL CORP	14,405	21.80	314,029.00	
MOODY'S CORP	14,544	45.87	667,133.28	
MORGAN STANLEY	107,749	16.61	1,789,710.89	
NASDAQ OMX GROUP	9,473	23.59	223,468.07	
NORTHERN TRUST CORP	15,802	46.64	737,005.28	
NYSE EURONEXT	18,717	22.95	429,555.15	
PRICE T ROWE GROUP INC	18,391	63.36	1,165,253.76	
SCHWAB (CHARLES) CORP	78,474	13.06	1,024,870.44	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	21.46	222,089.54	
SLM CORP	35,251	16.85	593,979.35	
STATE STREET CORP	35,392	44.31	1,568,219.52	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,221	15.54	236,534.34	
ACE LTD	24,520	78.15	1,916,238.00	
AFLAC	33,909	49.62	1,682,564.58	
ALLEGHANY CORP	880	330.22	290,593.60	
ALLSTATE CORP	35,288	38.73	1,366,704.24	
AMERICAN INT'L GROUP	79,672	32.17	2,563,048.24	
AON PLC	22,453	55.63	1,249,060.39	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,772	42.70	417,264.40	
ASSURANT INC	6,382	36.64	233,836.48	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,295	35.19	291,901.05	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	66,151	85.18	5,634,742.18	
CHUBB CORPORATION	19,392	74.75	1,449,552.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,169	39.10	436,707.90	
EVEREST RE GROUP LTD	3,922	105.48	413,692.56	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,773	22.88	338,006.24	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	32,823	5.61	184,137.03	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,412	20.81	632,873.72	
LINCOLN NATIONAL CORP	20,903	23.57	492,683.71	
LOEWS CORP	23,011	41.13	946,442.43	
MARSH & MCLENNAN COS	39,468	34.16	1,348,226.88	
METLIFE INC	61,613	32.02	1,972,848.26	
PARTNERRE LTD	4,703	79.49	373,841.47	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,845	26.60	581,077.00	
PROGRESSIVE CORP	42,171	22.35	942,521.85	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,624	52.71	1,772,321.04	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	78.54	288,398.88	
TORCHMARK CORP	7,064	50.22	354,754.08	

TRAVELERS COS INC/THE	27,998	68.98	1,931,302.04	
UNUM GROUP	21,059	19.66	414,019.94	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	12,323	33.87	417,380.01	
WR BERKLEY CORP	8,075	38.93	314,359.75	
XL GROUP PLC	22,876	24.00	549,024.00	
CBRE GROUP INC-A	22,035	17.50	385,612.50	
WEYERHAEUSER CO	38,964	26.31	1,025,142.84	
ACCENTURE PLC-CL A	46,351	65.81	3,050,359.31	
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,726	10.66	338,199.16	
ADOBE SYSTEMS INC	35,821	32.90	1,178,510.90	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,433	36.40	452,561.20	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,662	142.32	521,175.84	
ANSYS INC	6,600	67.56	445,896.00	
AUTODESK INC	16,451	30.94	508,993.94	
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,174	55.30	1,945,122.20	
BMC SOFTWARE	11,793	40.24	474,550.32	
CA INC	23,790	22.21	528,375.90	
CITRIX SYSTEMS INC	13,469	60.17	810,429.73	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,999	66.00	1,451,934.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	11,267	35.22	396,823.74	
EBAY	83,580	47.73	3,989,273.40	
ELECTRONIC ARTS INC	24,059	12.89	310,120.51	
EQUINIX INC	3,400	175.30	596,020.00	
FACEBOOK INC-A	32,300	19.21	620,483.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,601	34.52	573,066.52	
FISERV INC	9,818	73.91	725,648.38	
GOOGLE INC-CL A	18,716	663.03	12,409,269.48	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,802	189.64	14,944,011.28	
INTUIT INC	20,301	59.96	1,217,247.96	
LINKEDIN CORP - A	4,500	95.62	430,290.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	7,803	464.66	3,625,741.98	
MICROSOFT CORP	543,891	28.83	15,680,377.53	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,387	21.15	367,735.05	
ORACLE CORP	286,324	30.35	8,689,933.40	
PAYCHEX INC	23,706	32.16	762,384.96	
RACKSPACE HOSTING INC	7,600	60.48	459,648.00	
RED HAT INC	13,993	48.34	676,421.62	
SAIC INC	19,851	10.98	217,963.98	
SALESFORCE.COM INC	9,338	141.14	1,317,965.32	
SYMANTEC CORP	51,886	17.97	932,391.42	
SYNOPSYS INC	10,482	31.96	335,004.72	
TERADATA CORP	12,192	63.33	772,119.36	

TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	22.02	251,622.54	
VERIFONE SYSTEMS INC	7,500	31.24	234,300.00	
VERISIGN INC	11,271	41.48	467,521.08	
VISA INC-CLASS A SHARES	37,969	142.93	5,426,909.17	
VMWARE INC-CLASS A	5,918	87.59	518,357.62	
WESTERN UNION CO	45,095	12.35	556,923.25	
YAHOO	83,779	17.26	1,446,025.54	
AMPHENOL CORPORATION	11,881	61.04	725,216.24	
APPLE INC	67,300	547.06	36,817,138.00	
ARROW ELECTRONICS INC	7,742	36.88	285,524.96	
AVNET INC	10,281	29.64	304,728.84	
CISCO SYSTEMS	385,328	16.82	6,481,216.96	
CORNING	110,475	11.34	1,252,786.50	
DELL INC	106,902	9.40	1,004,878.80	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	32.74	116,980.02	
EMC CORP	150,991	24.22	3,657,002.02	
F5 NETWORKS INC	5,614	87.93	493,639.02	
FLEXTRONICS INTL LTD	49,418	5.99	296,013.82	
FLIR SYSTEMS INC	10,809	19.36	209,262.24	
HARRIS CORP	8,024	48.65	390,367.60	
HEWLETT-PACKARD CO	142,248	13.61	1,935,995.28	
JUNIPER NETWORKS INC	38,269	17.65	675,447.85	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,900	53.11	1,003,779.00	
NETAPP INC	26,032	27.34	711,714.88	
QUALCOMM	123,290	61.62	7,597,129.80	
SANDISK CORP	17,566	41.23	724,246.18	
SEAGATE TECHNOLOGY	27,572	29.06	801,242.32	
TE CONNECTIVITY LTD	30,979	34.09	1,056,074.11	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	8,800	52.90	465,520.00	
WESTERN DIGITAL CORP	16,631	35.11	583,914.41	
XEROX CORP	96,738	6.34	613,318.92	
AT&T INC	424,819	33.54	14,248,429.26	
CENTURYLINK INC	45,311	38.81	1,758,519.91	
CROWN CASTLE INTL CORP	21,214	66.83	1,417,731.62	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	72,707	4.35	316,275.45	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	21,951	10.16	223,022.16	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,748	67.23	588,128.04	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	219,202	5.55	1,216,571.10	
VERIZON COMMUNICATIONS	205,901	42.64	8,779,618.64	
WINDSTREAM CORP	42,903	8.50	364,675.50	
AES CORP	47,307	9.96	471,177.72	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,020	43.70	350,474.00	
AMEREN CORPORATION	17,596	30.36	534,214.56	



AMERICAN ELECTRIC POWER	35,087	41.80	1,466,636.60	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,762	36.55	466,451.10	
CALPINE CORP	22,701	17.43	395,678.43	
CENTERPOINT ENERGY INC	29,354	20.15	591,483.10	
CMS ENERGY CORP	18,200	23.00	418,600.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,283	55.74	1,186,314.42	
DOMINION RESOURCES	41,384	49.33	2,041,472.72	
DTE ENERGY COMPANY	12,316	59.19	728,984.04	
DUKE ENERGY CORP	50,669	61.96	3,139,451.24	
EDISON INTL	22,494	44.17	993,559.98	
ENTERGY CORP	12,875	64.90	835,587.50	
EXELON CORP	61,824	31.11	1,923,344.64	
FIRSTENERGY CORP	30,362	42.48	1,289,777.76	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,734	52.00	298,168.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	12,623	20.00	252,460.00	
NEXTERA ENERGY INC	28,738	67.38	1,936,366.44	
NISOURCE INC	20,479	24.30	497,639.70	
NORTHEAST UTILITIES	22,753	38.14	867,799.42	
NRG ENERGY INC	15,935	20.53	327,145.55	
ONEOK INC	14,358	44.92	644,961.36	
PEPCO HOLDINGS INC	16,574	19.05	315,734.70	
PG&E CORP	29,937	40.89	1,224,123.93	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,900	49.36	389,944.00	
PPL CORPORATION	42,065	28.68	1,206,424.20	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	36,725	29.90	1,098,077.50	
SCANA CORP	8,735	46.46	405,828.10	
SEMPRA ENERGY	16,532	65.79	1,087,640.28	
SOUTHERN CO	62,628	43.03	2,694,882.84	
WISCONSIN ENERGY CORP	16,762	36.32	608,795.84	
XCEL ENERGY INC	35,324	26.50	936,086.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	43,107	2.03	87,507.21	
ALTERA CORPORATION	23,453	30.64	718,599.92	
ANALOG DEVICES	21,622	40.28	870,934.16	
APPLIED MATERIALS	93,789	10.67	1,000,728.63	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,810	33.48	562,798.80	
BROADCOM CORP-CL A	35,694	30.61	1,092,593.34	
CREE INC	7,602	31.18	237,030.36	
INTEL CORP	361,849	20.80	7,526,459.20	
KLA-TENCOR CORP	12,143	46.24	561,492.32	
LAM RESEARCH CORP	14,184	36.43	516,723.12	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,628	32.48	540,077.44	
LSI CORP	39,045	6.74	263,163.30	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	36,022	7.77	279,890.94	

	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,204	28.39	601,981.56	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,579	30.62	415,788.98	
	MICRON TECHNOLOGY	69,687	5.62	391,640.94	
	NVIDIA CORP	44,313	12.19	540,175.47	
	TEXAS INSTRUMENTS	82,297	29.51	2,428,584.47	
	XILINX INC	19,048	33.59	639,822.32	
	アメリカドル小計	21,817,449		910,537,158.28 (72,396,809,454)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	20,964	23.11	484,478.04	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	22,554	11.21	252,830.34	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,644	43.23	373,680.12	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,461	16.35	171,037.35	
	CAMECO CORP	28,691	17.54	503,240.14	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,600	28.48	2,267,008.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	35,193	20.62	725,679.66	
	CENOVUS ENERGY INC	54,778	33.79	1,850,948.62	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,815	38.20	871,533.00	
	ENBRIDGE	53,992	39.37	2,125,665.04	
	ENCANA CORP	53,367	20.83	1,111,634.61	
	ENERPLUS CORP	13,454	12.84	172,749.36	
	HUSKY ENERGY INC	24,507	27.76	680,314.32	
	IMPERIAL OIL	21,536	44.97	968,473.92	
	MEG ENERGY CORP	9,188	35.65	327,552.20	
	NEXEN INC	38,395	24.02	922,247.90	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	21,259	22.95	487,894.05	
	PEMBINA PIPELINE CORP	20,722	27.37	567,161.14	
	PENGROWTH ENERGY CORP	36,075	5.39	194,444.25	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	34,312	10.70	367,138.40	
	PRECISION DRILLING CORP	15,689	7.07	110,921.23	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	13,474	19.60	264,090.40	
	SUNCOR ENERGY	112,257	33.26	3,733,667.82	
	TALISMAN ENERGY INC	74,847	11.18	836,789.46	
	TOURMALINE OIL CORP	8,840	32.21	284,736.40	
	TRANSCANADA CORP	50,616	44.80	2,267,596.80	
	VERMILION ENERGY INC	6,614	47.02	310,990.28	
	AGNICO-EAGLE MINES	12,112	55.67	674,275.04	
	AGRIUM INC	11,452	96.07	1,100,193.64	
	BARRICK GOLD CORP	71,966	36.09	2,597,252.94	
	CENTERRA GOLD INC	11,462	10.60	121,497.20	
	ELDORADO GOLD CORP	48,974	14.92	730,692.08	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	34,545	22.20	766,899.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,027	59.25	594,099.75	
	GOLDCORP INC	58,238	44.28	2,578,778.64	

