

【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26年8月11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1万口あ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】

指定販売会社が個別に定める単位とします。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

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26年8月12日から平成27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。）の指定する口座を経由して、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) ^{*1}
外 国 株 式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース) ^{*2}
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) ^{*3}
外 国 債 券	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ^{*4}
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み) ^{*5}
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) ^{*6}

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

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

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

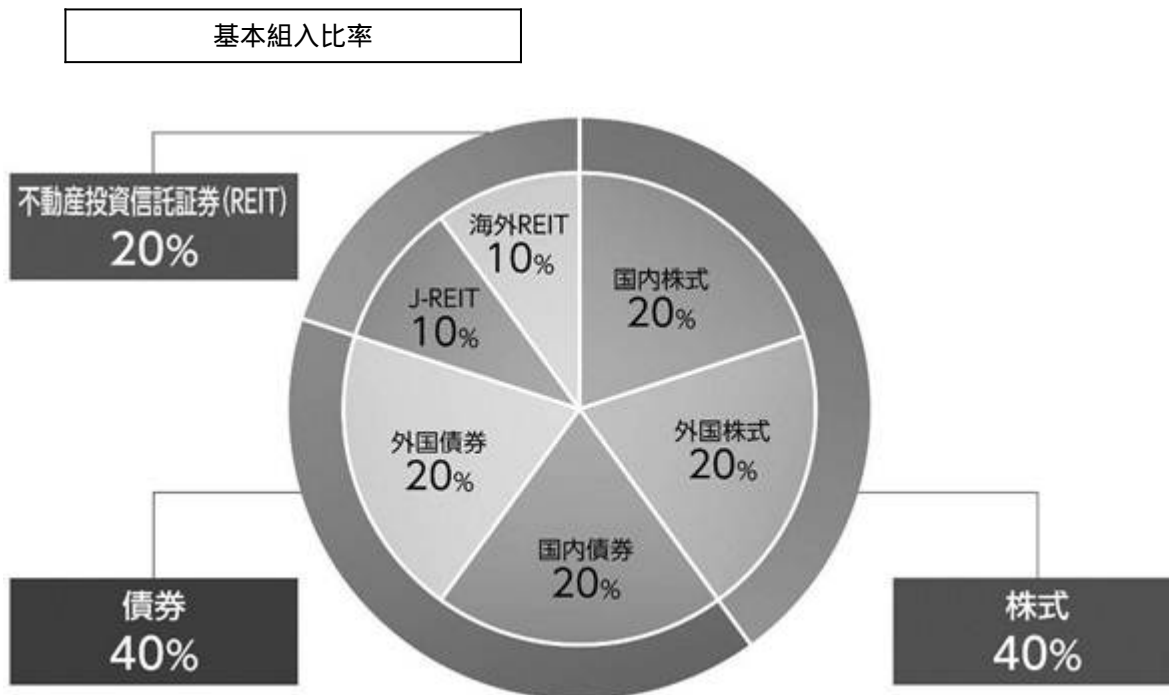
4「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべて

の権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

5「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

6「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）はSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

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0.7344%(税抜0.68%)です。)

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	グローバル (日本を含む)		
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	ファミリーファンド	あり ()
	年12回 (毎月)	アジア		
	年12回 (毎月)	オセアニア		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券、不 動産投信)資産配分固 定型))	日々	アフリカ		
	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

[区分における定義]

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券、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・ファンズのものをいいます。)、実質的に複数資産(本ファンドにおいては、株式、債券、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

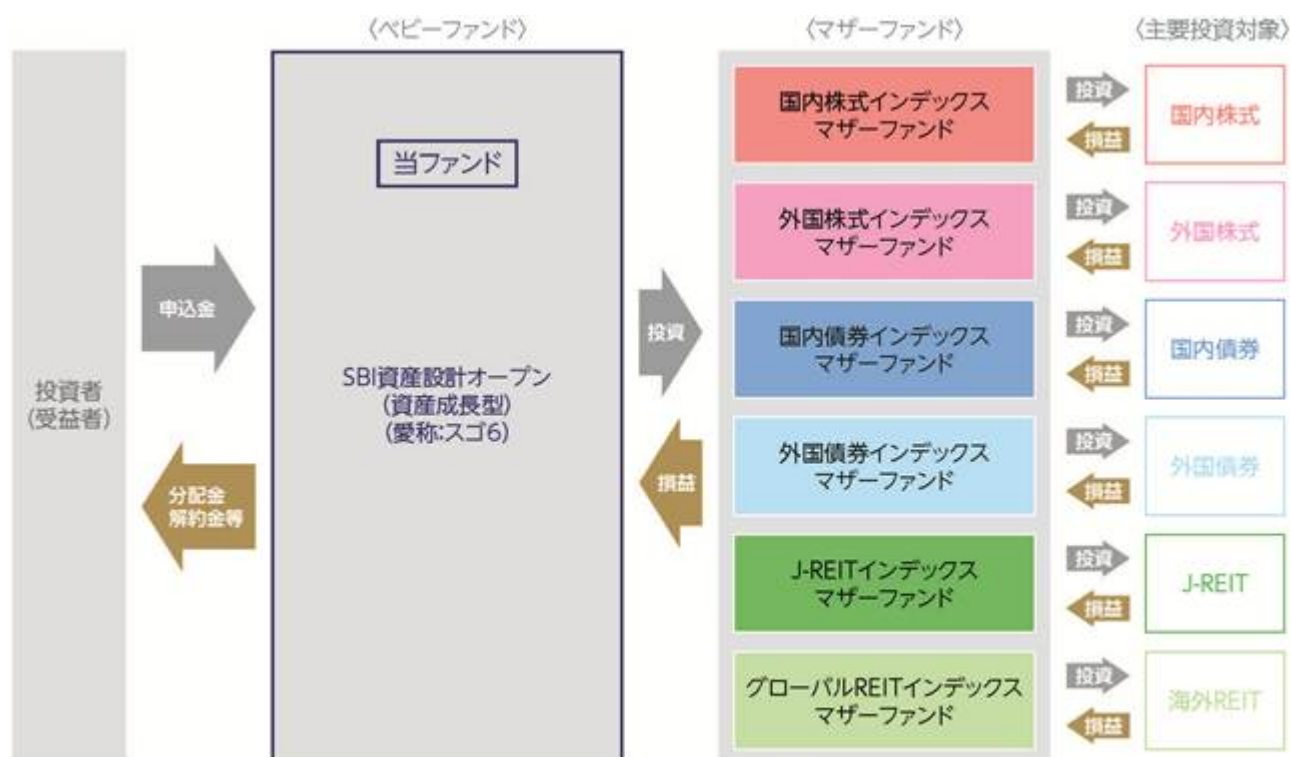
本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 J-REITインデックス マザーファンド」の名称を「J-REITインデックス マザーファンド」に、「住信 グローバルREITインデックス マザーファンド」の名称を「グローバル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

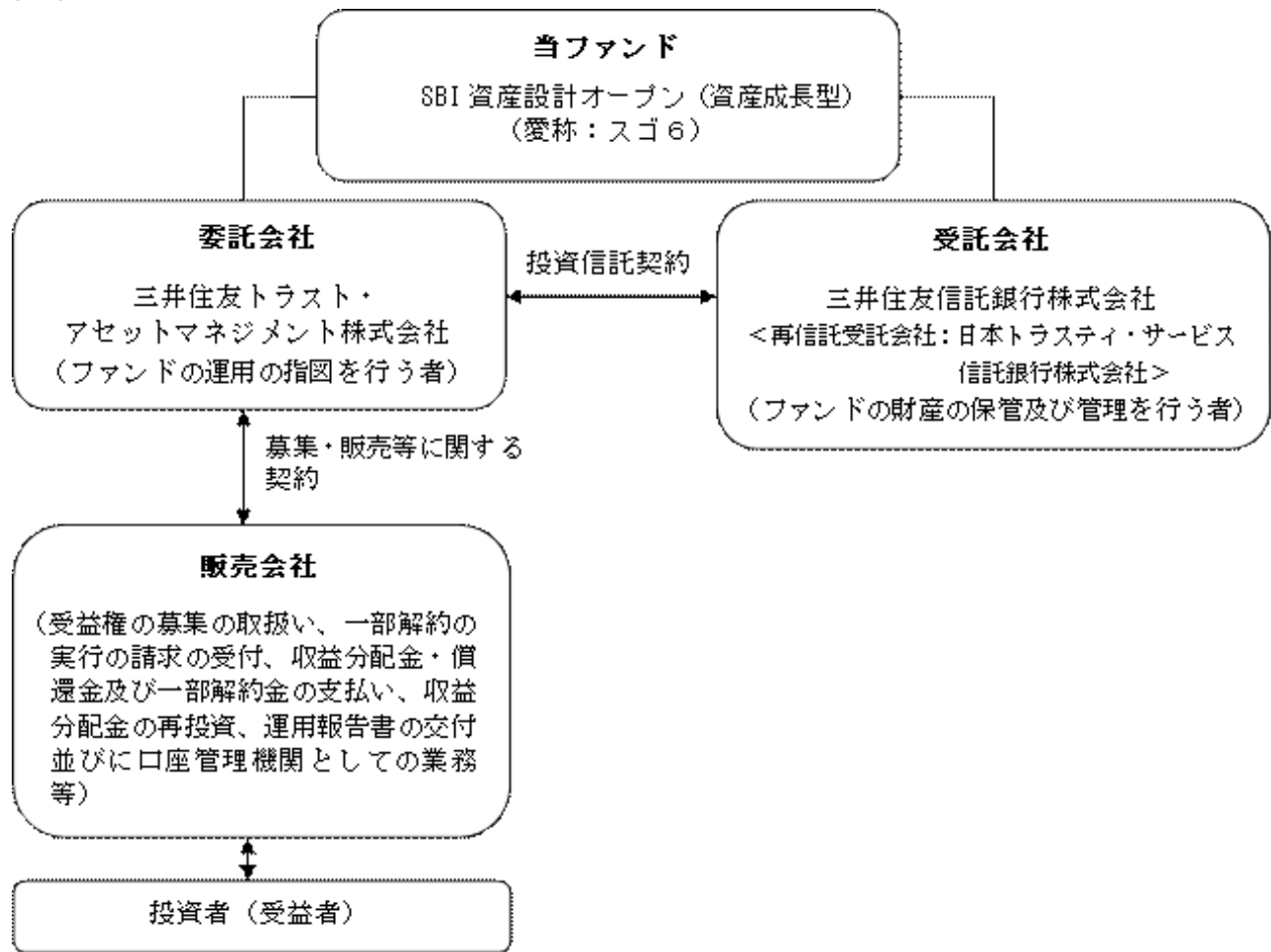
ファミリーファンド方式（ ）で運用します。

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。



※各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

(ロ) 当ファンドの関係法人図



(八) 委託会社等の概況

資本金

平成26年5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26年5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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(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書および公社債（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券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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書および公社債（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

八．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券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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書
- 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。

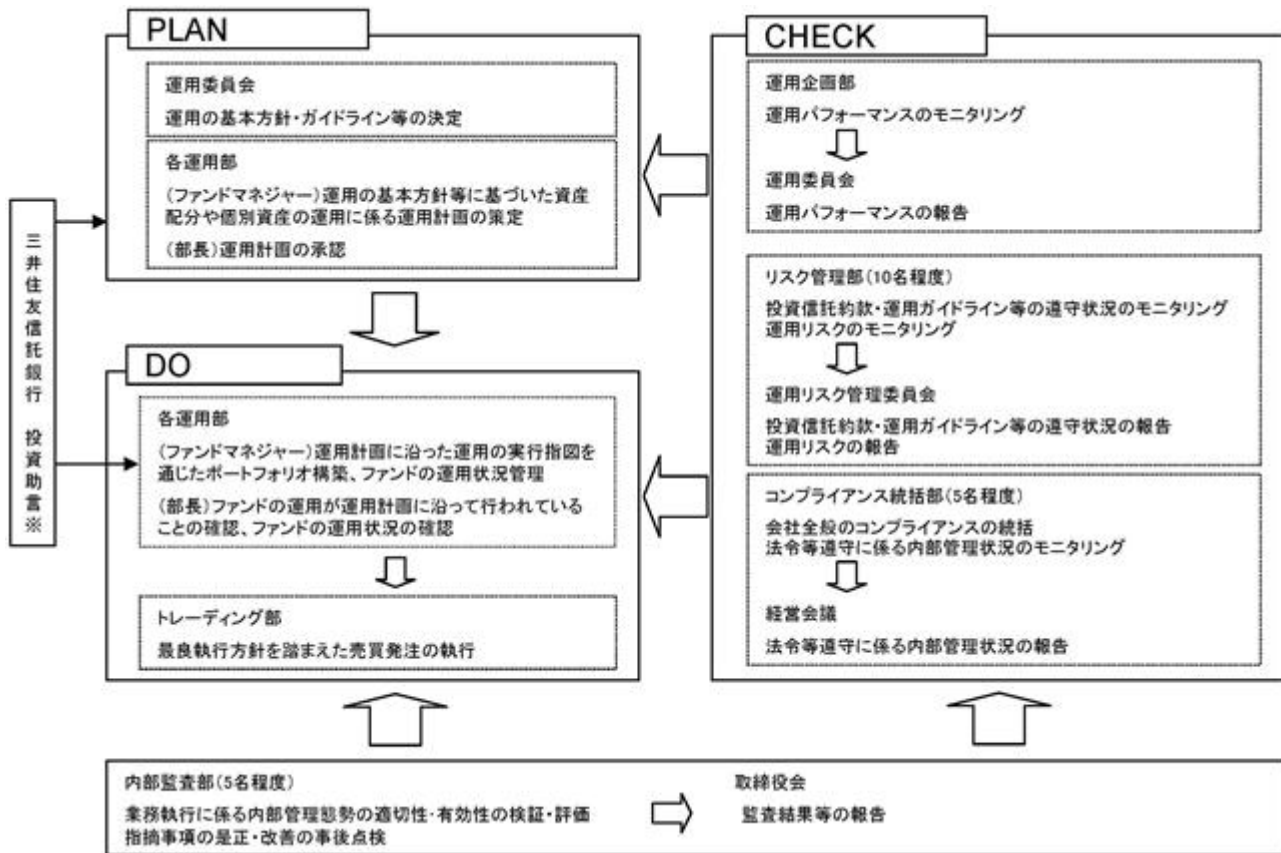
(ハ) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 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26年8月11日現在のものであり、今後変更されることがあります。



三井住友信託銀行は各マザーファンド（「J-REITインデックス マザーファンド」を除く）に対して投資助言を行います。

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

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

(4)【分配方針】

(イ) 分配方針

年1回の毎決算時（決算日は毎年11月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）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。）を含みません。）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。

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。

(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。

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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経営会議に報告します。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.7344%（税抜（ ）0.68%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

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0.7344% (税抜0.68%)	年率0.4104% (税抜0.38%)	年率0.2808% (税抜0.26%)	年率0.0432% (税抜0.04%)
100億円超300億円以下の部分	年率0.7344% (税抜0.68%)	年率0.3456% (税抜0.32%)	年率0.3456% (税抜0.32%)	年率0.0432% (税抜0.04%)
300億円超の部分	年率0.7344% (税抜0.68%)	年率0.2808% (税抜0.26%)	年率0.4104% (税抜0.38%)	年率0.0432% (税抜0.04%)

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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

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

(4)【その他の手数料等】

(イ) 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26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成26年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

なお、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26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成26年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

（ハ）個別元本について

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26年5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】

以下の記載は、平成26年5月30日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,952,397,684	96.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		306,111,759	3.31
合計(純資産総額)		9,258,509,443	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

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	1,168,009,055	1.5300	1,787,053,855	1.7012	1,987,017,004	21.46
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	1,833,864,825	0.9735	1,785,267,408	0.9946	1,823,961,954	19.70
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	682,626,663	2.3465	1,601,783,465	2.5063	1,710,867,205	18.48
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	1,105,958,320	1.2818	1,417,617,375	1.2912	1,428,013,382	15.42
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	786,499,301	1.1286	887,643,112	1.2876	1,012,696,499	10.94
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	786,462,451	1.1371	894,286,454	1.2586	989,841,640	10.69

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.69
合計	96.69

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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
第6期計算期間末 (平成25年11月11日)	7,540,466,177	7,554,112,856	11,051	11,071
平成25年 5月末日	6,897,437,027		10,847	
6月末日	6,723,867,727		10,554	
7月末日	6,872,609,023		10,622	
8月末日	6,911,497,767		10,460	
9月末日	7,377,356,987		10,980	
10月末日	7,582,846,444		11,180	
11月末日	7,809,175,488		11,476	
12月末日	7,801,584,822		11,784	
平成26年 1月末日	8,006,408,990		11,455	
2月末日	8,347,642,270		11,593	
3月末日	8,608,564,583		11,634	
4月末日	8,877,133,235		11,669	
5月末日	9,258,509,443		11,841	

【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
第6期計算期間(平成24年11月13日～平成25年11月11日)	20

【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
第6期計算期間(平成24年11月13日～平成25年11月11日)	38.5
第7期中間計算期間(平成25年11月12日～平成26年 5月11日)	5.7

(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
第6期計算期間 (平成24年11月13日～平成25年11月11日)	2,961,482,673	1,736,664,711	6,823,339,843
第7期中間計算期間 (平成25年11月12日～平成26年 5月11日)	2,034,777,811	1,179,638,105	7,678,479,549

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	202,294,222,050	78.64
	ポーランド	200,968,000	0.08
	小計	202,495,190,050	78.72
地方債証券	日本	16,201,344,567	6.30
特殊債券	日本	22,218,166,218	8.64
	アメリカ	209,146,000	0.08
	スウェーデン	100,979,000	0.04
	韓国	100,270,000	0.04
	小計	22,628,561,218	8.80
社債券	日本	13,174,415,930	5.12
	オーストラリア	405,859,000	0.16
	オランダ	405,712,000	0.16
	アメリカ	307,293,000	0.12
	スウェーデン	102,660,000	0.04
	イギリス	101,117,000	0.04
	小計	14,497,056,930	5.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,407,220,386	0.55
合計(純資産総額)		257,229,373,151	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

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113回利付国債(5年)	3,880,000,000	100.62	3,904,172,400	100.64	3,904,948,400	0.3	2018/06/20	1.52
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	3,560,000,000	100.11	3,564,088,300	100.14	3,565,055,200	0.2	2019/03/20	1.39
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,120,000,000	100.15	3,124,909,600	100.18	3,125,616,000	0.2	2018/12/20	1.22
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	3,000,000,000	100.49	3,014,970,000	100.45	3,013,590,000	0.6	2023/12/20	1.17
日本	国債証券	第105回利付国債(5年)	2,910,000,000	100.28	2,918,380,800	100.30	2,918,817,300	0.2	2017/06/20	1.13
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	100.30	2,758,288,400	100.27	2,757,645,000	0.6	2024/03/20	1.07
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	2,710,000,000	100.92	2,735,121,700	100.92	2,735,121,700	0.6	2023/03/20	1.06
日本	国債証券	第97回利付国債(5年)	2,700,000,000	100.64	2,717,388,000	100.64	2,717,361,000	0.4	2016/06/20	1.06
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.70	2,618,458,000	100.71	2,618,486,000	0.4	2016/09/20	1.02

日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,430,000,000	104.89	2,548,997,100	104.91	2,549,361,600	1.5	2017/12/20	0.99
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,360,000,000	102.88	2,428,038,800	102.88	2,428,015,200	0.8	2022/09/20	0.94
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,340,000,000	102.55	2,399,716,800	102.55	2,399,716,800	0.8	2023/06/20	0.93
日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	2,240,000,000	102.48	2,295,641,600	102.43	2,294,611,200	0.8	2023/09/20	0.89
日本	国債証券	第102回利付国債（5年）	2,280,000,000	100.52	2,291,878,800	100.52	2,291,878,800	0.3	2016/12/20	0.89
日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	2,280,000,000	100.27	2,286,361,200	100.29	2,286,726,000	0.2	2017/09/20	0.89
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,100,000,000	105.76	2,221,149,000	105.78	2,221,548,000	1.5	2018/09/20	0.86
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	2,110,000,000	104.66	2,208,442,400	104.66	2,208,389,300	1.0	2021/09/20	0.86
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	2,090,000,000	105.23	2,199,307,000	105.24	2,199,578,700	1.7	2017/09/20	0.86
日本	国債証券	第103回利付国債（5年）	2,090,000,000	100.57	2,101,933,900	100.57	2,101,933,900	0.3	2017/03/20	0.82
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	1,990,000,000	104.47	2,079,092,300	104.47	2,079,012,700	1.7	2017/03/20	0.81
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	1,960,000,000	106.03	2,078,344,800	106.03	2,078,286,000	1.3	2019/12/20	0.81
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	1,960,000,000	100.19	1,963,763,200	100.21	1,964,174,800	0.2	2018/09/20	0.76
日本	国債証券	第327回利付国債（10年）	1,840,000,000	102.75	1,890,673,600	102.75	1,890,673,600	0.8	2022/12/20	0.74
日本	国債証券	第96回利付国債（5年）	1,770,000,000	100.75	1,783,328,100	100.75	1,783,310,400	0.5	2016/03/20	0.69
日本	国債証券	第298回利付国債（10年）	1,660,000,000	105.12	1,745,091,600	105.14	1,745,440,200	1.3	2018/12/20	0.68
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	1,620,000,000	104.66	1,695,589,200	104.66	1,695,556,800	1.0	2021/12/20	0.66
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1,590,000,000	104.65	1,663,966,800	104.65	1,663,935,000	1.0	2020/09/20	0.65
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	1,520,000,000	104.57	1,589,555,200	104.57	1,589,524,800	1.0	2022/03/20	0.62
日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	1,470,000,000	103.22	1,517,451,600	103.06	1,515,114,300	1.6	2033/12/20	0.59
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	1,390,000,000	106.35	1,478,265,000	106.34	1,478,223,300	1.4	2019/09/20	0.57

(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	78.72
地方債証券	6.30
特殊債券	8.80
社債券	5.64
合計	99.45

(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 (%)
債券先物取引	長期国債先物	大阪取引所	買建	円	3	436,380,972	436,500,000	436,500,000	0.17

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

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	139,071,461,940	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,035,834,467	2.14
合計(純資産総額)		142,107,296,407	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

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	1,128,500	5,663.00	6,390,695,500	5,761.00	6,501,288,500	4.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,062,200	577.00	3,497,889,400	573.00	3,473,640,600	2.44
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	393,000	7,234.00	2,842,962,000	7,345.00	2,886,585,000	2.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	729,700	3,534.00	2,578,759,800	3,563.00	2,599,921,100	1.83
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	605,200	4,102.00	2,482,530,400	4,105.00	2,484,346,000	1.75
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,384,900	198.00	2,056,210,200	198.00	2,056,210,200	1.45
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	314,400	5,984.00	1,881,369,600	6,042.00	1,899,604,800	1.34
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	503,500	3,441.00	1,732,543,500	3,444.00	1,734,054,000	1.22
日本	株式	キヤノン	電気機器	470,100	3,326.00	1,563,552,600	3,338.00	1,569,193,800	1.10
日本	株式	ファナック	電気機器	90,500	17,480.00	1,581,940,000	17,320.00	1,567,460,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	248,400	5,929.00	1,472,763,600	6,053.00	1,503,565,200	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	318,100	4,622.00	1,470,258,200	4,607.00	1,465,486,700	1.03
日本	株式	三菱地所	不動産業	560,000	2,490.00	1,394,400,000	2,471.00	1,383,760,000	0.97
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	334,800	4,082.00	1,366,653,600	4,068.00	1,361,966,400	0.96
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,951,000	680.00	1,326,680,000	684.00	1,334,484,000	0.94
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	977,900	1,294.00	1,265,402,600	1,304.00	1,275,181,600	0.90
日本	株式	三菱商事	卸売業	624,400	2,013.00	1,256,917,200	2,009.00	1,254,419,600	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	377,000	3,193.00	1,203,761,000	3,221.00	1,214,317,000	0.85
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	149,200	7,694.00	1,147,944,800	7,765.00	1,158,538,000	0.82
日本	株式	三井物産	卸売業	723,600	1,556.00	1,125,921,600	1,542.00	1,115,791,200	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	659,400	1,691.00	1,115,045,400	1,690.00	1,114,386,000	0.78
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,637,000	680.00	1,113,160,000	669.00	1,095,153,000	0.77
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,138,100	927.00	1,055,018,700	919.00	1,045,913,900	0.74
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,589,000	286.00	1,026,454,000	287.00	1,030,043,000	0.72
日本	株式	パナソニック	電気機器	926,400	1,096.00	1,015,334,400	1,093.00	1,012,555,200	0.71

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	310,000	3,159.00	979,290,000	3,216.00	996,960,000	0.70
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	72,600	13,475.00	978,285,000	13,480.00	978,648,000	0.69
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	266,100	3,614.00	961,685,400	3,676.00	978,183,600	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	811,000	1,188.00	963,468,000	1,181.00	957,791,000	0.67
日本	株式	デンソー	輸送用機器	200,300	4,713.00	944,013,900	4,663.00	933,998,900	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	97.86
合計	97.86

(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	0.52
		建設業	2.61
		食料品	4.02
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.39
		医薬品	4.41
		石油・石炭製品	0.62
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.56
		非鉄金属	0.99
		金属製品	0.66
		機械	5.12
		電気機器	12.05
		輸送用機器	11.33
		精密機器	1.37
		その他製品	1.43
		電気・ガス業	2.08
		陸運業	3.93
		海運業	0.34
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	7.10
		卸売業	4.55
		小売業	4.21
		銀行業	8.92
		証券、商品先物取引業	1.54
		保険業	2.23
その他金融業	1.33		
不動産業	3.31		

	サービス業	2.58
合計		97.86

(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	大阪取引所	買建	円	231	2,773,155,000	2,775,465,000	2,775,465,000	1.95

(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

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	83,057,823,665	37.30
	フランス	22,632,584,832	10.16
	イタリア	22,529,967,162	10.12
	ドイツ	18,766,748,505	8.43
	イギリス	17,145,726,972	7.70
	スペイン	12,207,304,221	5.48
	ベルギー	6,027,569,311	2.71
	オランダ	6,006,702,436	2.70
	カナダ	5,079,173,728	2.28
	オーストリア	3,804,001,434	1.71
	オーストラリア	3,526,798,864	1.58
	メキシコ	2,418,645,359	1.09
	アイルランド	1,856,287,580	0.83
	デンマーク	1,782,262,226	0.80
	フィンランド	1,489,343,944	0.67
	ポーランド	1,451,374,989	0.65
	スウェーデン	1,239,328,588	0.56
	マレーシア	1,135,698,443	0.51
	南アフリカ	1,096,852,135	0.49
	スイス	871,751,828	0.39
ノルウェー	803,640,781	0.36	
シンガポール	801,282,052	0.36	
	小計	215,730,869,055	96.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,943,910,908	3.12
合計(純資産総額)		222,674,779,963	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

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 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,345.09	2,875,936,786	10,343.11	2,875,384,810	1.375	2015/11/30	1.29
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/30/15	22,000,000	10,195.38	2,242,984,951	10,194.79	2,242,853,891	0.375	2015/06/30	1.01
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,194.79	2,059,347,663	10,193.99	2,059,187,242	0.375	2015/06/15	0.92
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,153.09	1,827,556,912	10,150.71	1,827,128,025	0.250	2016/04/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 0.875% 04/15/17	16,000,000	10,213.25	1,634,120,966	10,207.69	1,633,231,433	0.875	2017/04/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,176.92	1,618,130,361	10,175.33	1,617,877,800	0.250	2015/10/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,359.59	1,553,938,624	10,358.20	1,553,730,140	1.750	2015/07/31	0.70
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,180.49	1,425,269,227	10,180.09	1,425,213,635	0.250	2015/07/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,212.66	1,358,283,821	10,211.27	1,358,098,978	0.625	2016/07/15	0.61

アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,360.58	1,357,236,457	10,359.78	1,357,132,408	1.875	2015/06/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,673.70	1,334,213,046	10,671.71	1,333,964,843	4.250	2015/08/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	9,922.17	1,240,271,861	9,907.48	1,238,435,220	2.000	2023/02/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	10,203.12	1,224,375,562	10,198.36	1,223,803,725	0.750	2017/01/15	0.55
フランス	国債証券	BTNS 2.25% 02/25/16	8,000,000	14,344.75	1,147,580,146	14,342.19	1,147,375,418	2.250	2016/02/25	0.52
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000	15,958.92	1,141,063,109	15,949.44	1,140,385,603	3.500	2020/04/25	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,284.65	1,105,896,393	11,277.90	1,105,234,812	4.500	2017/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	9,900.92	1,089,102,242	9,891.20	1,088,032,034	1.250	2020/02/29	0.49
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,463.83	1,077,774,704	10,461.25	1,077,508,835	2.000	2016/01/31	0.48
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,285.38	1,074,835,304	16,273.41	1,074,045,578	4.250	2019/04/25	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,815.07	1,027,432,154	10,809.51	1,026,903,994	3.000	2017/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	10,231.92	1,023,192,020	10,227.15	1,022,715,489	0.875	2017/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/19	10,000,000	10,207.89	1,020,789,500	10,198.16	1,019,816,583	1.500	2019/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/28/19	10,000,000	10,199.95	1,019,995,281	10,191.01	1,019,101,791	1.500	2019/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,038.32	1,013,871,266	10,031.57	1,013,189,421	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,068.70	1,006,870,822	10,060.96	1,006,096,458	0.750	2017/12/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,676.56	987,009,395	9,663.45	985,672,728	1.750	2023/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/31/19	10,000,000	9,861.61	986,161,561	9,853.07	985,307,780	1.125	2019/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	10,118.74	951,161,931	10,110.60	950,396,703	1.250	2018/11/30	0.43
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000	16,303.57	945,607,280	16,288.21	944,716,711	3.750	2021/04/25	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	5,100,000	18,474.17	942,183,128	18,440.84	940,482,914	6.500	2027/11/01	0.42

(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	96.88
合計	96.88

(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 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	53	6,354,293.79	6,350,062.50	645,547,353	0.29
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	29	3,645,039.77	3,643,125	370,360,087	0.17
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	18	2,481,668.25	2,478,375	251,951,602	0.11
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	35	3,872,859	3,872,400	535,669,092	0.24
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	40	5,075,208	5,073,200	701,775,756	0.32

EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	55	8,086,240	8,081,150	1,117,865,479	0.50
-----------	-----------------------	----	-----	----	-----------	-----------	---------------	------

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

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	89,563,408,927	53.05
	イギリス	15,009,024,952	8.89
	スイス	7,299,527,177	4.32
	カナダ	7,280,425,830	4.31
	フランス	6,936,416,903	4.11
	ドイツ	6,707,694,826	3.97
	オーストラリア	5,219,758,943	3.09
	オランダ	2,682,756,587	1.59
	スペイン	2,594,171,181	1.54
	スウェーデン	2,229,517,906	1.32
	イタリア	1,753,570,782	1.04
	香港	1,675,816,882	0.99
	アイルランド	1,458,910,192	0.86
	デンマーク	1,054,644,228	0.62
	シンガポール	1,037,304,261	0.61
	ジャージー	896,474,471	0.53
	ベルギー	880,752,663	0.52
	キュラソー	723,240,362	0.43
	フィンランド	630,217,561	0.37
	バミューダ	618,118,570	0.37
	ノルウェー	538,379,109	0.32
	イスラエル	371,062,633	0.22
	ルクセンブルク	301,944,750	0.18
	オーストリア	195,936,673	0.12
	ケイマン	185,587,684	0.11
	ポルトガル	117,910,615	0.07
	ニュージーランド	100,684,990	0.06
	英ヴァージン諸島	92,864,348	0.06
	パナマ	80,775,128	0.05
	リベリア	48,478,858	0.03
ガーンジー	39,744,622	0.02	
マン島	34,019,156	0.02	
モーリシャス	13,475,615	0.01	
小計	158,372,617,385	93.80	
投資信託受益証券	オーストラリア	87,796,800	0.05
	シンガポール	19,594,965	0.01
	香港	14,588,808	0.01
	小計	121,980,573	0.07
投資証券	アメリカ	2,453,296,917	1.45
	オーストラリア	382,340,860	0.23
	フランス	227,303,393	0.13
	イギリス	222,806,416	0.13
	香港	67,516,500	0.04

	シンガポール	55,484,105	0.03
	カナダ	36,149,514	0.02
	オランダ	17,389,529	0.01
	小計	3,462,287,234	2.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,875,378,145	4.07
合計(純資産総額)		168,832,263,337	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

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	46,945	63,436.85	2,978,043,233	64,592.73	3,032,305,747	1.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	226,856	10,273.75	2,330,664,007	10,295.10	2,335,507,065	1.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	413,638	4,067.41	1,682,438,067	4,100.96	1,696,314,712	1.00
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	148,510	10,196.49	1,514,281,917	10,243.26	1,521,226,780	0.90
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	526,964	2,710.25	1,428,207,131	2,718.38	1,432,492,824	0.85
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	262,421	5,127.73	1,345,624,139	5,110.44	1,341,088,927	0.79
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	168,891	7,923.23	1,338,163,335	7,923.23	1,338,163,335	0.79
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	100,148	12,455.38	1,247,381,716	12,435.05	1,245,345,507	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	142,341	8,142.96	1,159,077,923	8,173.46	1,163,419,039	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	198,797	5,637.04	1,120,628,032	5,664.49	1,126,084,652	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	220,837	5,056.56	1,116,677,395	5,054.53	1,116,228,389	0.66
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	36,816	30,050.53	1,106,340,349	30,050.53	1,106,340,349	0.66
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	120,620	9,152.21	1,103,940,293	9,152.21	1,103,940,293	0.65
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,010,293	1,070.08	1,081,094,776	1,067.86	1,078,861,109	0.64
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	335,083	3,010.15	1,008,650,963	3,009.13	1,008,310,318	0.60
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	277,712	3,592.66	997,726,015	3,597.74	999,137,625	0.59
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	51,989	18,611.91	967,614,734	18,681.04	971,208,671	0.58
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	154,372	5,733.62	885,111,004	5,865.78	905,512,498	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	208,164	4,125.36	858,752,021	4,133.49	860,444,978	0.51

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,038	57,100.38	858,675,646	56,937.73	856,229,625	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,759	57,991.94	855,903,145	58,003.12	856,068,189	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	555,179	1,539.13	854,493,986	1,540.14	855,058,381	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	967,994	860.72	833,175,928	859.87	832,352,794	0.49
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	204,745	3,983.88	815,681,506	4,012.80	821,601,072	0.49
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	189,918	4,226.00	802,594,645	4,290.05	814,758,095	0.48
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	112,577	7,165.49	806,669,818	7,154.42	805,423,995	0.48
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	159,402	4,810.55	766,811,482	4,806.48	766,163,290	0.45
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	58,805	12,957.58	761,970,703	13,023.66	765,856,479	0.45
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	83,342	8,880.00	740,077,043	8,983.69	748,719,042	0.44
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	87,454	8,498.77	743,251,956	8,542.48	747,074,902	0.44

(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	93.80
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.05
合計	95.93

(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	10.17
		素材	5.47
		資本財	7.26
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.76
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.62
		メディア	2.87
		小売	2.82
		食品・生活必需品小売り	2.05
		食品・飲料・タバコ	5.96
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	2.88
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.72
		銀行	9.39
		各種金融	3.83
		保険	4.06
		不動産	0.62

	ソフトウェア・サービス	6.39
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.97
	電気通信サービス	3.23
	公益事業	3.20
	半導体・半導体製造装置	1.45
合計		93.80

(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	89	42,486,193	42,673,275	4,338,165,136	2.57
	S&P/TSE 60	モントリオール取引 所	買建	カナダドル	24	4,012,405.50	3,999,840	375,144,993	0.22
	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	35	3,050,600	3,050,600	345,541,462	0.20
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイ ツ金融先物取引所	買建	ユーロ	203	6,571,477.50	6,575,170	909,543,266	0.54
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	28	3,875,557	3,871,700	366,766,141	0.22
	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	72	4,921,488.75	4,939,200	840,009,744	0.50

(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

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	26,061,032,540	98.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		338,992,138	1.28
合計(純資産総額)		26,400,024,678	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

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	4,477	587,164.28	2,628,734,524	596,000.00	2,668,292,000	10.11
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,968	540,211.54	2,143,559,412	595,000.00	2,360,960,000	8.94
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	7,319	197,372.66	1,444,570,561	223,900.00	1,638,724,100	6.21
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,547	146,451.12	1,105,266,609	162,900.00	1,229,406,300	4.66
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,959	191,596.31	950,126,127	222,800.00	1,104,865,200	4.19
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	4,122	219,790.12	905,974,911	251,200.00	1,035,446,400	3.92
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	2,616	332,582.55	870,035,964	365,500.00	956,148,000	3.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	1,573	485,552.41	763,773,956	552,000.00	868,296,000	3.29
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	6,235	122,874.88	766,124,939	135,900.00	847,336,500	3.21
日本	投資証券	G L P投資法人	6,652	99,507.16	661,921,677	107,800.00	717,085,600	2.72
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	796	799,630.74	636,506,074	854,000.00	679,784,000	2.57
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	4,186	169,889.40	711,157,048	160,800.00	673,108,800	2.55
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	1,255	434,514.59	545,315,816	516,000.00	647,580,000	2.45
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,280	101,476.72	535,797,134	116,100.00	613,008,000	2.32
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	4,391	132,599.92	582,246,276	137,700.00	604,640,700	2.29
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,632	206,001.32	542,195,481	227,300.00	598,253,600	2.27
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,122	457,186.82	512,963,618	532,000.00	596,904,000	2.26
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,181	475,944.00	562,089,865	474,500.00	560,384,500	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,463	347,608.39	508,551,079	371,000.00	542,773,000	2.06
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	3,846	122,346.61	470,545,077	138,500.00	532,671,000	2.02
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,186	409,632.92	485,824,645	445,000.00	527,770,000	2.00
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	525	875,312.64	459,539,139	908,000.00	476,700,000	1.81
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	3,100	120,212.10	372,657,524	138,900.00	430,590,000	1.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	931	387,037.54	360,331,957	437,000.00	406,847,000	1.54
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,312	45,820.12	380,856,915	47,450.00	394,404,400	1.49
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,012	141,120.19	425,054,035	127,900.00	385,234,800	1.46
日本	投資証券	福岡リート投資法人	2,188	158,459.21	346,708,757	173,600.00	379,836,800	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,067	143,169.11	295,930,570	150,000.00	310,050,000	1.17
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	4,677	64,759.98	302,882,430	64,500.00	301,666,500	1.14
日本	投資証券	野村不動産レジデンシャル投資法人	510	555,385.65	283,246,685	570,000.00	290,700,000	1.10

(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	98.72
合計	98.72

(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	大阪取引所	買建	円	217	320,041,700	339,171,000	339,171,000	1.28

(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

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	21,265,859,080	66.96
	オーストラリア	3,009,095,129	9.47
	イギリス	2,148,965,828	6.77
	フランス	1,648,661,520	5.19
	シンガポール	1,211,561,748	3.81
	カナダ	844,093,309	2.66
	香港	560,301,600	1.76
	オランダ	371,096,499	1.17
	ベルギー	170,485,838	0.54
	ニュージーランド	108,847,607	0.34
	アイルランド	62,410,346	0.20
	ドイツ	50,111,895	0.16
	イタリア	37,636,604	0.12
	マン島	29,481,464	0.09
	イスラエル	10,679,760	0.03
ギリシャ	8,144,178	0.03	
	小計	31,537,432,405	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		222,082,286	0.70
合計(純資産総額)		31,759,514,691	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

