

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年8月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	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（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	S B I 資産設計オープン（資産成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【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。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）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又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。

当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、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及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又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又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。）。委託会社は、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。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

**( 7 ) 【申込期間】**

平成27年 8月11日から平成28年 2月10日までとします。

継続申込期間は、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り更新されます。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社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「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

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 >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(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従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(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従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、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及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及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

## 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。

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

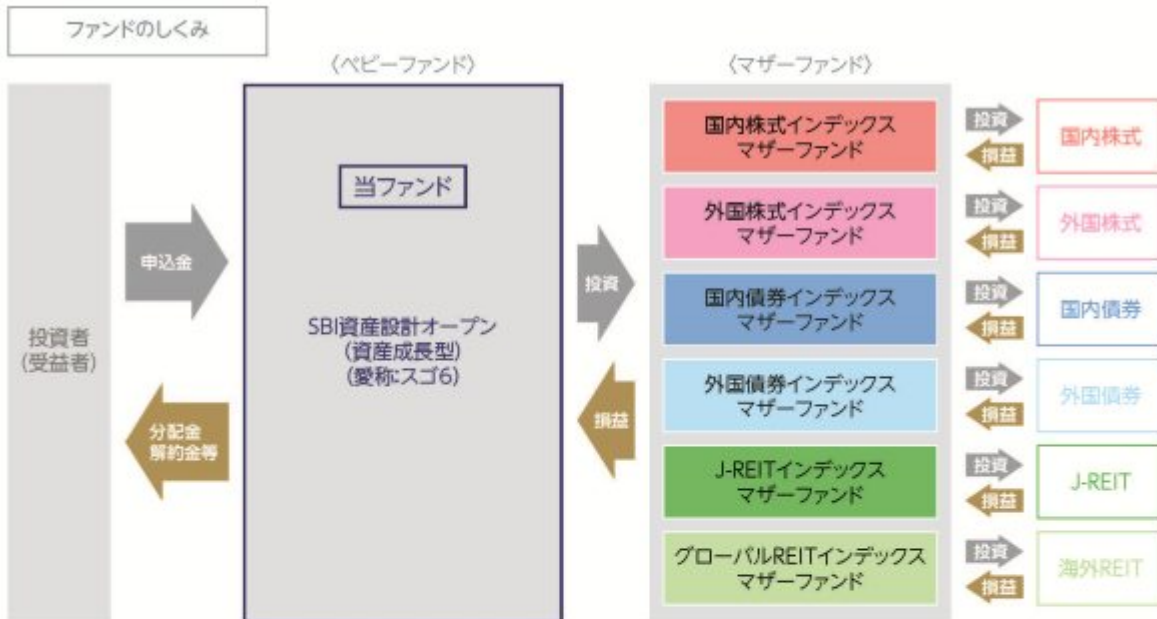
#### [ 特殊型 ]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

< ファンドの特色 >

# 1. 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。



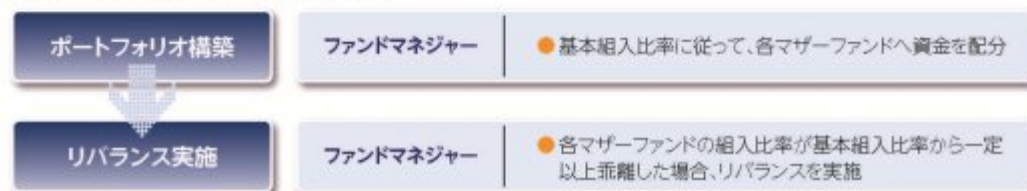
※各マザーファンド(J-REITインデックス マザーファンドを除く)の運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

## ? ファミリーファンド方式とは

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

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各マザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

# 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	TOPIX(東証株価指数)
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
国内債券	NOMURA-BPI 総合
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)
J - R E I T	東証REIT指数(配当込み)
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)