IAMGOLD CORP	27,343	15.40	421,082.20
INMET MINING CORPORATION	3,603	55.31	199,281.93
KINROSS GOLD CORP	82,648	10.32	852,927.36
NEW GOLD INC	32,614	10.70	348,969.80
OSISKO MINING CORP	27,237	9.82	267,467.34
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,864	20.38	221,408.32
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,764	39.04	2,411,266.56
SILVER WHEATON CORP	25,635	40.44	1,036,679.40
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,878	32.81	1,374,017.18
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	29,054	8.38	243,472.52
YAMANA GOLD INC	54,154	20.14	1,090,661.56
BOMBARDIER B	101,578	3.43	348,412.54
CAE INC	18,721	9.96	186,461.16
FINNING INTERNATIONAL INC	12,488	23.00	287,224.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,986	40.85	448,778.10
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,399	21.45	137,258.55
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,542	86.38	2,724,597.96
CP RAILWAY LIMITED	12,345	90.10	1,112,284.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,095	44.96	723,631.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,436	33.09	279,147.24
TIM HORTONS INC	11,422	46.98	536,605.56
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,332	21.53	588,457.96
THOMSON REUTERS CORP	27,176	27.89	757,938.64
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,533	69.81	386,258.73
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,661	48.06	416,247.66
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	56.50	118,198.00
LOBLAW COMPANIES LTD	8,209	33.93	278,531.37
METRO INC	7,126	57.63	410,671.38
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,465	41.06	634,992.90
WESTON (GEORGE) LTD	3,577	64.13	229,393.01
SAPUTO INC	9,389	43.90	412,177.10
VITERRA INC	22,351	15.77	352,475.27
CATAMARAN CORPORATION	14,000	48.18	674,520.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	21,132	54.02	1,141,550.64
BANK MONTREAL	46,523	58.57	2,724,852.11
BANK NOVA SCOTIA	79,142	53.80	4,257,839.60
CANADIAN IMPERIAL BANK	29,282	78.35	2,294,244.70
NATIONAL BANK OF CANADA	11,725	76.39	895,672.75
ROYAL BANK OF CANADA	103,567	55.85	5,784,216.95
TORONTO-DOMINION BANK	65,437	80.06	5,238,886.22
CI FINANCIAL CORP	10,864	23.17	251,718.88
IGM FINANCIAL INC	7,746	39.34	304,727.64

	ONEX CORP	6,404	40.45	259,041.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,428	362.45	517,578.60	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	20,147	23.29	469,223.63	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	27.96	171,870.12	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,362	62.50	585,125.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	12.18	1,593,363.24	
	POWER CORP OF CANADA	25,360	24.65	625,124.00	
	POWER FINANCIAL CORP	17,970	26.03	467,759.10	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	42,674	26.14	1,115,498.36	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	40,721	33.85	1,378,405.85	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	19,531	16.02	312,886.62	
	CGI GROUP INC - CL A	16,349	24.34	397,934.66	
	OPEN TEXT CORP	3,975	52.27	207,773.25	
	RESEARCH IN MOTION	33,341	8.56	285,398.96	
	BCE INC	18,738	42.62	798,613.56	
	BELL ALIANT INC	5,225	27.02	141,179.50	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	28,690	43.52	1,248,588.80	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	10,827	63.96	692,494.92	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	4,032	64.80	261,273.60	
	FORTIS INC	13,703	33.80	463,161.40	
	TRANSALTA CORP	15,821	15.44	244,276.24	
	カナダドル小計	2,776,018		88,039,968.84 (6,998,297,123)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	17.67	174,314.55	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	78,881	10.42	821,940.02	
	SANTOS	68,592	11.27	773,031.84	
	WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	2.88	95,356.80	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,807	34.21	1,601,267.47	
	WORLEYPARSONS LTD	14,513	25.06	363,695.78	
	ALUMINA LIMITED	163,150	0.86	140,309.00	
	AMCOR	87,631	7.90	692,284.90	
	BHP BILLITON LTD	231,943	34.46	7,992,755.78	
	BORAL LIMITED	54,086	3.77	203,904.22	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,757	3.93	399,905.01	
	ILUKA RESOURCES LTD	29,559	8.67	256,276.53	
	INCITEC PIVOT LTD	118,280	3.07	363,119.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	31,642	9.39	297,118.38	
	LYNAS CORP LTD	124,409	0.80	100,149.24	
	NEWCREST MINING LIMITED	55,516	26.48	1,470,063.68	
	ORICA LTD	26,507	25.00	662,675.00	
OZ MINERALS LTD	21,913	7.74	169,606.62		
RIO TINTO LTD	31,645	58.69	1,857,245.05		

SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	11,082	9.52	105,500.64		
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	10,493	17.27	181,214.11		
ALS LTD	24,510	8.72	213,727.20		
BRAMBLES LTD	112,884	7.10	801,476.40		
ASCIANO GROUP	70,833	4.36	308,831.88		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.26	97,593.48		
QR NATIONAL LTD	124,036	3.68	456,452.48		
TOLL HOLDINGS LIMITED	47,207	4.34	204,878.38		
TRANSURBAN GROUP	95,314	6.08	579,509.12		
CROWN LTD	29,093	10.14	295,003.02		
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	55,201	3.55	195,963.55		
TABCORP HOLDINGS	51,765	2.70	139,765.50		
TATTS GROUP LTD	97,367	2.75	267,759.25		
FAIRFAX MEDIA LTD	155,308	0.38	59,017.04		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	1.81	70,443.78		
METCASH LTD	62,759	3.54	222,166.86		
WESFARMERS LIMITED	72,400	34.30	2,483,320.00		
WOOLWORTHS LTD	89,098	28.79	2,565,131.42		
COCA-COLA AMATIL LIMITED	41,370	13.27	548,979.90		
COCHLEAR LIMITED	4,134	74.40	307,569.60		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,539	24.14	230,271.46		
SONIC HEALTHCARE LTD	26,904	12.82	344,909.28		
CSL LIMITED	36,712	48.40	1,776,860.80		
AUST AND NZ BANKING GROUP	192,754	24.56	4,734,038.24		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	28,337	7.94	224,995.78		
COMMONWEALTH BANK OF AUST	114,834	58.82	6,754,535.88		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	161,081	23.81	3,835,338.61		
WESTPAC BANKING	219,760	25.17	5,531,359.20		
ASX LTD	12,364	29.32	362,512.48		
MACQUARIE GROUP LIMITED	24,049	31.16	749,366.84		
AMP LTD	207,309	4.60	953,621.40		
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	150,981	4.57	689,983.17		
QBE INSURANCE GROUP	84,066	12.87	1,081,929.42		
SUNCORP GROUP LIMITED	93,434	9.31	869,870.54		
COMPUTERSHARE LIMITED	32,282	8.78	283,435.96		
TELSTRA CORP	316,269	4.11	1,299,865.59		
AGL ENERGY LTD	39,363	13.72	540,060.36		
SP AUSNET	117,439	1.06	124,485.34		
オーストラリアドル小計	4,468,098		58,926,763.43 (4,869,118,462)		
イギリス ボンド	AMEC PLC	24,066	10.49	252,452.34	
	BG GROUP	244,341	10.57	2,582,684.37	
	BP PLC	1,368,628	4.29	5,874,151.37	

PETROFAC LTD	18,310	15.42	282,340.20
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	265,864	21.37	5,681,513.68
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	190,199	22.04	4,192,936.95
TULLOW OIL PLC	65,722	13.82	908,278.04
ANGLO AMERICAN PLC	99,991	18.66	1,865,832.06
ANTOFAGASTA PLC	27,839	12.57	349,936.23
BHP BILLITTON PLC	151,925	19.50	2,963,297.12
CRODA INTERNATIONAL PLC	9,552	22.71	216,925.92
EURASIAN NATURAL RESOURCES	17,220	2.90	49,938.00
EVRAZ PLC	23,648	2.36	55,903.87
FRESNILLO PLC	12,424	19.29	239,658.96
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	273,880	3.39	929,685.66
JOHNSON MATTHEY PLC	14,466	22.80	329,824.80
KAZAKHMYS PLC	14,727	6.82	100,438.14
LONMIN PLC	10,840	4.55	49,354.52
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,328	70.45	445,807.60
REXAM	63,694	4.42	281,527.48
RIO TINTO PLC REG	96,419	30.99	2,988,024.81
VEDANTA RESOURCES PLC	7,996	10.87	86,916.52
XSTRATA PLC	150,709	9.70	1,462,329.42
BAE SYSTEMS PLC	235,080	3.09	726,397.20
BALFOUR BEATTY PLC	49,917	2.45	122,496.31
BUNZL PLC	24,018	10.15	243,782.70
COBHAM PLC	74,736	2.11	157,692.96
IMI PLC	22,666	9.49	215,100.34
INVENSYS PLC	59,010	2.34	138,496.47
MEGGITT PLC	56,555	3.71	210,158.38
MELROSE PLC	84,700	2.47	209,547.80
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	135,964	8.77	1,192,404.28
SMITHS GROUP PLC	27,715	10.54	292,116.10
WEIR GROUP PLC/THE	15,348	17.51	268,743.48
WOLSELEY LTD	20,700	27.10	560,970.00
AGGREKO PLC	19,399	21.55	418,048.45
BABCOCK INTL GROUP PLC	26,080	9.62	250,889.60
CAPITA GROUP PLC	46,156	7.23	333,938.66
EXPERIAN PLC	72,983	10.50	766,321.50
G4S PLC	102,444	2.53	259,593.09
INTERTEK GROUP PLC	11,308	28.56	322,956.48
SERCO GROUP PLC	36,163	5.54	200,523.83
NEW GKN	112,795	2.06	232,357.70
BURBERRY GROUP PLC	31,861	12.17	387,748.37
CARNIVAL PLC	13,154	25.37	333,716.98
COMPASS GROUP PLC	135,085	6.88	930,060.22