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	111,990	14,844.80	1,662,469,577	16,803.38	1,881,810,682	5.93
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	34,710	26,420.70	917,062,785	28,094.82	975,171,306	3.07
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	51,640	16,349.86	844,307,106	17,281.18	892,400,310	2.81
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	119,070	5,374.17	639,903,398	6,260.22	745,404,728	2.35
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	177,180	3,972.70	703,883,357	4,202.62	744,620,991	2.34
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD GROUP	695,220	1,017.50	707,388,646	1,027.82	714,561,368	2.25
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	104,380	6,273.29	654,806,649	6,754.29	705,012,831	2.22
アメリカ	投資証券	HCP INC	162,170	4,018.38	651,662,058	4,230.07	685,990,873	2.16
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	62,300	9,145.35	569,755,347	10,821.70	674,192,346	2.12
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	54,290	10,422.02	565,811,642	12,146.33	659,424,624	2.08
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	102,880	6,106.55	628,242,138	6,371.03	655,451,792	2.06
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,540	12,550.84	546,463,582	14,268.99	621,272,155	1.96
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	270,860	1,922.21	520,651,787	2,216.18	600,276,681	1.89
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	277,200	1,681.33	466,065,025	1,806.14	500,662,950	1.58

アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	187,000	2,109.65	394,506,050	2,404.25	449,596,433	1.42
香港	投資証券	LINK REIT	820,000	495.64	406,428,825	540.13	442,908,240	1.39
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	354,990	1,066.47	378,587,937	1,219.40	432,875,480	1.36
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	21,930	16,152.89	354,232,967	18,251.01	400,244,864	1.26
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	33,870	9,460.47	320,426,168	11,080.93	375,311,437	1.18
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	78,980	4,100.53	323,860,372	4,407.97	348,142,070	1.10
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	147,360	2,149.55	316,758,524	2,316.83	341,408,275	1.07
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	50,560	5,873.31	296,954,753	6,681.09	337,796,173	1.06
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD RETAIL TRUST	1,059,850	287.83	305,065,213	306.92	325,294,673	1.02
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	253,700	1,379.87	350,073,766	1,254.48	318,262,692	1.00
オーストラリア	投資証券	STOCKLAND	816,210	375.87	306,796,882	368.49	300,773,140	0.95
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,500	10,808.16	253,991,882	12,097.54	284,292,190	0.90
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,600	4,864.42	231,546,844	5,835.28	277,759,518	0.87
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	554,800	472.27	262,020,204	485.01	269,087,764	0.85
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	251,000	891.02	223,647,213	1,010.21	253,564,165	0.80
アメリカ	投資証券	UDR INC	89,010	2,448.01	217,897,477	2,796.66	248,931,294	0.78

(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：2014年5月30日



基準価額・純資産の推移



基準価額	11,841円
純資産総額	92.59億円

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

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:20円

決算期	2009年11月	2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月
分配金	0円	0円	0円	0円	20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	21.5%	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	-	-	0.4%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.3%
国内株式 インデックス マザーファンド	19.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.9%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.5%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.5%	T 1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	-	1.375%	2015/11/30	0.2%
		T 0.375% 06/30/15	アメリカ	国債証券	-	0.375%	2015/06/30	0.2%
国内債券 インデックス マザーファンド	15.4%	第113回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.3%	2018/06/20	0.2%
		第117回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.2%	2019/03/20	0.2%
グローバル REITインデックス マザーファンド	10.9%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		UNIBAIL-RODAMCO SE	オランダ	投資証券	-	-	-	0.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.7%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.1%
		ジャパリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	1.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2014年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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、分配金再投資に関する契約（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）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、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）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

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

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

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

（ロ）申込単位

指定販売会社が個別に定める単位とします。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。

指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

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、指定販売会社が個別に定める単位とします。（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、

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基づいて行われます。

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、前記の規定に基づい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1万口あたりに換算した価額で行われます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成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發します。

(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します。

(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れ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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れ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にあっても、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。

（二）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れ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）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。

(二) 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6期計算期間(平成24年11月13日から平成25年11月11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。

「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,275,133,768
株式	141,087,888,760
派生商品評価勘定	6,156,875
未収入金	1,376,600
未収配当金	1,065,443,953
未収利息	1,737
前払金	36,645,000
差入委託証拠金	69,420,000
流動資産合計	143,542,066,693
資産合計	143,542,066,693
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,682,600
未払解約金	205,141,978
流動負債合計	225,824,578
負債合計	225,824,578
純資産の部	
元本等	
元本	147,700,483,382
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,384,241,267
元本等合計	143,316,242,115
純資産合計	143,316,242,115
負債純資産合計	143,542,066,693

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額	196,416,477,753円
計算期間中の追加設定元本額	22,645,132,747円
計算期間中の一部解約元本額	71,361,127,118円
計算日の元本額	147,700,483,382円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,177,975,181円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,603,869,833円
SBI資産設計オープン(分配型)	27,214,358円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,468,820,160円
世界経済インデックスファンド	245,736,404円
マイセレクション25	73,074,331円
マイセレクション50	135,130,908円
マイセレクション75	153,420,895円
日本株式インデックス・オープン	18,234,887,569円
DCマイセレクション25	4,705,460,787円
DCマイセレクション50	15,749,178,139円
DCマイセレクション75	14,878,637,293円
DC日本株式インデックス・オープン	3,929,408,741円

DCマイセレクションS25	1,683,571,361円
DCマイセレクションS50	5,280,627,322円
DCマイセレクションS75	3,384,746,927円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,302,715,931円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	16,412,459円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	426,709,488円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	429,706,753円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	199,793,911円
DC世界経済インデックスファンド	174,862,283円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	353,724,835円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	199,390,414円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	423,236,090円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	209,062,872円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	2,073,434,081円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,541,631円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	27,562,886円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,136,237,226円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	4,237,034,836円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	9,272,434,000円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,408,429,147円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,433,535,907円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,931,502,257円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,491,986,680円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,805,868,835円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,037,071,202円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,172,922,588円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,316,510,718円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,193,949,347円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,617,590,339円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	130,702,008円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,986,518,535円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,449,181,875円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,939,673円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	38,953円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,985円

2. 計算日における受益権総数 147,700,483,382口

3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,384,241,267円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9703円 (9,703円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>4. 金銭債権の計算日後の償還予定額</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> <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> <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25年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,078,033,211	
合計	1,078,033,211	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年11月11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25年11月11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	2,151,125,725	-	2,136,600,000	14,525,725
	合計	2,151,125,725	-	2,136,600,000	14,525,725

(注)1. 時価の算定方法

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

- 2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在

該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25年11月11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	37,000	260.00	9,620,000	
日本水産	116,000	209.00	24,244,000	
マルハニチロホールディングス	182,000	182.00	33,124,000	
サカタのタネ	13,900	1,330.00	18,487,000	
ホクト	10,500	1,890.00	19,845,000	
住石ホールディングス	26,200	138.00	3,615,600	
日鉄鉱業	24,000	513.00	12,312,000	
三井松島産業	62,000	150.00	9,300,000	
国際石油開発帝石	458,800	1,120.00	513,856,000	
日本海洋掘削	2,400	6,520.00	15,648,000	
関東天然瓦斯開発	10,000	653.00	6,530,000	
石油資源開発	13,400	3,775.00	50,585,000	
ショーボンドホールディングス	8,400	4,445.00	37,338,000	
ミライト・ホールディングス	26,900	850.00	22,865,000	
タマホーム	4,800	1,039.00	4,987,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,300	1,911.00	2,484,300	
安藤・間	60,200	364.00	21,912,800	
東急建設	40,000	546.00	21,840,000	
コムシスホールディングス	45,800	1,349.00	61,784,200	
ミサワホーム	11,500	1,620.00	18,630,000	
高松コンストラクショングループ	7,300	1,837.00	13,410,100	
東建コーポレーション	3,580	5,130.00	18,365,400	
ヤマウラ	5,600	281.00	1,573,600	
大成建設	478,000	492.00	235,176,000	
大林組	283,000	606.00	171,498,000	
清水建設	289,000	494.00	142,766,000	
長谷工コーポレーション	125,800	704.00	88,563,200	
松井建設	16,000	428.00	6,848,000	
鹿島建設	415,000	413.00	171,395,000	
不動テトラ	66,600	185.00	12,321,000	
鉄建建設	57,000	323.00	18,411,000	

日鉄住金テックスエンジ	18,000	423.00	7,614,000	
西松建設	131,000	336.00	44,016,000	
三井住友建設	253,600	126.00	31,953,600	
前田建設工業	61,000	712.00	43,432,000	
ナカノフドー建設	16,700	248.00	4,141,600	
奥村組	84,000	462.00	38,808,000	
大和小田急建設	5,000	270.00	1,350,000	
東鉄工業	11,400	2,154.00	24,555,600	
イチケン	20,000	186.00	3,720,000	
戸田建設	110,000	351.00	38,610,000	
熊谷組	74,000	293.00	21,682,000	
青木あすなる建設	6,300	586.00	3,691,800	
北野建設	21,000	222.00	4,662,000	
植木組	26,000	226.00	5,876,000	
三井ホーム	13,000	476.00	6,188,000	
矢作建設工業	15,000	791.00	11,865,000	
ピーエス三菱	7,100	494.00	3,507,400	
大東建託	35,900	9,750.00	350,025,000	
新日本建設	22,700	342.00	7,763,400	
N I P P O	22,000	1,813.00	39,886,000	
東亜道路工業	20,000	552.00	11,040,000	
前田道路	30,000	1,616.00	48,480,000	
日本道路	27,000	585.00	15,795,000	
東亜建設工業	88,000	237.00	20,856,000	
東洋建設	33,500	375.00	12,562,500	
五洋建設	114,500	303.00	34,693,500	
大林道路	13,000	582.00	7,566,000	
福田組	22,000	404.00	8,888,000	
住友林業	65,200	1,143.00	74,523,600	
日本基礎技術	13,300	407.00	5,413,100	
日成ビルド工業	40,000	230.00	9,200,000	
巴コーポレーション	11,700	507.00	5,931,900	
パナホーム	36,000	639.00	23,004,000	
大和ハウス工業	259,000	1,864.00	482,776,000	
ライト工業	20,500	775.00	15,887,500	
積水ハウス	248,000	1,336.00	331,328,000	
日特建設	14,500	402.00	5,829,000	
北陸電気工事	7,000	410.00	2,870,000	
ユアテック	15,000	306.00	4,590,000	

西部電気工業	9,000	428.00	3,852,000	
四電工	8,000	352.00	2,816,000	
中電工	13,700	1,536.00	21,043,200	
関電工	43,000	635.00	27,305,000	
きんでん	63,000	1,069.00	67,347,000	
東京エネシス	11,000	520.00	5,720,000	
トーエネック	14,000	591.00	8,274,000	
住友電設	6,600	1,464.00	9,662,400	
日本電設工業	15,000	1,328.00	19,920,000	
協和エクシオ	37,000	1,141.00	42,217,000	
新日本空調	8,400	601.00	5,048,400	
N D S	14,000	282.00	3,948,000	
九電工	19,000	583.00	11,077,000	
三機工業	21,000	590.00	12,390,000	
日揮	95,000	3,725.00	353,875,000	
中外炉工業	29,000	251.00	7,279,000	
ヤマト	9,000	342.00	3,078,000	
太平電業	14,000	627.00	8,778,000	
高砂熱学工業	27,300	809.00	22,085,700	
三晃金属工業	17,000	269.00	4,573,000	
朝日工業社	12,000	345.00	4,140,000	
明星工業	15,000	404.00	6,060,000	
大気社	12,600	2,132.00	26,863,200	
ダイダン	13,000	526.00	6,838,000	
日比谷総合設備	11,600	1,036.00	12,017,600	
東芝プラントシステム	15,000	1,583.00	23,745,000	
東洋エンジニアリング	51,000	403.00	20,553,000	
千代田化工建設	75,000	1,219.00	91,425,000	
新興プランテック	19,500	785.00	15,307,500	
日本製粉	58,000	470.00	27,260,000	
日清製粉グループ本社	94,100	1,033.00	97,205,300	
日東富士製粉	8,000	303.00	2,424,000	
昭和産業	39,000	299.00	11,661,000	
鳥越製粉	7,600	664.00	5,046,400	
協同飼料	33,000	112.00	3,696,000	
中部飼料	9,100	557.00	5,068,700	
日本配合飼料	32,000	122.00	3,904,000	
東洋精糖	18,000	102.00	1,836,000	
日本甜菜製糖	48,000	180.00	8,640,000	

三井製糖	37,000	355.00	13,135,000	
森永製菓	93,000	207.00	19,251,000	
中村屋	22,000	396.00	8,712,000	
江崎グリコ	34,000	1,051.00	35,734,000	
名糖産業	4,200	1,008.00	4,233,600	
不二家	54,000	190.00	10,260,000	
山崎製パン	69,000	1,010.00	69,690,000	
モロゾフ	15,000	308.00	4,620,000	
亀田製菓	5,300	2,867.00	15,195,100	
カルビー	34,500	2,522.00	87,009,000	
森永乳業	81,000	296.00	23,976,000	
六甲バター	4,300	815.00	3,504,500	
ヤクルト本社	55,200	5,000.00	276,000,000	
明治ホールディングス	28,000	5,450.00	152,600,000	
雪印メグミルク	20,400	1,269.00	25,887,600	
プリマハム	48,000	208.00	9,984,000	
日本ハム	66,000	1,516.00	100,056,000	
伊藤ハム	52,000	419.00	21,788,000	
丸大食品	45,000	304.00	13,680,000	
米久	3,100	774.00	2,399,400	
S Foods	6,000	982.00	5,892,000	
サッポロホールディングス	156,000	433.00	67,548,000	
アサヒグループホールディングス	189,700	2,698.00	511,810,600	
キリンホールディングス	404,000	1,457.00	588,628,000	
宝ホールディングス	74,000	932.00	68,968,000	
オエノンホールディングス	24,000	239.00	5,736,000	
養命酒製造	7,000	805.00	5,635,000	
コカ・コーラウエスト	29,100	2,219.00	64,572,900	
コカ・コーライーストジャパン	19,500	1,795.00	35,002,500	
サントリー食品インターナショナル	48,500	3,225.00	156,412,500	
ダイトードリンコ	4,300	4,230.00	18,189,000	
伊藤園	25,700	2,181.00	56,051,700	
キーコーヒー	8,900	1,540.00	13,706,000	
ユニカフェ	2,700	544.00	1,468,800	
ジャパンフーズ	1,700	1,229.00	2,089,300	
日清オイリオグループ	41,000	322.00	13,202,000	
不二製油	22,900	1,643.00	37,624,700	
かどや製油	900	2,665.00	2,398,500	
J - オイルミルズ	40,000	284.00	11,360,000	

キッコーマン	77,000	1,850.00	142,450,000	
味の素	225,000	1,415.00	318,375,000	
キューピー	48,000	1,474.00	70,752,000	
ハウス食品グループ本社	33,200	1,556.00	51,659,200	
カゴメ	36,500	1,670.00	60,955,000	
焼津水産化学工業	4,500	859.00	3,865,500	
アリアケジャパン	8,600	2,345.00	20,167,000	
ニチレイ	101,000	502.00	50,702,000	
東洋水産	46,000	2,950.00	135,700,000	
日清食品ホールディングス	36,900	4,085.00	150,736,500	
永谷園	9,000	887.00	7,983,000	
フジッコ	9,000	1,191.00	10,719,000	
ロック・フィールド	4,900	1,869.00	9,158,100	
日本たばこ産業	522,900	3,510.00	1,835,379,000	
ケンコーマヨネーズ	3,200	893.00	2,857,600	
わらべや日洋	5,600	1,826.00	10,225,600	
なとり	4,400	955.00	4,202,000	
ミヨシ油脂	34,000	153.00	5,202,000	
片倉工業	10,200	1,126.00	11,485,200	
ゲンゼ	72,000	261.00	18,792,000	
東洋紡	373,000	188.00	70,124,000	
ユニチカ	242,000	60.00	14,520,000	
富士紡ホールディングス	46,000	193.00	8,878,000	
日清紡ホールディングス	56,000	820.00	45,920,000	
倉敷紡績	91,000	170.00	15,470,000	
シキボウ	51,000	133.00	6,783,000	
日本毛織	28,000	763.00	21,364,000	
トーア紡コーポレーション	37,000	77.00	2,849,000	
ダイドーリミテッド	10,100	629.00	6,352,900	
帝国繊維	9,000	907.00	8,163,000	
帝人	361,000	211.00	76,171,000	
東レ	640,000	663.00	424,320,000	
サカイオーベックス	24,000	154.00	3,696,000	
住江織物	29,000	282.00	8,178,000	
日本フェルト	5,100	441.00	2,249,100	
イチカワ	7,000	289.00	2,023,000	
日本バイリーン	12,000	566.00	6,792,000	
芦森工業	27,000	132.00	3,564,000	
アツギ	76,000	115.00	8,740,000	

ダイニック	17,000	170.00	2,890,000	
セーレン	23,800	653.00	15,541,400	
東海染工	12,000	122.00	1,464,000	
小松精練	15,000	472.00	7,080,000	
ワコールホールディングス	53,000	1,090.00	57,770,000	
ホギメディカル	5,600	5,430.00	30,408,000	
レナウン	21,200	128.00	2,713,600	
クラウディア	2,000	1,089.00	2,178,000	
T S Iホールディングス	43,100	659.00	28,402,900	
三陽商会	47,000	270.00	12,690,000	
オンワードホールディングス	59,000	781.00	46,079,000	
ルック	19,000	289.00	5,491,000	
ゴールドウイン	22,000	439.00	9,658,000	
デザート	20,000	710.00	14,200,000	
キング	5,700	411.00	2,342,700	
ヤマトインターナショナル	5,600	434.00	2,430,400	
特種東海製紙	51,000	200.00	10,200,000	
王子ホールディングス	390,000	439.00	171,210,000	
日本製紙	45,600	1,701.00	77,565,600	
三菱製紙	125,000	88.00	11,000,000	
北越紀州製紙	60,000	441.00	26,460,000	
中越パルプ工業	34,000	156.00	5,304,000	
巴川製紙所	14,000	179.00	2,506,000	
大王製紙	30,000	784.00	23,520,000	
レンゴー	71,000	494.00	35,074,000	
トーモク	28,000	320.00	8,960,000	
ザ・パック	6,200	1,895.00	11,749,000	
クラレ	140,100	1,178.00	165,037,800	
旭化成	550,000	768.00	422,400,000	
共和レザー	5,900	442.00	2,607,800	
コープケミカル	13,000	139.00	1,807,000	
昭和電工	587,000	140.00	82,180,000	
住友化学	649,000	374.00	242,726,000	
日本化成	16,000	137.00	2,192,000	
住友精化	18,000	647.00	11,646,000	
日産化学工業	60,400	1,538.00	92,895,200	
ラサ工業	33,000	204.00	6,732,000	
クレハ	62,000	376.00	23,312,000	
多木化学	6,000	760.00	4,560,000	

テイカ	15,000	291.00	4,365,000	
石原産業	158,000	98.00	15,484,000	
片倉チッカリン	6,000	264.00	1,584,000	
日本曹達	56,000	617.00	34,552,000	
東ソー	236,000	420.00	99,120,000	
トクヤマ	137,000	387.00	53,019,000	
セントラル硝子	84,000	331.00	27,804,000	
東亜合成	104,000	443.00	46,072,000	
ダイソー	35,000	291.00	10,185,000	
関東電化工業	21,000	201.00	4,221,000	
電気化学工業	176,000	415.00	73,040,000	
信越化学工業	158,200	5,860.00	927,052,000	
日本カーバイド工業	26,000	301.00	7,826,000	
堺化学工業	36,000	323.00	11,628,000	
エア・ウォーター	73,000	1,342.00	97,966,000	
大陽日酸	113,000	643.00	72,659,000	
日本化学工業	33,000	162.00	5,346,000	
日本パーカライジング	21,000	2,000.00	42,000,000	
高圧ガス工業	13,000	547.00	7,111,000	
チタン工業	10,000	245.00	2,450,000	
四国化成工業	13,000	755.00	9,815,000	
戸田工業	16,000	285.00	4,560,000	
ステラ ケミファ	4,500	1,724.00	7,758,000	
保土谷化学工業	26,000	192.00	4,992,000	
日本触媒	75,000	1,237.00	92,775,000	
大日精化工業	34,000	413.00	14,042,000	
カネカ	110,000	624.00	68,640,000	
三菱瓦斯化学	139,000	787.00	109,393,000	
三井化学	401,000	225.00	90,225,000	
J S R	80,900	1,879.00	152,011,100	
東京応化工業	17,100	2,061.00	35,243,100	
大阪有機化学工業	6,000	436.00	2,616,000	
三菱ケミカルホールディングス	551,500	452.00	249,278,000	
日本合成化学工業	18,000	928.00	16,704,000	
ダイセル	114,000	803.00	91,542,000	
住友ベークライト	69,000	350.00	24,150,000	
積水化学工業	181,000	1,087.00	196,747,000	
日本ゼオン	70,000	1,181.00	82,670,000	
アイカ工業	24,800	2,035.00	50,468,000	

宇部興産	444,000	192.00	85,248,000	
積水樹脂	12,000	1,398.00	16,776,000	
タキロン	21,000	404.00	8,484,000	
旭有機材工業	31,000	213.00	6,603,000	
日立化成	38,100	1,505.00	57,340,500	
ニチバン	9,000	379.00	3,411,000	
リケンテクノス	14,000	435.00	6,090,000	
大倉工業	21,000	338.00	7,098,000	
積水化成成品工業	25,000	266.00	6,650,000	
群栄化学工業	24,000	465.00	11,160,000	
タイガースポリマー	4,500	419.00	1,885,500	
ミライアル	2,200	1,537.00	3,381,400	
日本化薬	62,000	1,362.00	84,444,000	
カーリットホールディングス	7,100	486.00	3,450,600	
日本精化	7,300	654.00	4,774,200	
A D E K A	37,900	1,130.00	42,827,000	
日油	73,000	706.00	51,538,000	
ハリマ化成グループ	7,600	452.00	3,435,200	
花王	229,300	3,245.00	744,078,500	
第一工業製薬	16,000	239.00	3,824,000	
三洋化成工業	28,000	647.00	18,116,000	
大日本塗料	50,000	164.00	8,200,000	
日本ペイント	76,000	1,679.00	127,604,000	
関西ペイント	107,000	1,325.00	141,775,000	
神東塗料	5,000	223.00	1,115,000	
中国塗料	25,000	564.00	14,100,000	
日本特殊塗料	6,800	545.00	3,706,000	
藤倉化成	11,100	541.00	6,005,100	
太陽ホールディングス	7,200	3,120.00	22,464,000	
D I C	312,000	289.00	90,168,000	
サカタインクス	18,000	980.00	17,640,000	
東洋インキ S C ホールディングス	79,000	519.00	41,001,000	
T & K T O K A	3,200	2,007.00	6,422,400	
富士フイルムホールディングス	201,800	2,442.00	492,795,600	
資生堂	156,900	1,679.00	263,435,100	
ライオン	102,000	593.00	60,486,000	
高砂香料工業	32,000	583.00	18,656,000	
マンダム	8,900	3,265.00	29,058,500	
ミルボン	4,700	4,210.00	19,787,000	

ファンケル	20,500	1,155.00	23,677,500	
コーセー	14,300	3,105.00	44,401,500	
ドクターシーラボ	60	324,000.00	19,440,000	
シーボン	800	2,002.00	1,601,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,000	3,360.00	30,240,000	
ノエビアホールディングス	5,900	1,618.00	9,546,200	
エステー	5,500	998.00	5,489,000	
コニシ	6,400	1,936.00	12,390,400	
長谷川香料	11,200	1,418.00	15,881,600	
星光P M C	3,800	466.00	1,770,800	
小林製薬	14,500	5,390.00	78,155,000	
荒川化学工業	7,400	917.00	6,785,800	
メック	7,000	538.00	3,766,000	
日本高純度化学	25	217,100.00	5,427,500	
J C U	1,300	4,460.00	5,798,000	
新田ゼラチン	5,300	1,032.00	5,469,600	
アース製薬	6,400	3,625.00	23,200,000	
イハラケミカル工業	14,000	736.00	10,304,000	
北興化学工業	9,000	295.00	2,655,000	
大成ラミック	2,300	2,508.00	5,768,400	
クミアイ化学工業	18,000	704.00	12,672,000	
日本農薬	20,000	1,152.00	23,040,000	
アキレス	70,000	150.00	10,500,000	
有沢製作所	14,700	543.00	7,982,100	
日東電工	72,700	5,170.00	375,859,000	
レック	2,800	1,221.00	3,418,800	
きもと	6,500	915.00	5,947,500	
藤森工業	7,600	2,773.00	21,074,800	
前澤化成工業	6,200	1,024.00	6,348,800	
J S P	5,800	1,508.00	8,746,400	
エフピコ	4,300	7,450.00	32,035,000	
天馬	7,100	1,283.00	9,109,300	
信越ポリマー	17,300	344.00	5,951,200	
東リ	23,000	203.00	4,669,000	
ニフコ	19,700	2,567.00	50,569,900	
日本バルカー工業	37,000	269.00	9,953,000	
ユニ・チャーム	54,100	6,190.00	334,879,000	
協和発酵キリン	105,000	1,063.00	111,615,000	
武田薬品工業	330,300	4,715.00	1,557,364,500	

アステラス製薬	203,100	5,930.00	1,204,383,000	
大日本住友製薬	62,400	1,362.00	84,988,800	
塩野義製薬	137,700	2,197.00	302,526,900	
田辺三菱製薬	73,400	1,374.00	100,851,600	
わかもと製薬	10,000	255.00	2,550,000	
あすか製薬	10,000	699.00	6,990,000	
日本新薬	20,000	1,737.00	34,740,000	
ピオフェルミン製薬	1,400	2,379.00	3,330,600	
中外製薬	87,800	2,285.00	200,623,000	
科研製薬	32,000	1,557.00	49,824,000	
エーザイ	108,500	3,900.00	423,150,000	
ロート製薬	37,000	1,450.00	53,650,000	
小野薬品工業	40,100	8,050.00	322,805,000	
久光製薬	27,400	5,230.00	143,302,000	
有機合成薬品工業	6,000	269.00	1,614,000	
持田製薬	6,500	6,270.00	40,755,000	
参天製薬	32,400	4,810.00	155,844,000	
扶桑薬品工業	30,000	312.00	9,360,000	
日本ケミファ	12,000	450.00	5,400,000	
ツムラ	25,900	2,811.00	72,804,900	
日医工	13,800	2,216.00	30,580,800	
キッセイ薬品工業	16,400	2,186.00	35,850,400	
生化学工業	18,400	1,299.00	23,901,600	
栄研化学	6,800	1,939.00	13,185,200	
日水製薬	3,500	1,074.00	3,759,000	
鳥居薬品	6,000	2,600.00	15,600,000	
東和薬品	4,500	4,685.00	21,082,500	
富士製薬工業	2,500	1,713.00	4,282,500	
沢井製薬	12,600	6,870.00	86,562,000	
ゼリア新薬工業	13,900	2,091.00	29,064,900	
第一三共	278,000	1,894.00	526,532,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,500	2,005.00	47,117,500	
大幸薬品	4,100	1,629.00	6,678,900	
ダイト	2,900	1,395.00	4,045,500	
大塚ホールディングス	175,000	2,758.00	482,650,000	
大正製薬ホールディングス	21,200	7,080.00	150,096,000	
日本コークス工業	71,100	119.00	8,460,900	
昭和シェル石油	78,800	1,028.00	81,006,400	
コスモ石油	244,000	167.00	40,748,000	

ニチレキ	11,000	1,217.00	13,387,000	
東燃ゼネラル石油	133,000	925.00	123,025,000	
ユシロ化学工業	4,800	917.00	4,401,600	
ピーピー・カストロール	3,600	461.00	1,659,600	
富士石油	22,500	308.00	6,930,000	
MORESCO	2,100	1,530.00	3,213,000	
出光興産	10,500	8,510.00	89,355,000	
JXホールディングス	978,600	507.00	496,150,200	
横浜ゴム	99,000	911.00	90,189,000	
東洋ゴム工業	73,000	580.00	42,340,000	
ブリヂストン	276,300	3,420.00	944,946,000	
住友ゴム工業	68,800	1,294.00	89,027,200	
藤倉ゴム工業	5,500	445.00	2,447,500	
オカモト	31,000	316.00	9,796,000	
フコク	3,700	853.00	3,156,100	
ニッタ	8,700	2,105.00	18,313,500	
東海ゴム工業	16,300	906.00	14,767,800	
三ツ星ベルト	22,000	533.00	11,726,000	
バンドー化学	32,000	393.00	12,576,000	
日東紡績	65,000	461.00	29,965,000	
旭硝子	434,000	607.00	263,438,000	
日本板硝子	424,000	124.00	52,576,000	
石塚硝子	11,000	361.00	3,971,000	
日本山村硝子	35,000	177.00	6,195,000	
日本電気硝子	182,000	524.00	95,368,000	
オハラ	3,400	604.00	2,053,600	
住友大阪セメント	168,000	401.00	67,368,000	
太平洋セメント	518,000	415.00	214,970,000	
デイ・シイ	9,600	737.00	7,075,200	
日本ヒューム	9,000	861.00	7,749,000	
日本コンクリート工業	16,000	577.00	9,232,000	
三谷セキサン	4,500	1,356.00	6,102,000	
ジャパンパイル	7,400	981.00	7,259,400	
東海カーボン	83,000	327.00	27,141,000	
日本カーボン	47,000	187.00	8,789,000	
東洋炭素	4,900	1,788.00	8,761,200	
ノリタケカンパニーリミテド	50,000	255.00	12,750,000	
TOTO	130,000	1,344.00	174,720,000	
日本碍子	111,000	1,679.00	186,369,000	

日本特殊陶業	76,000	2,266.00	172,216,000	
MARUWA	2,300	3,570.00	8,211,000	
品川リフラクトリーズ	24,000	212.00	5,088,000	
黒崎播磨	21,000	274.00	5,754,000	
ヨータイ	5,000	297.00	1,485,000	
イソライト工業	5,500	185.00	1,017,500	
東京窯業	11,000	250.00	2,750,000	
ニッカトー	3,300	409.00	1,349,700	
フジミインコーポレーテッド	8,100	1,307.00	10,586,700	
ニチアス	43,000	653.00	28,079,000	
ニチハ	10,800	1,337.00	14,439,600	
新日鐵住金	3,727,000	318.00	1,185,186,000	
神戸製鋼所	1,223,000	169.00	206,687,000	
合同製鐵	45,000	177.00	7,965,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	224,900	2,205.00	495,904,500	
日新製鋼ホールディングス	38,100	1,397.00	53,225,700	
東京製鐵	49,800	517.00	25,746,600	
共英製鋼	8,200	2,039.00	16,719,800	
大和工業	18,200	3,405.00	61,971,000	
東京鐵鋼	18,000	416.00	7,488,000	
大阪製鐵	4,400	1,887.00	8,302,800	
淀川製鋼所	63,000	438.00	27,594,000	
東洋鋼鈹	21,000	436.00	9,156,000	
丸一鋼管	29,500	2,464.00	72,688,000	
モリ工業	13,000	411.00	5,343,000	
大同特殊鋼	148,000	531.00	78,588,000	
日本高周波鋼業	39,000	103.00	4,017,000	
日本冶金工業	72,500	311.00	22,547,500	
山陽特殊製鋼	48,000	468.00	22,464,000	
愛知製鋼	47,000	461.00	21,667,000	
日立金属	79,000	1,299.00	102,621,000	
日本金属	23,000	130.00	2,990,000	
大平洋金属	62,000	355.00	22,010,000	
日本電工	38,000	282.00	10,716,000	
栗本鐵工所	46,000	259.00	11,914,000	
虹技	11,000	196.00	2,156,000	
日本鑄鉄管	10,000	242.00	2,420,000	
三菱製鋼	55,000	276.00	15,180,000	
日亜鋼業	12,000	366.00	4,392,000	

日本精線	7,000	424.00	2,968,000	
シンニッタン	8,500	366.00	3,111,000	
新家工業	19,000	169.00	3,211,000	
大紀アルミニウム工業所	16,000	269.00	4,304,000	
日本軽金属ホールディングス	199,800	139.00	27,772,200	
三井金属鉱業	225,000	255.00	57,375,000	
東邦亜鉛	50,000	286.00	14,300,000	
三菱マテリアル	550,000	369.00	202,950,000	
住友金属鉱山	228,000	1,321.00	301,188,000	
DOWAホールディングス	97,000	916.00	88,852,000	
古河機械金属	149,000	202.00	30,098,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,600	2,045.00	19,632,000	
東邦チタニウム	14,900	758.00	11,294,200	
UACJ	113,000	311.00	35,143,000	
古河電気工業	277,000	226.00	62,602,000	
住友電気工業	332,100	1,444.00	479,552,400	
フジクラ	142,000	436.00	61,912,000	
昭和電線ホールディングス	113,000	103.00	11,639,000	
タツタ電線	13,500	558.00	7,533,000	
沖電線	13,000	167.00	2,171,000	
カナレ電気	1,400	1,517.00	2,123,800	
平河ヒューテック	2,100	743.00	1,560,300	
リョービ	54,000	446.00	24,084,000	
アサヒホールディングス	13,500	1,667.00	22,504,500	
稲葉製作所	3,800	1,243.00	4,723,400	
トーカロ	5,400	1,604.00	8,661,600	
アルファC o	4,100	1,019.00	4,177,900	
SUMCO	55,200	859.00	47,416,800	
川田テクノロジーズ	2,300	2,762.00	6,352,600	
東洋製罐グループホールディングス	62,700	1,961.00	122,954,700	
ホッカンホールディングス	25,000	305.00	7,625,000	
コロナ	4,700	1,098.00	5,160,600	
横河ブリッジホールディングス	17,000	1,407.00	23,919,000	
日本橋梁	19,200	209.00	4,012,800	
駒井ハルテック	21,000	333.00	6,993,000	
高田機工	12,000	229.00	2,748,000	
三和ホールディングス	75,000	623.00	46,725,000	
文化シャッター	23,000	562.00	12,926,000	
三協立山	12,100	2,005.00	24,260,500	

東洋シャッター	4,500	600.00	2,700,000	
LIXILグループ	122,800	2,299.00	282,317,200	
日本フィルコン	8,400	442.00	3,712,800	
ノーリツ	17,300	2,252.00	38,959,600	
長府製作所	9,400	2,181.00	20,501,400	
リンナイ	13,700	7,520.00	103,024,000	
ダイニチ工業	4,500	816.00	3,672,000	
日東精工	15,000	334.00	5,010,000	
三洋工業	17,000	186.00	3,162,000	
岡部	18,000	1,255.00	22,590,000	
東プレ	17,400	1,349.00	23,472,600	
高周波熱錬	13,600	904.00	12,294,400	
サンコール	7,000	608.00	4,256,000	
モリテック スチール	8,100	285.00	2,308,500	
パイオラックス	4,100	3,210.00	13,161,000	
日本発條	70,200	1,114.00	78,202,800	
中央発條	11,000	304.00	3,344,000	
三益半導体工業	7,500	870.00	6,525,000	
アタカ大機	7,000	424.00	2,968,000	
日本製鋼所	126,000	521.00	65,646,000	
三浦工業	13,100	2,695.00	35,304,500	
タクマ	28,000	832.00	23,296,000	
ツガミ	28,000	502.00	14,056,000	
オークマ	57,000	876.00	49,932,000	
東芝機械	48,000	541.00	25,968,000	
アマダ	135,000	843.00	113,805,000	
アイダエンジニアリング	20,700	925.00	19,147,500	
滝澤鉄工所	27,000	142.00	3,834,000	
富士機械製造	26,900	800.00	21,520,000	
牧野フライス製作所	44,000	753.00	33,132,000	
オーエスジー	36,200	1,580.00	57,196,000	
ダイジェット工業	13,000	152.00	1,976,000	
旭ダイヤモンド工業	22,700	875.00	19,862,500	
D M G 森精機	46,500	1,607.00	74,725,500	
ディスコ	9,800	6,440.00	63,112,000	
日東工器	5,200	1,850.00	9,620,000	
豊和工業	5,200	872.00	4,534,400	
大阪機工	34,000	139.00	4,726,000	
東洋機械金属	8,700	389.00	3,384,300	

津田駒工業	21,000	158.00	3,318,000	
島精機製作所	11,500	1,950.00	22,425,000	
日阪製作所	11,000	923.00	10,153,000	
やまびこ	3,500	2,838.00	9,933,000	
ペガサスミシン製造	10,600	364.00	3,858,400	
ナブテスコ	40,300	2,227.00	89,748,100	
三井海洋開発	7,300	2,908.00	21,228,400	
レオン自動機	8,000	504.00	4,032,000	
S M C	25,200	22,310.00	562,212,000	
新川	8,100	653.00	5,289,300	
ホソカワミクロン	15,000	620.00	9,300,000	
ユニオンツール	3,800	2,269.00	8,622,200	
オイレス工業	8,400	2,134.00	17,925,600	
日精エー・エス・ビー機械	2,800	1,929.00	5,401,200	
サトーホールディングス	9,200	2,064.00	18,988,800	
日本エアーテック	4,200	493.00	2,070,600	
日精樹脂工業	7,000	612.00	4,284,000	
ワイエイシイ	4,700	615.00	2,890,500	
小松製作所	411,300	2,116.00	870,310,800	
住友重機械工業	241,000	449.00	108,209,000	
日立建機	45,000	2,039.00	91,755,000	
日工	13,000	521.00	6,773,000	
巴工業	3,100	1,517.00	4,702,700	
井関農機	90,000	321.00	28,890,000	
T O W A	8,200	480.00	3,936,000	
丸山製作所	21,000	263.00	5,523,000	
北川鉄工所	44,000	199.00	8,756,000	
クボタ	460,000	1,594.00	733,240,000	
荏原実業	2,300	1,340.00	3,082,000	
三菱化工機	29,000	166.00	4,814,000	
月島機械	14,000	1,083.00	15,162,000	
帝国電機製作所	3,300	2,308.00	7,616,400	
新東工業	20,800	713.00	14,830,400	
澁谷工業	5,500	1,837.00	10,103,500	
アイチ コーポレーション	12,500	489.00	6,112,500	
小森コーポレーション	21,500	1,600.00	34,400,000	
鶴見製作所	7,000	995.00	6,965,000	
住友精密工業	14,000	405.00	5,670,000	
酒井重工業	18,000	427.00	7,686,000	

荏原製作所	195,000	568.00	110,760,000	
石井鐵工所	16,000	283.00	4,528,000	
西島製作所	9,400	876.00	8,234,400	
ダイキン工業	115,000	5,880.00	676,200,000	
オルガノ	14,000	467.00	6,538,000	
トーヨーカネツ	47,000	286.00	13,442,000	
栗田工業	53,000	2,107.00	111,671,000	
椿本チエイン	45,000	657.00	29,565,000	
大同工業	20,000	273.00	5,460,000	
日本コンベヤ	27,000	141.00	3,807,000	
木村化工機	9,800	509.00	4,988,200	
アネスト岩田	15,000	490.00	7,350,000	
ダイフク	35,500	1,257.00	44,623,500	
加藤製作所	21,000	628.00	13,188,000	
油研工業	20,000	218.00	4,360,000	
タダノ	37,000	1,305.00	48,285,000	
フジテック	25,000	1,218.00	30,450,000	
C K D	23,700	959.00	22,728,300	
キトー	5,200	1,559.00	8,106,800	
平和	18,600	1,611.00	29,964,600	
理想科学工業	6,500	2,183.00	14,189,500	
S A N K Y O	25,500	4,545.00	115,897,500	
日本金銭機械	8,200	2,109.00	17,293,800	
マースエンジニアリング	4,800	1,919.00	9,211,200	
福島工業	4,700	1,530.00	7,191,000	
オーイズミ	3,900	1,263.00	4,925,700	
ダイコク電機	3,500	2,102.00	7,357,000	
アマノ	24,100	922.00	22,220,200	
サンデン	50,000	384.00	19,200,000	
マックス	13,000	1,065.00	13,845,000	
グローリー	25,100	2,449.00	61,469,900	
新晃工業	5,900	808.00	4,767,200	
大和冷機工業	14,000	612.00	8,568,000	
セガサミーホールディングス	90,500	2,558.00	231,499,000	
日本ピストンリング	33,000	176.00	5,808,000	
リケン	34,000	424.00	14,416,000	
T P R	9,700	1,785.00	17,314,500	
ホシザキ電機	18,400	3,560.00	65,504,000	
大豊工業	6,100	1,159.00	7,069,900	