※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。

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

「MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の

株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

「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。

「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。

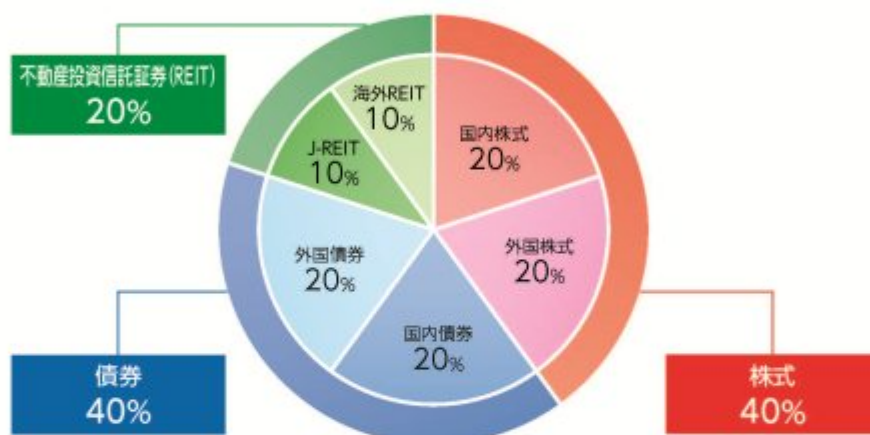
「東証REIT指数」とは、東証が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

「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<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> 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



- 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。)

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

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

## (2)【ファンドの沿革】

平成20年1月9日

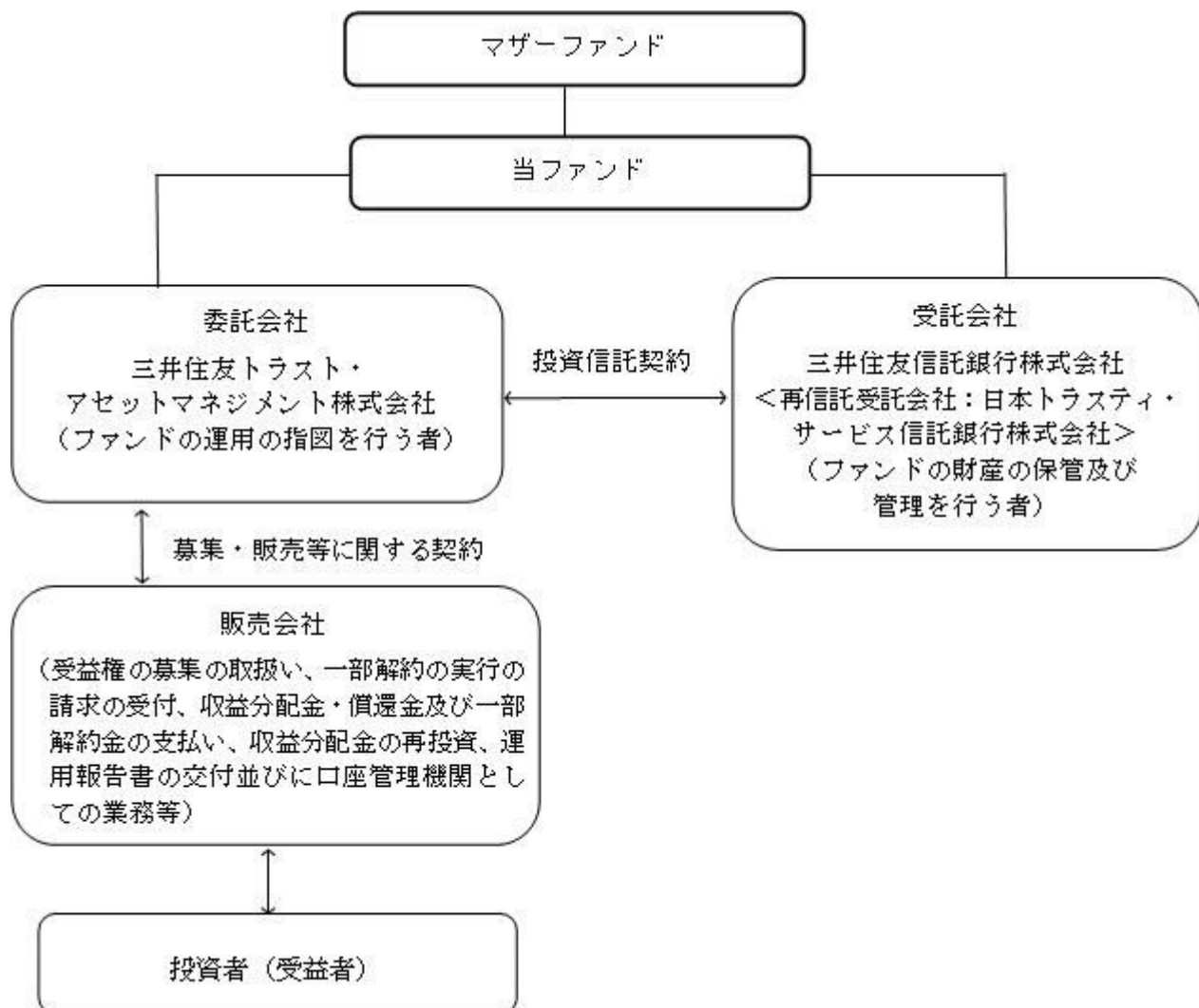
本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成27年 5月29日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年2月20日：	投資顧問業の登録
昭和62年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
平成2年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年3月25日：	証券投資信託委託業の認可