INTERCONTINENTAL HOTELS	19,180	15.57	298,632.60	
TUI TRAVEL PLC	34,970	2.50	87,425.00	
WHITBREAD PLC	12,920	23.99	309,950.80	
BRITISH SKY BROADCASTING	78,699	7.53	592,603.47	
ITV PLC	268,310	0.85	230,209.98	
PEARSON	59,257	12.25	725,898.25	
REED ELSEVIER PLC	88,399	6.09	538,791.90	
WPP PLC	91,523	8.08	739,505.84	
KINGFISHER PLC	172,045	2.83	488,091.66	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	116,498	3.82	445,255.35	
NEXT PLC	12,218	36.00	439,848.00	
MORRISON SUPERMARKETS	168,207	2.64	444,907.51	
SAINSBURY (J) PLC	88,638	3.47	308,371.60	
TESCO	578,329	3.24	1,878,412.59	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,150	13.75	345,812.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	140,684	31.99	4,500,481.16	
DIAGEO	180,212	18.03	3,249,222.36	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	71,604	24.34	1,742,841.36	
SABMILLER PLC	68,732	26.65	1,831,707.80	
TATE & LYLE	33,886	7.47	253,128.42	
UNILEVER PLC	92,322	23.14	2,136,331.08	
RECKITT BENCKISER PLC	46,801	37.74	1,766,269.74	
SMITH & NEPHEW PLC	65,063	6.56	427,138.59	
ASTRAZENECA	90,879	28.65	2,604,137.74	
GLAXOSMITHKLINE	360,823	13.69	4,939,666.87	
SHIRE PLC	40,852	17.63	720,220.76	
BARCLAYS	844,880	2.30	1,944,491.32	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,315,273	6.00	7,903,475.45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,012,047	0.43	1,313,553.69	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	146,470	2.70	395,615.47	
STANDARD CHARTERED PLC	173,767	14.38	2,499,638.29	
3I GROUP PLC	70,776	2.14	151,602.19	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	60,777	3.34	203,055.95	
ICAP PLC	38,331	3.11	119,362.73	
INVESTEC PLC	37,356	3.70	138,403.98	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	12,844	9.67	124,201.48	
MAN GROUP PLC	128,501	0.81	104,085.81	
SCHRODERS PLC	7,582	15.55	117,900.10	
ADMIRAL GROUP PLC	14,803	10.54	156,023.62	
AVIVA PIC	211,805	3.25	689,213.47	
LEGAL & GENERAL GROUP	428,034	1.41	606,096.14	
OLD MUTUAL PLC	354,739	1.68	596,316.25	
PRUDENTIAL	185,725	8.46	1,572,162.12	

	RESOLUTION LTD	100,306	2.37	238,327.05	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	257,389	1.12	289,820.01	
	STANDARD LIFE PLC	171,559	3.01	517,078.82	
	SAGE GROUP PLC	94,761	3.07	291,295.31	
	BT GROUP PLC	565,095	2.24	1,267,508.08	
	INMARSAT PLC	31,044	5.48	170,121.12	
	VODAFONE GROUP PLC	3,549,749	1.67	5,949,379.32	
	CENTRICA PLC	375,719	3.20	1,203,427.95	
	NATIONAL GRID PLC	256,757	6.89	1,769,055.73	
	SEVERN TRENT PLC	16,774	15.13	253,790.62	
	SSE PLC	68,149	13.99	953,404.51	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	48,132	6.50	313,098.66	
	ARM HOLDINGS PLC	99,911	7.12	711,865.87	
	イギリスポンド小計	20,257,881		105,572,053.00 (13,344,307,499)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	25,448	44.32	1,127,855.36	
	GIVAUDAN-REG	603	918.00	553,554.00	
	HOLCIM LTD	16,627	63.85	1,061,633.95	
	SIKA AG-BR	152	1,967.00	298,984.00	
	SYNGENTA AG	6,805	361.00	2,456,605.00	
	ABB LTD	158,179	17.40	2,752,314.60	
	GEBERIT AG-REG	2,749	190.90	524,784.10	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,564	122.40	191,433.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,530	124.00	437,720.00	
	SULZER AG-REG	1,662	136.60	227,029.20	
	ADECCO	9,621	44.60	429,096.60	
	SGS SA	398	2,020.00	803,960.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,922	114.60	449,461.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	37,548	64.50	2,421,846.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,240	415.00	929,600.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,008	72.00	216,576.00	
	ARYZTA AG	6,334	47.00	297,698.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	909.50	120,054.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	65	2,976.00	193,440.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	34,290.00	274,320.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	237,375	59.95	14,230,631.25	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,568	92.85	331,288.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	545	108.00	58,860.00	
	ACTELION LTD-REG	8,053	44.14	355,459.42	
	LONZA GROUP AG-REG	3,843	45.32	174,164.76	
	NOVARTIS	165,462	57.45	9,505,791.90	
	ROCHE HOLDING GENUSS	50,537	179.80	9,086,552.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	491.25	104,636.25	



	CREDIT SUISSE GROUP AG	88,517	21.66	1,917,278.22	
	GAM HOLDING LTD	13,170	12.85	169,234.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,061	32.71	492,645.31	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	63.00	118,440.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	973	185.60	180,588.80	
	UBS AG-REG	265,264	14.37	3,811,843.68	
	BALOISE HOLDING AG	3,304	77.50	256,060.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,112	116.60	246,259.20	
	SWISS RE LTD	25,669	65.95	1,692,870.55	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,741	232.90	2,501,578.90	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,464	75.60	261,878.40	
	SWISSCOM	1,693	380.00	643,340.00	
	スイスフラン小計	1,182,039		61,907,368.15 (5,192,790,040)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	28.90	1,199,350.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	155,000	77.00	11,935,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	101,000	12.06	1,218,060.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	13.66	1,120,120.00	
	MTR CORP	102,000	29.75	3,034,500.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	49.00	710,500.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	26.20	1,349,300.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	103,000	27.20	2,801,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	13.82	928,704.00	
	SANDS CHINA LTD	175,200	30.10	5,273,520.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	110,000	15.44	1,698,400.00	
	SJM HOLDINGS LTD	136,000	17.52	2,382,720.00	
	WYNN MACAU LTD	108,000	21.90	2,365,200.00	
	LI & FUNG	412,800	12.38	5,110,464.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	43,000	16.66	716,380.00	
	BANK EAST ASIA	95,360	28.60	2,727,296.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	268,500	23.65	6,350,025.00	
	HANG SENG BANK	55,500	115.70	6,421,350.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	78.50	981,250.00	
	FIRST PACIFIC CO	154,000	8.56	1,318,240.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	74,500	126.60	9,431,700.00	
	AIA GROUP LTD	736,400	30.20	22,239,280.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	101,000	112.90	11,402,900.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	64,000	46.05	2,947,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	26.85	4,403,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	69,000	52.75	3,639,750.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	46,000	35.35	1,626,100.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	52,000	39.00	2,028,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	265,500	12.26	3,255,030.00	

	SINO LAND CO	213,400	13.26	2,829,684.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	112.60	12,836,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	49,500	92.25	4,566,375.00	
	WHARF HOLDINGS	110,000	52.90	5,819,000.00	
	WHEELOCK & CO LTD	66,000	34.45	2,273,700.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	141,000	3.63	511,830.00	
	PCCW LTD	292,000	3.03	884,760.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	35,000	46.60	1,631,000.00	
	CLP HOLDINGS	131,000	65.65	8,600,150.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	379,061	20.05	7,600,173.05	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	100,500	66.40	6,673,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	89.00	1,228,200.00	
	香港ドル小計	5,506,221		176,069,811.05 (1,806,476,261)	
シンガポール ドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	0.88	60,180.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	67,000	9.19	615,730.00	
	KEPPEL CORP LTD	104,300	10.15	1,058,645.00	
	NOBLE GROUP LTD	267,363	1.17	314,151.52	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	71,000	4.99	354,290.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	61,000	4.36	265,960.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	111,000	3.50	388,500.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	0.91	121,030.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.60	210,255.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	1.13	69,235.00	
	SINGAPORE AIRLINES	39,533	10.48	414,305.84	
	GENTING SINGAPORE PLC	443,000	1.23	547,105.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	114,000	4.03	459,420.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	47.16	377,280.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	112,000	1.87	210,000.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	485,000	0.61	298,275.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	136,000	3.17	431,120.00	
	DBS GROUP	132,000	14.08	1,858,560.00	
	OCBC BANK	187,000	9.10	1,701,700.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	92,000	18.30	1,683,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,000	6.70	415,400.00	
	CAPITALAND LTD	186,500	3.42	637,830.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	1.89	187,110.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,000	11.59	417,240.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	146,000	2.67	389,820.00		
KEPPEL LAND LTD	50,000	3.43	171,500.00		
UOL GROUP LIMITED	31,300	5.51	172,463.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,243	3.17	1,836,200.31		
STARHUB LTD	44,000	3.63	159,720.00		

シンガポールドル小計		4,057,239		15,826,625.67 (1,028,097,603)	
ニュージーランド ドル	FLETCHER BUILDING LTD	47,170	7.24	341,510.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.65	179,608.09	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.91	164,841.69	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	133,366	2.41	321,412.06	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.35	136,441.05	
ニュージーランドドル小計		315,847		1,143,813.69 (74,119,127)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	16,161	155.20	2,508,187.20	
	BOLIDEN AB	19,863	113.80	2,260,409.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,671	192.90	708,135.90	
	SSAB AB-A SHS	10,878	49.10	534,109.80	
	ALFA LAVAL AB	24,369	116.20	2,831,677.80	
	ASSA ABLOY B	24,083	225.80	5,437,941.40	
	ATLAS COPCO A	48,766	163.10	7,953,734.60	
	ATLAS COPCO B	28,338	145.20	4,114,677.60	
	SANDVIK AB	72,876	92.85	6,766,536.60	
	SCANIA AB-B SHS	22,591	129.70	2,930,052.70	
	SKANSKA B	27,591	103.40	2,852,909.40	
	SKF AB-B	28,465	153.50	4,369,377.50	
	VOLVO B	101,065	89.85	9,080,690.25	
	SECURITAS B	22,739	52.35	1,190,386.65	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,470	166.00	2,900,020.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	30,739	39.32	1,208,657.48	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,258	208.50	679,293.00	
	HENNES & MAURITZ B	68,295	220.30	15,045,388.50	
	SWEDISH MATCH AB	14,818	224.00	3,319,232.00	
	SCA SV CELLULOSA B	42,020	132.30	5,559,246.00	
	ELEKTA AB-B SHS	25,880	90.45	2,340,846.00	
	GETINGE AB-B SHS	14,129	203.90	2,880,903.10	
	NORDEA BANK AB	191,746	59.55	11,418,474.30	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	102,808	52.50	5,397,420.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	35,722	233.30	8,333,942.60	
	SWEDBANK AB-A	59,797	122.80	7,343,071.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	93.75	807,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	33,199	145.00	4,813,855.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,990	122.70	1,839,273.00	
	RATOS AB-B SHS	13,965	56.00	782,040.00	
ERICSSON (LM) B	216,630	59.40	12,867,822.00		
HEXAGON AB-B SHS	17,560	156.50	2,748,140.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,557	567.00	2,583,819.00		
TELE2 AB-B SHS	22,436	111.20	2,494,883.20		