日本精工	187,000	1,004.00	187,748,000	
NTN	197,000	390.00	76,830,000	
ジェイテクト	89,500	1,259.00	112,680,500	
不二越	79,000	481.00	37,999,000	
日本トムソン	28,000	468.00	13,104,000	
THK	52,500	2,207.00	115,867,500	
ユーシン精機	3,800	1,958.00	7,440,400	
前澤給装工業	3,200	1,240.00	3,968,000	
イーグル工業	11,000	1,622.00	17,842,000	
前澤工業	7,700	353.00	2,718,100	
日本ピラー工業	9,000	670.00	6,030,000	
キッツ	37,900	417.00	15,804,300	
日立工機	22,600	701.00	15,842,600	
マキタ	54,900	4,975.00	273,127,500	
日立造船	62,500	780.00	48,750,000	
三菱重工業	1,499,000	608.00	911,392,000	
IHI	575,000	397.00	228,275,000	
イビデン	51,300	1,608.00	82,490,400	
コニカミノルタ	222,500	848.00	188,680,000	
ブラザー工業	108,800	1,070.00	116,416,000	
ミネベア	115,000	634.00	72,910,000	
日立製作所	2,022,000	688.00	1,391,136,000	
東芝	1,662,000	404.00	671,448,000	
三菱電機	842,000	1,079.00	908,518,000	
富士電機	234,000	432.00	101,088,000	
東洋電機製造	17,000	315.00	5,355,000	
安川電機	92,000	1,247.00	114,724,000	
シンフォニアテクノロジー	51,000	173.00	8,823,000	
明電舎	77,000	361.00	27,797,000	
オリジン電気	12,000	310.00	3,720,000	
山洋電気	13,000	613.00	7,969,000	
デンヨー	8,300	1,277.00	10,599,100	
東芝テック	53,000	583.00	30,899,000	
芝浦メカトロニクス	16,000	234.00	3,744,000	
マブチモーター	11,900	5,400.00	64,260,000	
日本電産	45,500	9,150.00	416,325,000	
東光高岳ホールディングス	4,700	2,036.00	9,569,200	
ダイヘン	50,000	419.00	20,950,000	
ヤーマン	1,100	1,244.00	1,368,400	

JVCケンウッド	60,000	159.00	9,540,000	
第一精工	3,500	1,344.00	4,704,000	
日新電機	17,000	615.00	10,455,000	
大崎電気工業	13,000	558.00	7,254,000	
オムロン	95,000	3,765.00	357,675,000	
日東工業	12,400	1,563.00	19,381,200	
I D E C	11,000	838.00	9,218,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	162,000	571.00	92,502,000	
サクサホールディングス	22,000	152.00	3,344,000	
メルコホールディングス	4,100	1,273.00	5,219,300	
テクノメディカ	1,900	2,054.00	3,902,600	
日本電気	1,158,000	211.00	244,338,000	
富士通	812,000	422.00	342,664,000	
沖電気工業	325,000	220.00	71,500,000	
岩崎通信機	40,000	95.00	3,800,000	
電気興業	24,000	672.00	16,128,000	
サンケン電気	46,000	585.00	26,910,000	
ナカヨ通信機	8,000	323.00	2,584,000	
アイホン	4,900	1,645.00	8,060,500	
ルネサスエレクトロニクス	43,400	561.00	24,347,400	
セイコーエプソン	57,500	2,239.00	128,742,500	
ワコム	66,300	700.00	46,410,000	
アルバック	14,100	973.00	13,719,300	
アクセル	4,200	1,816.00	7,627,200	
E I Z O	7,700	2,610.00	20,097,000	
日本信号	21,300	728.00	15,506,400	
京三製作所	20,000	310.00	6,200,000	
能美防災	11,000	1,045.00	11,495,000	
ホーチキ	6,000	529.00	3,174,000	
エレコム	3,100	1,378.00	4,271,800	
日本無線	22,000	352.00	7,744,000	
パナソニック	962,000	987.00	949,494,000	
シャープ	605,000	272.00	164,560,000	
アンリツ	49,000	1,215.00	59,535,000	
富士通ゼネラル	20,000	1,163.00	23,260,000	
日立国際電気	17,000	1,247.00	21,199,000	
ソニー	461,600	1,641.00	757,485,600	
T D K	50,800	4,250.00	215,900,000	
帝国通信工業	20,000	170.00	3,400,000	

ミツミ電機	32,000	665.00	21,280,000	
タムラ製作所	33,000	253.00	8,349,000	
アルプス電気	61,700	903.00	55,715,100	
パイオニア	117,000	165.00	19,305,000	
日本電波工業	8,000	841.00	6,728,000	
日本トリム	1,900	8,540.00	16,226,000	
ローランド ディー・ジー	3,700	3,065.00	11,340,500	
フォスター電機	8,600	1,952.00	16,787,200	
クラリオン	52,000	121.00	6,292,000	
S M K	25,000	450.00	11,250,000	
ヨコオ	7,100	547.00	3,883,700	
東光	39,000	335.00	13,065,000	
ホシデン	24,700	509.00	12,572,300	
ヒロセ電機	14,700	14,710.00	216,237,000	
日本航空電子工業	22,000	1,145.00	25,190,000	
T O A	9,100	829.00	7,543,900	
古野電気	8,100	624.00	5,054,400	
ユニデン	27,000	233.00	6,291,000	
アルパイン	18,300	1,337.00	24,467,100	
スミダコーポレーション	7,700	460.00	3,542,000	
アイコム	4,700	2,174.00	10,217,800	
リオン	2,600	1,473.00	3,829,800	
船井電機	8,500	1,013.00	8,610,500	
横河電機	91,300	1,328.00	121,246,400	
新電元工業	27,000	585.00	15,795,000	
アズビル	25,500	2,294.00	58,497,000	
日本光電工業	17,900	3,950.00	70,705,000	
チノー	15,000	227.00	3,405,000	
共和電業	10,000	422.00	4,220,000	
日本電子材料	3,700	356.00	1,317,200	
堀場製作所	15,600	3,475.00	54,210,000	
アドバンテスト	57,400	1,149.00	65,952,600	
小野測器	9,000	430.00	3,870,000	
エスベック	8,700	797.00	6,933,900	
パナソニック デバイス S U N X	7,400	452.00	3,344,800	
キーエンス	19,100	39,400.00	752,540,000	
日置電機	4,400	1,378.00	6,063,200	
シスメックス	35,200	6,330.00	222,816,000	
メガチップス	7,500	1,513.00	11,347,500	

OBARA GROUP	5,500	2,447.00	13,458,500	
日本電産コバル電子	8,700	596.00	5,185,200	
澤藤電機	7,000	219.00	1,533,000	
コーセル	12,200	1,207.00	14,725,400	
日立メディコ	6,000	1,345.00	8,070,000	
新日本無線	6,000	366.00	2,196,000	
オブテックス	5,300	1,629.00	8,633,700	
千代田インテグレ	3,700	1,899.00	7,026,300	
レーザーテック	6,000	947.00	5,682,000	
スタンレー電気	60,800	2,194.00	133,395,200	
岩崎電気	32,000	217.00	6,944,000	
ウシオ電機	51,100	1,211.00	61,882,100	
岡谷電機産業	4,500	341.00	1,534,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	8,200	358.00	2,935,600	
日本セラミック	4,800	1,490.00	7,152,000	
遠藤照明	3,500	2,139.00	7,486,500	
日本デジタル研究所	6,300	1,239.00	7,805,700	
古河電池	7,000	536.00	3,752,000	
双信電機	4,100	369.00	1,512,900	
図研	5,500	788.00	4,334,000	
日本電子	30,000	446.00	13,380,000	
カシオ計算機	87,600	944.00	82,694,400	
ファナック	93,900	15,550.00	1,460,145,000	
日本シイエムケイ	19,800	267.00	5,286,600	
エンプラス	3,200	5,860.00	18,752,000	
大真空	12,000	376.00	4,512,000	
ローム	44,500	3,905.00	173,772,500	
浜松ホトニクス	32,900	3,620.00	119,098,000	
三井ハイテック	11,100	674.00	7,481,400	
新光電気工業	28,300	794.00	22,470,200	
京セラ	150,000	4,945.00	741,750,000	
太陽誘電	41,000	1,272.00	52,152,000	
村田製作所	88,300	7,930.00	700,219,000	
ユーシン	12,200	726.00	8,857,200	
双葉電子工業	15,600	1,266.00	19,749,600	
北陸電気工業	34,000	131.00	4,454,000	
ニチコン	26,500	922.00	24,433,000	
日本ケミコン	53,000	366.00	19,398,000	
K O A	10,600	914.00	9,688,400	

市光工業	22,000	191.00	4,202,000	
小糸製作所	46,000	1,854.00	85,284,000	
ミツバ	15,700	1,567.00	24,601,900	
スター精密	16,000	1,123.00	17,968,000	
大日本スクリーン製造	80,000	503.00	40,240,000	
キャノン電子	7,700	1,833.00	14,114,100	
キャノン	488,200	3,100.00	1,513,420,000	
リコー	253,000	1,026.00	259,578,000	
MUTOHホールディングス	12,000	448.00	5,376,000	
東京エレクトロン	75,300	5,440.00	409,632,000	
トヨタ紡織	29,400	1,249.00	36,720,600	
鬼怒川ゴム工業	16,000	535.00	8,560,000	
ユニプレス	13,600	1,693.00	23,024,800	
豊田自動織機	76,700	4,250.00	325,975,000	
モリタホールディングス	15,000	861.00	12,915,000	
三櫻工業	10,700	695.00	7,436,500	
デンソー	208,000	4,720.00	981,760,000	
東海理化電機製作所	22,200	2,021.00	44,866,200	
三井造船	326,000	186.00	60,636,000	
佐世保重工業	59,000	96.00	5,664,000	
川崎重工業	656,000	397.00	260,432,000	
名村造船所	12,300	1,139.00	14,009,700	
サノヤスホールディングス	7,700	168.00	1,293,600	
日本車輛製造	31,000	503.00	15,593,000	
ニチユ三菱フォークリフト	10,000	526.00	5,260,000	
近畿車輛	14,000	294.00	4,116,000	
日産自動車	1,181,900	897.00	1,060,164,300	
いすゞ自動車	488,000	600.00	292,800,000	
トヨタ自動車	1,171,800	6,250.00	7,323,750,000	
日野自動車	105,000	1,339.00	140,595,000	
三菱自動車工業	195,400	1,072.00	209,468,800	
エフテック	2,900	1,559.00	4,521,100	
GMB	800	1,178.00	942,400	
武蔵精密工業	9,000	2,175.00	19,575,000	
日産車体	41,000	1,567.00	64,247,000	
新明和工業	34,000	736.00	25,024,000	
極東開発工業	14,500	1,242.00	18,009,000	
日信工業	17,100	1,818.00	31,087,800	
トピー工業	69,000	198.00	13,662,000	

ティラド	33,000	262.00	8,646,000	
曙ブレーキ工業	39,100	459.00	17,946,900	
タチエス	12,400	1,380.00	17,112,000	
N O K	40,700	1,585.00	64,509,500	
フタバ産業	25,600	343.00	8,780,800	
カヤバ工業	70,000	557.00	38,990,000	
シロキ工業	19,000	210.00	3,990,000	
大同メタル工業	12,000	976.00	11,712,000	
プレス工業	33,000	412.00	13,596,000	
カルソニックカンセイ	57,000	520.00	29,640,000	
太平洋工業	17,100	672.00	11,491,200	
ケーヒン	19,300	1,590.00	30,687,000	
河西工業	11,000	571.00	6,281,000	
アイシン精機	77,000	3,840.00	295,680,000	
富士機工	10,000	333.00	3,330,000	
マツダ	1,255,000	424.00	532,120,000	
ダイハツ工業	89,300	1,808.00	161,454,400	
今仙電機製作所	6,200	1,400.00	8,680,000	
本田技研工業	757,700	3,935.00	2,981,549,500	
スズキ	176,000	2,365.00	416,240,000	
富士重工業	286,500	2,640.00	756,360,000	
ヤマハ発動機	128,000	1,462.00	187,136,000	
ショーワ	19,900	1,437.00	28,596,300	
T B K	9,000	560.00	5,040,000	
エクセディ	10,200	2,939.00	29,977,800	
豊田合成	27,200	2,359.00	64,164,800	
愛三工業	10,200	954.00	9,730,800	
ヨロズ	6,200	1,855.00	11,501,000	
エフ・シー・シー	13,800	2,125.00	29,325,000	
シマノ	36,400	8,490.00	309,036,000	
タカタ	15,200	2,476.00	37,635,200	
テイ・エス テック	17,800	3,540.00	63,012,000	
テルモ	64,500	4,890.00	315,405,000	
クリエートメディック	2,800	933.00	2,612,400	
日機装	27,000	1,279.00	34,533,000	
島津製作所	108,000	938.00	101,304,000	
J M S	16,000	290.00	4,640,000	
ショットモリテックス	1,800	280.00	504,000	
長野計器	5,400	686.00	3,704,400	

ブイ・テクノロジー	18	257,800.00	4,640,400	
東京計器	29,000	306.00	8,874,000	
愛知時計電機	11,000	283.00	3,113,000	
東京精密	15,100	1,848.00	27,904,800	
マニー	2,600	3,705.00	9,633,000	
ニコン	157,200	1,731.00	272,113,200	
トプコン	22,600	1,532.00	34,623,200	
オリンパス	125,400	3,000.00	376,200,000	
理研計器	7,500	741.00	5,557,500	
タムロン	6,500	1,904.00	12,376,000	
HOYA	204,700	2,568.00	525,669,600	
ノーリツ鋼機	7,600	616.00	4,681,600	
エー・アンド・デイ	7,700	600.00	4,620,000	
シチズンホールディングス	103,700	722.00	74,871,400	
リズム時計工業	38,000	144.00	5,472,000	
大研医器	2,900	1,723.00	4,996,700	
松風	4,100	869.00	3,562,900	
セイコーホールディングス	54,000	440.00	23,760,000	
ニプロ	44,900	888.00	39,871,200	
パラマウントベッドホールディングス	8,100	3,165.00	25,636,500	
SHO-BI	3,200	423.00	1,353,600	
前田工織	6,700	1,067.00	7,148,900	
永大産業	11,000	498.00	5,478,000	
ダンロップスポーツ	4,600	1,224.00	5,630,400	
バンダイナムコホールディングス	92,900	1,970.00	183,013,000	
共立印刷	16,700	265.00	4,425,500	
フランスベッドホールディングス	53,000	193.00	10,229,000	
パイロットコーポレーション	7,400	3,625.00	26,825,000	
トッパン・フォームズ	15,100	879.00	13,272,900	
フジシールインターナショナル	10,200	3,100.00	31,620,000	
タカラトミー	28,400	503.00	14,285,200	
廣済堂	7,800	542.00	4,227,600	
タカノ	4,200	486.00	2,041,200	
プロネクサス	8,700	638.00	5,550,600	
ホクシン	8,900	168.00	1,495,200	
ウッドワン	16,000	280.00	4,480,000	
大建工業	34,000	253.00	8,602,000	
凸版印刷	238,000	751.00	178,738,000	
大日本印刷	256,000	988.00	252,928,000	

図書印刷	16,000	264.00	4,224,000	
共同印刷	28,000	267.00	7,476,000	
日本写真印刷	14,300	1,502.00	21,478,600	
光村印刷	8,000	260.00	2,080,000	
宝印刷	5,000	681.00	3,405,000	
アシックス	83,700	1,685.00	141,034,500	
ツツミ	4,200	2,289.00	9,613,800	
ローランド	8,400	1,308.00	10,987,200	
小松ウオール工業	3,000	1,988.00	5,964,000	
ヤマハ	61,900	1,427.00	88,331,300	
河合楽器製作所	31,000	189.00	5,859,000	
クリナップ	8,700	807.00	7,020,900	
ビジョン	13,800	4,750.00	65,550,000	
兼松日産農林	13,000	159.00	2,067,000	
キングジム	7,000	695.00	4,865,000	
リンテック	20,000	1,968.00	39,360,000	
イトーキ	18,500	498.00	9,213,000	
任天堂	51,900	12,100.00	627,990,000	
三菱鉛筆	6,900	2,457.00	16,953,300	
タカラスタンダード	35,000	787.00	27,545,000	
コクヨ	43,800	742.00	32,499,600	
ナカバヤシ	18,000	202.00	3,636,000	
グローブライド	44,000	165.00	7,260,000	
岡村製作所	32,000	835.00	26,720,000	
美津濃	42,000	545.00	22,890,000	
アデランス	10,500	1,165.00	12,232,500	
東京電力	714,200	517.00	369,241,400	
中部電力	277,400	1,393.00	386,418,200	
関西電力	343,600	1,171.00	402,355,600	
中国電力	116,400	1,453.00	169,129,200	
北陸電力	82,500	1,362.00	112,365,000	
東北電力	210,400	1,091.00	229,546,400	
四国電力	75,800	1,634.00	123,857,200	
九州電力	186,000	1,301.00	241,986,000	
北海道電力	78,800	1,203.00	94,796,400	
沖縄電力	5,500	3,245.00	17,847,500	
電源開発	52,300	3,080.00	161,084,000	
東京瓦斯	987,000	503.00	496,461,000	
大阪瓦斯	871,000	396.00	344,916,000	

東邦瓦斯	214,000	489.00	104,646,000	
北海道瓦斯	16,000	263.00	4,208,000	
西部瓦斯	95,000	240.00	22,800,000	
静岡瓦斯	21,900	632.00	13,840,800	
東武鉄道	478,000	498.00	238,044,000	
相鉄ホールディングス	144,000	366.00	52,704,000	
東京急行電鉄	495,000	659.00	326,205,000	
京浜急行電鉄	216,000	886.00	191,376,000	
小田急電鉄	270,000	924.00	249,480,000	
京王電鉄	235,000	666.00	156,510,000	
京成電鉄	126,000	1,002.00	126,252,000	
富士急行	23,000	837.00	19,251,000	
新京成電鉄	11,000	365.00	4,015,000	
東日本旅客鉄道	154,900	8,350.00	1,293,415,000	
西日本旅客鉄道	77,700	4,420.00	343,434,000	
東海旅客鉄道	75,400	12,250.00	923,650,000	
鴻池運輸	4,500	1,553.00	6,988,500	
西日本鉄道	109,000	384.00	41,856,000	
ハマキョウレックス	2,400	2,732.00	6,556,800	
サカイ引越センター	1,400	3,120.00	4,368,000	
近畿日本鉄道	847,000	360.00	304,920,000	
阪急阪神ホールディングス	565,000	551.00	311,315,000	
南海電気鉄道	175,000	366.00	64,050,000	
京阪電気鉄道	178,000	395.00	70,310,000	
神戸電鉄	21,000	315.00	6,615,000	
名糖運輸	3,500	640.00	2,240,000	
名古屋鉄道	294,000	285.00	83,790,000	
山陽電気鉄道	31,000	408.00	12,648,000	
日本通運	333,000	490.00	163,170,000	
ヤマトホールディングス	156,800	2,066.00	323,948,800	
山九	102,000	348.00	35,496,000	
丸運	5,300	247.00	1,309,100	
丸全昭和運輸	28,000	348.00	9,744,000	
センコー	34,000	523.00	17,782,000	
トナミホールディングス	17,000	210.00	3,570,000	
日本梱包運輸倉庫	25,700	1,676.00	43,073,200	
日本石油輸送	10,000	224.00	2,240,000	
福山通運	51,000	582.00	29,682,000	
セイノーホールディングス	60,000	949.00	56,940,000	

神奈川中央交通	10,000	502.00	5,020,000	
日立物流	17,500	1,575.00	27,562,500	
日本郵船	712,000	295.00	210,040,000	
商船三井	474,000	411.00	194,814,000	
川崎汽船	370,000	223.00	82,510,000	
N S ユナイテッド海運	36,000	265.00	9,540,000	
乾汽船	18,000	347.00	6,246,000	
飯野海運	40,900	608.00	24,867,200	
共栄タンカー	17,000	230.00	3,910,000	
日本航空	71,100	5,370.00	381,807,000	
A N A ホールディングス	1,655,000	213.00	352,515,000	
パスコ	8,000	489.00	3,912,000	
トランコム	2,400	2,852.00	6,844,800	
日新	32,000	271.00	8,672,000	
三菱倉庫	55,000	1,326.00	72,930,000	
三井倉庫	42,000	482.00	20,244,000	
住友倉庫	56,000	553.00	30,968,000	
澁澤倉庫	20,000	403.00	8,060,000	
東陽倉庫	14,000	255.00	3,570,000	
日本トランスシティ	18,000	324.00	5,832,000	
ケイヒン	15,000	178.00	2,670,000	
中央倉庫	4,900	926.00	4,537,400	
安田倉庫	6,500	1,161.00	7,546,500	
東洋埠頭	24,000	250.00	6,000,000	
宇徳	6,800	323.00	2,196,400	
上組	100,000	855.00	85,500,000	
サンリツ	2,000	524.00	1,048,000	
キムラユニティー	1,900	996.00	1,892,400	
キューソー流通システム	2,700	1,046.00	2,824,200	
郵船ロジスティクス	7,700	1,118.00	8,608,600	
近鉄エクスプレス	7,500	3,820.00	28,650,000	
東海運	4,500	278.00	1,251,000	
エーアイティー	3,100	733.00	2,272,300	
N E C ネットエスアイ	9,100	2,586.00	23,532,600	
システナ	8,100	709.00	5,742,900	
デジタルアーツ	2,200	977.00	2,149,400	
新日鉄住金ソリューションズ	6,900	2,201.00	15,186,900	
コア	3,100	740.00	2,294,000	
ソフトクリエイトホールディングス	2,700	901.00	2,432,700	

ITホールディングス	29,900	1,386.00	41,441,400	
ネオス	1,700	1,408.00	2,393,600	
電算システム	2,000	1,400.00	2,800,000	
グリー	43,200	842.00	36,374,400	
コーエーテックモホールディングス	16,500	1,181.00	19,486,500	
三菱総合研究所	3,200	2,039.00	6,524,800	
ボルテージ	1,200	974.00	1,168,800	
電算	600	1,904.00	1,142,400	
ヒト・コミュニケーションズ	900	1,412.00	1,270,800	
ブレインパッド	700	1,190.00	833,000	
K L a b	5,600	655.00	3,668,000	
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	2,500	2,919.00	7,297,500	
ネクソン	68,900	877.00	60,425,300	
アイスタイル	2,400	722.00	1,732,800	
エムアップ	1,500	1,033.00	1,549,500	
エイチーム	800	2,362.00	1,889,600	
ブロードリーフ	8,200	1,818.00	14,907,600	
ハーツユナイテッドグループ	1,900	2,087.00	3,965,300	
ドワンゴ	7,500	1,715.00	12,862,500	
ベリサーブ	500	1,832.00	916,000	
マクロミル	13,300	575.00	7,647,500	
ティーガイア	8,300	980.00	8,134,000	
テクマトリックス	2,700	567.00	1,530,900	
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	3,515.00	11,248,000	
ザッパラス	4,700	754.00	3,543,800	
インターネットイニシアティブ	12,200	2,578.00	31,451,600	
ビットアイル	6,300	834.00	5,254,200	
SRAホールディングス	4,000	1,114.00	4,456,000	
朝日ネット	7,700	492.00	3,788,400	
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,700	2,778.00	4,722,600	
フェイス	2,500	1,083.00	2,707,500	
野村総合研究所	47,100	3,195.00	150,484,500	
サイバネットシステム	6,800	341.00	2,318,800	
インテージホールディングス	4,500	1,226.00	5,517,000	
ソースネクスト	4,100	669.00	2,742,900	
クレスコ	1,900	752.00	1,428,800	
フジ・メディア・ホールディングス	80,400	2,032.00	163,372,800	
オービック	28,700	2,969.00	85,210,300	
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,800	789.00	1,420,200	

ヤフー	601,500	472.00	283,908,000	
トレンドマイクロ	36,700	3,560.00	130,652,000	
日本オラクル	16,600	3,945.00	65,487,000	
アルファシステムズ	2,700	1,361.00	3,674,700	
フューチャーアーキテクト	10,000	551.00	5,510,000	
シーエーシー	5,100	881.00	4,493,100	
ソフトバンク・テクノロジー	2,000	1,653.00	3,306,000	
トーセ	2,100	665.00	1,396,500	
オービックビジネスコンサルタント	4,200	3,375.00	14,175,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,800	3,910.00	38,318,000	
アイティフォー	9,300	403.00	3,747,900	
東計電算	1,500	1,418.00	2,127,000	
エクスネット	800	1,334.00	1,067,200	
大塚商会	7,500	12,180.00	91,350,000	
サイボウズ	125	28,450.00	3,556,250	
ソフトブレーン	11,500	128.00	1,472,000	
アグレックス	1,900	868.00	1,649,200	
電通国際情報サービス	5,100	1,133.00	5,778,300	
E Mシステムズ	1,100	1,990.00	2,189,000	
ウェザーニューズ	2,200	2,106.00	4,633,200	
C I J	7,700	397.00	3,056,900	
WOWOW	2,600	3,555.00	9,243,000	
ネットワンシステムズ	32,600	636.00	20,733,600	
アルゴグラフィックス	3,100	1,577.00	4,888,700	
マーベラスAQL	12,600	540.00	6,804,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	15,300	2,360.00	36,108,000	
日本ユニシス	20,100	805.00	16,180,500	
兼松エレクトロニクス	5,300	1,273.00	6,746,900	
東京放送ホールディングス	44,800	1,265.00	56,672,000	
日本テレビホールディングス	82,800	1,820.00	150,696,000	
テレビ朝日	21,100	2,296.00	48,445,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	63,100	549.00	34,641,900	
テレビ東京ホールディングス	6,800	1,733.00	11,784,400	
コネクシオ	7,300	837.00	6,110,100	
日本電信電話	326,500	5,270.00	1,720,655,000	
K D D I	257,900	5,680.00	1,464,872,000	
光通信	7,700	7,290.00	56,133,000	
N T T ドコモ	684,700	1,564.00	1,070,870,800	
G M O インターネット	27,700	1,112.00	30,802,400	

学研ホールディングス	28,000	295.00	8,260,000	
ゼンリン	11,000	1,028.00	11,308,000	
昭文社	5,000	612.00	3,060,000	
KADOKAWA	7,900	3,540.00	27,966,000	
インプレスホールディングス	6,000	127.00	762,000	
アイネット	3,500	704.00	2,464,000	
松竹	55,000	954.00	52,470,000	
東宝	59,300	2,119.00	125,656,700	
東映	35,000	574.00	20,090,000	
AOI Pro.	3,900	641.00	2,499,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	58,700	3,305.00	194,003,500	
DTS	7,900	1,738.00	13,730,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30,200	1,735.00	52,397,000	
シーイーシー	5,000	616.00	3,080,000	
カプコン	21,300	1,782.00	37,956,600	
ジャステック	5,300	843.00	4,467,900	
SCSK	19,800	2,373.00	46,985,400	
日本システムウエア	3,200	421.00	1,347,200	
アイネス	11,300	624.00	7,051,200	
TKC	7,000	1,614.00	11,298,000	
富士ソフト	10,600	2,086.00	22,111,600	
NSD	17,700	1,180.00	20,886,000	
コナミ	37,500	2,544.00	95,400,000	
福井コンピュータホールディングス	1,200	806.00	967,200	
JBCCHホールディングス	7,000	795.00	5,565,000	
ミロク情報サービス	5,500	378.00	2,079,000	
ソフトバンク	408,100	7,420.00	3,028,102,000	
ハウスイ	7,000	129.00	903,000	
高千穂交易	3,500	937.00	3,279,500	
伊藤忠食品	2,100	3,160.00	6,636,000	
エレマテック	3,900	1,489.00	5,807,100	
JALUX	2,400	1,127.00	2,704,800	
あらた	19,000	334.00	6,346,000	
トーメンデバイス	1,300	1,658.00	2,155,400	
東京エレクトロン デバイス	1,700	1,550.00	2,635,000	
双日	556,200	185.00	102,897,000	
アルフレッサ ホールディングス	24,600	5,200.00	127,920,000	
横浜冷凍	20,600	770.00	15,862,000	
山下医科器械	700	1,729.00	1,210,300	

ラサ商事	3,700	451.00	1,668,700	
アルコニックス	2,500	2,005.00	5,012,500	
神戸物産	900	2,185.00	1,966,500	
あい ホールディングス	14,800	1,191.00	17,626,800	
ダイワボウホールディングス	76,000	196.00	14,896,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,700	704.00	11,052,800	
八洲電機	6,500	417.00	2,710,500	
U K Cホールディングス	5,400	1,668.00	9,007,200	
T O K A Iホールディングス	40,700	345.00	14,041,500	
ミタチ産業	2,000	419.00	838,000	
シップヘルスケアホールディングス	11,900	3,950.00	47,005,000	
富士興産	3,100	629.00	1,949,900	
協栄産業	10,000	190.00	1,900,000	
小野建	7,300	1,190.00	8,687,000	
佐鳥電機	6,200	586.00	3,633,200	
エコートレーディング	2,100	724.00	1,520,400	
伯東	5,100	939.00	4,788,900	
コンドーテック	6,800	731.00	4,970,800	
中山福	4,800	739.00	3,547,200	
ナガイレーベン	11,000	1,527.00	16,797,000	
三菱食品	9,100	2,488.00	22,640,800	
松田産業	6,100	1,343.00	8,192,300	
メディカルホールディングス	83,100	1,275.00	105,952,500	
アドヴァン	4,300	1,186.00	5,099,800	
S P K	1,900	1,779.00	3,380,100	
アズワン	5,400	2,229.00	12,036,600	
スズデン	3,100	512.00	1,587,200	
尾家産業	2,700	809.00	2,184,300	
シモジマ	5,800	932.00	5,405,600	
ドウシシャ	8,800	1,438.00	12,654,400	
高速	5,000	875.00	4,375,000	
黒田電気	12,000	1,427.00	17,124,000	
丸文	7,400	477.00	3,529,800	
ハビネット	5,100	741.00	3,779,100	
トーメンエレクトロニクス	4,300	1,107.00	4,760,100	
エクセル	3,800	1,126.00	4,278,800	
マルカキカイ	2,700	1,454.00	3,925,800	
ガリバーインターナショナル	28,000	571.00	15,988,000	
日本エム・ディ・エム	7,100	276.00	1,959,600	

進和	4,900	1,122.00	5,497,800	
エスケイジャパン	2,100	272.00	571,200	
ダイトエレクトロン	3,900	380.00	1,482,000	
シークス	5,300	1,187.00	6,291,100	
田中商事	2,600	607.00	1,578,200	
オーハシテクニカ	4,500	935.00	4,207,500	
マクニカ	4,300	2,691.00	11,571,300	
白銅	2,700	800.00	2,160,000	
伊藤忠商事	662,900	1,240.00	821,996,000	
丸紅	727,000	716.00	520,532,000	
高島	16,000	269.00	4,304,000	
長瀬産業	47,100	1,143.00	53,835,300	
蝶理	5,300	1,141.00	6,047,300	
豊田通商	92,600	2,475.00	229,185,000	
三共生興	14,300	330.00	4,719,000	
兼松	177,000	133.00	23,541,000	
ツカモトコーポレーション	15,000	154.00	2,310,000	
三井物産	765,100	1,367.00	1,045,891,700	
日本紙パルプ商事	43,000	310.00	13,330,000	
日立ハイテクノロジーズ	25,200	2,153.00	54,255,600	
カメイ	10,900	737.00	8,033,300	
東都水産	15,000	214.00	3,210,000	
OUGホールディングス	12,000	179.00	2,148,000	
スターゼン	30,000	263.00	7,890,000	
山善	32,000	613.00	19,616,000	
椿本興業	10,000	264.00	2,640,000	
住友商事	490,400	1,250.00	613,000,000	
内田洋行	19,000	281.00	5,339,000	
三菱商事	648,400	1,975.00	1,280,590,000	
第一実業	19,000	422.00	8,018,000	
キャノンマーケティングジャパン	23,700	1,420.00	33,654,000	
西華産業	29,000	235.00	6,815,000	
佐藤商事	7,500	602.00	4,515,000	
菱洋エレクトロ	9,800	917.00	8,986,600	
東京産業	8,400	328.00	2,755,200	
ユアサ商事	85,000	200.00	17,000,000	
神鋼商事	21,000	200.00	4,200,000	
小林産業	5,600	326.00	1,825,600	
阪和興業	83,000	468.00	38,844,000	

カナデン	8,000	652.00	5,216,000	
菱電商事	12,000	661.00	7,932,000	
フルサト工業	4,600	1,034.00	4,756,400	
岩谷産業	92,000	449.00	41,308,000	
すてきナイスグループ	35,000	233.00	8,155,000	
昭光通商	27,000	156.00	4,212,000	
ニチモウ	13,000	192.00	2,496,000	
極東貿易	10,000	207.00	2,070,000	
イワキ	13,000	215.00	2,795,000	
三愛石油	19,000	425.00	8,075,000	
稲畑産業	20,500	1,038.00	21,279,000	
G S Iクレオス	22,000	146.00	3,212,000	
明和産業	7,800	318.00	2,480,400	
ワキタ	12,000	1,249.00	14,988,000	
東邦ホールディングス	26,600	1,782.00	47,401,200	
サンゲツ	14,700	2,535.00	37,264,500	
ミツウロコグループホールディングス	13,500	510.00	6,885,000	
シナネン	18,000	374.00	6,732,000	
伊藤忠エネクス	18,400	527.00	9,696,800	
サンリオ	21,000	4,700.00	98,700,000	
サンワテクノス	4,100	856.00	3,509,600	
リョーサン	12,400	1,979.00	24,539,600	
新光商事	9,200	852.00	7,838,400	
トーホー	17,000	352.00	5,984,000	
三信電気	10,400	664.00	6,905,600	
東陽テクニカ	11,500	1,101.00	12,661,500	
モスフードサービス	10,900	1,893.00	20,633,700	
加賀電子	7,600	1,036.00	7,873,600	
ソーダニッカ	9,000	412.00	3,708,000	
立花エレテック	5,100	1,136.00	5,793,600	
P a l t a c	11,700	1,296.00	15,163,200	
ヤマタネ	42,000	175.00	7,350,000	
丸紅建材リース	7,000	214.00	1,498,000	
日鉄住金物産	55,000	297.00	16,335,000	
トラスコ中山	9,500	2,015.00	19,142,500	
オートバックスセブン	29,200	1,455.00	42,486,000	
加藤産業	12,000	1,862.00	22,344,000	
イノテック	7,700	457.00	3,518,900	
イエローハット	7,200	1,811.00	13,039,200	

富士エレクトロニクス	4,300	1,332.00	5,727,600	
J Kホールディングス	7,000	620.00	4,340,000	
日伝	3,800	2,278.00	8,656,400	
北沢産業	7,000	178.00	1,246,000	
杉本商事	4,500	902.00	4,059,000	
因幡電機産業	11,400	3,045.00	34,713,000	
バイテック	2,900	901.00	2,612,900	
ミスミグループ本社	33,300	2,823.00	94,005,900	
江守商事	2,700	1,845.00	4,981,500	
アルテック	4,000	273.00	1,092,000	
タキヒヨー	14,000	398.00	5,572,000	
スズケン	34,400	3,395.00	116,788,000	
ジェコス	5,800	729.00	4,228,200	
ローソン	34,100	7,560.00	257,796,000	
サンエー	6,300	2,759.00	17,381,700	
キリン堂	3,000	648.00	1,944,000	
ダイユーエイト	1,700	662.00	1,125,400	
カワチ薬品	5,800	1,818.00	10,544,400	
エービーシー・マート	11,800	4,760.00	56,168,000	
ハードオフコーポレーション	4,000	743.00	2,972,000	
アスクル	7,100	2,877.00	20,426,700	
ゲオホールディングス	14,200	891.00	12,652,200	
アダストリアホールディングス	6,400	4,305.00	27,552,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	11,000	224.00	2,464,000	
くらコーポレーション	4,900	1,626.00	7,967,400	
キャンドウ	4,000	1,600.00	6,400,000	
パル	4,800	2,647.00	12,705,600	
エディオン	38,100	549.00	20,916,900	
サーラコーポレーション	7,100	508.00	3,606,800	
あみやき亭	1,400	3,300.00	4,620,000	
ひらまつ	8,600	629.00	5,409,400	
ゲンキー	700	2,108.00	1,475,600	
大黒天物産	1,700	2,811.00	4,778,700	
ハニーズ	6,570	1,072.00	7,043,040	
アルペン	6,400	1,791.00	11,462,400	
クオール	6,100	598.00	3,647,800	
ジェイアイエヌ	4,200	3,785.00	15,897,000	
ビックカメラ	316	49,350.00	15,594,600	
D C Mホールディングス	41,000	690.00	28,290,000	

MonotaRO	12,800	2,217.00	28,377,600	
J・フロントリテイリング	196,000	726.00	142,296,000	
ドトール・日レスホールディングス	14,600	1,743.00	25,447,800	
マツモトキヨシホールディングス	17,100	3,195.00	54,634,500	
ブロンコビリー	1,300	1,896.00	2,464,800	
スタートトゥデイ	25,900	2,780.00	72,002,000	
物語コーポレーション	1,200	3,865.00	4,638,000	
ココカラファイン	8,700	2,580.00	22,446,000	
三越伊勢丹ホールディングス	165,200	1,403.00	231,775,600	
ウエルシアホールディングス	2,900	5,620.00	16,298,000	
クリエイトSDホールディングス	3,500	3,540.00	12,390,000	
丸善CHIホールディングス	7,300	284.00	2,073,200	
エー・ピーカンパニー	700	1,955.00	1,368,500	
ブックオフコーポレーション	4,600	664.00	3,054,400	
あさひ	4,800	1,590.00	7,632,000	
日本調剤	1,050	2,657.00	2,789,850	
コスモス薬品	4,200	11,240.00	47,208,000	
一六堂	1,200	467.00	560,400	
セブン&アイ・ホールディングス	347,600	3,530.00	1,227,028,000	
ツルハホールディングス	8,200	8,720.00	71,504,000	
サンマルクホールディングス	2,700	5,120.00	13,824,000	
フェリシモ	2,400	988.00	2,371,200	
トリドール	7,200	788.00	5,673,600	
クスリのアオキ	1,200	5,650.00	6,780,000	
メディカルシステムネットワーク	6,800	435.00	2,958,000	
総合メディカル	2,000	3,760.00	7,520,000	
はるやま商事	3,500	666.00	2,331,000	
カップ・クリエイトホールディングス	6,100	1,828.00	11,150,800	
ライトオン	6,200	792.00	4,910,400	
良品計画	8,800	9,820.00	86,416,000	
三城ホールディングス	10,300	450.00	4,635,000	
コナカ	10,600	842.00	8,925,200	
ハウスオブローゼ	900	1,325.00	1,192,500	
G-7ホールディングス	2,500	740.00	1,850,000	
イオン北海道	6,900	637.00	4,395,300	
コジマ	12,300	271.00	3,333,300	
ヒマラヤ	1,900	1,282.00	2,435,800	
コーナン商事	10,900	1,035.00	11,281,500	
エコス	2,800	603.00	1,688,400	