- 平成19年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 平成24年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### （イ）基本方針

本ファンドは、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。

## （２）【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．金銭債権

ハ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

（ロ）委託会社は、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）委託会社は、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、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を前記(八)に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (参考)マザーファンドの概要

### 「国内債券インデックス 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。

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

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



こととなる投資の指図をしません。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに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。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

### (2)投資態度

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

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

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

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

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

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

## 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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

### (2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

## 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「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10%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10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、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。）および不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、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。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「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10%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10%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。

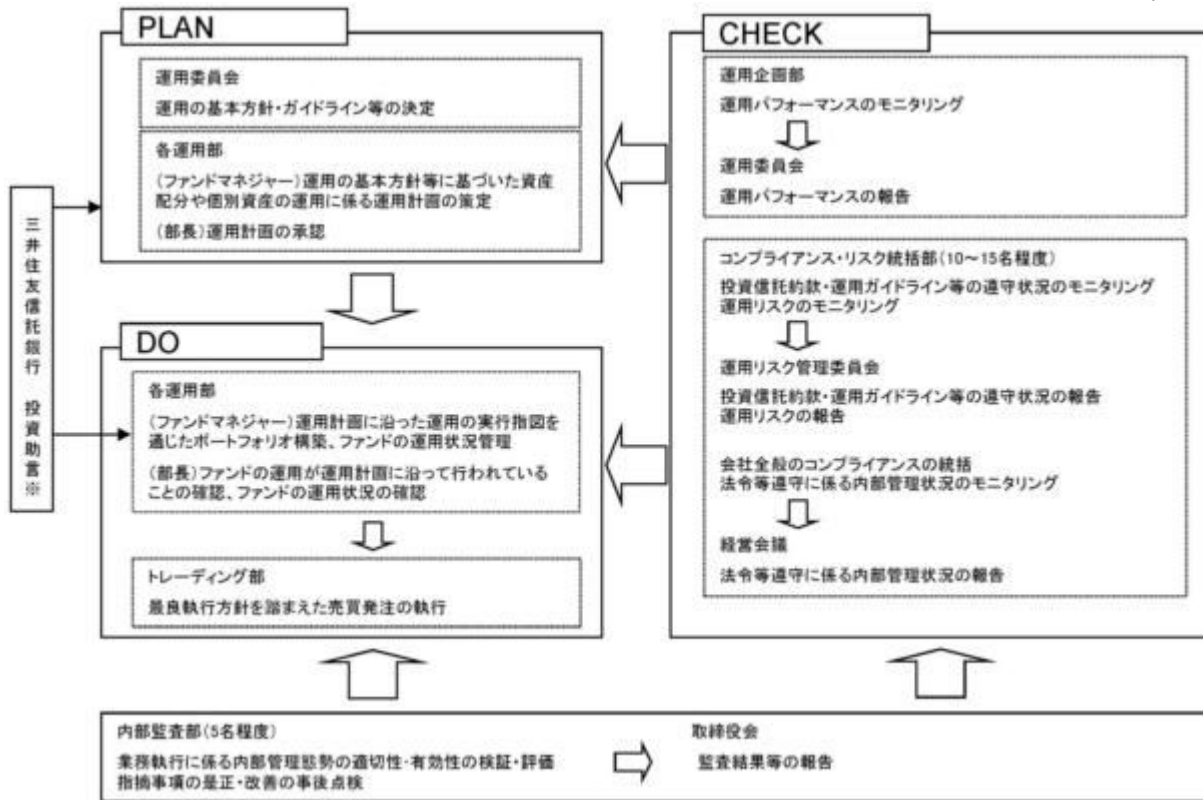
投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書および公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