	TELIASONERA AB	157,227	43.35	6,815,790.45	
スウェーデンクローナ小計		1,547,310		155,717,944.03 (1,837,471,739)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	11,939	105.80	1,263,146.20	
	SEADRILL LTD	25,558	224.70	5,742,882.60	
	STATOIL ASA	80,278	137.90	11,070,336.20	
	SUBSEA 7 SA	20,438	123.80	2,530,224.40	
	NORSK HYDRO	67,614	26.00	1,757,964.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,578	255.00	3,462,390.00	
	ORKLA	54,479	45.75	2,492,414.25	
	DNB ASA	71,231	69.40	4,943,431.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,577	82.75	1,206,246.75	
	TELENOR ASA	52,555	113.60	5,970,248.00	
ノルウェークローネ小計		412,247		40,439,283.80 (560,488,473)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	17,729	156.30	2,771,042.70	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	40	38,360.00	1,534,400.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	96	40,440.00	3,882,240.00	
	DSV A/S	13,798	132.40	1,826,855.20	
	CARLSBERG AS-B	7,768	537.00	4,171,416.00	
	COLOPLAST-B	1,654	1,326.00	2,193,204.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,854	463.40	859,143.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	29,295	928.00	27,185,760.00	
	DANSKE BANK A/S	47,538	93.15	4,428,164.70	
	TRYG A/S	1,646	390.70	643,092.20	
	TDC A/S	34,299	38.45	1,318,796.55	
デンマーククローネ小計		155,717		50,814,114.95 (689,039,398)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	31,437	46.58	1,464,335.46	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,496.00	401,856.00	
	DELEK GROUP LTD	299	747.70	223,562.30	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	67,818	158.50	10,749,153.00	
	BANK HAPOALIM BM	73,582	15.06	1,108,144.92	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	91,292	12.36	1,128,369.12	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	36.75	301,350.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	127.20	533,604.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	134,167	4.71	632,060.73	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,572	326.00	838,472.00	
イスラエルシェケル小計		413,723		17,380,907.53 (353,527,659)	
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	9,997	23.36	233,579.90	
	ENI	182,990	17.45	3,193,175.50	
	FUGRO NV-CVA	5,024	51.96	261,047.04	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,031	12.10	193,975.10	

NESTE OIL OYJ	8,623	9.39	80,969.97
OMV AG	10,941	27.40	299,783.40
REPSOL SA	57,629	15.20	875,960.80
SAIPEM	19,227	33.82	650,257.14
SBM OFFSHORE NV	12,450	9.99	124,450.20
TECHNIP S.A.	7,206	84.05	605,664.30
TENARIS SA	34,293	14.37	492,790.41
TOTAL SA	153,027	38.00	5,815,026.00
ACERINOX SA	6,932	8.80	61,001.60
AIR LIQUIDE	22,463	91.50	2,055,364.50
AKZO NOBEL	17,043	42.11	717,680.73
ARCELORMITTAL	68,013	12.04	818,876.52
ARKEMA	4,366	73.68	321,686.88
BASF SE	66,068	63.17	4,173,515.56
CRH	52,215	14.28	745,630.20
HEIDELBERGCEMENT AG	10,212	42.00	428,904.00
IMERYS SA	2,361	44.39	104,816.59
K+S AG	12,510	35.20	440,414.55
KONINKLIJKE DSM NV	11,199	41.60	465,934.39
LAFARGE (FRANCE)	13,444	46.48	624,944.34
LANXESS	6,042	62.00	374,604.00
LINDE AG	13,307	128.60	1,711,280.20
SALZGITTER AG	2,612	34.73	90,714.76
SOLVAY SA	4,306	93.99	404,720.94
STORA ENSO OYJ R	40,312	4.88	196,964.43
THYSSEN KRUPP	28,022	17.41	487,863.02
UMICORE	8,048	39.65	319,103.20
UPM KYMMENE CORP	38,131	8.29	316,296.64
VOESTALPINE AG	7,614	23.39	178,129.53
WACKER CHEMIE AG	1,088	42.41	46,142.08
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,283	15.98	164,322.34
ALSTOM RGPT	14,969	28.25	422,949.09
ANDRITZ AG	5,139	46.38	238,372.51
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,133	29.07	149,216.31
BOUYGUES ORD	13,337	18.07	241,066.27
BRENNTAG AG	3,704	95.74	354,620.96
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	29,819	26.32	784,836.08
FERROVIAL SA	28,481	11.01	313,718.21
FIAT INDUSTRIAL	62,149	8.28	514,593.72
FINMECCANICA SPA	29,572	3.87	114,680.21
GEA GROUP AG	12,681	23.87	302,758.87
HOCHTIEF AG	2,174	39.39	85,633.86
KONE OYJ-B	11,307	56.20	635,453.40

LEGRAND SA	17,208	29.02	499,462.20
MAN SE	2,986	79.68	237,924.48
METSO OYJ	9,281	26.87	249,380.47
PHILIPS ELECTRS (KON.)	74,773	20.06	1,499,946.38
PRYSMIAN SPA	14,113	14.37	202,803.81
REXEL SA	7,590	14.40	109,333.95
SAFRAN SA	16,657	30.30	504,707.10
SAINT-GOBAIN	28,378	28.45	807,495.99
SCHNEIDER ELECTRIC	37,512	50.09	1,878,976.08
SIEMENS	59,184	79.70	4,716,964.80
THALES SA	6,763	26.73	180,774.99
VALLOUREC	7,564	34.19	258,613.16
VINCI S.A.	32,926	32.78	1,079,314.28
WARTSILA OYJ	11,836	31.38	371,413.68
ZARDOYA OTIS SA	10,201	9.54	97,317.54
ZODIAC AEROSPACE	2,409	79.68	191,949.12
BUREAU VERITAS SA	3,969	82.20	326,251.80
EDENRED	11,961	22.90	273,906.90
RANDSTAD HOLDING NV	8,690	25.55	222,029.50
SOCIETE BIC SA	1,994	96.09	191,603.46
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	25,941	10.81	280,422.21
ADP	2,316	59.66	138,172.56
ATLANTIA SPA	24,031	12.18	292,697.58
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,628	12.29	204,358.12
DEUTSCHE POST AG-REG	61,460	14.91	916,368.60
FRAPORT AG	2,668	43.97	117,311.96
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	39,574	5.84	231,468.32
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,369	2.14	144,439.13
TNT EXPRESS	24,466	7.35	179,898.49
VOPAK	5,106	54.31	277,306.86
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,045	64.23	1,544,410.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,791	44.25	167,751.75
CONTINENTAL AG	5,810	76.44	444,116.40
DAIMLER AG	65,202	36.16	2,358,030.33
FIAT ORD	61,791	3.49	215,650.59
MICHELIN	13,073	65.67	858,503.91
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,831	31.13	243,779.03
PEUGEOT SA	16,283	4.42	72,019.70
PIRELLI & CO	17,274	8.55	147,692.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,120	50.13	557,445.60
RENAULT SA	13,959	34.24	478,025.95
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,503	154.50	1,622,713.50
VOLKSWAGEN STAMM	2,143	144.50	309,663.50

ADIDAS AG	15,193	64.20	975,390.60
CHRISTIAN DIOR	3,959	114.80	454,493.20
HUGO BOSS AG	1,789	78.10	139,720.90
LUXOTTICA GROUP SPA	8,490	29.05	246,634.50
LVMH	18,273	126.50	2,311,534.50
ACCOR	10,727	24.27	260,397.92
AUTOGRILL SPA	7,704	7.79	60,014.16
OPAP SA	14,930	4.70	70,171.00
SODEXO	6,847	60.51	414,311.97
AXEL SPRINGER AG	2,751	32.61	89,723.86
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,591	24.14	231,526.74
JC DECAUX SA	4,621	16.25	75,114.35
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,354	54.84	348,453.36
LAGADERE S.C.A	8,178	21.04	172,065.12
MEDIASET	47,386	1.27	60,511.92
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	6,178	20.84	128,780.41
PUBLICIS GROUPE	12,745	41.08	523,628.32
REED ELSEVIER NV	49,954	10.56	527,514.24
SES	21,856	21.77	475,805.12
WOLTERS KLUWER	21,907	14.56	318,965.92
INDITEX	15,843	100.00	1,584,300.00
PPR	5,526	135.25	747,391.50
AHOLD (KON.)	75,950	9.71	737,626.40
CARREFOUR	41,934	18.67	783,117.45
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,906	67.30	262,873.80
COLRUYT SA	5,507	35.80	197,150.60
DELHAIZE GROUP	7,400	28.22	208,828.00
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	44,401	4.87	216,277.27
JERONIMO MARTINS	15,262	13.80	210,691.91
KESKO OYJ-B SHS	4,473	24.59	109,991.07
METRO STAMM	9,415	21.30	200,586.57
ANHEUSER-BUSCH INBEV	57,765	65.23	3,768,010.95
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	12,699	17.10	217,152.90
DANONE (GROUPE)	41,637	49.78	2,072,689.86
DE MASTER BLENDERS1753 NV	42,962	9.14	392,801.56
HEINEKEN HOLDING NV	7,251	40.35	292,577.85
HEINEKEN NV	16,732	49.25	824,051.00
KERRY GROUP PLC-A	10,835	38.60	418,231.00
PERNOD-RICARD	15,379	83.36	1,281,993.44
REMY COINTREAU	1,575	83.23	131,087.25
SUEDZUCKER AG	4,813	30.36	146,146.74
UNILEVER NV-CVA	117,176	28.40	3,327,798.40

BEIERSDORF AG	7,320	59.69	436,930.80
HENKEL AG & CO KGAA	9,433	50.46	475,989.18
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,938	62.09	803,320.42
LOREAL	17,458	98.60	1,721,358.80
CELESIO AG	5,912	14.96	88,473.08
ESSILOR INTERNATIONAL	14,462	71.15	1,028,971.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,235	52.67	802,427.45
FRESENIUS SE&CO KGAA	9,006	84.64	762,267.84
BAYER	59,484	65.72	3,909,288.48
ELAN CORPORATION PLC	36,493	8.47	309,387.65
GRIFOLS SA	10,529	25.30	266,383.70
MERCK KGAA	4,693	97.25	456,394.25
ORION OYJ-CLASS B	6,894	19.73	136,018.62
QIAGEN N.V.	17,009	13.89	236,340.05
SANOFI	85,516	68.60	5,866,397.60
UCB (GROUPE)	7,767	42.43	329,592.64
BANCO BILBAO VIZCAYA	391,661	6.09	2,385,215.49
BANCO DE SABADELL SA	144,195	1.83	263,876.85
BANCO POPOLARE SPA	122,198	1.15	140,527.70
BANCO SANTANDER SA	713,093	5.50	3,922,011.50
BNP PARIBAS	69,972	39.45	2,760,745.26
CAIXABANK	54,400	2.68	146,172.80
COMMERZBANK AG	256,699	1.33	341,409.67
CREDIT AGRICOLE SA	72,829	5.57	405,876.01
ERSTE GROUP BANK AG	15,214	20.49	311,734.86
INTESA SANPAOLO	713,260	1.21	863,044.60
INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	1.01	65,521.73
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	0.00	0.00
KBC GROEP NV	11,204	19.16	214,668.64
NATIXIS	63,795	2.52	161,337.55
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	31.00	105,400.00
SOCIETE GENERALE	50,909	24.62	1,253,379.58
UNICREDIT SPA	285,979	3.38	967,752.93
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	2.81	152,690.45
DEUTSCHE BANK NAMEN	67,748	33.52	2,270,912.96
DEUTSCHE BOERSE	14,213	42.16	599,291.14
EURAZEO	2,357	36.51	86,054.07
EXOR SPA	4,687	19.59	91,818.33
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,711	58.53	334,264.83
ING GROEP	279,174	6.70	1,872,140.84
MEDIOBANCA	34,666	4.38	152,114.40
OKO BANK-A	9,611	10.21	98,128.31
WENDEL	2,395	66.97	160,393.15