ワタミ	9,800	1,462.00	14,327,600	
マルシェ	2,000	831.00	1,662,000	
ドン・キホーテ	24,500	6,090.00	149,205,000	
西松屋チェーン	16,400	722.00	11,840,800	
ゼンショーホールディングス	31,700	1,061.00	33,633,700	
幸楽苑	5,100	1,228.00	6,262,800	
ハークスレイ	2,300	757.00	1,741,100	
サイゼリヤ	12,300	1,191.00	14,649,300	
ポブラ	3,800	540.00	2,052,000	
ユニテッドアローズ	10,900	4,210.00	45,889,000	
ハイデイ日高	4,400	2,049.00	9,015,600	
京都きもの友禅	5,500	1,025.00	5,637,500	
コロワイド	27,500	990.00	27,225,000	
壺番屋	3,300	4,050.00	13,365,000	
トップカルチャー	3,000	443.00	1,329,000	
P L A N T	1,600	910.00	1,456,000	
スギホールディングス	14,900	3,935.00	58,631,500	
スクロール	10,800	275.00	2,970,000	
ヨンドシーホールディングス	6,300	1,373.00	8,649,900	
ファミリーマート	28,100	4,230.00	118,863,000	
木曽路	10,200	1,791.00	18,268,200	
サトレストラנסシステムズ	7,800	658.00	5,132,400	
千趣会	15,000	834.00	12,510,000	
タカキュー	6,500	318.00	2,067,000	
ケーヨー	14,100	457.00	6,443,700	
上新電機	18,000	754.00	13,572,000	
日本瓦斯	12,400	1,033.00	12,809,200	
ベスト電器	26,800	149.00	3,993,200	
マルエツ	19,000	318.00	6,042,000	
ロイヤルホールディングス	13,900	1,566.00	21,767,400	
東天紅	6,000	192.00	1,152,000	
いなげや	9,300	997.00	9,272,100	
島忠	18,800	2,292.00	43,089,600	
チヨダ	9,800	2,114.00	20,717,200	
ライフコーポレーション	6,300	1,572.00	9,903,600	
カスミ	17,100	604.00	10,328,400	
リンガーハット	8,100	1,423.00	11,526,300	
MrMax	8,300	326.00	2,705,800	
テンアライド	6,300	311.00	1,959,300	

A O K Iホールディングス	7,200	3,265.00	23,508,000	
オークワ	13,000	876.00	11,388,000	
コメリ	12,800	2,395.00	30,656,000	
青山商事	22,900	2,562.00	58,669,800	
しまむら	9,700	10,660.00	103,402,000	
C F Sコーポレーション	5,600	378.00	2,116,800	
はせがわ	2,900	688.00	1,995,200	
高島屋	112,000	917.00	102,704,000	
松屋	17,500	1,102.00	19,285,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,000	807.00	39,543,000	
近鉄百貨店	32,000	330.00	10,560,000	
ニッセンホールディングス	16,600	310.00	5,146,000	
パルコ	8,000	973.00	7,784,000	
丸井グループ	108,400	943.00	102,221,200	
アクシアル リテイリング	4,600	1,527.00	7,024,200	
ダイエー	51,300	323.00	16,569,900	
イズミヤ	33,000	451.00	14,883,000	
イオン	326,600	1,302.00	425,233,200	
ユニーグループ・ホールディングス	80,500	618.00	49,749,000	
イズミ	18,700	3,110.00	58,157,000	
東武ストア	11,000	256.00	2,816,000	
平和堂	17,100	1,471.00	25,154,100	
フジ	9,400	1,733.00	16,290,200	
ヤオコー	4,200	3,870.00	16,254,000	
ゼビオ	10,000	2,088.00	20,880,000	
ケーズホールディングス	17,600	3,135.00	55,176,000	
O l y m p i cグループ	4,900	684.00	3,351,600	
日産東京販売ホールディングス	12,000	395.00	4,740,000	
アインファーマシーズ	5,000	4,280.00	21,400,000	
元気寿司	2,600	1,254.00	3,260,400	
ヤマダ電機	328,500	332.00	109,062,000	
アークランドサカモト	5,400	1,549.00	8,364,600	
ニトリホールディングス	16,450	9,000.00	148,050,000	
グルメ杵屋	6,000	684.00	4,104,000	
愛眼	6,600	275.00	1,815,000	
吉野家ホールディングス	22,500	1,140.00	25,650,000	
松屋フーズ	4,000	1,594.00	6,376,000	
サガミチェーン	10,000	871.00	8,710,000	
関西スーパーマーケット	6,200	871.00	5,400,200	

王将フードサービス	4,100	3,235.00	13,263,500	
プレナス	9,300	2,142.00	19,920,600	
ミニストップ	6,200	1,553.00	9,628,600	
アークス	14,200	1,829.00	25,971,800	
パロー	17,900	1,268.00	22,697,200	
藤久	700	1,625.00	1,137,500	
ベルク	4,100	1,750.00	7,175,000	
大庄	3,900	1,239.00	4,832,100	
ファーストリテイリング	19,400	30,800.00	597,520,000	
サンドラッグ	17,600	4,690.00	82,544,000	
東京デリカ	4,200	1,491.00	6,262,200	
ヤマザワ	1,900	1,521.00	2,889,900	
やまや	1,700	1,398.00	2,376,600	
ベルーナ	20,700	467.00	9,666,900	
島根銀行	1,700	1,286.00	2,186,200	
じもとホールディングス	59,600	201.00	11,979,600	
新生銀行	719,000	223.00	160,337,000	
あおぞら銀行	431,000	283.00	121,973,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,294,900	613.00	3,858,773,700	
りそなホールディングス	789,900	504.00	398,109,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,633,000	470.00	767,510,000	
三井住友フィナンシャルグループ	628,500	4,770.00	2,997,945,000	
第四銀行	106,000	337.00	35,722,000	
北越銀行	90,000	194.00	17,460,000	
西日本シティ銀行	292,000	264.00	77,088,000	
千葉銀行	320,000	697.00	223,040,000	
横浜銀行	548,000	542.00	297,016,000	
常陽銀行	309,000	497.00	153,573,000	
群馬銀行	186,000	578.00	107,508,000	
武蔵野銀行	13,300	3,395.00	45,153,500	
千葉興業銀行	17,200	720.00	12,384,000	
筑波銀行	34,500	325.00	11,212,500	
東京都民銀行	14,700	1,030.00	15,141,000	
七十七銀行	130,000	477.00	62,010,000	
青森銀行	61,000	255.00	15,555,000	
秋田銀行	57,000	239.00	13,623,000	
山形銀行	51,000	396.00	20,196,000	
岩手銀行	5,400	4,550.00	24,570,000	
東邦銀行	74,000	303.00	22,422,000	

東北銀行	42,000	143.00	6,006,000	
みちのく銀行	44,000	195.00	8,580,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	337,000	440.00	148,280,000	
静岡銀行	243,000	1,105.00	268,515,000	
十六銀行	104,000	391.00	40,664,000	
スルガ銀行	81,000	1,684.00	136,404,000	
八十二銀行	153,000	602.00	92,106,000	
山梨中央銀行	53,000	406.00	21,518,000	
大垣共立銀行	104,000	274.00	28,496,000	
福井銀行	71,000	219.00	15,549,000	
北國銀行	93,000	347.00	32,271,000	
清水銀行	2,800	2,636.00	7,380,800	
滋賀銀行	78,000	523.00	40,794,000	
南都銀行	81,000	379.00	30,699,000	
百五銀行	75,000	390.00	29,250,000	
京都銀行	159,000	836.00	132,924,000	
紀陽銀行	32,600	1,287.00	41,956,200	
三重銀行	34,000	199.00	6,766,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	565,000	203.00	114,695,000	
広島銀行	245,000	418.00	102,410,000	
山陰合同銀行	51,000	702.00	35,802,000	
中国銀行	61,800	1,370.00	84,666,000	
鳥取銀行	26,000	185.00	4,810,000	
伊予銀行	89,000	1,004.00	89,356,000	
百十四銀行	91,000	348.00	31,668,000	
四国銀行	60,000	223.00	13,380,000	
阿波銀行	68,000	505.00	34,340,000	
鹿児島銀行	58,000	644.00	37,352,000	
大分銀行	52,000	370.00	19,240,000	
宮崎銀行	55,000	283.00	15,565,000	
肥後銀行	68,000	547.00	37,196,000	
佐賀銀行	50,000	204.00	10,200,000	
十八銀行	52,000	227.00	11,804,000	
沖縄銀行	6,200	3,835.00	23,777,000	
琉球銀行	16,100	1,039.00	16,727,900	
八千代銀行	4,000	2,617.00	10,468,000	
セブン銀行	311,400	356.00	110,858,400	
みずほフィナンシャルグループ	10,754,800	207.00	2,226,243,600	
山口フィナンシャルグループ	83,000	938.00	77,854,000	

長野銀行	27,000	175.00	4,725,000	
名古屋銀行	75,000	333.00	24,975,000	
北洋銀行	125,200	389.00	48,702,800	
愛知銀行	3,000	4,305.00	12,915,000	
第三銀行	47,000	159.00	7,473,000	
中京銀行	34,000	175.00	5,950,000	
東日本銀行	36,000	216.00	7,776,000	
大光銀行	29,000	210.00	6,090,000	
愛媛銀行	49,000	232.00	11,368,000	
トマト銀行	32,000	170.00	5,440,000	
みなと銀行	75,000	170.00	12,750,000	
京葉銀行	68,000	498.00	33,864,000	
関西アーバン銀行	116,000	114.00	13,224,000	
栃木銀行	42,000	382.00	16,044,000	
北日本銀行	2,600	2,343.00	6,091,800	
東和銀行	96,000	89.00	8,544,000	
福島銀行	102,000	83.00	8,466,000	
大東銀行	53,000	101.00	5,353,000	
トモニホールディングス	63,800	385.00	24,563,000	
フィデアホールディングス	47,800	191.00	9,129,800	
池田泉州ホールディングス	62,300	473.00	29,467,900	
F P G	7,000	988.00	6,916,000	
S B Iホールディングス	101,000	1,208.00	122,008,000	
ジャフコ	11,600	4,935.00	57,246,000	
大和証券グループ本社	823,000	911.00	749,753,000	
野村ホールディングス	1,699,700	716.00	1,216,985,200	
岡三証券グループ	65,000	823.00	53,495,000	
丸三証券	26,100	796.00	20,775,600	
東洋証券	35,000	334.00	11,690,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	88,100	800.00	70,480,000	
水戸証券	27,000	454.00	12,258,000	
いちよし証券	16,700	1,354.00	22,611,800	
松井証券	42,300	1,025.00	43,357,500	
だいこう証券ビジネス	5,200	648.00	3,369,600	
マネックスグループ	90,600	337.00	30,532,200	
カブドットコム証券	32,900	494.00	16,252,600	
極東証券	10,400	1,677.00	17,440,800	
岩井コスモホールディングス	8,800	1,192.00	10,489,600	
マネーパートナーズグループ	8,500	271.00	2,303,500	

N K S Jホールディングス	184,600	2,481.00	457,992,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	248,300	2,485.00	617,025,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	79,600	1,750.00	139,300,000	
第一生命保険	418,300	1,371.00	573,489,300	
東京海上ホールディングス	321,900	3,185.00	1,025,251,500	
T & Dホールディングス	285,100	1,188.00	338,698,800	
全国保証	11,000	4,215.00	46,365,000	
クレディセゾン	69,600	2,618.00	182,212,800	
芙蓉総合リース	9,300	4,060.00	37,758,000	
興銀リース	15,400	2,949.00	45,414,600	
東京センチュリーリース	20,700	3,420.00	70,794,000	
日本証券金融	42,700	690.00	29,463,000	
ポケットカード	12,000	842.00	10,104,000	
リコーリース	6,400	2,842.00	18,188,800	
イオンフィナンシャルサービス	49,600	2,801.00	138,929,600	
アコム	181,000	351.00	63,531,000	
ジャックス	58,000	435.00	25,230,000	
オリエントコーポレーション	205,300	238.00	48,861,400	
日立キャピタル	17,800	2,653.00	47,223,400	
アプラスフィナンシャル	67,200	143.00	9,609,600	
オリックス	506,100	1,589.00	804,192,900	
三菱U F Jリース	216,500	553.00	119,724,500	
日本取引所グループ	124,700	2,289.00	285,438,300	
イー・ギャランティ	4,300	2,030.00	8,729,000	
アサックス	1,400	1,287.00	1,801,800	
N E C キャピタルソリューション	4,700	2,308.00	10,847,600	
日本駐車場開発	907	7,220.00	6,548,540	
ヒューリック	140,100	1,560.00	218,556,000	
東京建物不動産販売	4,300	442.00	1,900,600	
三栄建築設計	2,500	818.00	2,045,000	
野村不動産ホールディングス	54,900	2,402.00	131,869,800	
常和ホールディングス	2,900	2,822.00	8,183,800	
フージャースホールディングス	12,400	795.00	9,858,000	
オープンハウス	3,300	2,501.00	8,253,300	
東急不動産ホールディングス	201,500	927.00	186,790,500	
飯田グループホールディングス	36,880	1,886.00	69,555,680	
パーク24	43,400	1,878.00	81,505,200	
パラカ	2,100	789.00	1,656,900	
三井不動産	392,000	3,245.00	1,272,040,000	

三菱地所	582,000	2,724.00	1,585,368,000	
平和不動産	16,800	1,666.00	27,988,800	
東京建物	170,000	853.00	145,010,000	
ダイビル	24,500	1,238.00	30,331,000	
京阪神ビルディング	13,900	540.00	7,506,000	
住友不動産	199,000	4,525.00	900,475,000	
大京	140,000	272.00	38,080,000	
テーオーシー	28,700	744.00	21,352,800	
東京楽天地	14,000	485.00	6,790,000	
レオパレス21	79,600	641.00	51,023,600	
フジ住宅	10,700	650.00	6,955,000	
空港施設	10,100	805.00	8,130,500	
明和地所	4,100	438.00	1,795,800	
住友不動産販売	6,000	3,035.00	18,210,000	
ゴールドクレスト	6,600	2,620.00	17,292,000	
日本エスリード	3,300	1,026.00	3,385,800	
日神不動産	5,600	777.00	4,351,200	
タカラレーベン	27,700	404.00	11,190,800	
サンヨーハウジング名古屋	4,300	1,166.00	5,013,800	
イオンモール	53,600	2,825.00	151,420,000	
ファースト住建	2,400	1,409.00	3,381,600	
トーセイ	11,400	720.00	8,208,000	
穴吹興産	6,000	316.00	1,896,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	51,700	1,160.00	59,972,000	
サンフロンティア不動産	7,900	1,125.00	8,887,500	
ランドビジネス	5,600	506.00	2,833,600	
グランディハウス	5,000	340.00	1,700,000	
日本空港ビルデング	28,700	2,023.00	58,060,100	
日本工営	30,000	459.00	13,770,000	
ネクスト	2,700	3,160.00	8,532,000	
日本M&Aセンター	4,500	7,410.00	33,345,000	
ノバレーゼ	2,300	702.00	1,614,600	
アコーディア・ゴルフ	36,200	1,126.00	40,761,200	
タケエイ	6,400	1,471.00	9,414,400	
パソナグループ	92	76,600.00	7,047,200	
リンクアンドモチベーション	57	34,700.00	1,977,900	
GCAサヴィアン	5,300	1,033.00	5,474,900	
エス・エム・エス	4,900	1,888.00	9,251,200	
テンプホールディングス	19,200	2,817.00	54,086,400	

リニカル	2,400	1,119.00	2,685,600	
クックパッド	5,300	3,130.00	16,589,000	
エスクリ	3,800	886.00	3,366,800	
アイ・ケイ・ケイ	2,600	750.00	1,950,000	
学情	3,400	911.00	3,097,400	
スタジオアリス	3,600	1,288.00	4,636,800	
シミックホールディングス	3,400	1,193.00	4,056,200	
NECフィールドディング	7,100	1,086.00	7,710,600	
総合警備保障	32,000	1,925.00	61,600,000	
カカクコム	53,400	1,812.00	96,760,800	
ルネサンス	3,900	736.00	2,870,400	
ツクイ	9,900	1,054.00	10,434,600	
総合臨床ホールディングス	2,600	566.00	1,471,600	
キャリアデザインセンター	24	108,900.00	2,613,600	
エムスリー	291	247,900.00	72,138,900	
ベストブライダル	5,300	665.00	3,524,500	
日本ERI	1,700	1,217.00	2,068,900	
アウトソーシング	3,900	855.00	3,334,500	
ディー・エヌ・エー	47,300	1,783.00	84,335,900	
博報堂DYホールディングス	121,900	780.00	95,082,000	
ぐるなび	6,100	2,127.00	12,974,700	
一休	63	137,300.00	8,649,900	
ジャパンベストレスキューシステム	68	79,600.00	5,412,800	
ジェイコムホールディングス	1,600	802.00	1,283,200	
PGMホールディングス	12,900	960.00	12,384,000	
バリューコマース	5,900	1,481.00	8,737,900	
J Pホールディングス	15,900	399.00	6,344,100	
イーピーエス	95	109,500.00	10,402,500	
アミューズ	2,400	1,847.00	4,432,800	
ドリームインキュベータ	27	181,600.00	4,903,200	
ケネディクス	105,900	480.00	50,832,000	
電通	82,900	3,715.00	307,973,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,814.00	7,800,200	
ぴあ	2,600	1,681.00	4,370,600	
イオンファンタジー	2,900	1,561.00	4,526,900	
ネクシィーズ	4,900	339.00	1,661,100	
みらかホールディングス	23,100	4,560.00	105,336,000	
アルプス技研	3,600	1,053.00	3,790,800	
サニックス	12,800	1,103.00	14,118,400	

ダイオーズ	1,600	723.00	1,156,800	
日本空調サービス	2,200	915.00	2,013,000	
オリエンタルランド	23,800	15,200.00	361,760,000	
ダスキン	23,800	1,991.00	47,385,800	
明光ネットワークジャパン	8,700	1,087.00	9,456,900	
ファルコSDホールディングス	4,500	1,221.00	5,494,500	
秀英予備校	3,500	325.00	1,137,500	
田谷	1,400	764.00	1,069,600	
ラウンドワン	26,200	601.00	15,746,200	
リゾートトラスト	15,000	3,495.00	52,425,000	
ピー・エム・エル	5,800	3,280.00	19,024,000	
ワタベウェディング	2,900	661.00	1,916,900	
もしもしホットライン	16,400	1,136.00	18,630,400	
リソー教育	9,900	630.00	6,237,000	
早稲田アカデミー	1,300	747.00	971,100	
ユー・エス・エス	106,500	1,436.00	152,934,000	
東京個別指導学院	4,400	236.00	1,038,400	
テー・オー・ダブリュー	2,900	567.00	1,644,300	
セントラルスポーツ	2,700	1,517.00	4,095,900	
フルキャストホールディングス	8,300	267.00	2,216,100	
リゾートソリューション	11,000	223.00	2,453,000	
リブセンス	2,200	4,855.00	10,681,000	
リロ・ホールディング	3,300	4,885.00	16,120,500	
エイチ・アイ・エス	7,200	5,140.00	37,008,000	
共立メンテナンス	4,500	3,890.00	17,505,000	
イチネンホールディングス	10,400	684.00	7,113,600	
建設技術研究所	5,200	892.00	4,638,400	
スペース	4,300	861.00	3,702,300	
燦ホールディングス	1,800	1,379.00	2,482,200	
スバル興業	6,000	372.00	2,232,000	
東京テアトル	34,000	158.00	5,372,000	
よみうりランド	19,000	705.00	13,395,000	
東京都競馬	68,000	397.00	26,996,000	
カナモト	11,000	2,536.00	27,896,000	
東京ドーム	67,000	660.00	44,220,000	
西尾レントオール	4,900	2,573.00	12,607,700	
トランス・コスモス	11,500	1,725.00	19,837,500	
乃村工藝社	17,000	829.00	14,093,000	
藤田観光	22,000	397.00	8,734,000	

日本管財	3,800	1,864.00	7,083,200	
トーカイ	3,900	2,456.00	9,578,400	
白洋舎	12,000	237.00	2,844,000	
セコム	91,500	6,060.00	554,490,000	
セントラル警備保障	3,900	927.00	3,615,300	
丹青社	9,000	626.00	5,634,000	
メイテック	12,100	2,718.00	32,887,800	
アサツー ディ・ケイ	15,600	2,696.00	42,057,600	
応用地質	8,400	1,649.00	13,851,600	
船井総合研究所	9,000	796.00	7,164,000	
進学会	3,700	392.00	1,450,400	
ベネッセホールディングス	29,500	3,705.00	109,297,500	
イオンディライト	8,500	1,888.00	16,048,000	
ナック	4,400	1,616.00	7,110,400	
ニチイ学館	19,100	856.00	16,349,600	
ダイセキ	13,000	1,882.00	24,466,000	
ステップ	2,600	825.00	2,145,000	
合計	133,717,998	-	141,087,888,760	

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25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	128,852,727
コール・ローン	1,700,422,469
国債証券	220,903,134,423
派生商品評価勘定	3,159,400
未収入金	64,627,490
未収利息	2,233,631,064
前払費用	157,005,933
差入委託証拠金	43,006,443
流動資産合計	225,233,839,949
資産合計	225,233,839,949
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,338,713
未払金	5,337,249
未払解約金	607,537,287
流動負債合計	619,213,249
負債合計	619,213,249
純資産の部	
元本等	
元本	96,807,388,714
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	127,807,237,986
元本等合計	224,614,626,700
純資産合計	224,614,626,700
負債純資産合計	225,233,839,949

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11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発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>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25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額	112,317,300,900円
計算期間中の追加設定元本額	22,679,849,470円
計算期間中の一部解約元本額	38,189,761,656円
計算日の元本額	96,807,388,714円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,998,279,211円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	239,335,614円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,021,487,924円

財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,580,988,738円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	591,137,777円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,674,152円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,484,487,397円
世界経済インデックスファンド	488,083,047円
マイセレクション25	14,451,970円
マイセレクション50	8,079,082円
マイセレクション75	6,182,426円
DCマイセレクション25	997,751,025円
DCマイセレクション50	933,139,235円
DCマイセレクション75	597,362,843円
DC外国債券インデックス・オープン	1,169,947,694円
DCマイセレクションS25	354,830,248円
DCマイセレクションS50	306,360,089円
DCマイセレクションS75	135,299,778円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,659,339円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	39,241,634円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	27,158,498円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	9,642,891円
DC世界経済インデックスファンド	366,364,463円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	10,223,614,015円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	250,957,561円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	24,730,535円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	8,581,483円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	325,708,015円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,067,190,735円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,756,505,698円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	18,716,606,512円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,293,141,014円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,033,180,300円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,239,124,159円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,159,765,553円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,000,623,628円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,469,158,959円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,336,515,785円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,343,043,501円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	505,602,804円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	684,947,424円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,448,176,867円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	852,183,388円

グローバル・バランスファンド・シリーズ1	335,520,490円
外国債券ファンド・シリーズ1	528,459,353円
コア投資戦略ファンド(安定型)	739,662,001円
コア投資戦略ファンド(成長型)	757,386,075円
分散投資コア戦略ファンドA	25,929,480円
分散投資コア戦略ファンドS	52,753,898円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
コア投資戦略ファンド(切替型)	39,117円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,478円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,807円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8,246,982,205円
2. 計算日における受益権総数	96,807,388,714口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3202円 (23,202円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成25年11月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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25年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券 「(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25年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,280,073,123
合計	4,280,073,123

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成25年11月11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25年11月11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	626,914,063	-	623,552,638	3,361,425
	合計	626,914,063	-	623,552,638	3,361,425

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成25年11月11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	353,610,000	-	356,256,000	2,646,000
	カナダドル	22,582,080	-	22,663,200	81,120
	イギリスポンド	58,232,820	-	58,641,300	408,480
	ユーロ	394,324,688	-	391,371,200	2,953,488
	計	828,749,588	-	828,931,700	182,112
	合計	828,749,588	-	828,931,700	182,112

(注)時価の算定方法

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

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

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

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25年11月11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 0.25% 01/15/15	10,000,000.00	10,008,984.40	
		T 0.25% 02/15/15	8,000,000.00	8,005,468.71	
		T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,920,898.46	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,996,718.82	
		T 0.25% 10/15/15	18,700,000.00	18,679,181.66	
		T 0.25% 12/15/14	2,000,000.00	2,001,992.18	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	2,999,414.07	
		T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,796,156.25	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,524,931.65	
		T 0.375% 06/15/15	20,200,000.00	20,238,269.50	
		T 0.375% 06/30/15	39,000,000.00	39,074,648.34	
		T 0.375% 11/15/14	4,000,000.00	4,008,984.36	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,338,964.87	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	985,273.44	
		T 0.625% 11/30/17	11,500,000.00	11,292,011.69	
		T 0.75% 02/28/18	13,100,000.00	12,866,400.40	
		T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,350,878.92	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,293,148.48	
		T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,851,757.80	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,438,662.12	
		T 0.875% 02/28/17	14,000,000.00	14,052,226.58	
		T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,245,398.44	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,409,542.97	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,671,289.04	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,992,886.69			
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,826,250.00			
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	5,997,673.83			
T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,896,289.06			

T 1.125% 12/31/19	8,700,000.00	8,324,642.58	
T 1.25% 01/31/19	900,000.00	888,591.79	
T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,557,851.59	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,331,777.33	
T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,364,937.50	
T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,653,640.64	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,207,046.88	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,897,410.16	
T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,388,578.26	
T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	1,990,468.76	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,382,984.36	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,411,867.20	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,839,082.02	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,161,972.64	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	7,807,216.76	
T 1.75% 05/15/22	10,000,000.00	9,409,960.90	
T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	9,358,699.18	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,379,687.50	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,444,898.50	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,153,281.27	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,126,347.64	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,097,617.18	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,580,175.77	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,669,753.93	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	5,796,328.14	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	11,801,513.62	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,188,625.00	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,331,562.51	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,014,814.47	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	12,858,644.48	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,535,738.28	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,995,048.84	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,091,875.00	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,738,500.09	
T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,441,820.33	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,195,078.12	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	576,662.10	
T 2.5% 03/31/15	9,500,000.00	9,799,658.21	

T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,051,132.81	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,372,830.05	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,301,269.55	
T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,708,935.54	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,275,000.00	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,648,387.68	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	637,359.37	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,052,121.10	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,526,875.04	
T 2.75% 08/15/42	9,200,000.00	7,401,328.14	
T 2.75% 11/15/42	11,000,000.00	8,830,937.50	
T 2.75% 11/30/16	5,000,000.00	5,313,671.90	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,177,646.49	
T 2.875% 05/15/43	8,400,000.00	6,913,265.59	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,188,193.39	
T 3% 05/15/42	5,500,000.00	4,681,552.75	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,288,779.28	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,765,097.66	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	869,472.66	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,007,050.76	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	13,834,000.00	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,628,351.58	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,976,328.12	
T 3.125% 11/15/41	3,500,000.00	3,067,353.52	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,789,285.13	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,683,886.72	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,776,103.52	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,303,296.85	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,251,964.85	
T 3.5% 02/15/39	3,400,000.00	3,250,187.50	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,695,578.12	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,695,351.58	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,312,775.37	
T 3.75% 08/15/41	5,900,000.00	5,835,699.20	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,565,429.70	
T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,263,000.00	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,543,968.76	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,710,759.77	

T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,092,839.82	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	649,546.87	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,370,849.62	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,177,156.25	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,400,781.25	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,547,000.00	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,404,259.78	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,202,578.12	
T 4.375% 11/15/39	4,300,000.00	4,745,453.12	
T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	2,821,923.82	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,031,890.67	
T 4.5% 05/15/38	1,500,000.00	1,688,671.87	
T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,264,312.50	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,359,443.37	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,621,386.70	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,318,412.10	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,482,787.11	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	603,701.17	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,362,312.51	
T 5.25% 02/15/29	800,000.00	982,812.50	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,597,705.08	
T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,003,562.51	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,509,585.93	
T 6.0% 02/15/26	1,900,000.00	2,476,494.14	
T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	2,948,264.07	
T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,563,042.18	
T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,534,310.55	
T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,430,616.20	
T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,612,656.25	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,410,712.89	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,848,945.32	
アメリカドル小計		870,200,000.00	887,816,904.08 (87,867,238,996)
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,930.00
	CAN 1% 11/01/15	1,000,000.00	997,525.00
	CAN 1.25% 03/01/18	2,300,000.00	2,255,150.00
	CAN 1.25% 09/01/18	850,000.00	827,322.00
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	1,905,445.50

	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,645,272.75	
	CAN 2% 06/01/16	1,800,000.00	1,836,018.00	
	CAN 2% 12/01/14	3,200,000.00	3,233,040.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,065,715.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,100,000.00	1,079,336.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,039,160.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,200,000.00	2,288,275.00	
	CAN 3% 12/01/15	2,900,000.00	3,008,953.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,900,000.00	2,022,939.50	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,900,000.00	2,057,586.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,100,000.00	2,242,716.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	2,951,221.50	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,300,854.75	
	CAN 4% 06/01/17	3,100,000.00	3,369,638.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,350,000.00	2,710,396.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,940,767.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	6,700,000.00	7,052,185.50	
	CAN 5% 06/01/37	2,150,000.00	2,820,058.25	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,800,000.00	2,427,327.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,950,000.00	2,713,376.25	
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,027,789.75	
	カナダドル小計	55,500,000.00	60,017,998.75 (5,668,699,981)	
オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,450,000.00	1,281,169.25	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,200,000.00	1,094,304.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	850,000.00	729,414.75	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,400,000.00	1,451,478.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,850,000.00	2,980,530.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,700,000.00	1,763,325.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	3,150,000.00	3,293,057.25	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,050,000.00	2,126,844.25	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,500,000.00	2,713,687.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,000,000.00	3,257,880.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,950,000.00	3,283,246.75	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,700,000.00	3,030,304.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,550,000.00	2,877,241.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,487,744.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,450,000.00	2,573,124.75	

オーストラリアドル小計		34,000,000.00	35,943,351.50 (3,337,699,620)
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	6,550,000.00	6,494,914.50
	UKT 1.25% 07/22/18	3,300,000.00	3,253,569.00
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	819,332.00
	UKT 1.75% 09/07/22	3,350,000.00	3,124,511.50
	UKT 2% 01/22/16	3,650,000.00	3,758,313.75
	UKT 2.25% 09/07/23	2,550,000.00	2,437,290.00
	UKT 2.75% 01/22/15	3,250,000.00	3,339,667.50
	UKT 3.25% 01/22/44	2,500,000.00	2,334,825.00
	UKT 3.5% 07/22/68	1,250,000.00	1,232,300.00
	UKT 3.75% 07/22/52	2,300,000.00	2,382,880.50
	UKT 3.75% 09/07/19	3,600,000.00	3,978,882.00
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,312,960.00
	UKT 3.75% 09/07/21	2,650,000.00	2,914,470.00
	UKT 4% 01/22/60	1,900,000.00	2,098,958.50
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	2,847,929.25
	UKT 4% 09/07/16	3,400,000.00	3,705,728.00
	UKT 4.25% 03/07/36	2,900,000.00	3,249,290.50
	UKT 4.25% 06/07/32	3,150,000.00	3,531,150.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,132,351.00
	UKT 4.25% 12/07/27	2,000,000.00	2,247,850.00
	UKT 4.25% 12/07/40	2,500,000.00	2,805,600.00
	UKT 4.25% 12/07/46	2,750,000.00	3,107,720.00
	UKT 4.25% 12/07/49	2,200,000.00	2,505,547.00
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	2,424,093.00
	UKT 4.5% 03/07/19	1,950,000.00	2,226,344.25
	UKT 4.5% 09/07/34	2,650,000.00	3,064,261.25
	UKT 4.5% 12/07/42	3,300,000.00	3,868,837.50
	UKT 4.75% 03/07/20	2,750,000.00	3,203,282.50
	UKT 4.75% 09/07/15	2,800,000.00	3,017,938.00
	UKT 4.75% 12/07/30	2,600,000.00	3,090,126.00
	UKT 4.75% 12/07/38	2,350,000.00	2,843,206.25
	UKT 5% 03/07/18	3,300,000.00	3,801,633.00
UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	2,884,176.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,700,000.00	2,274,778.50	
UKT 8% 06/07/21	2,300,000.00	3,212,904.50	
UKT 8% 12/07/15	2,195,000.00	2,536,234.70	

	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,920,120.00	
イギリスポンド小計		97,895,000.00	107,983,975.45 (17,115,460,108)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	110,931.50	
	SWISS 3% 01/08/18	3,350,000.00	3,747,410.50	
	SWISS 3% 05/12/19	200,000.00	228,732.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	848,648.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,900,000.00	2,410,843.50	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	401,842.50	
スイスフラン小計		6,650,000.00	7,748,408.00 (832,024,051)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	150,000.00	150,029.25	
	SIGB 0.5% 04/01/18	500,000.00	498,120.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	350,000.00	356,975.50	
	SIGB 2.25% 06/01/21	700,000.00	717,888.50	
	SIGB 2.375% 04/01/17	550,000.00	586,580.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	908,280.25	
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	433,334.25	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,303,337.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	400,000.00	395,872.00	
	SIGB 3% 09/01/24	400,000.00	421,452.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	976,554.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	700,000.00	768,232.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	200,000.00	210,361.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	900,000.00	980,770.50	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	876,976.00	
	SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	862,151.25	
シンガポールドル小計		9,850,000.00	10,446,915.00 (829,380,581)	
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	700,752.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	300,000.00	301,251.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,535,057.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,250,000.00	1,217,581.25	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,276,964.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,350,000.00	1,337,917.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,076,723.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,403,588.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	3,900,000.00	3,938,317.50	

	MGS 3.814% 02/15/17	1,700,000.00	1,726,630.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	800,000.00	811,464.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	345,135.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	697,872.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,829,378.75	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,725,816.50	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,100,000.00	5,253,586.50	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,633,437.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	650,000.00	676,500.50	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,341,983.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,200,000.00	1,354,806.00	
	マレーシアリングット小計	36,650,000.00	37,184,762.50 (1,152,355,789)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	12,000,000.00	11,054,940.00	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	7,951,044.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	7,100,000.00	7,613,507.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	9,227,610.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,050,000.00	11,965,271.50	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,800,000.00	13,288,688.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	9,850,000.00	10,446,368.25	
	SGB 5% 12/01/20	8,000,000.00	9,550,360.00	
	スウェーデンクローナ小計	75,800,000.00	81,097,789.25 (1,215,655,860)	
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	5,100,000.00	4,748,406.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,800,000.00	9,480,548.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	9,200,000.00	9,943,084.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,950,000.00	8,841,950.25	
	NGB 5% 05/15/15	11,750,000.00	12,350,953.75	
	ノルウェークローネ小計	42,800,000.00	45,364,942.00 (729,468,267)	
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	7,450,000.00	7,230,187.75	
	DGB 2% 11/15/14	9,050,000.00	9,234,167.50	
	DGB 2.5% 11/15/16	3,500,000.00	3,734,307.50	
	DGB 3% 11/15/21	14,250,000.00	15,910,267.50	
	DGB 4% 11/15/15	13,000,000.00	14,025,570.00	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,178,076.00	
	DGB 4% 11/15/19	13,500,000.00	15,869,925.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	17,850,000.00	24,137,573.25	

	DGB 7% 11/10/24	4,300,000.00	6,531,893.50	
デンマーククローネ小計		92,700,000.00	107,851,968.00 (1,912,215,392)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,500,000.00	10,786,245.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	10,400,000.00	10,240,932.00	
	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,590,732.00	
	MBONO 6% 06/18/15	75,550,000.00	78,246,757.25	
	MBONO 6.5% 06/10/21	18,400,000.00	19,123,120.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,411,170.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	21,175,132.00	
	MBONO 8% 12/07/23	27,100,000.00	30,614,734.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	49,900,000.00	56,843,086.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	35,771,377.50	
メキシコペソ小計		281,600,000.00	305,803,286.25 (2,302,698,745)	
ポーランドズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	1,500,000.00	1,427,760.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	5,000,000.00	5,046,875.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,700,000.00	2,626,222.50	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,197,587.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	4,650,000.00	4,856,436.75	
	POLGB 5% 04/25/16	2,300,000.00	2,405,995.50	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	5,974,584.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,438,656.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	3,500,000.00	3,637,042.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,250,000.00	4,621,237.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,750,000.00	1,950,007.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,900,000.00	5,419,228.50	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,087,826.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	10,200,000.00	10,850,301.00	
ポーランドズロチ小計		54,450,000.00	57,539,759.75 (1,819,982,600)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,200,000.00	23,775,198.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	13,100,000.00	9,598,828.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	10,450,000.00	7,635,606.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	13,304,970.00	
	SAGB 7% 02/28/31	11,900,000.00	9,925,135.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	12,900,000.00	12,768,484.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,300,000.00	5,238,043.00	

	SAGB 8% 12/21/18	12,700,000.00	13,167,169.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	13,500,000.00	14,124,105.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	4,900,000.00	4,637,678.50	
	SAGB 8.75% 12/21/14	1,700,000.00	1,769,538.50	
	南アフリカランド小計	120,650,000.00	115,944,757.00 (1,109,591,324)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,107,859.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	400,000.00	392,990.00	
	BGB 3% 09/28/19	1,050,000.00	1,139,412.75	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,100,000.00	3,343,737.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,045,440.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	700,000.00	717,300.50	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,000,000.00	2,131,810.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,050,000.00	3,447,689.50	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,597,620.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,538,634.50	
	BGB 4% 03/28/32	1,300,000.00	1,426,607.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,950,000.00	3,275,267.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,100,000.00	2,393,947.50	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,092,775.50	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,396,104.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,100,000.00	3,588,498.00	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,150,000.00	1,348,081.75	
	BGB 5% 03/28/35	2,800,000.00	3,487,988.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,650,000.00	3,419,997.25	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,800,000.00	2,119,716.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,494,389.25	
	BTNS 1% 07/25/17	3,000,000.00	3,036,615.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,663,272.00	
	BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,265,923.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,342,208.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	2,300,000.00	2,363,100.50	
	BTNS 2.5% 07/25/16	5,000,000.00	5,284,900.00	
	BTPS 2.75% 12/01/15	3,000,000.00	3,085,710.00	
	BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,909,478.00	
	BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,045,897.50	
	BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,894,290.00	
	BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	834,836.00	

BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,662,335.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,315,280.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,000,000.00	6,260,760.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000.00	6,642,531.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	5,400,000.00	5,514,561.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,842,457.50	
BTPS 4% 02/01/37	4,000,000.00	3,646,760.00	
BTPS 4% 09/01/20	2,900,000.00	3,034,806.50	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,563,119.50	
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,064,385.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,127,368.75	
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,827,497.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	5,050,000.00	5,466,978.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,350,000.00	6,824,218.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,696,281.75	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,150,000.00	2,221,541.25	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	2,779,866.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,150,000.00	3,290,773.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000.00	7,482,739.50	
BTPS 4.75% 06/01/17	4,900,000.00	5,319,538.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,300,000.00	4,605,730.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,325,000.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	900,000.00	879,741.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,218,981.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,350,000.00	2,567,163.50	
BTPS 5% 03/01/25	3,400,000.00	3,647,945.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,100,000.00	3,230,510.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,350,000.00	3,413,717.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	2,870,168.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,372,613.75	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,800,000.00	4,097,749.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,355,696.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	4,595,382.50	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	2,944,669.00	
BTPS 6% 05/01/31	4,700,000.00	5,448,545.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	6,300,000.00	7,640,797.50	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,446,278.50	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,124,952.00	

DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,550,266.00	
DBR 1.5% 05/15/23	3,500,000.00	3,433,937.50	
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,885,572.50	
DBR 1.75% 07/04/22	3,900,000.00	3,973,515.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,719,366.00	
DBR 2.25% 09/04/20	2,100,000.00	2,259,421.50	
DBR 2.25% 09/04/21	3,400,000.00	3,634,974.00	
DBR 2.5% 01/04/21	2,700,000.00	2,945,592.00	
DBR 2.5% 07/04/44	2,600,000.00	2,500,550.00	
DBR 3% 07/04/20	2,800,000.00	3,152,996.00	
DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,100,328.00	
DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000.00	9,254,520.00	
DBR 3.25% 07/04/21	2,300,000.00	2,632,844.50	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,456,916.00	
DBR 3.5% 01/04/16	6,900,000.00	7,401,423.00	
DBR 3.5% 07/04/19	4,550,000.00	5,226,152.75	
DBR 3.75% 01/04/15	1,300,000.00	1,354,801.50	
DBR 3.75% 01/04/17	2,600,000.00	2,884,180.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,500,000.00	4,040,610.00	
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,960,756.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,157,112.50	
DBR 4.0% 01/04/37	3,600,000.00	4,431,222.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,650,032.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,850,665.25	
DBR 4.25% 07/04/39	2,000,000.00	2,586,370.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,603,390.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,000,000.00	4,024,440.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,500,000.00	3,487,812.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,650,000.00	3,757,514.50	
DBR 5.625% 01/04/28	1,900,000.00	2,670,849.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	644,490.00	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,267,864.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,886,425.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,700,000.00	2,562,520.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,300,000.00	2,299,655.00	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,511,350.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	3,600,000.00	3,455,802.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,200,000.00	4,255,986.00	

FRTR 2.5% 10/25/20	5,200,000.00	5,531,266.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	2,350,000.00	2,330,401.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,200,000.00	6,711,066.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,270,550.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,714,248.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	850,000.00	822,111.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,595,440.25	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,278,923.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,323,100.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,300,000.00	5,766,214.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,761,362.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000.00	6,644,973.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	4,800,000.00	5,479,104.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,800,000.00	5,462,400.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,150,000.00	2,397,895.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,350,000.00	1,509,975.00	
FRTR 4% 10/25/38	3,850,000.00	4,315,118.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,685,634.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,000,000.00	4,550,420.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,800,000.00	5,556,216.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	5,976,996.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,413,215.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,300,000.00	4,103,698.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,671,725.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,300,000.00	5,682,966.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,550,000.00	4,920,016.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,245,460.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,544,430.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,586,468.80	
IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	824,088.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,550,000.00	1,688,841.25	
IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	737,649.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,350,000.00	3,621,484.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	879,404.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,800,000.00	1,951,479.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,212,869.75	
IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	566,297.50	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,000,000.00	1,163,535.00	

NETHER 0.75% 04/15/15	1,600,000.00	1,614,104.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	2,250,000.00	2,296,203.75	
NETHER 1.25% 01/15/19	600,000.00	606,624.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,900,000.00	1,843,532.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,400,000.00	2,470,212.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,233,087.50	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,500,000.00	1,449,525.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,443,295.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	3,900,000.00	4,100,616.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,550,000.00	2,842,842.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,400,000.00	2,720,928.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	1,955,858.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	2,604,096.00	
NETHER 4% 01/15/37	1,950,000.00	2,357,306.25	
NETHER 4% 07/15/16	3,850,000.00	4,224,797.50	
NETHER 4% 07/15/19	2,400,000.00	2,777,016.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,914,152.75	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,795,388.75	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,950,000.00	2,647,310.25	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	805,442.00	
OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	3,996,620.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,413,992.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,044,460.00	
OBL 1% 10/12/18	2,000,000.00	2,030,250.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	514,877.50	
OBL 1.75% 10/09/15	2,000,000.00	2,063,020.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,606,680.00	
OBL 2.5% 02/27/15	6,800,000.00	7,012,330.00	
OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,355,717.00	
RAGB 1.75% 10/20/23	900,000.00	872,217.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	600,000.00	626,259.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,250,000.00	1,359,525.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,150,000.00	1,289,564.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	1,450,000.00	1,531,011.50	
RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,495,240.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	1,300,000.00	1,485,172.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	607,317.50	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,200,000.00	2,548,260.00	

RAGB 4% 09/15/16	2,200,000.00	2,426,193.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,187,513.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,050,000.00	1,195,435.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	2,450,000.00	2,866,549.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	2,800,000.00	3,249,232.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,400,000.00	1,769,817.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,000,000.00	1,435,945.00	
RFGB 1.5% 04/15/23	600,000.00	576,054.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	750,000.00	735,738.75	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	622,380.00	
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	434,936.25	
RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	668,128.50	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,050,000.00	1,184,132.25	
RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	794,636.50	
RFGB 3.875% 09/15/17	2,100,000.00	2,359,161.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,000,000.00	1,178,550.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,200,000.00	1,281,390.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,061,986.50	
SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,849,257.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	6,313,164.50	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,600,000.00	1,661,656.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	1,800,000.00	1,870,209.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	1,000,000.00	1,025,060.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	1,400,000.00	1,463,196.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	3,550,000.00	3,746,847.50	
SPGB 4% 04/30/20	3,750,000.00	3,905,943.75	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,758,458.25	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,450,000.00	3,689,223.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,500,000.00	2,229,275.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	4,000,000.00	4,268,040.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,400,000.00	2,560,188.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000.00	7,720,161.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,272,557.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	4,500,000.00	4,881,667.50	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,600,000.00	2,672,150.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,750,000.00	1,667,426.25	
SPGB 4.8% 01/31/24	4,000,000.00	4,214,100.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	2,950,000.00	3,208,479.00	

	SPGB 4.9% 07/30/40	2,000,000.00	1,966,980.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	950,000.00	1,001,076.75	
	SPGB 5.15% 10/31/44	650,000.00	656,464.25	
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,800,000.00	3,090,850.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,829,046.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	2,350,000.00	2,621,883.25	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,516,096.25	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,255,654.75	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,483,573.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,650,000.00	3,028,009.25	
	ユーロ小計	653,280,000.00	718,580,117.30 (95,010,663,109)	
	国債証券合計		220,903,134,423 (220,903,134,423)	
	合計		220,903,134,423 (220,903,134,423)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 135銘柄	100.0%	39.8%
カナダドル	国債証券 26銘柄	100.0%	2.6%
オーストラリアドル	国債証券 15銘柄	100.0%	1.5%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	7.7%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券 232銘柄	100.0%	43.0%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,553,751,129
コール・ローン	44,461,057
株式	155,847,825,431
投資信託受益証券	92,678,095
投資証券	3,071,160,270
派生商品評価勘定	29,009,804
未収入金	1,934,304
未収配当金	224,118,960
未収利息	60
差入委託証拠金	1,023,389,113
流動資産合計	162,888,328,223
資産合計	162,888,328,223
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,750,287
未払解約金	773,229,722
流動負債合計	780,980,009
負債合計	780,980,009
純資産の部	
元本等	
元本	107,252,940,490
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	54,854,407,724
元本等合計	162,107,348,214
純資産合計	162,107,348,214
負債純資産合計	162,888,328,223

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
<p>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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
<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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</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25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額	137,810,442,940円
計算期間中の追加設定元本額	14,022,318,725円
計算期間中の一部解約元本額	44,579,821,175円
計算日の元本額	107,252,940,490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)	1,107,865,207円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,916,364円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,581,289,199円
世界経済インデックスファンド	822,152,357円
マイセレクション25	12,040,251円
マイセレクション50	39,772,515円
マイセレクション75	51,114,178円
外国株式インデックス・オープン	1,119,972,860円
DCマイセレクション25	809,232,772円
DCマイセレクション50	4,618,688,350円
DCマイセレクション75	5,015,939,911円
DC外国株式インデックス・オープン	5,397,810,832円
DCマイセレクションS25	295,803,122円
DCマイセレクションS50	1,534,574,466円
DCマイセレクションS75	1,135,109,098円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	5,385,262円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	140,633,329円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	141,576,759円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	65,869,878円
DC世界経済インデックスファンド	615,387,962円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	12,044,148,712円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	123,668,419円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	71,593,202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)	316,933,571円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	761,906,032円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,801,238,878円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,045,862,633円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,222,253,281円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,360,549,115円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,114,636,957円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,875,696,570円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	12,436,650,027円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,953,377,717円

バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,123,688,341円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,164,885,662円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	350,928,241円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,130,631,948円
F0Fs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	5,340,494,179円
外国株式ファンド・シリーズ1	764,235,038円
コア投資戦略ファンド(安定型)	689,586,027円
コア投資戦略ファンド(成長型)	940,735,820円
分散投資コア戦略ファンドA	24,673,759円
分散投資コア戦略ファンドS	65,806,453円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	47,681円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	138,312円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	46,104円
2. 計算日における受益権総数	107,252,940,490口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5114円 (15,114円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年11月11日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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25年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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25年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	8,762,420,006
投資信託受益証券	4,292,728
投資証券	294,656,835

合計	8,463,470,443
----	---------------

(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25年5月30日から平成25年11月11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25年11月11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	2,945,008,459	-	2,969,119,696	24,111,237
合計		2,945,008,459	-	2,969,119,696	24,111,237

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成25年11月11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 売 建				
	アメリカドル	513,884,210	-	516,571,200	2,686,990
	カナダドル	29,190,770	-	29,276,400	85,630
	オーストラリアドル	61,347,320	-	61,277,600	69,720
	イギリスポンド	80,669,960	-	80,829,900	159,940
	スイスフラン	35,498,030	-	35,435,400	62,630
	香港ドル	10,134,400	-	10,216,000	81,600
	スウェーデンクローナ	11,997,600	-	11,984,000	13,600
	デンマーククローネ	8,864,500	-	8,865,000	500
	イスラエルシェケル	6,984,750	-	6,982,500	2,250
	ユーロ	117,690,540	-	117,675,800	14,740
	計	876,262,080	-	879,113,800	2,851,720
合計		876,262,080	-	879,113,800	2,851,720

(注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年11月11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	28,676	90.97	2,608,655.72	
	APACHE CORP	22,378	89.80	2,009,544.40	
	BAKER HUGHES	25,183	57.92	1,458,599.36	
	CABOT OIL & GAS CORP	23,916	33.60	803,577.60	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	14,045	54.65	767,559.25	
	CHENIERE ENERGY INC	12,228	38.59	471,878.52	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	30,243	25.71	777,547.53	
	CHEVRON CORP	111,174	121.19	13,473,177.06	
	CIMAREX ENERGY CO	4,865	102.66	499,440.90	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,143	22.48	385,374.64	
	CONCHO RESOURCES INC	6,186	110.20	681,697.20	
	CONOCOPHILLIPS	66,527	73.69	4,902,374.63	
	CONSOL ENERGY INC	12,855	36.41	468,050.55	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,577	114.19	294,267.63	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,673	190.48	509,153.04	
	DENBURY RESOURCES INC	22,245	19.35	430,440.75	
	DEVON ENERGY CORPORATION	21,978	60.11	1,321,097.58	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,348	61.74	268,445.52	
	ENERGEN CORP	4,302	75.04	322,822.08	
	ENSCO PLC-CL A	13,189	61.48	810,859.72	
EOG RESOURCES INC	15,560	170.96	2,660,137.60		
EQT CORPORATION	8,518	83.38	710,230.84		
EXXON MOBIL	255,079	92.73	23,653,475.67		

FMC TECHNOLOGIES INC	14,145	49.75	703,713.75	
HALLIBURTON CO	48,332	55.32	2,673,726.24	
HELMERICH & PAYNE	5,975	78.02	466,169.50	
HESS CORP	17,611	80.30	1,414,163.30	
HOLLYFRONTIER CORP	10,843	44.18	479,043.74	
KINDER MORGAN INC	38,361	35.00	1,342,635.00	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,474	74.52	482,442.48	
MARATHON OIL CORP	40,396	36.39	1,470,010.44	
MARATHON PETROLEUM CORP	18,909	71.65	1,354,829.85	
MURPHY OIL CORP	10,789	61.04	658,560.56	
NABORS INDUSTRIES LTD	16,302	17.92	292,131.84	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	24,400	82.20	2,005,680.00	
NOBLE CORP	14,269	39.56	564,481.64	
NOBLE ENERGY INC	20,809	75.60	1,573,160.40	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	46,134	96.33	4,444,088.22	
OCEANEERING INTL INC	6,088	84.76	516,018.88	
PEABODY ENERGY CORP	16,869	20.87	352,056.03	
PHILLIPS 66	33,603	65.36	2,196,292.08	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,884	189.83	1,496,619.72	
QEP RESOURCES INC	9,981	32.42	323,584.02	
RANGE RESOURCES CORP	9,700	75.78	735,066.00	
ROWAN COMPANIES PLC	7,231	37.19	268,920.89	
SCHLUMBERGER	76,193	93.79	7,146,141.47	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,913	36.15	756,004.95	
SPECTRA ENERGY CORP	38,125	34.12	1,300,825.00	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	9,499	27.82	264,262.18	
TESORO CORP	8,166	50.09	409,034.94	
VALERO ENERGY CORP	31,042	40.32	1,251,613.44	
WEATHERFORD INTL LTD	44,155	17.07	753,725.85	
WHITING PETROLEUM CORP	6,704	64.44	432,005.76	
WILLIAMS COS	38,909	34.79	1,353,644.11	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	11,898	109.45	1,302,236.10	
AIRGAS INC	3,849	108.28	416,769.72	
ALBEMARLE CORP	5,130	67.34	345,454.20	
ALCOA	63,694	9.06	577,067.64	
ASHLAND INC	4,469	88.68	396,310.92	
AVERY DENNISON CORP	5,957	47.57	283,374.49	
BALL CORP	8,456	49.50	418,572.00	

CELANESE CORP-SERIES A	9,323	56.82	529,732.86	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,462	219.36	759,424.32	
CROWN HOLDINGS INC	8,530	43.20	368,496.00	
DOW CHEMICAL CO	69,353	39.67	2,751,233.51	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	52,808	62.00	3,274,096.00	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,170	79.11	725,438.70	
ECOLAB INC	15,235	106.56	1,623,441.60	
FMC CORP	8,200	73.42	602,044.00	
FREEMONT-MCMOR-B	59,622	36.58	2,180,972.76	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,854	86.94	422,006.76	
INT'L PAPER CO	24,097	43.96	1,059,304.12	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	24,708	75.39	1,862,736.12	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,855	100.70	287,498.50	
MEADWESTVACO CORP	10,334	33.99	351,252.66	
MONSANTO CO	30,628	107.22	3,283,934.16	
MOSAIC CO/THE	16,870	48.01	809,928.70	
NEWMONT MINING CORP	29,588	27.57	815,741.16	
NUCOR CORP	18,090	54.62	988,075.80	
OWENS-ILLINOIS INC	9,681	31.92	309,017.52	
PPG INDUSTRIES INC	8,344	181.57	1,515,020.08	
PRAXAIR INC	16,939	124.49	2,108,736.11	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,201	95.85	402,665.85	
SEALED AIR CORP	11,574	30.82	356,710.68	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,994	185.51	926,436.94	
SIGMA-ALDRICH	7,174	84.78	608,211.72	
VULCAN MATERIALS CO	7,736	56.60	437,857.60	
3 M COMPANY	37,550	127.99	4,806,024.50	
AGCO CORP	5,665	58.03	328,739.95	
AMETEK INC	14,491	48.53	703,248.23	
BOEING CO	41,289	133.49	5,511,668.61	
CATERPILLAR	37,628	84.24	3,169,782.72	
CUMMINS INC	10,494	130.70	1,371,565.80	
DANAHER CORP	33,652	74.60	2,510,439.20	
DEERE&CO	21,462	81.50	1,749,153.00	
DOVER CORP	10,004	92.24	922,768.96	
EATON CORP	27,011	70.60	1,906,976.60	
EMERSON ELECTRIC CO	41,107	66.97	2,752,935.79	
FASTENAL CO	15,974	47.13	752,854.62	

FLOWSERVE CORP	8,063	69.58	561,023.54	
FLUOR CORP	9,680	77.92	754,265.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,478	87.20	1,524,081.60	
GENERAL ELECTRIC CO	593,066	27.05	16,042,435.30	
GRAINGER (WW) INC	3,355	268.11	899,509.05	
HONEYWELL INTL INC	42,782	87.44	3,740,858.08	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,430	79.08	1,931,924.40	
INGERSOLL-RAND PLC	17,004	67.70	1,151,170.80	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,615	61.99	472,053.85	
JOY GLOBAL INC	6,186	57.60	356,313.60	
KBR INC	8,182	34.81	284,815.42	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,355	101.50	543,532.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	15,626	138.11	2,158,106.86	
MASCO CORP	21,437	20.35	436,242.95	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,007	110.73	1,440,265.11	
PACCAR INC	20,593	56.84	1,170,506.12	
PALL CORP	6,617	81.87	541,733.79	
PARKER HANNIFIN CORP	8,479	116.13	984,666.27	
PENTAIR LTD	11,573	67.36	779,557.28	
PRECISION CASTPARTS CORP	8,359	251.11	2,099,028.49	
QUANTA SERVICES INC	12,193	29.86	364,082.98	
RAYTHEON COMPANY	18,898	85.36	1,613,133.28	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,924	111.72	885,269.28	
ROCKWELL COLLIN	7,253	70.90	514,237.70	
ROPER INDUSTRIES INC	5,606	125.93	705,963.58	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	37.11	259,770.00	
SPX CORP	2,519	93.92	236,584.48	
STANLEY BLACK&DECKER	9,068	80.88	733,419.84	
TEXTRON	16,174	30.28	489,748.72	
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	147.27	417,068.64	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	50,029	108.55	5,430,647.95	
XYLEM INC	10,787	33.98	366,542.26	
ADT CORPORATION	12,100	42.40	513,040.00	
CINTAS CORP	6,063	53.46	324,127.98	
DUN & BRADSTREET CORP	2,435	111.45	271,380.75	
EQUIFAX INC	7,175	64.70	464,222.50	
IHS INC-CLASS A	3,625	108.96	394,980.00	
IRON MOUNTAIN INC	8,702	26.92	234,257.84	

MANPOWER GROUP	4,455	80.00	356,400.00	
NIELSEN HOLDINGS NV	13,430	39.77	534,111.10	
REPUBLIC SERVICES INC	17,278	34.32	592,980.96	
ROBERT HALF INTL INC	8,611	38.20	328,940.20	
STERICYCLE INC	5,128	116.57	597,770.96	
TYCO INTERNATIONAL LTD	26,352	36.40	959,212.80	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,032	62.47	564,229.04	
WASTE MANAGEMENT INC	25,231	44.16	1,114,200.96	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,593	59.66	572,318.38	
CSX CORP	59,497	26.61	1,583,215.17	
DELTA AIR LINES INC	12,452	26.89	334,834.28	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,300	42.43	521,889.00	
FEDEX CORP	17,200	132.57	2,280,204.00	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,843	21.35	509,048.05	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,476	73.20	400,843.20	
KANSAS CITY SOUTHERN	6,241	123.32	769,640.12	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,344	85.62	1,570,613.28	
SOUTHWEST AIRLINES CO	10,842	17.69	191,794.98	
UNION PACIFIC CORP	26,723	155.04	4,143,133.92	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	35.36	190,625.76	
UNITED PARCEL SERVICE B	41,486	99.62	4,132,835.32	
AUTOLIV INC	5,587	90.33	504,673.71	
BORGWARNER INC	6,751	101.25	683,538.75	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	17,352	55.42	961,647.84	
FORD MOTOR COMPANY	210,090	16.85	3,540,016.50	
GENERAL MOTORS CO	44,169	36.66	1,619,235.54	
HARLEY-DAVIDSON	12,719	64.26	817,322.94	
JOHNSON CONTROLS INC	39,113	47.66	1,864,125.58	
TESLA MOTORS INC	4,848	137.95	668,781.60	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	74.27	523,900.58	
COACH INC	15,937	51.81	825,695.97	
DR HORTON INC	16,578	18.14	300,724.92	
FOSSIL GROUP INC	2,953	127.91	377,718.23	
GARMIN LTD	6,856	46.25	317,090.00	
HASBRO INC	6,870	50.48	346,797.60	
LEGGETT & PLATT INC	8,864	29.38	260,424.32	
LENNAR CORP-CL A	9,411	32.79	308,586.69	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,911	69.00	407,859.00	

MATTEL INC	19,610	44.16	865,977.60	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,233	79.40	891,900.20	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,720	134.30	499,596.00	
NEWELL RUBBERMAID	16,854	29.01	488,934.54	
NIKE B	40,976	77.12	3,160,069.12	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,815	127.13	485,000.95	
PULTE GROUP INC	20,375	16.85	343,318.75	
PVH CORP	4,650	125.57	583,900.50	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,565	173.42	618,242.30	
TOLL BROTHERS INC	9,562	31.94	305,410.28	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,800	78.94	378,912.00	
VF CORP	5,119	218.74	1,119,730.06	
WHIRLPOOL CORP	4,625	145.25	671,781.25	
BLOCK H & R INC	15,909	27.85	443,065.65	
CARNIVAL CORPORATION	21,811	36.27	791,084.97	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,756	535.20	939,811.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,584	52.16	395,581.44	
INT'L GAME TECHNOLOGY	16,160	17.47	282,315.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	23,550	69.80	1,643,790.00	
MARRIOTT INTL A	13,885	46.10	640,098.50	
MCDONALD'S CORP	57,484	97.01	5,576,522.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	23,000	19.09	439,070.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,973	43.02	386,018.46	
STARBUCKS CORP	42,881	81.20	3,481,937.20	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,040	74.44	821,817.60	
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,163	66.20	540,390.60	
WYNN RESORTS LTD	4,721	163.71	772,874.91	
YUM BRANDS INC	25,688	70.57	1,812,802.16	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	15.08	159,863.08	
CBS CORP-CL B	32,693	58.74	1,920,386.82	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,616	128.06	463,064.96	
COMCAST CORP-CL A	122,116	48.14	5,878,664.24	
COMCAST CORP-SPECIAL A	28,888	47.05	1,359,180.40	
DIRECTV	30,319	63.89	1,937,080.91	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	8,670	85.36	740,071.20	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	5,403	79.05	427,107.15	
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,632	48.25	609,494.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	25,027	16.94	423,957.38	

LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,715	80.45	942,471.75	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	8,926	76.13	679,536.38	
LIBERTY MEDIA CORP	5,334	149.44	797,112.96	
NEWS CORP-CLASS A	22,802	17.60	401,315.20	
OMNICOM GROUP	15,107	70.40	1,063,532.80	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,954	76.51	379,030.54	
SIRIUS XM RADIO INC	186,426	3.66	682,319.16	
THE WALT DISNEY CO	98,135	68.58	6,730,098.30	
TIME WARNER CABLE-A	16,629	121.08	2,013,439.32	
TIME WARNER INC	53,403	67.65	3,612,712.95	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	86,795	33.84	2,937,142.80	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	24,935	33.61	838,065.35	
VIACOM INC-CLASS B	24,798	82.28	2,040,379.44	
ADVANCE AUTO PARTS	4,262	96.96	413,243.52	
AMAZON.COM	20,893	350.31	7,319,026.83	
AUTOZONE INC	2,124	448.55	952,720.20	
BED BATH & BEYOND INC	12,855	75.77	974,023.35	
BEST BUY COMPANY INC	16,090	42.41	682,376.90	
CARMAX INC	13,119	47.56	623,939.64	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,200	54.11	335,482.00	
DOLLAR GENERAL CORP	17,686	57.28	1,013,054.08	
DOLLAR TREE INC	13,077	58.66	767,096.82	
EXPEDIA INC	6,277	59.88	375,866.76	
FAMILY DOLLAR STORES	6,337	67.50	427,747.50	
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,944	55.48	385,253.12	
GAP	17,669	41.43	732,026.67	
GENUINE PARTS CO	8,773	80.69	707,893.37	
HOME DEPOT	83,781	75.48	6,323,789.88	
KOHL'S CORP	12,322	57.03	702,723.66	
L BRANDS INC	13,954	62.93	878,125.22	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	29,256	27.43	802,492.08	
LKQ CORP	17,445	31.19	544,109.55	
LOWES COMPANIES	62,328	48.72	3,036,620.16	
MACY'S INC	22,416	46.18	1,035,170.88	
NETFLIX INC	2,872	334.90	961,832.80	
NORDSTROM INC	9,415	61.02	574,503.30	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,454	123.52	797,198.08	
PETSMART INC	5,734	72.54	415,944.36	

PRICELINE.COM INC	2,953	1,073.20	3,169,159.60	
ROSS STORES INC	12,841	78.09	1,002,753.69	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,537	56.72	143,898.64	
STAPLES INC	37,503	15.73	589,922.19	
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,860	65.11	2,269,734.60	
TIFFANY & CO	7,453	79.65	593,631.45	
TJX COMPANIES INC	41,175	61.72	2,541,321.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,154	71.37	581,950.98	
TRIPADVISOR INC	6,995	84.48	590,937.60	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,534	127.89	451,963.26	
URBAN OUTFITTERS INC	7,459	39.48	294,481.32	
COSTCO WHOLESALE CORP	24,958	122.78	3,064,343.24	
CVS CAREMARK CORPORATION	70,107	63.78	4,471,424.46	
KROGER CO	28,763	41.96	1,206,895.48	
SAFEWAY INC	13,559	33.02	447,718.18	
SYSCO CORP	33,754	33.13	1,118,270.02	
WALGREEN CO	51,489	59.70	3,073,893.30	
WAL-MART STORES	94,274	77.96	7,349,601.04	
WHOLE FOODS MKT INC	20,500	58.57	1,200,685.00	
ALTRIA GROUP INC	115,004	37.55	4,318,400.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	37,569	41.44	1,556,859.36	
BEAM INC	8,162	68.12	555,995.44	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,903	74.21	512,271.63	
BUNGE LIMITED	8,562	80.92	692,837.04	
CAMPBELL SOUP CO (US)	11,922	41.93	499,889.46	
COCA-COLA CO	229,796	40.05	9,203,329.80	
COCA-COLA ENTERPRISES	14,695	41.32	607,197.40	
CONAGRA	24,266	32.64	792,042.24	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,671	66.76	645,635.96	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,655	47.91	558,391.05	
GENERAL MILLS INC	36,796	50.54	1,859,669.84	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	7,383	59.74	441,060.42	
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,788	97.55	857,269.40	
HORMEL FOODS CORP	8,128	43.20	351,129.60	
JM SMUCKER CO	6,389	108.61	693,909.29	
KELLOGG CO	14,988	62.19	932,103.72	
KRAFT FOODS GROUP INC	33,934	52.73	1,789,339.82	
LORILLARD INC	21,475	51.46	1,105,103.50	

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,714	69.10	463,937.40	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	11,495	80.48	925,117.60	
MOLSON COORS BREWING CO -B	8,767	53.79	471,576.93	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	96,992	32.68	3,169,698.56	
MONSTER BEVERAGE CORP	8,382	55.16	462,351.12	
PEPSICO INC	88,633	85.85	7,609,143.05	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	93,753	89.41	8,382,455.73	
REYNOLDS AMERICAN INC	18,639	51.29	955,994.31	
TYSON FOODS INC	16,582	28.00	464,296.00	
AVON PRODUCTS INC	24,395	17.46	425,936.70	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,773	64.19	498,948.87	
CLOROX COMPANY	7,719	89.88	693,783.72	
COLGATE-PALMOLIVE CO	53,526	64.83	3,470,090.58	
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,469	101.58	352,381.02	
ESTEE LAUDER CO-CL A	13,568	70.96	962,785.28	
HERBALIFE LTD	5,219	62.40	325,665.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,977	108.03	2,374,175.31	
PROCTER & GAMBLE CO	157,176	82.51	12,968,591.76	
ABBOTT LABORATORIES	89,196	38.12	3,400,151.52	
AETNA INC	21,544	63.35	1,364,812.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,097	68.00	890,596.00	
BARD C R INC	4,451	137.62	612,546.62	
BAXTER INTERNATIONAL	31,032	65.13	2,021,114.16	
BECTON DICKINSON & CO	11,052	107.71	1,190,410.92	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	76,553	11.88	909,449.64	
CARDINAL HEALTH	19,433	62.30	1,210,675.90	
CAREFUSION CORP	13,118	37.65	493,892.70	
CERNER CORP	17,575	57.04	1,002,478.00	
CIGNA CORP	16,238	80.68	1,310,081.84	
COVIDIEN PLC	26,844	63.84	1,713,720.96	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,682	56.30	601,396.60	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,997	47.81	382,336.57	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,351	64.26	408,115.26	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	46,894	64.20	3,010,594.80	
HCA HOLDINGS INC	15,475	45.13	698,386.75	
HENRY SCHEIN INC	5,073	111.15	563,863.95	
HOLOGIC INC	14,997	22.04	330,533.88	
HUMANA INC	8,928	95.19	849,856.32	

INTUITIVE SURGICAL INC	2,277	389.83	887,642.91	
LABORATORY CRP OF AMER	5,326	104.97	559,070.22	
MCKESSON CORP	12,940	158.56	2,051,766.40	
MEDTRONIC	58,135	58.03	3,373,574.05	
OMNICARE INC	5,836	56.55	330,025.80	
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	43.25	200,334.00	
QUEST DIAGNOSTICS	9,200	63.32	582,544.00	
RESMED INC	7,971	50.61	403,412.31	
ST JUDE MEDICAL INC	16,086	56.99	916,741.14	
STRYKER CORP	17,222	73.33	1,262,889.26	
UNITEDHEALTH GROUP INC	58,392	70.50	4,116,636.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,312	73.39	463,237.68	
WELLPOINT INC	17,487	87.28	1,526,265.36	
ZIMMER HOLDINGS INC	9,546	88.59	845,680.14	
ABBVIE INC	90,690	48.03	4,355,840.70	
ACTAVIS PLC	9,198	156.73	1,441,602.54	
AGILENT TECHNOLOGIES	19,575	50.78	994,018.50	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,119	117.43	1,305,704.17	
ALLERGAN INC	16,902	89.95	1,520,334.90	
AMGEN	42,957	113.21	4,863,161.97	
BIOGEN IDEC INC	13,584	236.69	3,215,196.96	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,093	61.48	497,557.64	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	94,064	52.35	4,924,250.40	
CELGENE CORP	23,875	148.92	3,555,465.00	
FOREST LABORATORIES INC	14,275	48.00	685,200.00	
GILEAD SCIENCES INC	87,400	67.37	5,888,138.00	
HOSPIRA INC	9,252	38.89	359,810.28	
ILLUMINA INC	7,029	96.05	675,135.45	
JOHNSON & JOHNSON	161,102	94.05	15,151,643.10	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	10,149	75.59	767,162.91	
LILLY (ELI) & CO	58,152	50.63	2,944,235.76	
MERCK & CO	173,089	46.80	8,100,565.20	
MYLAN INC	21,607	40.41	873,138.87	
PERRIGO CO	5,318	148.75	791,052.50	
PFIZER	376,450	31.32	11,790,414.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,370	283.07	1,237,015.90	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,496	98.17	2,012,092.32	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,996	61.06	793,535.76	

WATERS CORP	4,818	100.12	482,378.16	
ZOETIS INC	28,383	31.59	896,618.97	
BB&T CORP	39,980	33.63	1,344,527.40	
CIT GROUP INC	11,131	47.75	531,505.25	
COMERICA INC	10,866	45.20	491,143.20	
FIFTH THIRD BANCORP	49,666	20.01	993,816.66	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,082	50.99	259,131.18	
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.18	254,166.66	
KEY CORP	52,029	13.02	677,417.58	
M & T BANK CORP	6,760	113.87	769,761.20	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	24,669	16.30	402,104.70	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	14.61	267,216.90	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,251	75.52	2,284,555.52	
REGIONS FINL CORP	80,046	9.78	782,849.88	
SUNTRUST BANKS	30,701	35.72	1,096,639.72	
US BANCORP	105,889	38.08	4,032,253.12	
WELLS FARGO & CO	288,544	42.71	12,323,714.24	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,977	202.51	602,872.27	
AMERICAN EXPRESS	56,626	81.78	4,630,874.28	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,464	103.12	1,182,167.68	
BANK NEW YORK CO	66,294	33.15	2,197,646.10	
BANK OF AMERICA CORP	618,014	14.32	8,849,960.48	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	61,440	115.88	7,119,667.20	
BLACKROCK INC	7,713	301.59	2,326,163.67	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,383	69.59	2,323,122.97	
CITIGROUP	174,440	49.94	8,711,533.60	
CME GROUP INC	18,072	77.81	1,406,182.32	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,948	52.26	1,460,562.48	
EATON VANCE CORP	6,650	42.14	280,231.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,608	52.27	1,233,990.16	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,937	163.17	4,068,970.29	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,125	204.20	842,325.00	
INVESCO LTD	26,264	33.32	875,116.48	
JPMORGAN CHASE & CO	216,737	53.96	11,695,128.52	
LEGG MASON INC	6,202	39.55	245,289.10	
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,488	28.88	533,933.44	
MCGRAW-HILL FINANCIAL	15,160	71.42	1,082,727.20	
MOODY'S CORP	11,371	73.07	830,878.97	

MORGAN STANLEY	84,026	29.44	2,473,725.44	
NASDAQ OMX GROUP	6,376	35.93	229,089.68	
NORTHERN TRUST CORP	12,864	58.40	751,257.60	
NYSE EURONEXT	14,159	46.03	651,738.77	
PRICE T ROWE GROUP INC	14,750	78.80	1,162,300.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,476	46.26	345,839.76	
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,066	24.02	1,610,925.32	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,731	33.48	292,313.88	
SLM CORP	25,101	25.10	630,035.10	
STATE STREET CORP	26,028	71.86	1,870,372.08	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,812	28.33	362,963.96	
ACE LTD	19,418	98.28	1,908,401.04	
AFLAC	26,605	65.75	1,749,278.75	
ALLEGHANY CORP	1,001	395.60	395,995.60	
ALLSTATE CORP	27,284	54.12	1,476,610.08	
AMERICAN INT'L GROUP	80,300	48.54	3,897,762.00	
AON PLC	16,724	80.60	1,347,954.40	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,748	58.47	453,025.56	
ASSURANT INC	4,482	59.84	268,202.88	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	48.50	288,138.50	
CHUBB CORPORATION	14,765	94.32	1,392,634.80	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,700	50.57	439,959.00	
EVEREST RE GROUP LTD	2,801	156.42	438,132.42	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	27.14	352,087.22	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,705	34.30	847,381.50	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,180	48.76	740,176.80	
LOEWS CORP	19,248	48.57	934,875.36	
MARSH & MCLENNAN COS	31,374	46.14	1,447,596.36	
METLIFE INC	53,211	50.14	2,667,999.54	
PARTNERRE LTD	3,128	100.37	313,957.36	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,623	48.44	805,218.12	
PROGRESSIVE CORP	32,460	26.58	862,786.80	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,506	86.90	2,303,371.40	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,591	95.25	246,792.75	
TORCHMARK CORP	5,579	73.90	412,288.10	
TRAVELERS COS INC/THE	21,914	87.80	1,924,049.20	
UNUM GROUP	15,540	33.16	515,306.40	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,629	44.71	430,512.59	

WR BERKLEY CORP	6,732	43.29	291,428.28	
XL GROUP PLC	16,306	31.25	509,562.50	
CBRE GROUP INC-A	16,741	22.32	373,659.12	
REALOGY HOLDINGS CORP	8,488	43.12	366,002.56	
WEYERHAEUSER CO	33,573	29.30	983,688.90	
ACCENTURE PLC-CL A	37,220	75.24	2,800,432.80	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,101	17.07	428,474.07	
ADOBE SYSTEMS INC	27,213	54.84	1,492,360.92	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	9,990	45.27	452,247.30	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,864	242.86	695,551.04	
ANSYS INC	5,240	84.40	442,256.00	
AUTODESK INC	12,636	42.74	540,062.64	
AUTOMATIC DATA PROCESS	27,749	76.01	2,109,201.49	
CA INC	18,491	31.93	590,417.63	
CITRIX SYSTEMS INC	11,103	59.77	663,626.31	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,215	90.23	1,553,309.45	
COMPUTER SCIENCES CORP	9,142	51.03	466,516.26	
EBAY	66,925	53.00	3,547,025.00	
ELECTRONIC ARTS INC	17,619	25.70	452,808.30	
EQUINIX INC	2,777	155.94	433,045.38	
FACEBOOK INC-A	95,322	47.56	4,533,514.32	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,630	48.32	803,561.60	
FISERV INC	7,557	105.62	798,170.34	
GOOGLE INC-CL A	15,571	1,016.03	15,820,603.13	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60,476	179.99	10,885,075.24	
INTUIT INC	16,066	72.48	1,164,463.68	
LEIDOS HOLDINGS	3,963	47.42	187,925.46	
LINKEDIN CORP - A	5,331	215.17	1,147,071.27	
MASTERCARD INC-CLASS A	6,030	734.47	4,428,854.10	
MICROSOFT CORP	455,633	37.78	17,213,814.74	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,487	15.58	241,287.46	
ORACLE CORP	216,259	34.35	7,428,496.65	
PAYCHEX INC	18,584	42.21	784,430.64	
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	48.54	334,926.00	
RED HAT INC	11,038	43.32	478,166.16	
SALESFORCE.COM INC	32,628	55.49	1,810,527.72	
SYMANTEC CORP	41,051	23.16	950,741.16	

SYNOPSYS INC	9,382	36.31	340,660.42	
TERADATA CORP	9,513	43.50	413,815.50	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	30.18	281,669.94	
VERISIGN INC	8,776	54.15	475,220.40	
VISA INC-CLASS A SHARES	29,715	198.29	5,892,187.35	
VMWARE INC-CLASS A	4,666	79.28	369,920.48	
WESTERN UNION CO	31,488	17.21	541,908.48	
YAHOO	56,726	33.12	1,878,765.12	
AMPHENOL CORPORATION	9,512	81.34	773,706.08	
APPLE INC	53,922	520.60	28,071,793.20	
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	51.20	296,960.00	
AVNET INC	7,613	40.30	306,803.90	
CISCO SYSTEMS	306,670	23.51	7,209,811.70	
CORNING	84,182	16.58	1,395,737.56	
EMC CORP	120,301	23.95	2,881,208.95	
F5 NETWORKS INC	4,405	82.02	361,298.10	
FLEXTRONICS INTL LTD	36,425	7.70	280,472.50	
FLIR SYSTEMS INC	8,635	29.06	250,933.10	
HARRIS CORP	6,127	63.62	389,799.74	
HEWLETT-PACKARD CO	111,293	25.94	2,886,940.42	
JUNIPER NETWORKS INC	30,344	19.27	584,728.88	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,889	63.12	876,673.68	
NETAPP INC	20,453	39.91	816,279.23	
QUALCOMM	99,144	67.45	6,687,262.80	
SANDISK CORP	13,836	68.05	941,539.80	
SEAGATE TECHNOLOGY	18,340	48.18	883,621.20	
TE CONNECTIVITY LTD	23,683	52.22	1,236,726.26	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,353	31.84	456,999.52	
WESTERN DIGITAL CORP	12,086	71.67	866,203.62	
XEROX CORP	69,252	10.30	713,295.60	
AT&T INC	311,369	35.17	10,950,847.73	
CENTURYLINK INC	35,759	31.33	1,120,329.47	
CROWN CASTLE INTL CORP	17,584	74.54	1,310,711.36	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	63,307	4.70	297,542.90	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,275	91.60	666,390.00	
SPRINT CORP	55,972	7.07	395,722.04	
T-MOBILE US INC	8,460	27.68	234,172.80	
VERIZON COMMUNICATIONS	165,534	50.20	8,309,806.80	

WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	8.03	266,194.50	
AES CORP	36,943	14.21	524,960.03	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,173	52.87	326,366.51	
AMEREN CORPORATION	13,296	36.41	484,107.36	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,681	46.25	1,280,246.25	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,567	42.75	451,739.25	
CALPINE CORP	20,101	19.61	394,180.61	
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	24.82	559,790.28	
CMS ENERGY CORP	14,951	27.28	407,863.28	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,637	57.27	952,800.99	
DOMINION RESOURCES	32,998	65.41	2,158,399.18	
DTE ENERGY COMPANY	10,127	69.34	702,206.18	
DUKE ENERGY CORP	40,364	72.43	2,923,564.52	
EDISON INTL	17,558	49.05	861,219.90	
ENTERGY CORP	10,608	64.42	683,367.36	
EXELON CORP	49,826	28.34	1,412,068.84	
FIRSTENERGY CORP	23,734	38.84	921,828.56	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,934	56.64	279,461.76	
MDU RESOURCES GROUP INC	10,444	30.16	314,991.04	
NEXTERA ENERGY INC	24,253	87.12	2,112,921.36	
NISOURCE INC	18,279	31.32	572,498.28	
NORTHEAST UTILITIES	17,823	42.27	753,378.21	
NRG ENERGY INC	17,935	28.32	507,919.20	
OGE ENERGY CORP	11,103	37.79	419,582.37	
ONEOK INC	11,649	57.90	674,477.10	
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	19.19	275,837.06	
PG&E CORP	25,136	41.77	1,049,930.72	
PINNACLE WEST CAPITAL	6,136	55.73	341,959.28	
PPL CORPORATION	34,717	30.51	1,059,215.67	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	28,743	33.51	963,177.93	
SCANA CORP	7,835	46.90	367,461.50	
SEMPRA ENERGY	13,169	89.63	1,180,337.47	
SOUTHERN CO	49,715	41.21	2,048,755.15	
WISCONSIN ENERGY CORP	13,316	41.71	555,410.36	
XCEL ENERGY INC	29,084	28.52	829,475.68	
ALTERA CORPORATION	18,638	33.39	622,322.82	
ANALOG DEVICES	17,941	49.80	893,461.80	
APPLIED MATERIALS	68,477	17.75	1,215,466.75	

	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	13,930	44.37	618,074.10	
	BROADCOM CORP-CL A	30,854	26.50	817,631.00	
	CREE INC	6,609	56.48	373,276.32	
	INTEL CORP	285,248	24.09	6,871,624.32	
	KLA-TENCOR CORP	9,658	64.80	625,838.40	
	LAM RESEARCH CORP	9,670	52.85	511,059.50	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	13,144	40.97	538,509.68	
	LSI CORP	31,994	8.25	263,950.50	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	23,144	13.35	308,972.40	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,389	28.87	473,150.43	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,067	42.89	474,663.63	
	MICRON TECHNOLOGY	59,971	18.11	1,086,074.81	
	NVIDIA CORP	33,645	15.56	523,516.20	
	TEXAS INSTRUMENTS	63,487	41.98	2,665,184.26	
	XILINX INC	15,362	44.63	685,606.06	
	アメリカドル小計	17,325,610		932,227,914.38 (92,262,596,686)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	38.98	269,819.56	
	ARC RESOURCES LTD	18,664	29.67	553,760.88	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	6.54	131,153.16	
	BAYTEX ENERGY CORP	7,544	41.90	316,093.60	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,435	12.14	126,680.90	
	CAMECO CORP	23,549	20.03	471,686.47	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	62,279	33.03	2,057,075.37	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,862	20.54	592,825.48	
	CENOVUS ENERGY INC	41,686	30.44	1,268,921.84	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,215	40.23	893,709.45	
	ENBRIDGE	45,292	45.84	2,076,185.28	
	ENCANA CORP	43,667	19.21	838,843.07	
	ENERPLUS CORP	10,454	18.09	189,112.86	
	HUSKY ENERGY INC	20,481	30.58	626,308.98	
	IMPERIAL OIL	15,870	44.74	710,023.80	
	KEYERA CORP	4,636	59.59	276,259.24	
	MEG ENERGY CORP	8,375	31.33	262,388.75	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,856	19.53	348,727.68	
	PEMBINA PIPELINE CORP	17,567	34.29	602,372.43	
	PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	6.58	207,105.50	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	29,712	9.09	270,082.08	

PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,413	31.02	260,971.26	
SUNCOR ENERGY	84,855	36.87	3,128,603.85	
TALISMAN ENERGY INC	61,047	12.42	758,203.74	
TOURMALINE OIL CORP	8,740	39.03	341,122.20	
TRANSCANADA CORP	41,160	47.23	1,943,986.80	
VERMILION ENERGY INC	6,014	59.47	357,652.58	
AGNICO EAGLE MINES	10,066	30.68	308,824.88	
AGRIUM INC	8,401	94.28	792,046.28	
BARRICK GOLD CORP	55,121	19.07	1,051,157.47	
ELDORADO GOLD CORP	43,374	6.75	292,774.50	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,423	19.36	647,069.28	
FRANCO-NEVADA CORP	8,570	46.23	396,191.10	
GOLDCORP INC	47,438	25.71	1,219,630.98	
KINROSS GOLD CORP	67,919	5.14	349,103.66	
NEW GOLD INC	29,614	5.88	174,130.32	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	48,564	34.15	1,658,460.60	
SILVER WHEATON CORP	20,718	22.62	468,641.16	
TECK RESOURCES LTD-CL B	31,778	28.37	901,541.86	
YAMANA GOLD INC	43,938	9.78	429,713.64	
BOMBARDIER B	85,798	4.68	401,534.64	
CAE INC	16,121	12.12	195,386.52	
FINNING INTERNATIONAL INC	10,988	23.63	259,646.44	
SNC-LAVALIN GROUP INC	7,496	46.99	352,237.04	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,790	116.90	2,781,051.00	
CP RAILWAY LIMITED	9,680	152.03	1,471,650.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC	12,795	88.43	1,131,461.85	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,836	50.55	345,559.80	
TIM HORTONS INC	9,165	62.50	572,812.50	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,741	24.75	562,839.75	
THOMSON REUTERS CORP	20,240	40.08	811,219.20	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,643	97.15	451,067.45	
DOLLARAMA INC	4,200	88.42	371,364.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,961	71.85	571,997.85	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	80.01	167,380.92	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,078	47.62	337,054.36	
METRO INC	5,624	66.37	373,264.88	
SHOPPERS DRUG MART CORP	10,732	61.00	654,652.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,224	85.12	274,426.88	

	SAPUTO INC	7,636	49.71	379,585.56	
	CATAMARAN CORPORATION	12,239	49.99	611,827.61	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	17,854	110.37	1,970,545.98	
	BANK MONTREAL	36,731	72.76	2,672,547.56	
	BANK NOVA SCOTIA	68,765	64.24	4,417,463.60	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	23,276	89.10	2,073,891.60	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,362	91.57	857,278.34	
	ROYAL BANK OF CANADA	83,089	70.31	5,841,987.59	
	TORONTO-DOMINION BANK	53,086	96.61	5,128,638.46	
	CI FINANCIAL CORP	9,764	35.03	342,032.92	
	IGM FINANCIAL INC	5,864	51.38	301,292.32	
	ONEX CORP	5,304	56.87	301,638.48	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,992	32.68	555,298.56	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	48.42	297,637.74	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,762	67.23	521,839.26	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	106,714	19.72	2,104,400.08	
	POWER CORP OF CANADA	20,816	31.42	654,038.72	
	POWER FINANCIAL CORP	14,791	35.05	518,424.55	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	34,735	36.95	1,283,458.25	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	32,268	40.92	1,320,406.56	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	16,031	19.79	317,253.49	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	17.11	94,686.74	
	CGI GROUP INC - CL A	12,038	35.69	429,636.22	
	OPEN TEXT CORP	3,673	87.66	321,975.18	
	BCE INC	15,348	46.36	711,533.28	
	BELL ALIANT INC	5,225	26.34	137,626.50	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,190	47.07	997,413.30	
	TELUS CORP	16,454	36.90	607,152.60	
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	47.84	191,360.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	37.35	215,285.40	
	FORTIS INC	11,903	31.88	379,467.64	
	TRANSALTA CORP	15,621	14.03	219,162.63	
	カナダドル小計	2,123,928		77,432,356.74 (7,313,486,094)	
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	18.51	157,131.39	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	61,040	14.35	875,924.00	

SANTOS	57,269	14.87	851,590.03
WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	1.51	50,161.65
WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,373	39.24	1,505,756.52
WORLEYPARSONS LTD	10,573	21.55	227,848.15
ALUMINA LIMITED	163,150	1.00	163,965.75
AMCOR	71,875	10.80	776,250.00
BHP BILLITON LTD	183,558	37.95	6,966,026.10
BORAL LIMITED	48,581	4.79	232,702.99
FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,738	5.46	489,969.48
ILUKA RESOURCES LTD	26,815	10.03	268,954.45
INCITEC PIVOT LTD	102,417	2.63	269,356.71
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,623	10.75	243,197.25
NEWCREST MINING LIMITED	45,621	9.88	450,735.48
ORICA LTD	21,846	19.54	426,870.84
RIO TINTO LTD	25,369	65.25	1,655,327.25
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,493	17.14	162,710.02
ALS LTD	21,808	9.71	211,755.68
BRAMBLES LTD	86,320	9.33	805,365.60
SEEK LTD	19,117	12.80	244,697.60
ASCIANO GROUP	51,076	5.80	296,240.80
AURIZON HOLDINGS LTD	116,346	4.70	546,826.20
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.25	96,436.25
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.67	236,478.69
TRANSURBAN GROUP	84,248	7.07	595,633.36
CROWN RESORTS LTD	21,269	16.67	354,554.23
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	47,591	2.45	116,597.95
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	50.10	163,476.30
TABCORP HOLDINGS	45,765	3.50	160,177.50
TATTS GROUP LTD	87,285	3.17	276,693.45
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.28	101,063.36
METCASH LTD	55,380	3.31	183,307.80
WESFARMERS LIMITED	57,088	43.50	2,483,328.00
WOOLWORTHS LTD	70,653	34.76	2,455,898.28
COCA-COLA AMATIL LIMITED	34,047	11.99	408,223.53
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.76	183,507.52
COCHLEAR LIMITED	3,583	56.56	202,654.48
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,612	38.67	294,356.04
SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	16.18	350,264.64

	CSL LIMITED	28,631	67.75	1,939,750.25	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	156,599	32.71	5,122,353.29	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,405	10.92	277,422.60	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	92,135	79.10	7,287,878.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	133,675	34.78	4,649,216.50	
	WESTPAC BANKING	177,293	33.18	5,882,581.74	
	ASX LTD	10,432	36.74	383,271.68	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	16,984	54.56	926,647.04	
	AMP LTD	174,549	4.65	811,652.85	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	123,836	6.13	759,114.68	
	QBE INSURANCE GROUP	66,852	14.95	999,437.40	
	SUNCORP GROUP LIMITED	71,639	13.35	956,380.65	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,469	10.63	302,625.47	
	TELSTRA CORP	253,545	5.18	1,313,363.10	
	AGL ENERGY LTD	32,770	15.35	503,019.50	
	SP AUSNET	87,439	1.24	108,861.55	
	オーストラリアドル小計	3,522,512		58,765,592.12 (5,456,972,884)	
イギリス ボンド	AMEC PLC	17,698	11.91	210,783.18	
	BG GROUP	194,288	12.66	2,460,657.52	
	BP PLC	1,086,832	4.77	5,191,253.04	
	PETROFAC LTD	15,103	14.45	218,238.35	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	217,354	20.55	4,466,624.70	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	146,284	21.39	3,129,014.76	
	TULLOW OIL PLC	50,757	9.01	457,320.57	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,139	14.92	1,166,224.57	
	ANTOFAGASTA PLC	22,958	8.36	192,043.67	
	BHP BILLITTON PLC	119,961	19.70	2,363,231.70	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,905	22.75	179,838.75	
	FRESNILLO PLC	11,483	9.60	110,294.21	
	GLENCORE XSTRATA PLC	600,738	3.31	1,990,244.99	
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,206	30.20	368,621.20	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,212	47.35	246,788.20	
	REXAM	46,082	5.25	242,160.91	
	RIO TINTO PLC REG	72,004	33.19	2,389,812.76	
	VEDANTA RESOURCES PLC	6,684	10.36	69,246.24	
	BAE SYSTEMS PLC	188,528	4.57	861,572.96	
BUNZL PLC	19,364	14.14	273,806.96		

COBHAM PLC	67,822	2.84	192,885.76	
IMI PLC	19,153	15.05	288,252.65	
INVENSYS PLC	37,986	4.99	189,550.14	
MEGGITT PLC	45,930	5.16	236,998.80	
MELROSE INDUSTRIES PLC	77,063	3.17	244,289.71	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	106,464	12.10	1,288,214.40	
SMITHS GROUP PLC	23,431	14.36	336,469.16	
TRAVIS PERKINS PLC	14,589	17.44	254,432.16	
WEIR GROUP PLC/THE	12,658	22.05	279,108.90	
WOLSELEY LTD	15,121	33.28	503,226.88	
AGGREKO PLC	15,998	15.67	250,688.66	
BABCOCK INTL GROUP PLC	21,079	12.97	273,394.63	
CAPITA GROUP PLC	39,034	9.75	380,581.50	
EXPERIAN PLC	55,666	11.83	658,528.78	
G4S PLC	88,705	2.59	229,834.65	
INTERTEK GROUP PLC	9,579	31.85	305,091.15	
SERCO GROUP PLC	29,062	5.38	156,353.56	
EASYJET PLC	9,444	12.25	115,689.00	
NEW GKN	97,251	3.68	358,564.43	
BURBERRY GROUP PLC	26,334	15.02	395,536.68	
PERSIMMON PLC	18,044	11.97	215,986.68	
CARNIVAL PLC	10,686	23.14	247,274.04	
COMPASS GROUP PLC	105,961	9.07	961,066.27	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,984	18.01	287,871.84	
TUI TRAVEL PLC	20,444	3.82	78,136.96	
WHITBREAD PLC	10,679	34.22	365,435.38	
WILLIAM HILL	51,392	3.85	198,064.76	
BRITISH SKY BROADCASTING	60,347	9.30	561,227.10	
ITV PLC	221,382	1.90	421,732.71	
PEARSON	44,692	13.03	582,336.76	
REED ELSEVIER PLC	66,114	8.84	584,778.33	
WPP PLC	76,682	13.67	1,048,242.94	
KINGFISHER PLC	131,309	3.80	498,974.20	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	96,106	5.00	480,530.00	
NEXT PLC	8,404	55.05	462,640.20	
MORRISON SUPERMARKETS	131,478	2.78	366,034.75	
SAINSBURY (J) PLC	71,870	3.95	283,886.50	
TESCO	460,108	3.66	1,684,225.33	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,220	22.60	479,572.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	109,703	34.26	3,758,424.78	
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	17.92	201,815.04	
DIAGEO	143,412	19.98	2,865,371.76	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	55,336	23.74	1,313,676.64	
SABMILLER PLC	54,773	31.94	1,749,449.62	
TATE & LYLE	27,775	8.04	223,311.00	
UNILEVER PLC	73,127	24.64	1,801,849.28	
RECKITT BENCKISER PLC	36,846	48.15	1,774,134.90	
SMITH & NEPHEW PLC	53,914	8.01	432,120.71	
ASTRAZENECA	71,451	32.78	2,342,163.78	
GLAXOSMITHKLINE	281,883	16.48	4,645,431.84	
SHIRE PLC	32,255	27.96	901,849.80	
BARCLAYS	883,762	2.55	2,256,244.38	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,081,581	6.95	7,521,314.27	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,672,574	0.75	2,008,706.61	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	126,708	3.22	408,633.30	
STANDARD CHARTERED PLC	139,946	14.83	2,076,098.91	
3I GROUP PLC	57,274	3.79	217,183.00	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,623	4.22	234,840.30	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,852	11.65	149,725.80	
ICAP PLC	32,393	3.75	121,765.28	
INVESTEC PLC	34,476	4.23	146,040.33	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	9,458	16.08	152,084.64	
SCHRODERS PLC	6,124	24.38	149,303.12	
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	12.77	147,225.33	
AVIVA PIC	168,384	4.40	740,889.60	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,676	2.29	114,205.12	
LEGAL & GENERAL GROUP	337,802	2.10	711,411.01	
OLD MUTUAL PLC	278,237	2.00	556,474.00	
PRUDENTIAL	147,829	12.61	1,864,123.69	
RESOLUTION LTD	83,609	3.46	289,287.14	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	215,507	1.20	260,332.45	
STANDARD LIFE PLC	133,540	3.47	464,185.04	
SAGE GROUP PLC	67,266	3.44	231,731.37	
BT GROUP PLC	449,171	3.72	1,671,365.29	
INMARSAT PLC	28,187	6.77	190,825.99	
VODAFONE GROUP PLC	2,788,571	2.28	6,378,856.16	

	CENTRICA PLC	299,561	3.50	1,048,463.50	
	NATIONAL GRID PLC	210,288	7.74	1,627,629.12	
	SEVERN TRENT PLC	14,198	17.70	251,304.60	
	SSE PLC	54,421	13.95	759,172.95	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,616	6.84	277,813.44	
	ARM HOLDINGS PLC	78,854	9.41	742,016.14	
	イギリスポンド小計	16,876,605		99,112,338.62 (15,709,305,671)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	20,179	48.36	975,856.44	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	326.75	155,859.75	
	GIVAUDAN-REG	495	1,302.00	644,490.00	
	HOLCIM LTD	12,338	68.10	840,217.80	
	SIKA AG-BR	125	2,881.00	360,125.00	
	SYNGENTA AG	5,222	361.80	1,889,319.60	
	ABB LTD	124,022	23.11	2,866,148.42	
	GEBERIT AG-REG	2,260	272.40	615,624.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,379	129.60	178,718.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,895	128.70	372,586.50	
	SULZER AG-REG	1,508	141.00	212,628.00	
	ADECCO	7,891	70.15	553,553.65	
	SGS SA	296	2,080.00	615,680.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,144	112.50	353,700.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	29,490	92.35	2,723,401.50	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,695	567.50	961,912.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,730	98.05	267,676.50	
	ARYZTA AG	5,078	67.65	343,526.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,034.00	136,488.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	3,850.00	188,650.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	46,000.00	276,000.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	184,748	66.20	12,230,317.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,677	116.60	312,138.20	
	ACTELION LTD-REG	6,418	73.55	472,043.90	
	LONZA GROUP AG-REG	2,757	84.15	232,001.55	
	NOVARTIS	132,117	70.95	9,373,701.15	
ROCHE HOLDING GENUSS	40,402	251.70	10,169,183.40		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	488.00	103,944.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG	86,395	26.73	2,309,338.35		
JULIUS BAER GROUP LTD	13,195	42.47	560,391.65		

	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	70.35	132,258.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,099	228.60	251,231.40	
	UBS AG-REG	210,881	16.75	3,532,256.75	
	BALOISE HOLDING AG	2,556	107.00	273,492.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,929	179.90	347,027.10	
	SWISS RE LTD	20,763	82.75	1,718,138.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,539	249.90	2,133,896.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,464	68.55	237,457.20	
	SWISSCOM	1,396	471.40	658,074.40	
	スイスフラン小計	942,840		60,579,053.76 (6,504,978,792)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	35,500	25.95	921,225.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	124,000	94.45	11,711,800.00	
	NWS HOLDINGS LTD	101,000	12.04	1,216,040.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	14.92	850,440.00	
	MTR CORP	84,500	29.35	2,480,075.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	40.70	590,150.00	
	LI & FUNG	346,800	10.64	3,689,952.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	21.30	990,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	114,000	57.70	6,577,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	59,600	26.40	1,573,440.00	
	SANDS CHINA LTD	131,200	54.35	7,130,720.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	14.10	1,381,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	113,000	25.70	2,904,100.00	
	WYNN MACAU LTD	74,800	28.85	2,157,980.00	
	BANK EAST ASIA	76,960	33.75	2,597,400.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	220,000	24.65	5,423,000.00	
	HANG SENG BANK	45,500	126.10	5,737,550.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.84	1,131,520.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	63,000	124.00	7,812,000.00	
	AIA GROUP LTD	689,200	38.10	26,258,520.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	81,000	120.40	9,752,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	133,000	25.70	3,418,100.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,000	45.20	2,531,200.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	34.75	1,390,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	33.10	1,274,350.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	236,500	10.60	2,506,900.00	
	SINO LAND CO	183,400	10.62	1,947,708.00	

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	93,000	102.00	9,486,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	90.90	3,681,450.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	75,000	21.35	1,601,250.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	63.95	5,371,800.00	
	WHEELOCK & CO LTD	53,000	38.30	2,029,900.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	43,500	30.85	1,341,975.00	
	PCCW LTD	232,000	3.45	800,400.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	52.30	1,621,300.00	
	CLP HOLDINGS	94,500	61.70	5,830,650.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	324,967	18.02	5,855,905.34	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	81,000	62.90	5,094,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	63.95	882,510.00	
	香港ドル小計	4,557,727		159,554,660.34 (2,037,513,012)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	85,300	10.91	930,623.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.04	237,594.33	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	46,000	5.29	243,340.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	54,000	4.35	234,900.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	76,000	4.05	307,800.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.19	158,270.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.89	247,590.00	
	SINGAPORE AIRLINES	33,533	10.30	345,389.90	
	GENTING SINGAPORE PLC	363,000	1.46	529,980.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.21	391,530.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	35.65	213,900.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	1.47	127,890.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	444,000	0.57	255,300.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.38	375,180.00	
	DBS GROUP	97,000	16.88	1,637,360.00	
	OCBC BANK	143,000	10.39	1,485,770.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	70,000	20.86	1,460,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	7.25	304,500.00	
	CAPITALAND LTD	152,500	3.06	466,650.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	2.02	159,580.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	10.07	241,680.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	182,000	3.00	546,000.00	
	KEPPEL LAND LTD	40,000	3.71	148,400.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	6.36	199,068.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	459,243	3.80	1,745,123.40	
	STARHUB LTD	38,000	4.29	163,020.00	
	シンガポールドル小計	3,248,239		13,156,638.63 (1,044,505,540)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	40,789	9.63	392,798.07	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	3.60	243,536.40	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	33,590	3.87	129,993.30	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.35	253,875.20	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.16	131,595.48	
	ニュージーランドドル小計	275,563		1,151,798.45 (94,435,954)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,993	136.00	1,903,048.00	
	BOLIDEN AB	17,199	94.35	1,622,725.65	
	ALFA LAVAL AB	18,739	149.40	2,799,606.60	
	ASSA ABLOY B	18,234	327.10	5,964,341.40	
	ATLAS COPCO A	37,011	182.00	6,736,002.00	
	ATLAS COPCO B	23,243	162.20	3,770,014.60	
	SANDVIK AB	60,102	90.50	5,439,231.00	
	SCANIA AB-B SHS	19,061	130.30	2,483,648.30	
	SKANSKA B	21,892	122.80	2,688,337.60	
	SKF AB-B	23,353	176.00	4,110,128.00	
	VOLVO B	87,725	84.20	7,386,445.00	
	SECURITAS B	19,690	70.45	1,387,160.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	162.60	2,215,750.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	39.26	1,015,067.30	
	HENNES & MAURITZ B	53,480	270.50	14,466,340.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,270	214.10	2,627,007.00	
	SCA SV CELLULOSA B	31,937	187.30	5,981,800.10	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	96.75	2,041,715.25	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	203.80	2,204,708.40	
	NORDEA BANK AB	163,626	81.35	13,310,975.10	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	84,774	77.60	6,578,462.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	29,383	298.90	8,782,578.70	
	SWEDBANK AB-A	51,020	166.80	8,510,136.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	116.20	866,038.60	
INVESTOR AB-B SHS	25,163	206.80	5,203,708.40		
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,279	240.00	3,186,960.00		
RATOS AB-B SHS	12,127	57.90	702,153.30		

	ERICSSON (LM) B	176,367	79.50	14,021,176.50	
	HEXAGON AB-B SHS	14,104	197.80	2,789,771.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,975	601.50	2,390,962.50	
	TELE2 AB-B SHS	20,353	78.05	1,588,551.65	
	TELIASONERA AB	138,656	53.20	7,376,499.20	
	スウェーデンクローナ小計	1,269,612		152,151,050.45 (2,280,744,246)	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	90.80	956,033.20	
	SEADRILL LTD	21,855	281.80	6,158,739.00	
	STATOIL ASA	64,973	140.20	9,109,214.60	
	SUBSEA 7 SA	15,716	125.80	1,977,072.80	
	NORSK HYDRO	58,546	26.85	1,571,960.10	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,004	265.00	2,916,060.00	
	ORKLA	45,519	47.56	2,164,883.64	
	DNB ASA	53,015	105.00	5,566,575.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,659	111.80	1,415,276.20	
	TELENOR ASA	37,827	147.20	5,568,134.40	
	ノルウェークローネ小計	331,643		37,403,948.94 (601,455,498)	
デンマーク クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	31	50,600.00	1,568,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	75	53,700.00	4,027,500.00	
	DSV A/S	10,479	161.70	1,694,454.30	
	CARLSBERG AS-B	6,151	549.50	3,379,974.50	
	COLOPLAST-B	6,468	349.30	2,259,272.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	512.50	760,550.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	22,815	943.00	21,514,545.00	
	NOVOZYMES A/S	13,135	215.00	2,824,025.00	
	DANSKE BANK A/S	37,811	126.60	4,786,872.60	
	TRYG A/S	1,646	498.90	821,189.40	
	TDC A/S	41,126	49.53	2,036,970.78	
	デンマーククローネ小計	141,221		45,673,953.98 (809,799,204)	
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	299	1,255.00	375,245.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,519	30.43	867,833.17	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,857.00	298,977.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	47,826	131.30	6,279,553.80	
	BANK HAPOALIM BM	58,582	19.01	1,113,643.82	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.36	946,155.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	40.80	334,560.00	

	NICE SYSTEMS LTD	3,358	134.10	450,307.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.18	690,450.10	
	イスラエルシェケル小計	329,398		11,356,725.89 (317,306,921)	
ユーロ	CGG	10,161	15.78	160,391.38	
	ENI	143,603	17.97	2,580,545.91	
	FUGRO NV-CVA	4,431	45.57	201,920.67	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.31	258,891.61	
	NESTE OIL OYJ	8,623	15.36	132,449.28	
	OMV AG	8,574	36.11	309,650.01	
	REPSOL SA	49,929	18.88	942,659.52	
	SAIPEM	15,771	17.92	282,616.32	
	TECHNIP S.A.	6,058	77.42	469,010.36	
	TENARIS SA	24,127	17.07	411,847.89	
	TOTAL SA	122,032	43.80	5,345,001.60	
	VOPAK	4,421	42.89	189,616.69	
	AIR LIQUIDE	17,692	99.59	1,761,946.28	
	AKZO NOBEL	13,460	55.25	743,665.00	
	ARCELORMITTAL	55,626	12.83	713,959.71	
	ARKEMA	3,655	82.87	302,889.85	
	BASF SE	52,515	75.68	3,974,335.20	
	CRH	43,755	18.29	800,278.95	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,114	61.18	129,334.52	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,376	56.98	477,264.48	
	IMERYS SA	1,975	58.48	115,498.00	
	K+S AG	10,261	20.81	213,531.41	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,186	58.42	536,646.12	
	LAFARGE (FRANCE)	10,122	51.62	522,497.64	
	LANXESS	4,844	51.82	251,016.08	
	LINDE AG	10,527	141.75	1,492,202.25	
	SOLVAY SA	3,532	116.30	410,771.60	
	STORA ENSO OYJ R	31,297	7.18	224,712.46	
	THYSSEN KRUPP	22,984	19.22	441,752.48	
	UMICORE	6,637	35.37	234,783.87	
	UPM KYMMENE CORP	30,064	12.73	382,714.72	
	VOESTALPINE AG	6,910	35.91	248,138.10	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,693	24.04	233,019.72	
	ALSTOM RGPT	11,643	28.24	328,798.32	

ANDRITZ AG	3,162	47.49	150,179.19	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	34.98	154,878.59	
BOUYGUES ORD	11,148	27.70	308,799.60	
BRENTAG AG	3,068	123.05	377,517.40	
CNH INDUSTRIAL NV	50,975	8.39	427,935.12	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	32,678	53.44	1,746,312.32	
FERROVIAL SA	24,281	14.00	339,934.00	
FINMECCANICA SPA	25,448	5.10	129,912.04	
GEA GROUP AG	10,980	32.92	361,516.50	
HOCHTIEF AG	1,793	66.67	119,539.31	
KONE OYJ-B	8,398	67.05	563,085.90	
KONINKLIJKE PHILIPS	54,328	26.19	1,423,121.96	
LEGRAND SA	15,181	40.02	607,543.62	
MAN SE	2,099	89.01	186,831.99	
METSO OYJ	7,612	29.44	224,097.28	
OCI NV	5,400	29.45	159,030.00	
OSRAM LICHT AG	4,722	38.14	180,120.69	
PRYSMIAN SPA	9,810	18.68	183,250.80	
REXEL SA	12,359	18.60	229,939.19	
SAFRAN SA	14,689	47.40	696,258.60	
SAINT-GOBAIN	23,191	38.97	903,869.22	
SCHNEIDER ELECTRIC	29,962	61.72	1,849,254.64	
SIEMENS	45,347	95.62	4,336,080.14	
THALES SA	5,301	45.05	238,810.05	
VALLOUREC	6,501	42.17	274,147.17	
VINCI S.A.	26,999	46.88	1,265,713.12	
WARTSILA OYJ	10,737	33.02	354,535.74	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	12.65	129,042.65	
ZODIAC AEROSPACE	1,790	118.20	211,578.00	
BUREAU VERITAS SA	12,862	21.68	278,912.47	
EDENRED	11,350	24.64	279,664.00	
RANDSTAD HOLDING NV	6,762	46.55	314,771.10	
SOCIETE BIC SA	1,800	91.88	165,384.00	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	22,413	15.37	344,599.87	
ADP	1,728	77.93	134,663.04	
ATLANTIA SPA	19,265	16.06	309,395.90	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	14.49	176,183.91	
DEUTSCHE POST AG-REG	52,790	24.31	1,283,588.85	

FRAPORT AG	2,319	53.25	123,486.75	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	32,020	7.32	234,418.42	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	4.53	257,616.57	
TNT EXPRESS	22,191	6.57	145,794.87	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,823	81.77	1,539,156.71	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,343	63.14	211,077.02	
CONTINENTAL AG	6,552	143.65	941,194.80	
DAIMLER AG	54,961	59.47	3,268,530.67	
FIAT ORD	52,136	5.68	296,393.16	
MICHELIN	10,227	78.43	802,103.61	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	38.43	237,420.54	
PIRELLI & CO	14,958	11.05	165,285.90	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	8,558	69.76	597,006.08	
RENAULT SA	10,728	61.10	655,480.80	
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,215	192.35	1,580,155.25	
VOLKSWAGEN STAMM	1,758	184.00	323,472.00	
ADIDAS AG	12,180	86.94	1,058,929.20	
CHRISTIAN DIOR	3,142	142.40	447,420.80	
HUGO BOSS AG	1,699	96.34	163,681.66	
KERING	4,403	165.65	729,356.95	
LUXOTTICA GROUP SPA	9,878	39.50	390,181.00	
LVMH	14,332	139.40	1,997,880.80	
ACCOR	9,288	32.75	304,228.44	
OPAP SA	12,816	9.47	121,367.52	
SODEXO	5,616	73.25	411,372.00	
AXEL SPRINGER AG	2,489	43.68	108,719.52	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	23.86	201,850.17	
JC DECAUX SA	3,121	28.39	88,620.79	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	92.00	121,716.00	
LAGADERE S.C.A	6,639	26.67	177,095.32	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	6,369	33.36	212,469.84	
PUBLICIS GROUPE	9,914	64.36	638,065.04	
REED ELSEVIER NV	41,081	15.43	633,879.83	
SES	17,459	22.43	391,605.37	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	40.49	130,393.90	
WOLTERS KLUWER	17,576	20.27	356,353.40	
INDITEX	12,682	116.15	1,473,014.30	
AHOLD (KON.)	56,724	13.93	790,165.32	

CARREFOUR	35,096	26.88	943,380.48
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,282	83.18	272,996.76
COLRUYT SA	4,415	40.70	179,690.50
DELHAIZE GROUP	6,071	43.67	265,120.57
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	39,901	6.52	260,154.52
JERONIMO MARTINS	15,262	14.60	222,825.20
KESKO OYJ-B SHS	4,473	24.86	111,198.78
METRO STAMM	7,548	33.77	254,933.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV	45,478	75.90	3,451,780.20
DANONE (GROUPE)	32,451	53.72	1,743,267.72
HEINEKEN HOLDING NV	5,452	46.24	252,127.74
HEINEKEN NV	12,916	49.82	643,475.12
KERRY GROUP PLC-A	9,560	46.87	448,077.20
PERNOD-RICARD	12,357	88.60	1,094,830.20
REMY COINTREAU	1,575	71.81	113,100.75
SUEDZUCKER AG	4,926	23.15	114,036.90
UNILEVER NV-CVA	92,952	28.69	2,666,792.88
BEIERSDORF AG	6,056	73.06	442,451.36
HENKEL AG & CO KGAA	7,230	69.49	502,412.70
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	10,372	81.56	845,940.32
LOREAL	13,721	123.85	1,699,345.85
CELESIO AG	4,224	23.11	97,616.64
ESSILOR INTERNATIONAL	11,876	76.25	905,545.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	12,050	47.89	577,074.50
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,007	96.38	675,334.66
BAYER	47,297	93.80	4,436,458.60
ELAN CORPORATION PLC	31,320	12.98	406,533.60
GRIFOLS SA	9,679	30.95	299,613.44
MERCK KGAA	3,762	123.60	464,983.20
ORION OYJ-CLASS B	5,839	19.65	114,736.35
QIAGEN N.V.	13,772	16.98	233,848.56
SANOFI	68,876	78.02	5,373,705.52
UCB (GROUPE)	6,553	48.86	320,212.34
BANCO BILBAO VIZCAYA	330,542	8.45	2,793,079.90
BANCO DE SABADELL SA	146,060	1.84	269,918.88
BANCO SANTANDER SA	667,405	6.40	4,277,398.64
BNP PARIBAS	57,436	53.10	3,049,851.60

CAIXABANK	56,299	3.75	211,571.64	
COMMERZBANK AG	58,251	10.42	607,266.67	
CREDIT AGRICOLE SA	60,165	9.11	548,584.47	
ERSTE GROUP BANK AG	15,199	25.50	387,574.50	
INTESA SANPAOLO	685,455	1.75	1,205,715.34	
KBC GROEP NV	13,809	39.90	550,979.10	
NATIXIS	55,749	4.08	227,511.66	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	27.30	92,820.00	
SOCIETE GENERALE	40,360	40.77	1,645,477.20	
UNICREDIT SPA	255,991	5.39	1,381,071.44	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	4.89	265,336.29	
DEUTSCHE BANK NAMEN	58,891	34.75	2,046,462.25	
DEUTSCHE BOERSE	10,968	54.88	601,923.84	
EURAZEO	1,975	56.22	111,034.50	
EXOR SPA	5,807	28.51	165,557.57	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,858	64.39	312,806.62	
ING GROEP	221,195	9.64	2,132,319.80	
MEDIOBANCA	30,462	6.26	190,692.12	
OKO BANK-A	9,611	14.31	137,533.41	
WENDEL	1,898	101.85	193,311.30	
AEGON	106,867	6.04	645,904.14	
AGEAS	13,907	31.17	433,481.19	
ALLIANZ SE-REG	26,402	124.25	3,280,448.50	
ASSICURAZIONI GENERALI	68,843	16.81	1,157,250.83	
AXA	103,239	18.12	1,871,206.87	
CNP ASSURANCES	11,367	13.22	150,271.74	
DELTA LLOYD NV	11,075	16.25	180,024.12	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,252	61.38	199,607.76	
MAPFRE SA	55,064	2.98	164,586.29	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,334	153.95	1,590,919.30	
SAMPO OYJ-A SHS	23,388	35.25	824,427.00	
SCOR SE	9,248	25.82	238,783.36	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	38.40	86,937.60	
IMMOFINANZ AG	58,893	3.32	195,524.76	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	22,953	27.97	641,995.41	
ATOS	3,458	64.61	223,421.38	
CAP GEMINI SA	8,568	48.18	412,849.08	

DASSAULT SYSTEMES SA	3,709	86.81	321,978.29	
SAP AG	52,620	58.99	3,104,053.80	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,790	27.30	185,367.00	
GEMALTO	4,718	81.78	385,838.04	
NOKIA CORP	208,144	5.67	1,181,217.20	
BELGACOM	6,473	20.56	133,117.24	
DEUTSCHE TELEKOM	160,819	11.34	1,824,491.55	
ELISA A	9,087	18.39	167,109.93	
ILIAD SA	1,349	168.50	227,306.50	
KPN (KON.)	192,845	2.47	477,291.37	
ORANGE	108,509	9.69	1,051,669.22	
PORTUGAL TELECOM	41,591	3.27	136,335.29	
TELECOM ITALIA ORD	601,478	0.68	409,005.04	
TELECOM ITALIA RNC	378,931	0.55	208,412.05	
TELEFONICA	237,971	12.44	2,960,359.24	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	5.85	97,822.86	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	6.24	99,533.45	
VIVENDI	69,784	18.55	1,294,493.20	
ZIGGO NV	8,778	31.50	276,507.00	
ACCIONA SA	1,857	45.93	85,292.01	
E.ON SE	104,845	13.43	1,408,592.57	
ELECTRICITE DE FRANCE	13,993	25.82	361,369.22	
ENAGAS	12,304	19.56	240,727.76	
ENEL	363,213	3.24	1,178,262.97	
ENEL GREEN POWER SPA	110,043	1.79	197,197.05	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	124,604	2.69	335,932.38	
FORTUM OYJ	26,458	16.71	442,113.18	
GAS NATURAL SDG SA	21,106	18.02	380,330.12	
GDF SUEZ	74,259	18.64	1,384,559.05	
IBERDROLA SA	277,941	4.69	1,304,377.11	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,979	45.94	320,650.15	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	24.88	65,260.24	
RWE STAMM	27,529	27.00	743,283.00	
SNAM SPA	120,285	3.80	457,564.14	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,532	12.58	182,885.22	
TERNA SPA	83,672	3.67	307,745.61	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	12.43	245,579.51	
VERBUND AG	4,553	16.90	76,945.70	

	ASML HOLDING NV	20,282	65.48	1,328,065.36	
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,362	7.12	458,321.80	
	STMICROELECTRONICS	37,108	5.59	207,507.93	
	ユーロ小計	9,596,661		161,962,826.57 (21,414,724,929)	
	合計	60,541,559		155,847,825,431 (155,847,825,431)	