### (3)【運用体制】

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



三井住友信託銀行は各マザーファンド（「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】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への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」）

委託会社は、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）

委託会社は、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）

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

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。

#### <その他の投資制限>

イ.当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

### 3【投資リスク】

#### （イ）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なり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が小さかった場合も同様です。

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリ



スクを実質的に負うこととなります。

## (ロ) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較



\*2010年6月～2015年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

#### \*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)<sup>※1</sup>

先進国株… MSCIロクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)<sup>※2</sup>

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

日本国債… NOMURA-BPI国債<sup>※4</sup>

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)<sup>※5</sup>

新興国債… JPMorganガバナメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド<sup>※6</sup>

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

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証に有しています。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ロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、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額（ ）として当該基準価額から控除します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられません。

## (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（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

内訳 (純資産総額に対し)	支払先	純資産総額			主な役務
		100億円以下の部分	100億円超300億円以下の部分	300億円超の部分	
	委託会社	年率 0.4104% (税抜 0.38%)	年率 0.3456% (税抜 0.32%)	年率 0.2808% (税抜 0.26%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
	販売会社	年率 0.2808% (税抜 0.26%)	年率 0.3456% (税抜 0.32%)	年率 0.4104% (税抜 0.38%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年率 0.0432% (税抜 0.04%)	年率 0.0432% (税抜 0.04%)	年率 0.0432% (税抜 0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

個人の受益者に対する課税

イ．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。）

ロ．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（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、上記イ．の表の通りです。

ハ．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、上場株式等の譲渡益及び申告分

離課税を選択した上場株式等の配当所得から控除することが可能です。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です。

なお、平成28年1月1日以降は、損益通算の対象に特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等が追加され、これらの所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能となります。

## 二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額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一定期間非課税となります。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。

### 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。ただし、株式投資信託（一部のETFを除く）に係る益金不算入制度は、法令改正により、平成27年4月1日をもって廃止され、同日以後に開始する法人の事業年度については適用されません。

	税 率（所得税のみ）
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。）

### 個別元本について

- イ．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。
- ロ．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。
- ハ．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。
- ニ．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「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。）

### 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、

- イ．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、
- ロ．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。

### 確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

適用されます。

上記は、平成27年 5月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、平成27年 5月29日現在の状況について記載してあります。

### 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

#### （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	17,481,711,059	98.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		269,896,914	1.52
合計（純資産総額）		17,751,607,973	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	2,766,219,565	1.1571	3,200,877,008	1.4114	3,904,242,294	21.99
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	1,739,722,763	1.9485	3,389,949,393	2.1973	3,822,692,827	21.53
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,151,144,053	2.7836	3,204,356,102	2.8802	3,315,525,101	18.68
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	2,018,162,307	1.3137	2,651,451,094	1.3215	2,667,001,488	15.02
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	1,139,727,852	1.5472	1,763,474,194	1.7055	1,943,805,851	10.95
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	1,179,260,560	1.4205	1,675,207,273	1.5505	1,828,443,498	10.30