AEGON	125,270	4.25	532,648.04	
AGEAS	16,487	19.70	324,793.90	
ALLIANZ SE-REG	32,973	93.40	3,079,678.20	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,107	12.25	1,042,560.75	
AXA	128,857	11.76	1,516,002.60	
CNP ASSURANCES	9,966	10.46	104,294.19	
DELTA LLOYD NV	10,040	11.65	116,966.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,395	55.67	244,669.65	
MAPFRE SA	55,064	2.04	112,495.75	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,072	126.90	1,658,836.80	
SAMPO OYJ-A SHS	30,547	23.85	728,545.95	
SCOR SE	11,593	20.42	236,729.06	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	33.70	94,629.60	
IMMOFINANZ AG	68,672	2.97	203,955.84	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,753	19.32	439,701.72	
ATOS	3,835	52.15	199,995.25	
CAP GEMINI SA	10,447	31.36	327,617.92	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,434	81.50	361,371.00	
SAP AG	66,254	55.66	3,687,697.64	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,820	14.99	117,221.80	
ALCATEL-LUCENT	168,500	0.90	152,324.00	
GEMALTO	5,753	69.80	401,559.40	
NOKIA CORP	271,962	2.09	568,400.58	
BELGACOM	11,046	22.34	246,822.87	
DEUTSCHE TELEKOM	202,046	8.34	1,686,680.00	
ELISA A	10,288	16.45	169,237.60	
FRANCE TELECOM	134,655	8.30	1,117,905.81	
ILIAD SA	1,611	123.50	198,958.50	
KPN (KON.)	72,771	4.65	338,457.92	
MOBISTAR SA	2,086	19.63	40,958.61	
PORTUGAL TELECOM	46,591	3.78	176,300.34	
TELECOM ITALIA ORD	682,040	0.69	471,289.64	
TELECOM ITALIA RNC	437,622	0.61	267,605.85	
TELEFONICA	290,015	10.03	2,908,850.45	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	4.58	73,020.93	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,004	35.48	142,061.92	
VIVENDI	93,597	15.00	1,404,422.98	
ACCIONA SA	1,857	46.00	85,422.00	
E.ON AG	129,542	16.50	2,137,443.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	16,968	15.48	262,749.48	
ENAGAS	12,407	14.78	183,375.46	
ENEL	478,016	2.77	1,326,972.41	

ENEL GREEN POWER SPA	121,260	1.26	153,636.42	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,604	1.97	251,890.29	
FORTUM OYJ	32,257	13.96	450,307.72	
GAS NATURAL SDG SA	25,206	11.88	299,447.28	
GDF SUEZ	91,850	16.81	1,544,457.75	
IBERDROLA SA	281,941	3.78	1,067,146.68	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,859	35.24	276,951.16	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	30.11	78,991.64	
RWE STAMM	35,539	33.15	1,178,117.85	
SNAM SPA	116,704	3.35	391,425.21	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	20,379	8.05	164,050.95	
TERNA SPA	92,233	2.83	261,388.32	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,321	7.90	192,135.90	
VERBUND AG	4,553	17.25	78,562.01	
ASML HOLDING NV	30,490	43.38	1,322,808.65	
INFINEON TECHNOLOGIES	78,920	5.36	423,405.80	
STMICROELECTRONICS	46,288	4.37	202,510.00	
ユーロ小計	11,722,185		159,536,531.26 (16,133,929,406)	
合計	74,631,974		125,284,472,244 (125,284,472,244)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 575銘柄	100.0%	57.8%
カナダドル	株式 98銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	株式 102銘柄	100.0%	10.7%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式 41銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	株式 29銘柄	100.0%	0.8%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 35銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 10銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	株式 234銘柄	100.0%	12.9%

(注)組入株式時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する株式の比率であります。

## B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	379,000.00	291,830.00	
	アメリカドル小計		379,000.00	291,830.00 (23,203,403)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	45,498.00	238,409.52	
		LEND LEASE GROUP	39,449.00	335,710.99	
		SYDNEY AIRPORT	26,529.00	90,994.47	
オーストラリアドル小計		111,476.00	665,114.98 (54,958,450)		
投資信託受益証券合計				78,161,853 (78,161,853)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	24,500.00	755,090.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	28,577.00	2,138,702.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	70,459.00	1,055,475.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,957.00	917,837.01	
		BOSTON PROPERTIES	10,770.00	1,110,387.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,800.00	379,900.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,731.00	535,734.16	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	254,515.50	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,832.00	1,237,001.12	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,645.00	481,454.25	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,165.00	550,635.20	
		HCP INC	29,765.00	1,314,124.75	
		HEALTH CARE REIT INC	16,259.00	953,427.76	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	51,418.00	732,192.32	
		KIMCO REALTY CORP	29,508.00	558,881.52	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,458.00	293,492.60	
		MACERICH CO/THE	9,622.00	538,832.00	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,675.00	497,588.50	
		PROLOGIS INC	33,339.00	1,113,189.21	
		PUBLIC STORAGE	10,621.00	1,547,479.70	
		RAYONIER INC	8,845.00	430,663.05	
		REALTY INCOME CORP	9,600.00	368,640.00	
		REGENCY CENTERS CORP	6,512.00	303,524.32	
		SIMON PROPERTY GROUP	21,842.00	3,319,984.00	
		SL GREEN REALTY CORP	6,300.00	462,231.00	
		UDR INC	17,800.00	417,232.00	
	VENTAS INC	20,950.00	1,334,305.50		
VORNADO REALTY TRUST	12,102.00	935,726.64			
アメリカドル小計		534,905.00	24,538,247.61 (1,951,036,067)		
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	6,113.00	146,589.74		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	254,428.89		

カナダドル小計		15,596.00	401,018.63 (31,876,970)
オーストラリアドル	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	89,917.00	194,220.72
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	140,325.00	270,827.25
	DEXUS PROPERTY GROUP	335,304.00	331,950.96
	GOODMAN GROUP	112,356.00	496,613.52
	GPT GROUP	102,192.00	355,628.16
	MIRVAC GROUP	248,145.00	359,810.25
	STOCKLAND	161,862.00	555,186.66
	WESTFIELD GROUP	155,181.00	1,621,641.45
	WESTFIELD RETAIL TRUST	210,706.00	653,188.60
オーストラリアドル小計		1,555,988.00	4,839,067.57 (399,852,153)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	60,538.00	315,100.29
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	40,760.00	136,260.68
	HAMMERSON PLC	51,853.00	242,412.77
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,796.00	447,836.46
	SEGRO PLC	54,059.00	122,713.93
イギリスポンド小計		264,006.00	1,264,324.13 (159,810,570)
香港ドル	LINK REIT	164,500.00	6,522,425.00
香港ドル小計		164,500.00	6,522,425.00 (66,920,080)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134,000.00	308,200.00
	CAPITAMALL TRUST	165,000.00	339,900.00
シンガポールドル小計		299,000.00	648,100.00 (42,100,576)
ユーロ	CORIO NV	4,573.00	147,662.17
	FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	116,093.25
	GECINA SA	1,598.00	137,443.98
	ICADE	1,564.00	106,508.40
	KLEPIERRE	6,998.00	196,293.90
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,692.00	1,130,948.00
ユーロ小計		23,336.00	1,834,949.70 (185,568,463)
投資証券合計			2,837,164,879 (2,837,164,879)
合計			2,915,326,732 (2,915,326,732)

(注) 有価証券明細表注記

(1) 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4) 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 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	投資信託受益証券	1銘柄	1.2%		67.7%
	投資証券	28銘柄		98.8%	
カナダドル	投資証券	2銘柄		100.0%	1.1%
オーストラリアドル	投資信託受益証券	3銘柄	12.1%		15.6%
	投資証券	9銘柄		87.9%	
イギリスポンド	投資証券	5銘柄		100.0%	5.5%
香港ドル	投資証券	1銘柄		100.0%	2.3%
シンガポールドル	投資証券	2銘柄		100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券	6銘柄		100.0%	6.4%

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

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

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

#### 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	213,216,207
投資証券	7,291,690,530
派生商品評価勘定	7,944,100
未収入金	173,800
未収配当金	79,513,314
未収利息	393
差入委託証拠金	4,042,500
流動資産合計	7,596,580,844
資産合計	7,596,580,844
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,642,000
前受金	9,795,900
未払金	23,841,553
未払解約金	30,801,869
流動負債合計	66,081,322
負債合計	66,081,322
純資産の部	
元本等	
元本	9,717,909,882
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,187,410,360
元本等合計	7,530,499,522
純資産合計	7,530,499,522
負債純資産合計	7,596,580,844

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年11月12日現在
--	---------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成24年11月12日現在
1. 計算期間の期首元本額	7,919,817,576円
計算期間中の追加設定元本額	5,358,344,795円
計算期間中の一部解約元本額	3,560,252,489円
計算日の元本額	9,717,909,882円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	704,942,876円
SBI資産設計オープン（分配型）	19,207,671円
SMT J-REITインデックス・オープン	2,641,018,089円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	5,887,602,238円
コア投資戦略ファンド（安定型）	293,028,027円
コア投資戦略ファンド（成長型）	172,110,981円
2. 計算日における受益権総数	9,717,909,882口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>2,187,410,360円</p>
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.7749円</p> <p>(7,749円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

平成24年11月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、不動産投信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、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年11月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。



## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	760,302,048	
合計	760,302,048	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成23年11月11日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

## 投資証券関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買 建	232,611,900	-	238,914,000	6,302,100
	合計	232,611,900	-	238,914,000	6,302,100

## (注)1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しております。

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (3) 附属明細表(平成24年11月12日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	357	193,851,000	
	M I Dリート投資法人	337	66,793,400	
	森ヒルズリート投資法人	425	161,075,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	277	130,882,500	
	産業ファンド投資法人	258	156,606,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,020	329,664,000	