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	335,000.00	241,200.00	
	アメリカドル小計		335,000.00	241,200.00 (23,871,564)	
	オーストラリア ドル	APA GROUP	40,986.00	250,834.32	
		LEND LEASE GROUP	28,820.00	314,138.00	
		SYDNEY AIRPORT	13,063.00	52,643.89	
	オーストラリアドル小計		82,869.00	617,616.21 (57,351,841)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	897,000.00	
香港ドル小計		130,000.00	897,000.00 (11,454,690)		
投資信託受益証券合計				92,678,095 (92,678,095)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	23,168.00	487,686.40	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,572.00	1,755,875.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,422.00	601,458.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,977.00	850,077.68	
		BOSTON PROPERTIES	8,617.00	864,543.61	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,256.00	315,254.88	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,831.00	358,738.11	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	295,426.51	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,452.00	1,005,668.40	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,867.00	406,151.01	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	554,020.55	
		HCP INC	25,848.00	1,024,356.24	
		HEALTH CARE REIT INC	16,006.00	966,922.46	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	43,285.00	805,101.00	
		KIMCO REALTY CORP	22,989.00	482,769.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	285,972.84			

	MACERICH CO/THE	8,322.00	470,692.32	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	9,142.00	407,916.04	
	PROLOGIS INC	28,346.00	1,104,076.70	
	PUBLIC STORAGE	8,326.00	1,331,410.66	
	RAYONIER INC	7,016.00	315,439.36	
	REALTY INCOME CORP	11,551.00	462,733.06	
	REGENCY CENTERS CORP	5,612.00	271,564.68	
	SIMON PROPERTY GROUP	17,731.00	2,713,020.31	
	SL GREEN REALTY CORP	5,153.00	470,468.90	
	UDR INC	13,985.00	332,003.90	
	VENTAS INC	16,675.00	1,026,679.75	
	VORNADO REALTY TRUST	9,544.00	840,635.52	
アメリカドル小計		457,929.00	20,806,664.29 (2,059,235,564)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	157,406.15	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	232,807.65	
カナダドル小計		17,018.00	390,213.80 (36,855,693)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	256,140.04	
	DEXUS PROPERTY GROUP	289,071.00	306,415.26	
	FEDERATION CENTRES	89,917.00	223,893.33	
	GOODMAN GROUP	102,048.00	516,362.88	
	GPT GROUP	105,353.00	390,859.63	
	MIRVAC GROUP	215,406.00	380,191.59	
	STOCKLAND	131,200.00	530,048.00	
	WESTFIELD GROUP	121,352.00	1,315,455.68	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	165,924.00	502,749.72	
オーストラリアドル小計		1,347,073.00	4,422,116.13 (410,637,703)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	54,509.00	335,230.35	
	HAMMERSON PLC	38,982.00	201,926.76	
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	134,086.59	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	47,061.00	458,844.75	
	SEGRO PLC	46,969.00	151,803.80	
イギリスポンド小計		227,751.00	1,281,892.25 (203,179,921)	
香港ドル	LINK REIT	136,000.00	5,161,200.00	

香港ドル小計		136,000.00	5,161,200.00 (65,908,524)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	259,740.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	161,700.00	
	CAPITAMALL TRUST	149,000.00	298,000.00	
シンガポールドル小計		370,000.00	719,440.00 (57,116,341)	
ユーロ	CORIO NV	3,438.00	111,992.85	
	FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	105,651.43	
	GECINA SA	1,389.00	135,871.98	
	ICADE	2,102.00	146,089.00	
	KLEPIERRE	6,313.00	213,347.83	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,696.00	1,088,790.40	
ユーロ小計		20,587.00	1,801,743.49 (238,226,524)	
投資証券合計			3,071,160,270 (3,071,160,270)	
合計			3,163,838,365 (3,163,838,365)	

(注) 有価証券明細表注記

(1) 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4) 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率	
アメリカドル	株式	569銘柄	97.8%	58.0%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	28銘柄	2.2%	1.3%
カナダドル	株式	91銘柄	99.5%	4.6%
	投資証券	2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式	56銘柄	92.1%	3.4%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.0%	0.0%
	投資証券	9銘柄	6.9%	0.3%
イギリスポンド	株式	102銘柄	98.7%	9.9%
	投資証券	5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式	39銘柄	96.3%	1.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.5%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.1%	0.0%

シンガポールドル	株式	26銘柄	94.8%	0.7%
	投資証券	3銘柄	5.2%	0.0%
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	32銘柄	100.0%	1.4%
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	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	225銘柄	98.9%	13.5%
	投資証券	6銘柄	1.1%	0.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	97,757,629
投資証券	17,865,457,790
派生商品評価勘定	4,740,000
未収入金	44,682,706
未収配当金	147,704,772
未収利息	133
差入委託証拠金	13,608,000
流動資産合計	18,173,951,030
資産合計	18,173,951,030
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,281,700
前受金	2,729,300
未払金	32,762,907
未払解約金	39,462,227
流動負債合計	76,236,134
負債合計	76,236,134
純資産の部	
元本等	
元本	16,019,431,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,078,282,955
元本等合計	18,097,714,896
純資産合計	18,097,714,896
負債純資産合計	18,173,951,030

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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配当金額を計上し、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25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額	9,717,909,882円
計算期間中の追加設定元本額	12,615,371,833円
計算期間中の一部解約元本額	6,313,849,774円
計算日の元本額	16,019,431,941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)	691,134,348円
SBI資産設計オープン(分配型)	10,901,275円
SMT J-REITインデックス・オープン	5,512,143,256円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	8,579,451,071円
コア投資戦略ファンド(安定型)	518,050,859円
コア投資戦略ファンド(成長型)	645,182,395円
分散投資コア戦略ファンドA	17,740,156円
分散投資コア戦略ファンドS	44,793,847円
コア投資戦略ファンド(切替型)	34,734円

2. 計算日における受益権総数	16,019,431,941口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1297円 (11,297円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年11月11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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月11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。

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>4. 金銭債権の計算日後の償還予定額</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> <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> <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25年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	2,125,637,247	
合計	2,125,637,247	

(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24年11月13日から平成25年11月11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25年11月11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	228,606,700	-	232,065,000	3,458,300
	合計	228,606,700	-	232,065,000	3,458,300

(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又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

- 2. 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25年11月11日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在

該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25年11月11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	595	411,740,000	
	M I Dリート投資法人	473	106,377,700	
	森ヒルズリート投資法人	714	470,526,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	415	232,400,000	
	産業ファンド投資法人	403	356,252,000	
	大和ハウスリート投資法人	316	235,104,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,196	699,924,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	623	130,518,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	529	417,910,000	
	G L P投資法人	5,407	531,508,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	174	119,364,000	
	日本プロロジスリート投資法人	719	666,513,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,293	428,870,700	
	星野リゾート・リート投資法人	52	29,640,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,784	2,114,040,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,532	1,657,624,000	
	日本リテールファンド投資法人	5,950	1,162,630,000	
	オリックス不動産投資法人	4,338	523,596,600	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,127	699,783,000	
	プレミア投資法人	561	224,400,000	
	東急リアル・エステート投資法人	504	298,368,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	250	139,250,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	960	465,120,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,135	890,802,000	
森トラスト総合リート投資法人	675	581,850,000		
インヴィンシブル投資法人	3,476	46,717,440		
フロンティア不動産投資法人	639	605,772,000		
平和不動産リート投資法人	2,050	157,645,000		
日本ロジスティクスファンド投資法人	428	429,712,000		
福岡リート投資法人	356	278,036,000		

ケネディクス不動産投資法人	739	322,943,000	
積水ハウス・S I投資法人	411	199,951,500	
いちご不動産投資法人	2,405	145,983,500	
大和証券オフィス投資法人	1,020	425,340,000	
阪急リート投資法人	271	150,676,000	
スターツプロシード投資法人	374	63,879,200	
トップリート投資法人	400	175,000,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	959	390,313,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,757	305,078,550	
日本賃貸住宅投資法人	3,430	223,979,000	
ジャパンエクセレント投資法人	580	350,320,000	
投資証券 小計	67,020	17,865,457,790	
合計	67,020	17,865,457,790	

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25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	43,958,676
コール・ローン	10,048,739
投資証券	23,010,279,249

派生商品評価勘定	960
未収入金	76,182,384
未収配当金	52,932,031
未収利息	13
流動資産合計	23,193,402,052
資産合計	23,193,402,052
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	194,950
未払金	14,909,122
未払株式払込金	1,089,866
未払解約金	59,246,496
流動負債合計	75,440,434
負債合計	75,440,434
純資産の部	
元本等	
元本	20,717,981,137
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,399,980,481
元本等合計	23,117,961,618
純資産合計	23,117,961,618
負債純資産合計	23,193,402,052

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額 計算期間中の追加設定元本額 計算期間中の一部解約元本額 計算日の元本額	14,351,666,510円 9,189,659,926円 2,823,345,299円 20,717,981,137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) SBI資産設計オープン(資産成長型) SBI資産設計オープン(分配型) SMT グローバルREITインデックス・オープン グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用) コア投資戦略ファンド(安定型) コア投資戦略ファンド(成長型) 分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS コア投資戦略ファンド(切替型)	594,956,287円 693,257,056円 11,954,673円 6,183,007,530円 12,005,249,923円 519,542,005円 646,850,208円 17,976,785円 45,151,862円 34,808円
2. 計算日における受益権総数	20,717,981,137口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1158円 (11,158円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年11月11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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年11月11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。

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25年11月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	529,253,953	
合計	529,253,953	

(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24年11月13日から平成25年11月11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25年11月11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 売 建				
	アメリカドル	40,432,403	-	40,573,600	141,197
	オーストラリアドル	9,732,607	-	9,748,200	15,593
	イギリスポンド	6,322,080	-	6,339,600	17,520
	ユーロ	5,269,120	-	5,288,800	19,680
	計	61,756,210	-	61,950,200	193,990
合計		61,756,210	-	61,950,200	193,990

(注)時価の算定方法

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

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

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

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年11月11日現在	
該当事項はありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25年11月11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	17,600.00	462,176.00	
		AGREE REALTY CORP	3,700.00	117,734.00	
		ALEXANDER'S INC	650.00	199,686.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,760.00	1,385,459.20	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,803.00	345,047.82	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	32,200.00	1,078,056.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	13,000.00	210,210.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	54,500.00	685,610.00	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	3,800.00	68,362.00	
		AMREIT INC	5,000.00	85,950.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	44,750.00	1,185,875.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	5,500.00	52,195.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	21,630.00	264,751.20	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	13,200.00	192,324.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,100.00	4,520,264.00	
		AVIV REIT INC	4,300.00	107,930.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	58,350.00	1,110,400.50	
		BOSTON PROPERTIES	45,980.00	4,613,173.40	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	48,200.00	645,880.00	
		BRE PROPERTIES-CL A	23,300.00	1,257,268.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	25,580.00	1,534,288.40	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	20,800.00	207,168.00	
		CBL & ASSOCIATES PRTYS	51,450.00	936,390.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	20,000.00	108,800.00	
		CHAMBERS STREET PROPERTIES	73,600.00	640,320.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,000.00	148,050.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	14,142.00	319,892.04			
COLE REAL ESTATE INVESTMENT	128,900.00	1,737,572.00			

COMMONWEALTH REIT	33,300.00	777,888.00	
CORESITE REALTY CORP	6,040.00	188,025.20	
CORPORATE OFFICE PPTYS	25,240.00	593,644.80	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	35,850.00	1,266,580.50	
COUSINS PROPERTIES INC	54,000.00	569,700.00	
CUBESMART	39,520.00	671,049.60	
CYRUSONE INC	5,300.00	104,145.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	98,630.00	730,848.30	
DDR CORPORATION	78,150.00	1,263,685.50	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	61,710.00	694,854.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,450.00	1,807,204.50	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	38,660.00	915,468.80	
DUKE REALTY CORP	98,000.00	1,535,660.00	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	18,853.00	432,676.35	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	9,340.00	570,487.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	36,000.00	313,200.00	
EPR PROPERTIES	15,400.00	791,098.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,420.00	889,132.20	
EQUITY ONE INC	18,590.00	426,268.70	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	102,120.00	5,279,604.00	
ESSEX PROPERTY TRUST	11,590.00	1,796,334.10	
EXCEL TRUST INC	13,200.00	152,460.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	32,750.00	1,393,840.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,870.00	2,086,946.10	
FELCOR LODGING TRUST INC	32,000.00	214,400.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	31,470.00	548,836.80	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	15,917.00	179,384.59	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,530.00	350,461.30	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	166,730.00	3,412,963.10	
GEO GROUP INC/THE	22,040.00	738,119.60	
GETTY REALTY CORP	8,118.00	148,397.04	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,800.00	90,384.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	42,106.00	409,270.32	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	15,300.00	369,036.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	12,000.00	56,400.00	
GYRODYNE CO OF AMERICA INC	216.00	16,126.56	
HCP INC	136,950.00	5,427,328.50	
HEALTH CARE REIT INC	86,280.00	5,212,174.80	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	29,100.00	667,554.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	51,300.00	553,527.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	54,708.00	304,723.56	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,250.00	986,177.50	
HOME PROPERTIES INC	17,250.00	943,230.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	43,330.00	1,197,641.20	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	228,960.00	4,258,656.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	12,919.00	261,738.94	
INLAND REAL ESTATE CORP	26,600.00	277,970.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	31,200.00	260,520.00	
KILROY REALTY CORPORATION	24,900.00	1,267,908.00	
KIMCO REALTY CORP	123,620.00	2,596,020.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	23,534.00	146,616.82	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	29,820.00	922,929.00	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	59,100.00	637,098.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	42,900.00	1,474,902.00	
LTC PROPERTIES INC	10,400.00	399,568.00	
MACERICH CO/THE	42,440.00	2,400,406.40	
MACK-CALI REALTY CORP	27,600.00	528,264.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48,400.00	620,004.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,500.00	1,391,175.00	
MONMOUTH REIT -CL A	13,500.00	124,335.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	36,590.00	1,186,979.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,208.00	444,733.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,140.00	1,105,153.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,463.00	49,826.49	
PARKWAY PROPERTIES INC	13,040.00	226,374.40	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18,060.00	514,168.20	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	19,500.00	331,890.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	3,000.00	36,570.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	51,570.00	894,739.50	
POST PROPERTIES	16,400.00	727,668.00	
PROLOGIS INC	150,090.00	5,846,005.50	
PS BUSINESS PARKS INC	5,466.00	430,447.50	
PUBLIC STORAGE	43,520.00	6,959,283.20	
RAMCO-GERSHENSON PRTYS	16,700.00	261,355.00	
REALTY INCOME CORP	60,160.00	2,410,009.60	
REGENCY CENTERS CORP	28,540.00	1,381,050.60	

RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	19,335.00	279,197.40	
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	53,200.00	740,544.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,500.00	58,815.00	
RLJ LODGING TRUST	38,400.00	925,824.00	
ROUSE PROPERTIES INC	7,352.00	145,202.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,480.00	608,673.60	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,425.00	268,026.75	
SAUL CENTERS INC	4,000.00	190,560.00	
SELECT INCOME REIT	7,526.00	199,664.78	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	57,290.00	1,340,586.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	11,000.00	173,360.00	
SIMON PROPERTY GROUP	93,620.00	14,324,796.20	
SL GREEN REALTY CORP	28,190.00	2,573,747.00	
SOVRAN SELF STORAGE INC	9,450.00	652,900.50	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	106,600.00	1,063,868.00	
STAG INDUSTRIAL INC	12,500.00	268,750.00	
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	53,071.00	442,612.14	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,500.00	224,400.00	
SUN COMMUNITIES INC	9,930.00	420,436.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	55,680.00	723,283.20	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	28,130.00	936,166.40	
TAUBMAN CENTERS INC	19,220.00	1,255,450.40	
TERRENO REALTY CORP	5,400.00	93,420.00	
UDR INC	75,110.00	1,783,111.40	
UMH PROPERTIES INC	3,180.00	31,736.40	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,900.00	167,544.00	
URSTADT BIDDLE - CL A	7,960.00	150,762.40	
VENTAS INC	88,240.00	5,432,936.80	
VORNADO REALTY TRUST	52,300.00	4,606,584.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	20,290.00	496,496.30	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	33,350.00	997,498.50	
WHITESTONE REIT	7,600.00	102,220.00	
WINTHROP REALTY TRUST	10,500.00	119,490.00	
WP CAREY INC	16,590.00	1,064,082.60	
アメリカドル小計	4,816,832.00	154,534,881.70 (15,294,317,241)	

カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	10,600.00	345,666.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,434.00	246,168.08	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,010.00	463,779.00	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	5,287.00	135,400.07	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	16,970.00	421,365.10	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	15,600.00	326,508.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,736.00	403,459.84	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	27,300.00	272,454.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	12,000.00	122,160.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	18,730.00	341,260.60	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,619.00	113,081.28	
	DUNDEE INDUSTRIAL REAL ESTAT	7,600.00	66,880.00	
	DUNDEE INTERNATIONAL REIT	17,294.00	151,495.44	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	15,990.00	451,717.50	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,500.00	268,500.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	39,330.00	821,603.70	
	HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	3,600.00	35,208.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,154.00	42,646.80	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,012.00	27,114.92	
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	5,000.00	48,000.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	4,000.00	39,600.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	8,786.00	142,772.50	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	5,203.00	142,302.05	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	4,401.00	46,166.49	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,000.00	84,550.00		
RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,650.00	65,793.00		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	44,730.00	1,098,121.50		
カナダドル小計		361,536.00	6,723,773.87 (635,060,442)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	76,150.00	174,383.50	
	ALE PROPERTY GROUP	53,471.00	142,232.86	
	ASPEN GROUP	26,259.00	43,458.64	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	24,000.00	86,160.00	

	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	66,849.00	264,053.55	
	BWP TRUST	155,000.00	356,500.00	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	723,000.00	1,460,460.00	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	24,112.00	62,932.32	
	CHARTER HALL GROUP	68,500.00	261,670.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	82,010.00	337,881.20	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	607,430.00	722,841.70	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	389,412.00	391,359.06	
	DEXUS PROPERTY GROUP	1,448,000.00	1,534,880.00	
	FEDERATION CENTRES	443,000.00	1,103,070.00	
	GOODMAN GROUP	454,130.00	2,297,897.80	
	GPT GROUP	491,510.00	1,823,502.10	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	35,000.00	90,300.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES RTS	3,448.00	89.64	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	200,000.00	102,000.00	
	INVESTA OFFICE FUND	190,700.00	606,426.00	
	MIRVAC GROUP	1,101,980.00	1,944,994.70	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	200,000.00	320,000.00	
	STOCKLAND	697,500.00	2,817,900.00	
	WESTFIELD GROUP	600,700.00	6,511,588.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	905,400.00	2,743,362.00	
	オーストラリアドル小計	9,067,561.00	26,199,943.07 (2,432,926,713)	
イギリスポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	38,089.00	179,284.92	
	BRITISH LAND CO PLC	300,800.00	1,849,920.00	
	DERWENT LONDON PLC	25,660.00	630,209.60	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	103,500.00	586,327.50	
	HAMMERSON PLC	215,600.00	1,116,808.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	203,530.00	212,688.85	
	INTU PROPERTIES PLC	203,600.00	678,598.80	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	234,300.00	2,284,425.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	172,538.00	221,711.33	
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	15,000.00	75,075.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	33,240.00	108,611.70	
	SEGRO PLC	222,500.00	719,120.00	
	SHAFTESBURY PLC	78,170.00	454,949.40	
	WORKSPACE GROUP PLC	33,654.00	164,231.52	

イギリスポンド小計		1,880,181.00	9,281,961.62 (1,471,190,916)	
香港ドル	CHAMPION REIT	831,000.00	2,916,810.00	
	FORTUNE REIT	366,000.00	2,302,140.00	
	LINK REIT	696,000.00	26,413,200.00	
	PROSPERITY REIT	322,000.00	740,600.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	254,000.00	579,120.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	313,000.00	957,780.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	546,000.00	2,113,020.00	
香港ドル小計		3,328,000.00	36,022,670.00 (460,009,495)	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	117,000.00	179,595.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	163,000.00	123,880.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	611,266.00	1,430,362.44	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	215,000.00	269,825.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	231,000.00	270,270.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	310,000.00	215,450.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	668,000.00	981,960.00	
	CAPITAMALL TRUST	803,500.00	1,607,000.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	186,560.00	253,721.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	214,000.00	353,100.00	
	CROESUS RETAIL TRUST	121,000.00	105,875.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	269,000.00	240,755.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	178,000.00	194,020.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	160,000.00	292,000.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	145,600.00	187,096.00	
	KEPPEL REIT	221,000.00	262,990.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	458,000.00	206,100.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	408,000.00	501,840.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	550,000.00	497,750.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	341,160.00	472,506.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	427,920.00	462,153.60	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	100,000.00	240,000.00	
	RELIGARE HEALTH TRUST	145,000.00	116,000.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	173,000.00	189,435.00	
SAIZEN REIT	80,000.00	74,000.00		

	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	180,000.00	139,500.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	440,000.00	358,600.00	
	SUNTEC REIT	700,000.00	1,155,000.00	
シンガポールドドル小計		8,617,006.00	11,380,785.24 (903,520,540)	
ニュージーランド ドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	79,159.00	124,675.42	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	301,000.00	310,030.00	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	302,000.00	332,200.00	
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	132,000.00	173,580.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	70,793.00	92,384.86	
ニュージーランドドル小計		884,952.00	1,032,870.28 (84,685,034)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	26,000.00	221,936.00	
イスラエルシェケル小計		26,000.00	221,936.00 (6,200,891)	
ユーロ	AEDIFICA	2,548.00	130,126.36	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	23,400.00	218,509.20	
	ALTAREA	1,070.00	138,030.00	
	ANF IMMOBILIER	1,870.00	43,010.00	
	BEFIMMO S.C.A.	5,380.00	286,000.80	
	BENI STABILI SPA	226,757.00	115,419.31	
	COFINIMMO	4,903.00	434,013.56	
	CORIO NV	29,590.00	963,894.25	
	EUROBANK PROPERTIES REAL ESTATE	4,000.00	36,000.00	
	EUROCOMMERCIAL	10,862.00	321,841.06	
	FONCIERE DES REGIONS	13,200.00	845,724.00	
	GECINA SA	7,890.00	771,799.80	
	HAMBORNER REIT AG	12,171.00	89,030.86	
	ICADE	10,380.00	721,410.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	52,169.00	46,899.93	
	KLEPIERRE	29,980.00	1,013,174.10	
	MERCIALYS	16,603.00	270,296.84	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	15,591.00	73,277.70	
	PRIME OFFICE REIT-AG	15,000.00	45,600.00	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	1,780.00	89,747.60	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	29,340.00	5,608,341.00	
	VASTNED RETAIL	5,500.00	186,450.00	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,300.00	177,045.00		

	WERELDHAVE NV	6,900.00	400,890.00	
	ユーロ小計	530,184.00	13,026,531.37 (1,722,367,977)	
	投資証券合計		23,010,279,249 (23,010,279,249)	
	合計		23,010,279,249 (23,010,279,249)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 138銘柄	100.0%	66.5%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.8%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	10.6%
イギリスポンド	投資証券 14銘柄	100.0%	6.4%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 28銘柄	100.0%	3.9%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
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 24銘柄	100.0%	7.5%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

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](#)

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5期 (平成24年11月12日現在)	第6期 (平成25年11月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	75,833,485	243,442,482
親投資信託受益証券	4,418,948,503	7,351,922,283
未収入金	1,740,000	-
未収利息	139	331
流動資産合計	4,496,522,127	7,595,365,096
資産合計	4,496,522,127	7,595,365,096
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	13,646,679
未払解約金	4,946,219	15,614,303
未払受託者報酬	890,462	1,488,500
未払委託者報酬	14,247,313	23,815,970
その他未払費用	205,471	333,467
流動負債合計	20,289,465	54,898,919
負債合計	20,289,465	54,898,919
純資産の部		
元本等		
元本	5,598,521,881	6,823,339,843
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,122,289,219	717,126,334
（分配準備積立金）	232,170,631	1,508,410,867
元本等合計	4,476,232,662	7,540,466,177
純資産合計	4,476,232,662	7,540,466,177
負債純資産合計	4,496,522,127	7,595,365,096

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 (自 平成23年11月11日 至 平成24年11月12日)	第6期 (自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11日)
営業収益		
受取利息	38,450	85,573
有価証券売買等損益	373,869,836	1,855,003,780
営業収益合計	373,908,286	1,855,089,353
営業費用		
受託者報酬	1,644,782	2,668,706
委託者報酬	26,316,275	42,699,152
その他費用	205,471	333,467
営業費用合計	28,166,528	45,701,325
営業利益又は営業損失()	345,741,758	1,809,388,028
経常利益又は経常損失()	345,741,758	1,809,388,028
当期純利益又は当期純損失()	345,741,758	1,809,388,028
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()	36,625,296	323,696,887
期首剰余金又は期首欠損金()	1,199,803,787	1,122,289,219
剰余金増加額又は欠損金減少額	189,509,511	367,371,091
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	189,509,511	279,555,048
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	87,816,043
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	421,111,405	-
分配金	-	13,646,679
期末剰余金又は期末欠損金()	1,122,289,219	717,126,334

(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6期(自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は平成24年11月13日から平成25年11月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (平成24年11月12日現在)	第6期 (平成25年11月11日現在)
1. 期首元本額	4,427,235,469円	5,598,521,881円
期中追加設定元本額	1,886,342,012円	2,961,482,673円
期中一部解約元本額	715,055,600円	1,736,664,711円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	5,598,521,881口	6,823,339,843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 1,122,289,219円	
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7995円 (7,995円)	1.1051円 (11,051円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第5期 自 平成23年11月11日 至 平成24年11月12日	第6期 自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11日
費用控除後の配当等収益額	A	105,520,458円 (115,098,061円)	156,178,171円 (160,900,476円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	1,190,317,935円
収益調整金額	C	221,640,656円	381,251,931円
分配準備積立金額	D	126,650,173円	175,561,440円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	453,811,287円	1,903,309,477円
当ファンドの期末残存口数	F	5,598,521,881口	6,823,339,843口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	810.59円	2,789.41円

1万口当たり分配金額	H	- 円	20円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	- 円	13,646,679円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(株価変動リスク、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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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5期 (平成24年11月12日現在)	第6期 (平成25年11月11日現在)
	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)	計算期間(自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11日)の損益に含ま れた評価差額(円)
親投資信託受益証券	372,177,616	1,757,955,765
合計	372,177,616	1,757,955,765

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

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	932,369,821	1,195,391,347	
	国内株式インデックス マザーファンド	1,603,869,833	1,556,234,898	
	外国債券インデックス マザーファンド	591,137,777	1,371,557,870	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,107,865,207	1,674,427,473	
	J-REITインデックス マザーファンド	691,134,348	780,774,472	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	693,257,056	773,536,223	
親投資信託受益証券 小計		5,619,634,042	7,351,922,283	
合計		5,619,634,042	7,351,922,283	

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。

<参考>

「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25年11月11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25年11月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	798,348,033
国債証券	196,569,519,500
地方債証券	16,009,207,660
特殊債券	22,721,404,840
社債券	15,654,677,650
未収入金	201,060,000
未収利息	704,404,952
前払金	30,000
前払費用	57,530,702
流動資産合計	252,716,183,337
資産合計	252,716,183,337
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	110,630
未払金	200,000,000
未払解約金	240,943,048
流動負債合計	441,053,678

負債合計	441,053,678
純資産の部	
元本等	
元本	196,768,519,264
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,506,610,395
元本等合計	252,275,129,659
純資産合計	252,275,129,659
負債純資産合計	252,716,183,337

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年11月11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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 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25年11月11日現在
1. 計算期間の期首元本額	171,045,390,624円
計算期間中の追加設定元本額	88,330,674,982円
計算期間中の一部解約元本額	62,607,546,342円
計算日の元本額	196,768,519,264円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	3,779,674円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	932,369,821円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,972,321円

SMT 国内債券インデックス・オープン	3,284,756,472円
世界経済インデックスファンド	122,047,728円
マイセレクション25	160,663,883円
マイセレクション50	117,983,982円
マイセレクション75	39,451,651円
DCマイセレクション25	10,903,274,424円
DCマイセレクション50	13,605,498,038円
DCマイセレクション75	3,748,322,259円
DC日本債券インデックス・オープン	380,364,354円
DC日本債券インデックス・オープンS	44,137,211,813円
DC日本債券インデックス・オープンP	14,693,188,856円
DCマイセレクションS25	3,865,887,758円
DCマイセレクションS50	4,559,617,689円
DCマイセレクションS75	840,067,553円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	35,399,034円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	798,863,779円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	407,272,225円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	92,884,464円
DC世界経済インデックスファンド	93,553,995円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	795,260,147円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	52,636,514円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	361,912,503円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,963,611円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,573,510円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	7,260,578円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,739,228,275円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,660,889,851円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,848,494,921円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	734,160,639円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	17,352,544,371円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,817,957,487円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,461,721,535円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,513,375,931円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,139,497,129円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,549,706,147円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,413,781,769円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,830,193,403円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,834,694,690円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	285,941,079円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,262,762,566円

日本債券ファンド・シリーズ1	6,936,567,028円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,966,829,073円
コア投資戦略ファンド(成長型)	947,268,838円
分散投資コア戦略ファンドA	104,072,310円
分散投資コア戦略ファンドS	64,024,356円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	21,196,605,317円
コア投資戦略ファンド(切替型)	47,850円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	9,361円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	28,862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 105,853,000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	196,768,519,264口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2821円 (12,821円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年11月11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	<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経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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25年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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25年11月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,459,746,050
地方債証券	263,561,097
特殊債券	343,879,355

社債券	85,691,280
合計	4,152,877,782

(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25年5月30日から平成25年11月11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25年11月11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	290,210,630	-	290,100,000	110,630
	合計	290,210,630	-	290,100,000	110,630

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年11月11日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成25年11月11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323回利付国債(2年)	420,000,000	420,067,200	
	第324回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,220,207,400	
	第326回利付国債(2年)	730,000,000	730,138,700	
	第327回利付国債(2年)	1,210,000,000	1,210,254,100	
	第328回利付国債(2年)	1,270,000,000	1,270,279,400	
	第329回利付国債(2年)	770,000,000	771,339,800	
	第330回利付国債(2年)	670,000,000	671,226,100	
	第331回利付国債(2年)	490,000,000	490,083,300	
	第332回利付国債(2年)	1,260,000,000	1,260,226,800	

第 3 3 3 回利付国債（ 2 年）	2,060,000,000	2,060,391,400	
第 8 7 回利付国債（ 5 年）	2,820,000,000	2,832,859,200	
第 8 8 回利付国債（ 5 年）	2,570,000,000	2,584,340,600	
第 8 9 回利付国債（ 5 年）	1,610,000,000	1,618,098,300	
第 9 0 回利付国債（ 5 年）	220,000,000	220,754,600	
第 9 1 回利付国債（ 5 年）	200,000,000	201,146,000	
第 9 2 回利付国債（ 5 年）	1,260,000,000	1,264,888,800	
第 9 3 回利付国債（ 5 年）	1,110,000,000	1,119,423,900	
第 9 4 回利付国債（ 5 年）	1,110,000,000	1,121,754,900	
第 9 5 回利付国債（ 5 年）	620,000,000	627,260,200	
第 9 6 回利付国債（ 5 年）	1,470,000,000	1,483,759,200	
第 9 7 回利付国債（ 5 年）	3,630,000,000	3,657,261,300	
第 9 9 回利付国債（ 5 年）	1,800,000,000	1,814,310,000	
第 1 0 0 回利付国債（ 5 年）	100,000,000	100,511,000	
第 1 0 1 回利付国債（ 5 年）	1,020,000,000	1,028,506,800	
第 1 0 2 回利付国債（ 5 年）	1,880,000,000	1,889,870,000	
第 1 0 3 回利付国債（ 5 年）	1,840,000,000	1,849,807,200	
第 1 0 4 回利付国債（ 5 年）	410,000,000	410,815,900	
第 1 0 5 回利付国債（ 5 年）	3,060,000,000	3,065,477,400	
第 1 0 6 回利付国債（ 5 年）	1,880,000,000	1,882,876,400	
第 1 0 7 回利付国債（ 5 年）	620,000,000	620,756,400	
第 1 0 8 回利付国債（ 5 年）	790,000,000	787,740,600	
第 1 0 9 回利付国債（ 5 年）	390,000,000	388,650,600	
第 1 1 0 回利付国債（ 5 年）	900,000,000	904,653,000	
第 1 1 1 回利付国債（ 5 年）	1,570,000,000	1,584,899,300	
第 1 1 2 回利付国債（ 5 年）	870,000,000	878,325,900	
第 1 1 3 回利付国債（ 5 年）	3,430,000,000	3,447,184,300	
第 1 1 4 回利付国債（ 5 年）	1,110,000,000	1,115,328,000	
第 1 1 5 回利付国債（ 5 年）	490,000,000	490,000,000	
第 1 回利付国債（ 4 0 年）	150,000,000	179,584,500	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	300,000,000	343,353,000	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	340,000,000	389,116,400	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	530,000,000	607,178,600	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	640,000,000	696,697,600	
第 6 回利付国債（ 4 0 年）	300,000,000	317,136,000	
第 2 6 5 回利付国債（ 1 0 年）	530,000,000	538,246,800	
第 2 6 6 回利付国債（ 1 0 年）	470,000,000	476,796,200	
第 2 6 7 回利付国債（ 1 0 年）	590,000,000	597,882,400	
第 2 6 8 回利付国債（ 1 0 年）	760,000,000	774,478,000	

第269回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,453,380,500	
第270回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,038,660,000	
第271回利付国債(10年)	680,000,000	692,056,400	
第272回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,095,915,400	
第273回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,631,451,300	
第274回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,369,328,100	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	287,691,600	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	495,201,600	
第277回利付国債(10年)	410,000,000	424,403,300	
第278回利付国債(10年)	720,000,000	748,670,400	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	459,580,000	
第280回利付国債(10年)	600,000,000	627,840,000	
第281回利付国債(10年)	700,000,000	734,293,000	
第282回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,316,763,000	
第283回利付国債(10年)	280,000,000	293,412,000	
第284回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,268,866,500	
第285回利付国債(10年)	2,390,000,000	2,514,638,500	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	921,564,900	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	573,939,000	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,213,644,400	
第289回利付国債(10年)	1,530,000,000	1,612,880,100	
第290回利付国債(10年)	270,000,000	284,272,200	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	880,773,600	
第292回利付国債(10年)	860,000,000	916,588,000	
第293回利付国債(10年)	870,000,000	934,084,200	
第294回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,165,319,000	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	105,997,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,232,258,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	593,930,400	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,752,196,400	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,385,508,400	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	886,622,600	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,327,792,000	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	213,054,000	
第303回利付国債(10年)	2,110,000,000	2,251,897,500	
第304回利付国債(10年)	400,000,000	424,588,000	
第305回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,210,582,400	
第306回利付国債(10年)	740,000,000	791,933,200	
第307回利付国債(10年)	600,000,000	638,370,000	

第308回利付国債(10年)	600,000,000	639,036,000	
第309回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,325,230,200	
第310回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,047,984,400	
第311回利付国債(10年)	160,000,000	165,038,400	
第312回利付国債(10年)	1,710,000,000	1,810,086,300	(注)
第313回利付国債(10年)	1,510,000,000	1,608,723,800	
第314回利付国債(10年)	680,000,000	714,992,800	
第315回利付国債(10年)	730,000,000	772,785,300	
第316回利付国債(10年)	620,000,000	651,768,800	
第317回利付国債(10年)	280,000,000	294,249,200	
第318回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,585,800,800	
第319回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,839,617,500	
第320回利付国債(10年)	1,680,000,000	1,752,895,200	
第321回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,460,186,000	
第322回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,479,978,500	
第323回利付国債(10年)	930,000,000	961,861,800	
第324回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,528,114,200	
第325回利付国債(10年)	2,070,000,000	2,120,839,200	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	304,293,000	
第327回利付国債(10年)	2,260,000,000	2,311,957,400	
第328回利付国債(10年)	2,640,000,000	2,650,533,600	
第329回利付国債(10年)	2,490,000,000	2,542,115,700	
第330回利付国債(10年)	2,890,000,000	2,947,857,800	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	49,647,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	188,576,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,636,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	137,496,700	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	56,948,000	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	221,806,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	206,706,600	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	53,124,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	238,382,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	150,401,600	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	93,647,700	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	210,333,800	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	315,807,100	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	347,508,000	
第15回利付国債(30年)	390,000,000	458,589,300	
第16回利付国債(30年)	270,000,000	317,422,800	

第17回利付国債（30年）	310,000,000	359,032,700	
第18回利付国債（30年）	370,000,000	421,611,300	
第19回利付国債（30年）	130,000,000	148,175,300	
第20回利付国債（30年）	330,000,000	388,462,800	
第21回利付国債（30年）	280,000,000	319,300,800	
第22回利付国債（30年）	300,000,000	353,763,000	
第23回利付国債（30年）	340,000,000	401,108,200	
第24回利付国債（30年）	290,000,000	342,263,800	
第25回利付国債（30年）	320,000,000	365,801,600	
第26回利付国債（30年）	540,000,000	627,836,400	
第27回利付国債（30年）	600,000,000	711,018,000	
第28回利付国債（30年）	510,000,000	605,273,100	
第29回利付国債（30年）	740,000,000	864,475,400	
第30回利付国債（30年）	540,000,000	620,476,200	
第31回利付国債（30年）	730,000,000	824,418,200	
第32回利付国債（30年）	780,000,000	898,684,800	
第33回利付国債（30年）	800,000,000	869,904,000	
第34回利付国債（30年）	960,000,000	1,087,152,000	
第35回利付国債（30年）	920,000,000	1,000,536,800	
第36回利付国債（30年）	1,040,000,000	1,131,052,000	
第37回利付国債（30年）	860,000,000	915,444,200	
第38回利付国債（30年）	540,000,000	562,129,200	
第39回利付国債（30年）	240,000,000	255,487,200	
第40回利付国債（30年）	540,000,000	561,816,000	
第28回利付国債（20年）	20,000,000	21,324,800	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	64,572,000	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	85,355,200	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	86,388,800	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	54,227,500	
第33回利付国債（20年）	140,000,000	154,687,400	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	55,598,000	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	11,053,000	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	77,640,500	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	77,908,600	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	22,183,800	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	552,435,000	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	110,144,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	352,512,600	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	90,135,200	

第43回利付国債（20年）	140,000,000	161,630,000	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	193,779,600	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	328,755,600	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	191,044,300	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	101,383,200	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	149,476,600	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	157,281,600	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	244,094,400	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	111,805,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	124,051,400	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	90,458,400	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	227,802,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	157,463,600	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	169,039,500	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	268,368,000	
第58回利付国債（20年）	300,000,000	336,030,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	220,700,000	
第60回利付国債（20年）	350,000,000	376,929,000	
第61回利付国債（20年）	240,000,000	249,600,000	
第62回利付国債（20年）	320,000,000	326,844,800	
第63回利付国債（20年）	200,000,000	222,896,000	
第64回利付国債（20年）	320,000,000	359,865,600	
第65回利付国債（20年）	220,000,000	247,946,600	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	368,590,200	
第67回利付国債（20年）	130,000,000	146,679,000	
第68回利付国債（20年）	190,000,000	220,154,900	
第69回利付国債（20年）	390,000,000	447,868,200	
第70回利付国債（20年）	400,000,000	472,460,000	
第71回利付国債（20年）	300,000,000	348,183,000	
第72回利付国債（20年）	630,000,000	725,911,200	
第73回利付国債（20年）	390,000,000	445,898,700	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	230,862,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	150,159,100	
第76回利付国債（20年）	170,000,000	192,661,000	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	331,899,200	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	192,817,400	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	309,150,000	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	254,408,000	
第81回利付国債（20年）	190,000,000	217,626,000	