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
----	---------

親投資信託受益証券	98.48
合計	98.48

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（平成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
第7期計算期間末（平成26年11月10日）	12,528,899,676	12,548,085,801	13,060	13,080
平成26年 5月末日	9,258,509,443		11,841	
6月末日	9,722,626,362		12,054	
7月末日	10,268,631,096		12,210	
8月末日	10,721,403,610		12,318	
9月末日	11,462,363,826		12,581	
10月末日	12,138,693,813		12,707	
11月末日	13,334,222,474		13,613	
12月末日	14,131,800,591		13,822	
平成27年 1月末日	14,626,931,775		13,680	
2月末日	15,372,086,479		14,006	
3月末日	16,052,573,424		14,057	
4月末日	16,812,186,967		14,130	
5月末日	17,751,607,973		14,491	

#### 【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
第7期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10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期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10日	18.4
第8期中間計算期間	平成26年11月11日～平成27年 5月10日	7.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	平成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期計算期間	平成25年11月12日～平成26年11月10日	4,666,930,535	1,897,207,667	9,593,062,711
第8期中間計算期間	平成26年11月11日～平成27年 5月10日	3,652,276,057	1,244,501,139	12,000,837,629

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	256,065,426,800	80.03
	ポーランド	201,622,000	0.06
	メキシコ	101,112,000	0.03
	小計	256,368,160,800	80.12
地方債証券	日本	19,484,388,393	6.09
特殊債券	日本	26,047,496,547	8.14
	アメリカ	209,114,000	0.07
	小計	26,256,610,547	8.21
社債券	日本	14,993,440,420	4.69
	アメリカ	506,053,000	0.16
	オランダ	405,141,000	0.13
	オーストラリア	403,035,000	0.13
	スウェーデン	302,342,000	0.09
	フランス	100,263,000	0.03
	小計	16,710,274,420	5.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,159,502,530	0.36
合計(純資産総額)		319,978,936,690	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。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第118回利付国債(5年)	4,880,000,000	100.30	4,894,842,100	100.62	4,910,548,800	0.200	2019/6/20	1.53
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	4,900,000,000	100.25	4,912,423,800	100.13	4,906,664,000	0.100	2019/12/20	1.53
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	4,520,000,000	100.21	4,529,516,900	100.64	4,549,108,800	0.200	2019/3/20	1.42
日本	国債証券	第113回利付国債(5年)	4,390,000,000	100.64	4,418,242,000	100.93	4,430,827,000	0.300	2018/6/20	1.38
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	4,360,000,000	100.03	4,361,517,100	100.07	4,363,095,600	0.100	2020/3/20	1.36
日本	国債証券	第120回利付国債(5年)	4,240,000,000	100.34	4,254,745,100	100.62	4,266,372,800	0.200	2019/9/20	1.33
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	4,020,000,000	100.26	4,030,520,000	100.67	4,047,094,800	0.200	2018/12/20	1.26
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	3,590,000,000	100.28	3,600,345,300	100.09	3,593,374,600	0.400	2025/3/20	1.12