ケネディクス・レジデンシャル投資法人	139	23,796,800	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	377	195,663,000	
日本ビルファンド投資法人	1,125	952,875,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,083	850,155,000	
日本リテールファンド投資法人	3,818	545,974,000	
オリックス不動産投資法人	522	196,533,000	
日本プライムリアルティ投資法人	1,515	352,540,500	
プレミア投資法人	361	101,838,100	
東急リアル・エステート投資法人	311	125,644,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	178	81,791,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	560	263,760,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,862	369,207,200	
森トラスト総合リート投資法人	444	313,464,000	
インヴィンシブル投資法人	2,476	15,549,280	
フロンティア不動産投資法人	418	282,986,000	
平和不動産リート投資法人	1,278	68,500,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	272	193,120,000	
福岡リート投資法人	226	131,306,000	
ケネディクス不動産投資法人	526	139,390,000	
積水ハウス・S I投資法人	252	90,720,000	
いちご不動産投資法人	1,547	63,349,650	
大和証券オフィス投資法人	727	181,750,000	
阪急リート投資法人	157	62,407,500	
スターツプロシード投資法人	198	23,324,400	
トップリート投資法人	285	101,317,500	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	295	177,000,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,876	86,822,400	
日本賃貸住宅投資法人	2,443	113,599,500	
ジャパンエクセレント投資法人	346	148,434,000	
投資証券 小計	33,291	7,291,690,530	
合計	33,291	7,291,690,530	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成24年11月12日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	101,835,266
コール・ローン	42,272,170
投資証券	11,762,861,398
派生商品評価勘定	880
未収入金	340,149
未収配当金	28,053,657
未収利息	78
流動資産合計	11,935,363,598
資産合計	11,935,363,598
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	112,618
未払金	67,935,572
未払解約金	480,000
流動負債合計	68,528,190
負債合計	68,528,190
純資産の部	
元本等	
元本	14,351,666,510
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,484,831,102
元本等合計	11,866,835,408
純資産合計	11,866,835,408
負債純資産合計	11,935,363,598

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

平成24年11月12日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成24年11月12日現在	
1. 計算期間の期首元本額	11,048,967,075円
計算期間中の追加設定元本額	5,509,803,861円
計算期間中の一部解約元本額	2,207,104,426円
計算日の元本額	14,351,666,510円
計算日の元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	858,430,205円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	672,830,792円
SBI資産設計オープン（分配型）	18,108,225円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	5,051,977,970円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	7,316,866,103円
コア投資戦略ファンド（安定型）	271,449,638円
コア投資戦略ファンド（成長型）	162,003,577円

2. 計算日における受益権総数		14,351,666,510口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	2,484,831,102円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		0.8269円 (8,269円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(リートの価格変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約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、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年11月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成24年11月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		996,415,268
合計		996,415,268

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成23年11月11日から平成24年11月12日まで)に対応するものです。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## . ヘッジ会計が適用されていないもの

## 通貨関連

区分	種類	平成24年11月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	38,218,858	-	38,160,000	58,858
	カナダドル	1,192,230	-	1,192,200	30
	オーストラリアドル	8,282,980	-	8,261,700	21,280
	イギリスポンド	3,811,760	-	3,791,700	20,060
	香港ドル	1,025,800	-	1,026,000	200
	ユーロ	3,045,610	-	3,033,900	11,710
	計	55,577,238	-	55,465,500	111,738
合計	55,577,238	-	55,465,500	111,738	

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

## . ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成24年11月12日現在
該当事項はありません。

## (3) 附属明細表(平成24年11月12日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	10,949.00	273,177.55	
		AGREE REALTY CORP	2,407.00	60,776.75	
		ALEXANDER'S INC	460.00	200,932.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,175.00	956,103.75	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,336.00	201,226.48	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,255.00	1,040,893.80	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	2,007.00	25,709.67	
		AMERICAN REALTY CAPITAL TRUST	35,786.00	393,288.14	
		APARTMENT INVEST & MGMT	32,457.00	823,758.66	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	13,741.00	116,111.45	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	10,871.00	162,630.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,883.00	2,887,024.19	
		BIOMED REALTY TRUST INC	34,618.00	647,702.78	
		BOSTON PROPERTIES	34,044.00	3,509,936.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	31,499.00	359,718.58	
		BRE PROPERTIES-CL A	17,127.00	845,731.26	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,875.00	1,236,312.50	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	8,542.00	93,705.74	
		CAPLEASE INC	14,051.00	71,098.06	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	35,360.00	792,064.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	12,087.00	60,918.48	
		CHATHAM LODGING TRUST	2,420.00	32,960.40	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	8,486.00	157,500.16	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	18,685.00	389,769.10	
		COMMONWEALTH REIT	18,391.00	262,991.30	
		CORESITE REALTY CORP	4,640.00	101,059.20	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	17,972.00	438,337.08	
		COUSINS PROPERTIES INC	19,912.00	160,291.60	
		CUBESMART	24,902.00	326,465.22	
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	58,563.00	366,018.75	
DDR CORPORATION	52,903.00	801,480.45			
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	42,862.00	364,327.00			

DIGITAL REALTY TRUST INC	27,391.00	1,680,711.76	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	29,178.00	661,465.26	
DUKE REALTY CORP	60,144.00	811,944.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	13,903.00	290,155.61	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	6,409.00	331,986.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	24,329.00	245,236.32	
EPR PROPERTIES	10,576.00	460,373.28	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,723.00	581,649.64	
EQUITY ONE INC	13,519.00	278,626.59	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	67,973.00	3,851,350.18	
ESSEX PROPERTY TRUST	8,223.00	1,173,915.48	
EXCEL TRUST INC	7,543.00	88,856.54	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,747.00	767,451.63	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,395.00	1,492,041.75	
FELCOR LODGING TRUST INC	24,493.00	103,850.32	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,650.00	255,646.50	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	11,217.00	124,172.19	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	15,849.00	175,923.90	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	101,077.00	1,908,333.76	
GETTY REALTY CORP	5,918.00	97,706.18	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,472.00	44,570.16	
GLIMCHER REALTY TRUST	30,781.00	329,048.89	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	9,556.00	214,341.08	
GYRODYNE CO OF AMERICA INC	216.00	23,075.28	
HCP INC	101,943.00	4,500,783.45	
HEALTH CARE REIT INC	57,484.00	3,370,861.76	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,420.00	455,787.40	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	12,587.00	129,016.75	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	37,939.00	169,966.72	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,178.00	554,677.62	
HOME PROPERTIES INC	11,203.00	671,171.73	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27,743.00	631,708.11	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	163,168.00	2,323,512.32	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	6,119.00	113,201.50	
INLAND REAL ESTATE CORP	17,049.00	135,539.55	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	20,146.00	161,772.38	
KILROY REALTY CORPORATION	16,600.00	739,364.00	
KIMCO REALTY CORP	91,895.00	1,740,491.30	
KITE REALTY GROUP TRUST	15,534.00	83,106.90	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	19,479.00	458,535.66	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	32,298.00	299,079.48	
LIBERTY PROPERTY TRUST	26,543.00	921,042.10	
LTC PROPERTIES INC	6,688.00	212,544.64	



MACERICH CO/THE	29,889.00	1,673,784.00	
MACK-CALI REALTY CORP	18,839.00	478,698.99	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,778.00	337,980.30	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,229.00	576,443.34	
MISSION WEST PROPERTIES	3,520.00	31,433.60	
MONMOUTH REIT -CL A	8,958.00	92,177.82	
MPG OFFICE TRUST INC	11,508.00	33,948.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,127.00	743,111.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,318.00	283,608.94	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,540.00	546,996.60	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,463.00	44,875.86	
PARKWAY PROPERTIES INC	4,839.00	66,052.35	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,948.00	263,880.24	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,564.00	186,989.88	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	37,922.00	664,014.22	
POST PROPERTIES	12,168.00	582,847.20	
PROLOGIS INC	104,027.00	3,473,461.53	
PS BUSINESS PARKS INC	3,941.00	252,421.05	
PUBLIC STORAGE	32,539.00	4,740,932.30	
RAMCO-GERSHENSON PRYS	10,270.00	127,861.50	
REALTY INCOME CORP	30,133.00	1,157,107.20	
REGENCY CENTERS CORP	20,310.00	946,649.10	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	9,787.00	121,358.80	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	7,153.00	88,697.20	
RLJ LODGING TRUST	24,079.00	427,643.04	
ROUSE PROPERTIES INC	5,052.00	76,234.68	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	8,138.00	172,525.60	
SAUL CENTERS INC	2,783.00	118,834.10	
SELECT INCOME REIT	1,514.00	37,895.42	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	39,355.00	877,616.50	
SIMON PROPERTY GROUP	68,251.00	10,374,152.00	
SL GREEN REALTY CORP	20,241.00	1,485,082.17	
SOVRAN SELF STORAGE INC	6,650.00	406,980.00	
STAG INDUSTRIAL INC	7,265.00	124,086.20	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	39,042.00	236,204.10	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,555.00	78,351.00	
SUN COMMUNITIES INC	6,008.00	239,238.56	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,043.00	289,914.95	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,079.00	679,376.17	
TAUBMAN CENTERS INC	13,932.00	1,079,590.68	
TERRENO REALTY CORP	1,830.00	26,864.40	
UDR INC	56,177.00	1,316,788.88	

	UMH PROPERTIES INC	3,180.00	31,863.60	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,786.00	133,449.40	
	URSTADT BIDDLE - CL A	5,607.00	105,411.60	
	VENTAS INC	66,671.00	4,246,275.99	
	VORNADO REALTY TRUST	38,183.00	2,952,309.56	
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	14,567.00	365,777.37	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25,047.00	673,263.36	
	WHITESTONE REIT	2,914.00	37,066.08	
	WINTHROP REALTY TRUST	6,448.00	70,734.56	
	アメリカドル小計	2,879,731.00	96,003,479.32 (7,633,236,640)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	6,399.00	200,800.62	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,834.00	186,267.16	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,752.00	363,468.88	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	3,479.00	101,760.75	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	11,931.00	343,970.73	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,417.00	250,216.34	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	7,474.00	305,910.82	
	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	18,363.00	184,731.78	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,577.00	308,197.90	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,360.00	79,864.00	
	DUNDEE INTERNATIONAL REIT	6,194.00	66,151.92	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	11,009.00	387,736.98	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	20,697.00	496,314.06	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,154.00	45,794.54	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,871.00	20,477.59	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	6,254.00	111,008.50	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	3,683.00	114,688.62	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	3,837.00	48,729.90	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	9,849.00	224,064.75	
	RETROCOM MID-MARKET REIT	3,635.00	19,992.50	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	32,048.00	859,847.84		
	カナダドル小計	205,817.00	4,719,996.18 (375,192,496)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	58,628.00	119,601.12	
	ALE PROPERTY GROUP	35,413.00	80,741.64	
	ASPEN GROUP	262,593.00	44,640.81	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	10,577.00	33,846.40	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	51,602.00	151,709.88	
	BWP TRUST	86,936.00	179,957.52	