第 8 2 回利付国債(20年)	510,000,000	590,075,100	
第 8 3 回利付国債(20年)	290,000,000	335,854,800	
第 8 4 回利付国債(20年)	550,000,000	630,470,500	
第 8 5 回利付国債(20年)	290,000,000	335,762,000	
第 8 6 回利付国債(20年)	400,000,000	472,736,000	
第 8 7 回利付国債(20年)	290,000,000	339,244,900	
第 8 8 回利付国債(20年)	550,000,000	650,006,500	
第 8 9 回利付国債(20年)	320,000,000	374,275,200	
第 9 0 回利付国債(20年)	560,000,000	654,796,800	
第 9 1 回利付国債(20年)	440,000,000	519,943,600	
第 9 2 回利付国債(20年)	900,000,000	1,041,210,000	
第 9 3 回利付国債(20年)	430,000,000	491,636,200	
第 9 4 回利付国債(20年)	500,000,000	578,040,000	
第 9 5 回利付国債(20年)	650,000,000	767,234,000	
第 9 6 回利付国債(20年)	300,000,000	346,347,000	
第 9 7 回利付国債(20年)	590,000,000	688,282,200	
第 9 8 回利付国債(20年)	320,000,000	369,113,600	
第 9 9 回利付国債(20年)	750,000,000	863,700,000	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	550,000,000	640,040,500	
第 1 0 1 回利付国債(20年)	255,000,000	303,603,000	
第 1 0 2 回利付国債(20年)	400,000,000	475,888,000	
第 1 0 3 回利付国債(20年)	270,000,000	317,547,000	
第 1 0 4 回利付国債(20年)	340,000,000	390,632,800	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	600,000,000	688,458,000	
第 1 0 6 回利付国債(20年)	460,000,000	534,142,800	
第 1 0 7 回利付国債(20年)	230,000,000	263,711,100	
第 1 0 8 回利付国債(20年)	600,000,000	670,848,000	
第 1 0 9 回利付国債(20年)	200,000,000	223,206,000	
第 1 1 0 回利付国債(20年)	890,000,000	1,018,231,200	
第 1 1 1 回利付国債(20年)	300,000,000	346,941,000	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	700,000,000	799,589,000	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	890,000,000	1,014,235,100	
第 1 1 4 回利付国債(20年)	540,000,000	613,861,200	
第 1 1 5 回利付国債(20年)	560,000,000	644,700,000	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	590,000,000	678,045,700	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	770,000,000	873,665,100	
第 1 1 8 回利付国債(20年)	650,000,000	726,505,000	
第 1 1 9 回利付国債(20年)	380,000,000	413,276,600	
第 1 2 0 回利付国債(20年)	200,000,000	211,512,000	

	第121回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,143,646,400	
	第122回利付国債(20年)	280,000,000	303,760,800	
	第123回利付国債(20年)	580,000,000	654,066,000	
	第124回利付国債(20年)	400,000,000	445,088,000	
	第125回利付国債(20年)	380,000,000	433,317,800	
	第126回利付国債(20年)	430,000,000	476,994,700	
	第127回利付国債(20年)	360,000,000	393,638,400	
	第128回利付国債(20年)	500,000,000	545,310,000	
	第129回利付国債(20年)	440,000,000	472,863,600	
	第130回利付国債(20年)	370,000,000	396,802,800	
	第131回利付国債(20年)	650,000,000	686,673,000	
	第132回利付国債(20年)	330,000,000	347,810,100	
	第133回利付国債(20年)	860,000,000	920,303,200	
	第134回利付国債(20年)	370,000,000	395,063,800	
	第135回利付国債(20年)	380,000,000	399,554,800	
	第136回利付国債(20年)	530,000,000	548,677,200	
	第137回利付国債(20年)	290,000,000	304,183,900	
	第138回利付国債(20年)	450,000,000	457,312,500	
	第139回利付国債(20年)	480,000,000	495,628,800	
	第140回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,171,856,000	
	第141回利付国債(20年)	260,000,000	271,346,400	
	第142回利付国債(20年)	480,000,000	509,318,400	
	第143回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,045,479,600	
	第144回利付国債(20年)	250,000,000	252,077,500	
	第145回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,466,033,400	
	第146回利付国債(20年)	890,000,000	923,579,700	
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	199,932,000	
	国債証券 小計	185,795,000,000	196,569,519,500	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,670,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,610,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,466,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	109,046,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,413,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,568,000	
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,861,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	205,650,000	
	第622回東京都公募公債	100,000,000	101,823,000	
	第633回東京都公募公債	129,000,000	134,494,110	

第639回東京都公募公債	50,000,000	52,375,000	
第649回東京都公募公債	102,000,000	107,973,120	
第650回東京都公募公債	140,000,000	148,842,400	
第674回東京都公募公債	100,000,000	106,340,000	
第678回東京都公募公債	100,000,000	106,477,000	
第683回東京都公募公債	100,000,000	106,164,000	
第691回東京都公募公債	100,000,000	105,764,000	
第695回東京都公募公債	100,000,000	105,487,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,399,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,879,000	
平成18年度第10回北海道公募公債	100,000,000	105,171,000	
平成19年度第9回北海道公募公債	110,000,000	116,286,500	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,422,000	
平成22年度第11回北海道公募公債	100,000,000	106,139,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	117,053,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,083,000	
第144回神奈川県公募公債	100,000,000	105,114,000	
第150回神奈川県公募公債	100,000,000	105,923,000	
第167回神奈川県公募公債	140,000,000	149,961,000	
第172回神奈川県公募公債	200,000,000	212,636,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	211,372,000	
第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,990,000	
第284回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,860,000	
第290回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,536,000	
第291回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,682,000	
第307回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,216,000	
第311回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,990,000	
第345回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,516,000	
第349回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,365,000	
平成18年度第1回京都府公募公債	100,000,000	104,720,000	
平成22年度第2回京都府公募公債	100,000,000	105,186,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	97,794,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	207,100,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	106,209,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	106,853,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,251,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,709,000	
平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,686,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	108,842,870	

平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	104,043,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,301,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	115,563,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,365,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	213,090,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,751,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,518,000	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,480,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	116,658,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,512,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,889,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	101,970,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,669,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	105,881,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	204,595,440	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,165,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	107,238,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	109,490,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	210,536,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	107,187,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	103,191,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	105,275,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	106,906,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	107,115,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,947,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	124,885,200	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	102,932,000	
平成22年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,665,000	
第29回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,474,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,065,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,298,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,644,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	126,261,600	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,089,000	
第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	143,544,765	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,247,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	168,572,448	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,027,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,776,000	

第 6 7 回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,918,719	
第 7 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,166,000	
第 7 7 回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,884,800	
第 7 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,381,000	
第 8 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,989,000	
第 8 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,079,000	
第 8 9 回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,877,128	
第 9 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,380,000	
第 9 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,775,000	
第 9 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,735,000	
第 9 5 回共同発行市場公募地方債	250,000,000	265,020,000	
第 9 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,478,000	
第 9 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,281,000	
第 1 0 2 回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,166,500	
第 1 0 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,845,000	
第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,813,000	
第 1 1 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,323,000	
第 1 1 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,080,000	
第 1 1 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,670,000	
平成 1 7 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	102,926,000	
平成 2 2 年度第 1 回静岡市公募公債	100,000,000	104,055,000	
平成 1 6 年度第 8 回大阪市公募公債	100,000,000	101,479,000	
平成 1 7 年度第 1 0 回大阪市公募公債	100,000,000	102,892,000	
平成 1 9 年度第 7 回大阪市公募公債	100,000,000	106,018,000	
平成 2 2 年度第 2 回大阪市公募公債（ 5 年）	100,000,000	100,464,000	
平成 2 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	105,159,000	
第 5 回名古屋市公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	114,705,000	
第 9 回名古屋市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	113,005,000	
第 1 2 回す号名古屋市公募公債	100,000,000	103,606,000	
平成 2 2 年度第 1 回京都市公募公債	100,000,000	100,409,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都市公募公債	102,000,000	106,797,060	
平成 2 4 年度第 4 回京都市公募公債	100,000,000	101,749,000	
平成 1 7 年度第 1 3 回神戸市公募公債	100,000,000	103,231,000	
第 5 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	115,468,000	
平成 1 7 年度第 1 回横浜市公募公債	100,000,000	101,566,000	
平成 2 1 年度第 1 回横浜市公募公債	200,000,000	214,338,000	
平成 2 1 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	107,453,000	
平成 2 3 年度第 5 回横浜市公募公債	100,000,000	103,908,000	
平成 1 7 年度第 6 回札幌市公募公債	100,000,000	102,842,000	

	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,770,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,889,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	107,085,000	
	平成23年度第1回北九州市公募公債（5年）	100,000,000	100,486,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	105,357,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	104,201,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）	100,000,000	105,065,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	116,638,000	
	地方債証券 小計	15,130,190,000	16,009,207,660	
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	100,068,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,300,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	111,440,980	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,343,000	
	第16回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,698,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	114,527,000	
	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	102,897,000	
	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	103,349,000	
	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	110,552,000	
	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	103,453,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,818,000	
	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	221,162,000	
	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	105,178,000	
	第21回道路債券	100,000,000	117,973,000	
	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	104,794,000	
	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	105,149,000	
	第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,722,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,271,000	
	第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	334,473,300	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,217,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,537,000	
	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,218,000	
	第42回道路債券	100,000,000	114,783,000	
	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	106,055,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,423,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,965,000	
	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	105,320,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,987,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,175,000	

第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,520,000	
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	31,549,200	
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	116,807,520	
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	107,267,000	
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	193,554,160	
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,324,000	
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,612,000	
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	115,137,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,266,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,803,000	
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	318,420,000	
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	146,658,120	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,502,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,292,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,222,000	
第117回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,390,000	
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	206,928,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,090,000	
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	111,823,000	
第126回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,537,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,293,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,777,000	
第140回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,688,000	
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	103,077,000	
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	205,984,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,928,000	

第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,134,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,893,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,557,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,864,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	146,256,110	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	184,938,560	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,590,560	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,890,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,135,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,395,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	338,700,000	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	10,317,000	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,517,000	
第6回地方公共団体金融機構債券（5年）	100,000,000	100,646,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,322,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,804,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,608,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	45,921,600	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,611,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,531,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,510,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,702,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	102,609,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,517,830	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,552,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,321,590	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,324,620	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,602,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,294,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	106,474,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	107,733,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,112,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,290,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	143,028,200	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	134,947,030	

第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,094,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,112,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,699,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,228,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,686,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,224,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	223,329,280	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	129,518,860	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	108,280,810	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,120,800	
第7回首都高速道路株式会社債	100,000,000	100,834,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,176,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,392,000	
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	107,021,620	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,038,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,339,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,709,000	
第322回東京交通債券	10,000,000	10,558,800	
第344回東京交通債券	100,000,000	108,964,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,811,400	
第190回政府保証預金保険機構債	200,000,000	199,680,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	99,820,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,754,000	46,947,604	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,230,000	34,563,452	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,446,000	36,196,599	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,283,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,284,000	47,854,618	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,892,000	38,385,417	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	28,319,000	29,983,874	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,463,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,794,000	63,609,816	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	35,723,000	37,951,757	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,861,000	33,260,442	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,435,000	43,047,101	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,513,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,549,000	32,956,566	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	45,488,000	48,457,456	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,300,000	51,908,463	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,631,000	52,183,026	

第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,232,000	61,820,289	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,937,000	62,849,478	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,156,000	61,794,780	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,748,000	69,019,425	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,093,000	71,492,958	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,378,000	73,596,876	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,157,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,276,000	150,772,722	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,183,000	46,936,042	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,940,000	82,436,358	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,877,000	46,499,967	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,653,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,274,000	45,929,010	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,022,000	91,052,566	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,297,000	41,476,416	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,972,000	91,376,199	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,563,000	92,217,295	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,493,000	47,099,439	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,306,000	183,739,971	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,808,000	92,926,026	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,465,000	46,647,072	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,679,000	94,518,298	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,292,000	94,159,481	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,904,000	94,903,746	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,853,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,070,000	190,989,690	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,801,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,993,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,408,000	192,766,996	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,030,000	96,421,802	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,631,000	98,304,648	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,795,000	98,616,681	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,305,000	99,010,756	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,647,000	97,905,764	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,944,000	99,941,078	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,524,000	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,448,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,180,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,879,000	

第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	115,426,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	151,881,870	
い第718号商工債	100,000,000	100,656,000	
い第721号商工債	150,000,000	150,921,000	
い第722号商工債	100,000,000	100,553,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,560,000	
い第729号商工債	100,000,000	101,188,000	
い第731号商工債	100,000,000	101,260,000	
い第736号商工債	100,000,000	100,715,000	
い第738号商工債	100,000,000	100,724,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,750,000	
い第715号農林債	100,000,000	100,570,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,663,000	
い第722号農林債	100,000,000	100,604,000	
い第723号農林債	200,000,000	201,270,000	
い第740号農林債	100,000,000	100,843,000	
い第743号農林債	100,000,000	100,701,000	
い第746号農林債	100,000,000	100,349,000	
い第748号農林債	100,000,000	100,343,000	
い第752号農林債	100,000,000	100,082,000	
第243回信金中金債（5年）	100,000,000	100,697,000	
第247回信金中金債（5年）	100,000,000	100,622,000	
第258回信金中金債（5年）	100,000,000	100,922,000	
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,940,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,900,000	
第267回信金中金債（5年）	200,000,000	201,532,000	
第5回S B A B銀行A B（p u b l）円貨債券	100,000,000	101,155,000	
第10回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	101,048,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,978,000	
第19回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,999,000	
第22回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	206,966,000	
第28回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	101,894,000	
第33回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	103,569,000	
第43回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,160,000	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,106,000	
特殊債券 小計	21,591,431,000	22,721,404,840	
社債券			
第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,545,000	

第9回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,864,000	
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	104,864,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,535,000	
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	101,440,000	
第9回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,768,000	
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	101,530,000	
第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	205,046,000	
第17回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,098,000	
第3回エイチエスピーシー・バンク・ビーエルシー円貨社債	100,000,000	100,952,000	
第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,604,000	
第13回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,694,000	
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
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	105,922,000	
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	107,322,000	
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	107,422,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,328,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,796,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,603,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,021,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,183,000	
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	102,440,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,141,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	99,842,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,176,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	
第15回JFEホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,858,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,897,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,036,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	100,742,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,166,000	

第30回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,127,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,518,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,404,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	102,105,000	
第24回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	106,356,000	
第37回川崎重工株式会社無担保社債	100,000,000	100,624,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,934,000	
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	100,640,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,912,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,217,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	102,301,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,946,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,121,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,818,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,375,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,129,000	
第77回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,933,000	
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	100,397,000	
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	101,263,000	
第26回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	302,370,000	
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	100,616,000	
第30回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,185,000	
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	121,554,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,983,000	
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	107,197,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,811,000	
第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,296,000	
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	109,241,000	
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	108,443,000	
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	109,768,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,676,000	
第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,241,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,811,000	

第10回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	213,916,000	
第20回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,492,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,635,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,222,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,835,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,759,000	
第133回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,186,000	
第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,657,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,138,000	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,447,000	
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	100,958,000	
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	101,025,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,483,000	
第40回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,079,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,015,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	110,990,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,680,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,149,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,321,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,801,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	102,117,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,295,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,529,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,149,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,055,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,901,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,396,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,584,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,620,480	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,314,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,650,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,816,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,470,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,750,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,553,000	
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	102,959,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,161,000	

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	101,000,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,538,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,766,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	107,485,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	100,220,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,363,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,402,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	110,751,600	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,477,400	
第510回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,895,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,406,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,159,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,409,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,230,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,522,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,775,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	89,018,000	
第405回中部電力株式会社社債	50,000,000	52,747,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	53,520,000	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,284,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,366,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,571,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,702,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,428,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,783,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,902,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,481,000	
第248回北陸電力株式会社社債	100,000,000	108,906,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,908,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,532,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	109,063,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,740,600	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,698,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,424,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,288,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,808,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,170,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,263,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,887,000	

第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,711,570	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,099,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,510,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,541,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,230,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	110,902,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,937,000	
第42回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	101,658,000	
社債券 小計	15,220,000,000	15,654,677,650	
合計	237,736,621,000	250,954,809,650	

(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](#)

- (1)当ファンドの中間財務諸表は、「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)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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7期中間計算期間(平成25年11月12日から平成26年5月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【SBI資産設計オープン(資産成長型)】 中間財務諸表

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

第7期中間計算期間 (平成26年 5月11日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	351,783,794
親投資信託受益証券	8,664,268,823
未収入金	7,217,970
未収利息	1,408
流動資産合計	9,023,271,995
資産合計	9,023,271,995
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,593,356
未払受託者報酬	1,716,986
未払委託者報酬	27,471,697
その他未払費用	214,568
流動負債合計	56,996,607
負債合計	56,996,607
純資産の部	
元本等	
元本	7,678,479,549
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	1,287,795,839
(分配準備積立金)	1,272,860,429
元本等合計	8,966,275,388
純資産合計	8,966,275,388
負債純資産合計	9,023,271,995

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期中間計算期間 (自 平成25年11月12日 至 平成26年 5月11日)
営業収益	
受取利息	71,379
有価証券売買等損益	460,746,540
営業収益合計	460,817,919
営業費用	
受託者報酬	1,716,986
委託者報酬	27,471,697
その他費用	214,568
営業費用合計	29,403,251
営業利益又は営業損失()	431,414,668
経常利益又は経常損失()	431,414,668
中間純利益又は中間純損失()	431,414,668
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	44,446,922
期首剰余金又は期首欠損金()	717,126,334
剰余金増加額又は欠損金減少額	310,486,915
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	310,486,915
剰余金減少額又は欠損金増加額	126,785,156
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	126,785,156
中間剰余金又は中間欠損金()	1,287,795,839

(3) 【中間注記表】

(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7期中間計算期間(自 平成25年11月12日 至 平成26年 5月11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、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は平成25年11月12日から平成26年 5月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第7期中間計算期間 (平成26年 5月11日現在)
1. 期首元本額	6,823,339,843円
期中追加設定元本額	2,034,777,811円
期中一部解約元本額	1,179,638,105円
2. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	7,678,479,549口
3. 1口当たり純資産額	1.1677円
(1万口当たり純資産額)	(11,677円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間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、中間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。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

<参考>

「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、中間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26年5月11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26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,382,876,736
国債証券	200,086,864,650
地方債証券	15,766,381,024
特殊債券	21,957,451,154
社債券	14,385,697,190
派生商品評価勘定	659,028
未収利息	695,013,835
前払費用	23,771,369
流動資産合計	254,298,714,986
資産合計	254,298,714,986
負債の部	
流動負債	
前受金	690,000
未払解約金	760,568,636
流動負債合計	761,258,636
負債合計	761,258,636
純資産の部	
元本等	
元本	196,747,344,191
剰余金	
剰余金又は欠損金()	56,790,112,159
元本等合計	253,537,456,350
純資産合計	253,537,456,350

負債純資産合計	254,298,714,986
---------	-----------------

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 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26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	196,768,519,264円
中間計算期間中の追加設定元本額	25,575,895,443円
中間計算期間中の一部解約元本額	25,597,070,516円
計算日の元本額	196,747,344,191円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,084,689,346円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,747,660円
SMT 国内債券インデックス・オープン	4,355,225,783円
世界経済インデックスファンド	159,269,294円
マイセレクション25	149,578,207円
マイセレクション50	90,297,660円
マイセレクション75	29,492,417円
DCマイセレクション25	11,816,181,815円
DCマイセレクション50	14,538,228,184円
DCマイセレクション75	4,009,755,597円
DC日本債券インデックス・オープン	392,775,983円
DC日本債券インデックス・オープンS	48,347,322,805円
DC日本債券インデックス・オープンP	16,496,694,203円

DCマイセレクションS25	4,254,541,133円
DCマイセレクションS50	4,775,263,743円
DCマイセレクションS75	870,056,829円
DCターゲット・イヤールファンド2015	30,700,270円
DCターゲット・イヤールファンド2025	946,392,885円
DCターゲット・イヤールファンド2035	488,950,586円
DCターゲット・イヤールファンド2045	115,630,897円
DC世界経済インデックスファンド	150,115,691円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	944,840,130円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	38,398,923円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	262,939,055円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,689,514円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,471,999円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,385,172,422円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,019,356,482円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,296,197,908円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	539,570,388円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	16,399,542,151円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,836,051,511円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,397,381,861円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,505,856,636円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,152,591,766円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,417,436,991円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,321,953,132円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,698,879,428円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,601,456,665円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	261,823,699円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,983,779,913円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,912,549,104円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,724,978,197円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,263,216,410円
分散投資コア戦略ファンドA	191,355,961円
分散投資コア戦略ファンドS	144,966,325円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	16,109,577,023円
コア投資戦略ファンド(切替型)	153,978,668円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	7,954,288円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	8,161,573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 105,898,000円
	なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。
3. 計算日における受益権総数	196,747,344,191口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2886円 (12,886円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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>

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

(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

平成26年 5月11日現在

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	434,730,972	-	435,390,000	659,028
	合計	434,730,972	-	435,390,000	659,028

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
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」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,077,538,688
株式	134,730,881,340
派生商品評価勘定	28,450,860
未収入金	976,085,277
未収配当金	1,369,897,226
未収利息	1,439
差入委託証拠金	89,625,000
流動資産合計	138,272,479,830
資産合計	138,272,479,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,720
前受金	9,040,000
未払解約金	672,055,797
流動負債合計	681,435,517
負債合計	681,435,517
純資産の部	
元本等	
元本	142,631,424,917
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,040,380,604
元本等合計	137,591,044,313
純資産合計	137,591,044,313
負債純資産合計	138,272,479,830

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	147,700,483,382円
中間計算期間中の追加設定元本額	16,024,223,844円
中間計算期間中の一部解約元本額	21,093,282,309円
計算日の元本額	142,631,424,917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)	1,917,664,369円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,800,446,600円
SBI資産設計オープン(分配型)	20,644,192円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,300,541,631円
世界経済インデックスファンド	305,603,478円
マイセレクション25	63,414,548円
マイセレクション50	102,090,549円
マイセレクション75	112,351,843円
日本株式インデックス・オープン	17,681,557,809円
DCマイセレクション25	5,046,690,856円
DCマイセレクション50	16,503,593,006円
DCマイセレクション75	15,313,468,415円

DC日本株式インデックス・オープン	4,060,810,414円
DCマイセレクションS25	1,827,497,517円
DCマイセレクションS50	5,529,200,009円
DCマイセレクションS75	3,494,743,966円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,845,052,887円
DCターゲット・イヤール ファンド2015	13,479,471円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	463,519,526円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	473,946,659円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	227,494,943円
DC世界経済インデックスファンド	265,527,866円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	390,794,702円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	143,408,478円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	294,348,244円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	167,410,361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)	1,724,259,716円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24,373,558円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	847,567,880円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,123,259,271円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5,999,006,500円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,582,724,082円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,811,109,237円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,748,860,213円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,441,561,266円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,800,266,009円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2,530,981,062円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,033,019,773円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,347,806,027円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,123,809,867円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,489,517,522円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	119,557,955円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,548,486,725円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,426,806,742円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,294,020円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	31,293,108円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,459,617円
2. 計算日における受益権総数	142,631,424,917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 5,040,380,604円

4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9647円 (9,647円)
------------------------------	---------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

(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26年 5月11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	2,773,888,860	-	2,802,000,000	28,111,140
合計		2,773,888,860	-	2,802,000,000	28,111,140

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

「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26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	126,007,595
コール・ローン	2,579,506,143
国債証券	216,722,072,160
派生商品評価勘定	10,560,808
未収入金	1,941,491
未収利息	2,111,422,374
前払費用	116,184,054
差入委託証拠金	53,294,649
流動資産合計	221,720,989,274
資産合計	221,720,989,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,396,150
前受収益	20,544
未払金	211,244
未払解約金	406,443,513
流動負債合計	416,071,451
負債合計	416,071,451
純資産の部	
元本等	
元本	88,033,748,891
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	133,271,168,932
元本等合計	221,304,917,823
純資産合計	221,304,917,823
負債純資産合計	221,720,989,274

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
--	---------------

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	96,807,388,714円
中間計算期間中の追加設定元本額	9,116,078,238円
中間計算期間中の一部解約元本額	17,889,718,061円
計算日の元本額	88,033,748,891円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,179,128,946円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	207,538,473円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,741,756,497円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,252,534,917円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	669,739,051円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,330,865円

SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,758,150,659円
世界経済インデックスファンド	620,889,654円
マイセレクション25	12,800,154円
マイセレクション50	6,256,169円
マイセレクション75	4,443,191円
DCマイセレクション25	1,063,404,373円
DCマイセレクション50	954,232,198円
DCマイセレクション75	604,828,366円
DC外国債券インデックス・オープン	1,216,713,371円
DCマイセレクションS25	381,339,804円
DCマイセレクションS50	314,471,204円
DCマイセレクションS75	132,910,482円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,325,846円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	42,737,701円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	29,820,655円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	10,871,958円
DC世界経済インデックスファンド	568,555,954円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	11,829,110,161円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	271,183,338円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,055,932円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	6,853,193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)	236,805,875円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	821,769,463円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,258,797,751円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11,037,478,205円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,584,222,275円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,439,309,315円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,179,490,714円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,953,774,893円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,682,572,670円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,394,624,663円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,247,245,820円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,008,199,449円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	471,942,459円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	624,111,225円
F0Fs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,773,445,701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)	879,589,128円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	558,867,418円
外国債券ファンド・シリーズ1	151,702,006円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,058,494,837円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,594,534,395円
分散投資コア戦略ファンドA	74,476,070円
分散投資コア戦略ファンドS	181,492,653円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円

コア投資戦略ファンド(切替型)	195,782,125円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	22,817,461円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	23,567,564円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	46,957,702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)	10,623,457,143円
2. 計算日における受益権総数	88,033,748,891口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5139円 (25,139円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

(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

平成26年 5月11日現在

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	1,708,488,527	-	1,717,310,325	8,821,798
合計		1,708,488,527	-	1,717,310,325	8,821,798

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 5月11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	958,832,918	-	955,698,000	3,134,918
	カナダドル	95,855,006	-	96,655,200	800,194
	イギリスポンド	185,502,340	-	185,878,800	376,460
	ユーロ	1,118,556,776	-	1,112,857,900	5,698,876
	計	2,358,747,040	-	2,351,089,900	7,657,140
合計		2,358,747,040	-	2,351,089,900	7,657,140

(注)時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
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」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,272,957,348
コール・ローン	458,814,026
株式	154,686,650,844

投資信託受益証券	117,307,995
投資証券	3,440,299,059
派生商品評価勘定	132,606,099
未収入金	28,804,722
未収配当金	343,927,998
未収利息	612
差入委託証拠金	895,399,015
流動資産合計	165,376,767,718
資産合計	165,376,767,718
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,296,975
未払株式払込金	1,923,386
未払解約金	381,288,926
流動負債合計	384,509,287
負債合計	384,509,287
純資産の部	
元本等	
元本	98,635,357,735
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,356,900,696
元本等合計	164,992,258,431
純資産合計	164,992,258,431
負債純資産合計	165,376,767,718

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	107,252,940,490円
中間計算期間中の追加設定元本額	10,105,237,930円
中間計算期間中の一部解約元本額	18,722,820,685円
計算日の元本額	98,635,357,735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)	1,148,770,708円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,455,530円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	18,757,004,917円
世界経済インデックスファンド	987,955,896円
マイセレクション25	10,784,383円
マイセレクション50	27,195,591円
マイセレクション75	33,268,964円
外国株式インデックス・オープン	1,066,561,085円

DCマイセレクション25	858,782,895円
DCマイセレクション50	4,456,341,227円
DCマイセレクション75	4,650,073,887円
DC外国株式インデックス・オープン	5,629,841,128円
DCマイセレクションS25	315,729,201円
DCマイセレクションS50	1,479,927,414円
DCマイセレクションS75	1,005,093,458円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	4,036,463円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	138,947,954円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	142,099,123円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	68,199,851円
DC世界経済インデックスファンド	889,616,791円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	13,077,538,182円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	81,323,986円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,360,653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)	263,567,110円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	530,441,809円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,885,242,530円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,474,441,447円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,495,975,453円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,883,261,662円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	952,584,512円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,981,445,212円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	8,081,733,497円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,383,334,998円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	951,375,799円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,022,114,097円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	328,951,951円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,690,953,929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)	4,784,605,599円
外国株式ファンド・シリーズ1	618,402,749円
コア投資戦略ファンド(安定型)	922,812,107円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,858,615,607円
分散投資コア戦略ファンドA	64,909,044円
分散投資コア戦略ファンドS	212,097,463円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	233,701,076円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	108,502,020円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,985,638円
2. 計算日における受益権総数	98,635,357,735口

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6727円 (16,727円)
------------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11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)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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

(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26年 5月11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	6,551,385,048	-	6,682,797,530	131,412,482
合計		6,551,385,048	-	6,682,797,530	131,412,482

(注)1. 時価の算定方法

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

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 5月11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	43,807,368	-	43,718,100	89,268
	オーストラリアドル	7,600,000	-	7,611,200	11,200
	イギリスポンド	10,362,390	-	10,326,600	35,790
	計	61,769,758	-	61,655,900	113,858
	売 建				
	アメリカドル	10,167,800	-	10,167,000	800
	香港ドル	13,119,000	-	13,110,000	9,000
	ユーロ	14,069,700	-	14,069,000	700
計	37,356,500	-	37,346,000	10,500	
合計		99,126,258	-	99,001,900	103,358

(注)時価の算定方法

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

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

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

.ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

「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26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	431,711,374
投資証券	24,046,368,300
派生商品評価勘定	5,544,700
未収配当金	192,208,084
未収利息	576
差入委託証拠金	10,864,000
流動資産合計	24,686,697,034
資産合計	24,686,697,034
負債の部	
流動負債	
前受金	3,895,700

未払金	340,152,844
未払解約金	5,287,905
流動負債合計	349,336,449
負債合計	349,336,449
純資産の部	
元本等	
元本	20,196,797,093
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,140,563,492
元本等合計	24,337,360,585
純資産合計	24,337,360,585
負債純資産合計	24,686,697,034

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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配当金額を計上し、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26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	16,019,431,941円
中間計算期間中の追加設定元本額	5,474,745,261円
中間計算期間中の一部解約元本額	1,297,380,109円

計算日の元本額	20,196,797,093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)	773,226,546円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,444,698円
SMT J-REITインデックス・オープン	5,497,456,927円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	11,148,106,133円
コア投資戦略ファンド(安定型)	810,223,795円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,477,636,461円
分散投資コア戦略ファンドA	56,299,970円
分散投資コア戦略ファンドS	168,427,741円
コア投資戦略ファンド(切替型)	181,184,946円
J-REITインデックス・オープン	74,789,876円
2. 計算日における受益権総数	20,196,797,093口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2050円 (12,050円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

(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26年 5月11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	284,970,300	-	290,515,000	5,544,700
	合計	284,970,300	-	290,515,000	5,544,700

(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又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 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26年 5月11日現在
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26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	272,822,911
コール・ローン	95,362,828
投資証券	30,190,287,328
派生商品評価勘定	13,300
未収入金	502,220
未収配当金	77,691,971
未収利息	127
流動資産合計	30,636,680,685
資産合計	30,636,680,685
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	131,815
未払金	214,887,433
未払解約金	510,302
流動負債合計	215,529,550
負債合計	215,529,550

純資産の部	
元本等	
元本	23,715,925,628
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,705,225,507
元本等合計	30,421,151,135
純資産合計	30,421,151,135
負債純資産合計	30,636,680,685

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 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26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	20,717,981,137円

中間計算期間中の追加設定元本額	5,033,278,575円
中間計算期間中の一部解約元本額	2,035,334,084円
計算日の元本額	23,715,925,628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)	534,985,845円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	773,917,165円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,670,102円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	5,922,756,839円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	13,898,663,055円
コア投資戦略ファンド(安定型)	768,323,405円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,405,628,529円
分散投資コア戦略ファンドA	54,089,009円
分散投資コア戦略ファンドS	159,872,682円
コア投資戦略ファンド(切替型)	176,895,369円
グローバルREITインデックス・オープン	11,123,628円
2. 計算日における受益権総数	23,715,925,628口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2827円 (12,827円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 5月11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)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。</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	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。

(有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在

該当事項はありません。

(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26年 5月11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	66,210,700	-	66,085,500	125,200
	カナダドル	3,754,000	-	3,753,600	400
	オーストラリアドル	9,500,700	-	9,514,000	13,300
	イギリスポンド	4,303,075	-	4,302,750	325
	香港ドル	5,247,600	-	5,244,000	3,600
	シンガポールドル	4,891,740	-	4,891,200	540
	ユーロ	35,174,250	-	35,172,500	1,750
	計	129,082,065	-	128,963,550	118,515
	合計	129,082,065	-	128,963,550	118,515

(注)時価の算定方法

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

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

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

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在

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26年5月30日現在）

資産総額	9,282,418,119 円
負債総額	23,908,676 円
純資産総額(-)	9,258,509,443 円
発行済口数	7,818,718,207 口
1口当たり純資産額(/)	1.1841 円
1万口当たり純資産額	11,841 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	264,812,544,893 円
負債総額	7,583,171,742 円
純資産総額(-)	257,229,373,151 円
発行済口数	199,216,389,431 口
1口当たり純資産額(/)	1.2912 円
1万口当たり純資産額	12,912 円

国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	142,480,788,867 円
負債総額	373,492,460 円
純資産総額(-)	142,107,296,407 円
発行済口数	142,873,502,738 口
1口当たり純資産額(/)	0.9946 円
1万口当たり純資産額	9,946 円

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	222,990,908,397 円
負債総額	316,128,434 円
純資産総額(-)	222,674,779,963 円
発行済口数	88,844,919,833 口
1口当たり純資産額(/)	2.5063 円
1万口当たり純資産額	25,063 円

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	170,960,889,778 円
負債総額	2,128,626,441 円
純資産総額(-)	168,832,263,337 円
発行済口数	99,243,956,313 口
1口当たり純資産額(/)	1.7012 円

1万口当たり純資産額	17,012 円
------------	----------

J-REITインデックス マザーファンド

資産総額	26,848,172,818 円
負債総額	448,148,140 円
純資産総額(-)	26,400,024,678 円
発行済口数	20,974,964,621 口
1口当たり純資産額(/)	1.2586 円
1万口当たり純資産額	12,586 円

グローバルREITインデックス マザーファンド

資産総額	32,235,979,043 円
負債総額	476,464,352 円
純資産総額(-)	31,759,514,691 円
発行済口数	24,666,292,571 口
1口当たり純資産額(/)	1.2876 円
1万口当たり純資産額	12,876 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26年5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年間における資本金の額の増減	: 該当事項はありません。

（ロ）委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成26年8月11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26年5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	374	4,968,020
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	374	4,968,020

3【委託会社等の経理状況】

(1)委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「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、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)		当事業年度 (平成26年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		8,192,444		10,457,599
前払費用		81,751		114,325
未収委託者報酬		2,210,605		2,735,763
未収運用受託報酬		31,051		15,268
未収入金		676		-
繰延税金資産		61,743		144,183
その他		19,263		3,448
流動資産合計		10,597,535		13,470,589
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	79,281	1	67,359
器具備品	1	103,209	1	87,378
有形固定資産合計		182,491		154,737
無形固定資産				
ソフトウェア		168,561		203,360
その他		1,770		4,686
無形固定資産合計		170,332		208,046
投資その他の資産				
投資有価証券		47,112		69,583
長期前払費用		-		34,773
長期貸付金		31,838		28,838
会員権		25,000		25,000
繰延税金資産		-		117,743
その他		633		553
貸倒引当金		31,838		28,838
投資その他の資産合計		72,746		247,653
固定資産合計		425,570		610,437
資産合計		11,023,105		14,081,027

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日現在）	当事業年度 （平成26年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
固定負債		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		19,128,296		22,773,831
運用受託報酬		94,659		55,511
営業収益合計		19,222,955		22,829,342
営業費用				
支払手数料		9,030,246		10,451,296
広告宣伝費		73,287		76,961
公告費		2,244		-
調査費		4,132,154		5,091,105
調査費		207,030		259,236
委託調査費		3,922,394		4,830,390
図書費		2,729		1,479
営業雑経費		1,294,879		1,264,334
通信費		21,905		17,246
印刷費		330,735		327,214
協会費		21,939		22,524
諸会費		757		773
情報機器関連費		874,151		837,859
その他営業雑経費		45,391		58,716
営業費用合計		14,532,812		16,883,698
一般管理費				
給料		2,259,238		2,201,964
役員報酬		78,205		102,330
給料・手当		1,967,177		1,846,450
賞与		213,855		253,183
退職給付費用		64,787		72,029
役員退職慰労金		-		1,070
福利費		190,716		207,122
交際費		879		2,758
旅費交通費		45,160		45,973
租税公課		25,420		42,862
不動産賃借料		129,096		130,938
寄付金		-		3,385
減価償却費		129,966		119,445
諸経費	1	257,947	1	219,615
一般管理費合計		3,103,213		3,047,165
営業利益		1,586,929		2,898,479

（単位：千円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1 23,222
支払補償費	-	14,648
投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638
当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
合併による増加			2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496

当期末残高	4,998	4,998	8,546,410
-------	-------	-------	-----------

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成25年3月31日）		当事業年度 （平成26年3月31日）	
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	"	188,630	"
計	258,807	"	224,147	"

（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24年4月1日 至 平成25年3月31日）		当事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	
諸経費	97,199	千円	73,276	千円
長期前払費用償却	-	"	23,222	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

平成26年6月30日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
（2）未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
（4）未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1） 金融商品の時価の算定方法

（1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

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

（3）投資有価証券

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

（4）未払金、並びに（5）未払法人税等

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

（注2） 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	45,159	37,315	7,843
小計	45,159	37,315	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	1,952	2,030	77
小計	1,952	2,030	77
合計	47,112	39,345	7,766

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付債務	268,531	313,992
（2）退職給付引当金	268,531	313,992

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付費用	64,787	72,029

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成25年3月31日）		当事業年度 （平成26年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	〃	10,277	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	〃	33,736	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	〃	111,906	〃
減価償却超過額	1,067	〃	-	〃
その他	11,680	〃	13,094	〃
繰延税金資産 小計	171,228	〃	271,384	〃
評価性引当額	11,347	〃	-	〃
繰延税金資産 合計	159,881	〃	271,384	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	〃	1,503	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	〃	7,953	〃
繰延税金負債 合計	401,693	〃	9,457	〃
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	〃	261,926	〃

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

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

3．法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。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した法定実効税率は、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従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

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

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

（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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	97,199	-	-

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	73,276	-	-

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

（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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 会社	三井住友信託 銀行(株)	東京都 千代田区	342,037	信託業務 及び 銀行業務	-	営業上の 取引 役員の 兼任	投信販売 代行手数料等 の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用 の支払	2,226,006	その他 未払金	221,229

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(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25年3月31日）

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

当事業年度（平成26年3月31日）

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

（企業結合等関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、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

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(ロ) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年8月11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26年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成26年3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26年3月末日現在）

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

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

第3【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みます。）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26年1月10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24年11月13日から平成25年11月11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25年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年7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25年11月12日から平成26年5月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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な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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成26年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年11月12日から平成26年5月11日まで）の損益の状況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

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、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。
2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成26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	白川 芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 浩之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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