	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	320,483.00	692,243.28	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	530,228.00	1,023,340.04	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	24,112.00	59,797.76	
	CHARTER HALL GROUP	48,446.00	149,213.68	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	60,502.00	217,807.20	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	529,981.00	553,830.14	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	207,151.00	171,935.33	
	DEXUS PROPERTY GROUP	1,092,709.00	1,081,781.91	
	GOODMAN GROUP	320,778.00	1,417,838.76	
	GPT GROUP	365,823.00	1,273,064.04	
	INVESTA OFFICE FUND	134,872.00	389,780.08	
	MIRVAC GROUP	771,218.00	1,118,266.10	
	STOCKLAND	501,275.00	1,719,373.25	
	WESTFIELD GROUP	469,162.00	4,902,742.90	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	630,805.00	1,955,495.50	
	オーストラリアドル小計	6,513,294.00	17,337,007.34 (1,432,556,916)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	25,466.00	84,037.80	
	BRITISH LAND CO PLC	200,745.00	1,044,877.72	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	136,760.00	457,188.68	
	DERWENT LONDON PLC	19,100.00	389,640.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	70,606.00	326,411.53	
	HAMMERSON PLC	160,037.00	748,172.97	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	140,316.00	104,044.31	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	176,165.00	1,389,061.02	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY	119,222.00	132,217.19	
	METRIC PROPERTY INVESTMENTS PLC	42,091.00	42,406.68	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	15,240.00	49,949.10	
	SEGRO PLC	165,475.00	375,628.25	
	SHAFTESBURY PLC	56,785.00	302,664.05	
	WORKSPACE GROUP PLC	23,154.00	70,272.39	
	イギリスポンド小計	1,351,162.00	5,516,571.69 (697,294,661)	
香港ドル	CHAMPION REIT	675,000.00	2,463,750.00	
	FORTUNE REIT	257,000.00	1,608,820.00	
	LINK REIT	516,000.00	20,459,400.00	
	PROSPERITY REIT	242,000.00	549,340.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	184,000.00	391,920.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	229,000.00	751,120.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	366,000.00	1,354,200.00	

香港ドル小計		2,469,000.00	27,578,550.00 (282,955,923)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	76,000.00	110,580.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	103,000.00	94,760.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	414,266.00	952,811.80	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	127,000.00	163,830.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	139,000.00	165,410.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	245,000.00	159,250.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	455,000.00	700,700.00	
	CAPITAMALL TRUST	553,500.00	1,140,210.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	85,000.00	130,475.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	149,000.00	286,080.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	155,000.00	155,000.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	111,000.00	113,220.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	112,000.00	220,080.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	103,600.00	128,464.00	
	KEPPEL REIT	138,000.00	160,080.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	350,000.00	166,250.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	241,000.00	289,200.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	256,160.00	341,973.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	328,920.00	363,456.60	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	77,000.00	166,320.00	
SABANA SHARIAH COMP IND REI	125,000.00	140,000.00		
STARHILL GLOBAL REIT	304,000.00	232,560.00		
SUNTEC REIT	476,000.00	737,800.00		
シンガポールドル小計		5,124,446.00	7,118,511.00 (462,418,474)	
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	54,159.00	85,842.01	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	180,547.00	190,477.08	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	213,622.00	253,142.07	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	50,793.00	64,253.14	
ニュージーランドドル小計		499,121.00	593,714.30 (38,472,686)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	17,145.00	118,677.69	
イスラエルシェケル小計		17,145.00	118,677.69 (2,413,904)	
ユーロ	AEDIFICA	1,495.00	66,796.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	13,686.00	124,747.89	
	ALTAREA	719.00	83,260.20	
	ANF IMMOBILIER	2,928.00	97,268.16	
	BEFIMMO S.C.A.	3,313.00	155,561.91	
	BENI STABILI SPA	180,936.00	77,440.60	

	COFINIMMO	3,346.00	288,759.80	
	CORIO NV	21,596.00	697,334.84	
	EUROCOMMERCIAL	7,981.00	219,876.55	
	FONCIERE DES REGIONS	8,365.00	508,173.75	
	GECINA SA	5,862.00	504,190.62	
	HAMBORNER REIT AG	9,171.00	63,967.72	
	ICADE	5,131.00	349,421.10	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	32,169.00	23,402.94	
	KLEPIERRE	22,071.00	619,091.55	
	MERCIALYS	12,120.00	193,314.00	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	11,591.00	74,101.26	
	SILIC	1,863.00	154,927.08	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	1,180.00	48,380.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	20,612.00	3,483,428.00	
	VASTNED RETAIL NV	4,181.00	139,310.92	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,354.00	96,419.84	
	WERELDHAVE NV	4,868.00	220,350.02	
	ユーロ小計	377,538.00	8,289,525.35 (838,319,698)	
	投資証券合計		11,762,861,398 (11,762,861,398)	
	合計		11,762,861,398 (11,762,861,398)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 126銘柄	100.0%	64.9%
カナダドル	投資証券 21銘柄	100.0%	3.2%
オーストラリアドル	投資証券 21銘柄	100.0%	12.2%
イギリスポンド	投資証券 14銘柄	100.0%	5.9%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.4%
シンガポールドル	投資証券 23銘柄	100.0%	3.9%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
ユーロ	投資証券 23銘柄	100.0%	7.1%

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成24年11月30日現在)

資産総額	4,743,600,481	円
負債総額	15,651,250	円
純資産総額( - )	4,727,949,231	円
発行済口数	5,644,449,622	口
1口当たり純資産額( / )	0.8376	円
1万口当たり純資産額	8,376	円

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	225,536,809,597	円
負債総額	6,194,507,244	円
純資産総額( - )	219,342,302,353	円
発行済口数	174,851,452,937	口
1口当たり純資産額( / )	1.2544	円
1万口当たり純資産額	12,544	円

国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	122,274,460,927	円
負債総額	265,205,111	円
純資産総額( - )	122,009,255,816	円
発行済口数	194,490,876,741	口
1口当たり純資産額( / )	0.6273	円
1万口当たり純資産額	6,273	円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	213,511,841,462	円
負債総額	139,329,301	円
純資産総額( - )	213,372,512,161	円
発行済口数	111,551,789,688	口
1口当たり純資産額( / )	1.9128	円
1万口当たり純資産額	19,128	円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	139,442,646,845	円
負債総額	820,933,778	円
純資産総額( - )	138,621,713,067	円

発行済口数	136,988,754,200 口
1口当たり純資産額( / )	1.0119 円
1万口当たり純資産額	10,119 円

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	8,108,122,416 円
負債総額	62,135,869 円
純資産総額( - )	8,045,986,547 円
発行済口数	9,955,092,548 口
1口当たり純資産額( / )	0.8082 円
1万口当たり純資産額	8,082 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	12,741,690,607 円
負債総額	75,404,227 円
純資産総額( - )	12,666,286,380 円
発行済口数	14,638,371,580 口
1口当たり純資産額( / )	0.8653 円
1万口当たり純資産額	8,653 円



#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （イ）名義書換

該当事項はありません。

##### （ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### （ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

##### （ニ）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

###### 受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

###### 受益権の譲渡

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

###### 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### （イ）資本金の額（平成24年11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。

###### （ロ）委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役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、または解任されます。

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

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

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

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

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、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、ファンドマネー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ージャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

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

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部

のトレーダーが行います。

[ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年1月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年11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	304	3,714,880
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	654
単位型公社債投資信託	0	0
合計	309	3,715,534

### 3【委託会社等の経理状況】

- (イ) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度の中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

## (2)【損益計算書】

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



	1,985,197	1,919,541
一般管理費合計		
営業利益	848,907	585,991
(単位：千円)		
	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,280	2,795
受取利息	1 14,783	13,889
投資有価証券売却益	756	149
その他	1,877	2,125
営業外収益合計	18,697	18,961
営業外費用		
支払手数料	-	800
投資有価証券売却損	480	12
その他	242	74
営業外費用合計	722	887
経常利益	866,883	604,065
特別利益		
投資有価証券売却益	-	1,277,804
特別利益合計	-	1,277,804
特別損失		
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	6,776	-
統合関連損失	-	123,726
特別損失合計	6,776	123,726
税引前当期純利益	860,106	1,758,142
法人税、住民税及び事業税	377,534	241,760
法人税等調整額	29,183	368,903
法人税等合計	348,350	610,664
当期純利益	511,755	1,147,477

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	-	3,019,410
その他利益剰余金より振替	-	3,019,410
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	50,500	53,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	53,500	56,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	5,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	-	3,000,000
当期変動額合計	-	3,000,000
当期末残高	5,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	942,449	1,421,205
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	511,755	1,147,477
別途積立金より振替	-	3,000,000
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410
当期変動額合計	478,755	1,095,067
当期末残高	1,421,205	2,516,273
利益剰余金合計		
当期首残高	6,092,949	6,574,705
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	511,755	1,147,477
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410

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

(単位：千円)

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1)有形固定資産

定率法によっております。

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

#### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2)退職給付引当金

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

#### (3)移転関連費用引当金

本店事務所の移転に伴い発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 会計上の見積りの変更

### 1. 耐用年数の変更

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

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

### 2. 資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

#### 追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

#### 注記事項

（貸借対照表関係）

##### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
建 物	49,316	千円	84,592	千円
器具備品	113,320	"	127,549	"
計	162,636	"	212,142	"

2関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
預金	3,477,508	千円		
未払手数料	333,570	"		
未払費用	123,687	"		

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
支払手数料	3,761,890	千円		
受取利息	6,579	"		

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式（株）	6,000	-	-	6,000
---------	-------	---	---	-------

## 2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成22年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	-	3,000	3,000

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数

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

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

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

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

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

平成24年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

(1) 配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29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、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、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23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	6,223,302	6,223,302	-
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	39,590	39,590	-
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 前事業年度（平成23年3月31日）において保有する非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がな

く、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、

「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	6,223,302	-	-	-
未収委託者報酬	953,916	-	-	-

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	4,826,115	-	-	-



未収委託者報酬	944,716	-	-	-
---------	---------	---	---	---

(有価証券関係)

## 1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

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

## 2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）（単位：千円）

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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,307千円、当事業年度で12,680千円です。

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
繰延税金資産		
未払事業税	17,667 千円	4,898 千円
賞与引当金損金算入限度超過額	32,484 "	27,004 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	69,626 "	71,271 "
有価証券評価差額	5,832 "	5,459 "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額		15,755 "
減価償却超過額		12,745 "
敷金償却超過額		19,348 "
その他	4,558 "	3,334 "

			有価証券届出書(内国投資信託受益証券)	
繰延税金資産 合計	130,169	"	159,817	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額			398,925	"
繰延税金負債 合計			398,925	"
繰延税金資産(負債)の純額	130,169	"	239,107	"

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

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
法定実効税率		40.69 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目		4.14 "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正		2.30 "
その他		0.49 "
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.73 "

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

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

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

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

### (持分法損益等)

該当事項はありません。

### (セグメント情報等)

#### セグメント情報

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

#### 関連情報

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### (1) 営業収益

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

###### (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容又は職 業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	住友信託 銀行(株)	大阪市 中央区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	3,761,890	未払手数料	333,570
							投資助言費用 の支払	692,451	未払費用	123,687

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友トラ スト・ホール ディングス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	100%	役員の兼任	投資有価証券 の譲渡	67,316	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

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

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用 の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産 仲介業務	-	-	投資有価証券 の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の 取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジット カード業務	-	-	投資有価証券 の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の 取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュー タ関連業務	-	-	投資有価証券 の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の 取得	301,941	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

## （1株当たり情報）

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	1,144,367円30銭	1,654,304円66銭
1株当たり当期純利益	85,292円63銭	197,729円22銭

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
期中平均株式数	6,000株	5,803株

## （重要な後発事象）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

## 1. 企業結合の概要

## (1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

## 結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## (2) 企業結合日

平成24年4月1日

## (3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## (4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5) その他取引の概要に関する事項

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

## 2. 実施した会計処理の概要

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

[次へ](#)

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第27期中間会計期間末 (平成24年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金及び預金		7,260,016
未収委託者報酬		1,814,969
未収運用受託報酬		28,372
繰延税金資産		101,482
その他	2	93,819
流動資産合計		9,298,659
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	86,364
器具備品	1	125,490
有形固定資産合計		211,855
無形固定資産		
投資その他の資産		
投資有価証券		74,123
長期貸付金		33,338
会員権		25,000
その他		1,550
貸倒引当金		33,338
投資その他の資産合計		100,673
固定資産合計		497,530
資産合計		9,796,190
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		962,627
未払費用		281,477
未払法人税等		5,190
賞与引当金		95,026
その他		19,459
流動負債合計		1,363,781
固定負債		
退職給付引当金		247,039
繰延税金負債		300,749
資産除去債務		12,177
固定負債合計		559,966
負債合計		1,923,747

(単位：千円)

第27期中間会計期間末



（平成24年9月30日）

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	5,076,855
利益剰余金合計	7,236,355
株主資本合計	7,886,355
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	13,912
評価・換算差額等合計	13,912
純資産合計	7,872,442
負債純資産合計	9,796,190

## 中間損益計算書

（単位：千円）

		第27期中間会計期間
		（自 平成24年4月1日
		至 平成24年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		9,035,190
運用受託報酬		44,467
営業収益合計		9,079,657
営業費用		
一般管理費	1	1,564,871
営業利益		553,930
営業外収益	2	8,237
営業外費用		542
経常利益		561,626
特別損失	1 3	484,725
税引前中間純利益		76,900
法人税、住民税及び事業税		1,327
法人税等調整額		24,285
法人税等合計		25,612
中間純利益		51,287

## 中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

第27期中間会計期間

（自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日）

株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	-
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	-
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	56,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	2,516,273
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,560,582
当中間期末残高	5,076,855
利益剰余金合計	
当期首残高	4,672,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,563,582
当中間期末残高	7,236,355
株主資本合計	
当期首残高	4,972,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
当中間期変動額合計	2,913,582
当中間期末残高	7,886,355

（単位：千円）

第27期中間会計期間  
（自 平成24年4月1日  
至 平成24年9月30日）

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	4,053
当中間期末残高	13,912
評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	4,053
当中間期末残高	13,912
純資産合計	
当期首残高	4,962,913
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	2,909,528
当中間期末残高	7,872,442

## 重要な会計方針

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
その他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
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。	
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)	
当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。	
これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ5,543千円増加しております。	
(2) 無形固定資産	
定額法によっております。	
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）	

に基づく定額法によっております。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

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

### 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

### ( 中間貸借対照表関係 )

第27期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 16,512千円
	器具備品 213,925千円
	計 230,438千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。

### ( 中間損益計算書関係 )

第27期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 33,259千円
	無形固定資産 34,512千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 2,688千円
3	特別損失の主要項目
	統合関連損失 484,725千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	当期増加	当期減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月29日

（リ - ス取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

平成24年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	7,260,016	7,260,016	-
(2)未収委託者報酬	1,814,969	1,814,969	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	64,123	64,123	-
(4)未払金	(962,627)	(962,627)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額10,000千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)

投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	4,200	4,311	111
小計	4,200	4,311	111
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	81,539	59,812	21,727
小計	81,539	59,812	21,727
計	85,739	64,123	21,616

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 10,000千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

## 1. 企業結合の概要

### (1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

### (2) 企業結合日

平成24年4月1日

### (3) 企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

関連情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,110,941千円

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

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
1株当たり純資産額	2,624,147円63銭
1株当たり中間純利益	17,096円00銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
中間純利益	51,287千円
普通株式に係る中間純利益	51,287千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)



<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

(1) 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」といいます。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 木村 充男 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅則 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以上

---

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

[次へ](#)

## ( 1 ) 貸借対照表

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

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

## ( 2 ) 損益計算書

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

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

## (3) 株主資本等変動計算書

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



## 重要な会計方針

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

## 追加情報

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

## 1. 会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

## 2. 役員賞与引当金

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

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

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

## 2. 損益計算書関係

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

## 3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

## 4．リース取引関係

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

## 5．金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金・預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

## (3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

## 6．有価証券関係

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

## 7. デリバティブ関係

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

## 8. 退職給付関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <table data-bbox="143 683 726 761"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>18,693千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>18,693千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <table data-bbox="143 907 726 985"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	18,693千円	退職給付引当金	18,693千円	勤務費用	7,250千円	退職給付費用	7,250千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成24年3月31日現在）</p> <table data-bbox="790 683 1372 761"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>20,003千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>20,003千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）</p> <table data-bbox="790 907 1372 985"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	20,003千円	退職給付引当金	20,003千円	勤務費用	7,090千円	退職給付費用	7,090千円
退職給付債務	18,693千円																
退職給付引当金	18,693千円																
勤務費用	7,250千円																
退職給付費用	7,250千円																
退職給付債務	20,003千円																
退職給付引当金	20,003千円																
勤務費用	7,090千円																
退職給付費用	7,090千円																



## 9. 税効果会計関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																																																																										
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">15,294千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">20,418千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">資産除去債務</td><td style="text-align: right;">6,650千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">7,170千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">未払事業税</td><td style="text-align: right;">6,824千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他</td><td style="text-align: right;">19,740千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">76,099千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">評価性引当額</td><td style="text-align: right;">32,440千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">43,658千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">793千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他</td><td style="text-align: right;">806千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,600千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">2.9%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.1%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他</td><td style="text-align: right;">0.4%</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">36.7%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	繰延税金資産小計	76,099千円	評価性引当額	32,440千円	繰延税金資産合計	43,658千円	その他有価証券評価差額金	793千円	その他	806千円	繰延税金負債合計	1,600千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	評価性引当額の減少	1.6%	住民税均等割	0.1%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">12,629千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">18,980千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,602千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">6,698千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">未払事業税</td><td style="text-align: right;">7,012千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他</td><td style="text-align: right;">28,721千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">81,645千円</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">評価性引当額</td><td style="text-align: right;">19,763千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">61,881千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">901千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="padding-left: 20px;">法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">5.4%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">3.7%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td style="padding-left: 20px;">税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td style="border-top: 1px solid black;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">44.2%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	12,629千円	賞与引当金繰入超過額	18,980千円	資産除去債務	7,602千円	移転による除却予定資産減損	6,698千円	未払事業税	7,012千円	その他	28,721千円	繰延税金資産小計	81,645千円	評価性引当額	19,763千円	繰延税金資産合計	61,881千円	その他有価証券評価差額金	901千円	繰延税金負債合計	901千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%	評価性引当額の減少	3.7%	住民税均等割	0.2%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%
貸倒引当金繰入超過額	15,294千円																																																																										
賞与引当金繰入超過額	20,418千円																																																																										
資産除去債務	6,650千円																																																																										
移転による除却予定資産減損	7,170千円																																																																										
未払事業税	6,824千円																																																																										
その他	19,740千円																																																																										
繰延税金資産小計	76,099千円																																																																										
評価性引当額	32,440千円																																																																										
繰延税金資産合計	43,658千円																																																																										
その他有価証券評価差額金	793千円																																																																										
その他	806千円																																																																										
繰延税金負債合計	1,600千円																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																										
(調整)																																																																											
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%																																																																										
評価性引当額の減少	1.6%																																																																										
住民税均等割	0.1%																																																																										
その他	0.4%																																																																										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%																																																																										
貸倒引当金繰入超過額	12,629千円																																																																										
賞与引当金繰入超過額	18,980千円																																																																										
資産除去債務	7,602千円																																																																										
移転による除却予定資産減損	6,698千円																																																																										
未払事業税	7,012千円																																																																										
その他	28,721千円																																																																										
繰延税金資産小計	81,645千円																																																																										
評価性引当額	19,763千円																																																																										
繰延税金資産合計	61,881千円																																																																										
その他有価証券評価差額金	901千円																																																																										
繰延税金負債合計	901千円																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																										
(調整)																																																																											
交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%																																																																										
評価性引当額の減少	3.7%																																																																										
住民税均等割	0.2%																																																																										
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%																																																																										
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%																																																																										

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

## 10. 資産除去債務関係

第25期  
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

## 3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	5,776千円
時の経過による調整額	79千円
見積りの変更による増加額	10,489千円
期末残高	<u>16,345千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

第26期  
平成24年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

## 3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	16,345千円
時の経過による調整額	80千円
見積りの変更による増加額	3,574千円
期末残高	<u>20,000千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、平成24年5月にオフィス移転することを決定したことから、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

## 11. セグメント情報等

第25期  
(平成22年4月1日から  
平成23年3月31日まで)

## (セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
中央三井高金利ソブリンオープン	1,336,886千円
中央三井VAバランスファンド（株25/100）	1,150,446千円

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

## (報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

## (セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,529,799千円

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

## 12. 関連当事者との取引関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	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	中央三井トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	(被所有)直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払 統合関連費用	51,394	未払金	15,680

## (2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	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
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	(被所有)直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払(注2) 統合関連費用	12,011	-	-

## (2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## 13. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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



## 14. 重要な後発事象

第26期  
(平成23年4月1日から  
平成24年3月31日まで)

## (企業結合)

当社は、平成24年1月31日開催の取締役会における決議に基づき、住信アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び住信アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

## (1) 企業結合の概要

結合当事企業の名称及び当該事業の内容

## 結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## 企業結合日

平成24年4月1日

## 企業結合の法的形式

住信アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、当社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## 結合後の企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## その他取引の概要に関する事項

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

## (2) 実施した会計処理の概要

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (イ) 定款の変更

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

##### (ロ) 訴訟事件その他の重要事項

平成25年1月30日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (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24年9月末日現在）

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

#### (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年9月末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

#### (2)販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### （参考）再信託受託会社

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24年9月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

# 独立監査人の監査報告書

平成25年1月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 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SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成23年11月11日から平成24年11月12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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成24年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの平成23年11月10日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成23年12月2日付けで無限定適正意見を表明している。

#### 利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

**独立監査人の監査報告書**

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	羽 太 典 明 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石 井 勝 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名：住信アセットマネジメント株式会社）の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**強調事項**

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

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

以上

---

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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