日本	国債証券	第105回利付国債（5年）	3,500,000,000	100.29	3,510,321,500	100.42	3,514,700,000	0.200	2017/6/20	1.10
日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	3,260,000,000	100.32	3,270,723,400	100.47	3,275,354,600	0.200	2017/9/20	1.02
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	3,010,000,000	103.06	3,102,167,300	104.35	3,141,085,500	0.800	2022/9/20	0.98
日本	国債証券	第334回利付国債（10年）	2,950,000,000	100.68	2,970,090,300	102.32	3,018,646,500	0.600	2024/6/20	0.94
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	2,900,000,000	100.49	2,914,210,000	102.50	2,972,529,000	0.600	2023/12/20	0.93
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	2,860,000,000	100.38	2,870,914,300	101.30	2,897,323,000	0.500	2024/9/20	0.91
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	102.39	2,815,862,500	0.600	2024/3/20	0.88
日本	国債証券	第115回利付国債（5年）	2,660,000,000	100.29	2,667,907,200	100.66	2,677,556,000	0.200	2018/9/20	0.84
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	100.53	2,613,858,000	0.400	2016/9/20	0.82
日本	国債証券	第328回利付国債（10年）	2,540,000,000	101.37	2,574,828,900	102.75	2,609,977,000	0.600	2023/3/20	0.82
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	2,490,000,000	104.87	2,611,263,000	103.83	2,585,591,100	1.500	2017/12/20	0.81
日本	国債証券	第103回利付国債（5年）	2,500,000,000	100.56	2,514,180,500	100.55	2,513,925,000	0.300	2017/3/20	0.79
日本	国債証券	第321回利付国債（10年）	2,330,000,000	104.87	2,443,572,400	105.75	2,464,068,200	1.000	2022/3/20	0.77
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,300,000,000	102.75	2,363,345,600	104.25	2,397,911,000	0.800	2023/6/20	0.75
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	104.21	2,334,483,200	0.800	2023/9/20	0.73
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,170,000,000	106.08	2,302,076,200	105.98	2,299,852,800	1.200	2020/12/20	0.72
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	100.48	2,290,944,000	0.300	2016/12/20	0.72
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,160,000,000	106.03	2,290,296,800	105.60	2,281,024,800	1.300	2019/12/20	0.71
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	2,100,000,000	104.89	2,202,762,600	105.61	2,217,936,000	1.000	2021/12/20	0.69
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	104.93	2,203,614,000	1.500	2018/9/20	0.69
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	2,050,000,000	106.49	2,183,130,000	106.42	2,181,651,000	1.200	2021/6/20	0.68
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	103.92	2,172,011,600	1.700	2017/9/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.12
地方債証券	6.09
特殊債券	8.21
社債券	5.22
合計	99.64

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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

## 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	154,204,742,110	97.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,233,928,237	2.05
合計(純資産総額)		157,438,670,347	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,840,700,000	1.80

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	868,700	5,680.13	4,934,328,931	8,604.00	7,474,294,800	4.75
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,985,800	579.11	2,887,326,638	921.20	4,592,918,960	2.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	469,900	4,103.22	1,928,103,078	5,670.00	2,664,333,000	1.69
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	328,600	7,264.40	2,387,081,840	7,447.00	2,447,084,200	1.55

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	566,600	3,533.15	2,001,882,790	4,261.00	2,414,282,600	1.53
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	8,664,100	197.92	1,714,798,672	274.60	2,379,161,860	1.51
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	243,200	5,992.23	1,457,310,336	8,669.00	2,108,300,800	1.34
日本	株式	ファナック	電気機器	65,600	17,504.18	1,148,274,208	27,540.00	1,806,624,000	1.15
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	391,000	3,440.23	1,345,129,930	4,540.00	1,775,140,000	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	631,300	2,005.67	1,266,179,471	2,811.00	1,774,584,300	1.13
日本	株式	ソニー	電気機器	411,600	1,720.69	708,236,004	3,862.00	1,589,599,200	1.01
日本	株式	キヤノン	電気機器	365,000	3,330.09	1,215,482,850	4,292.00	1,566,580,000	1.00
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	247,100	4,624.34	1,142,674,414	6,040.00	1,492,484,000	0.95
日本	株式	パナソニック	電気機器	767,300	1,108.71	850,713,183	1,831.00	1,404,926,300	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	751,000	1,300.11	976,382,610	1,812.00	1,360,812,000	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	259,900	4,083.93	1,061,413,407	5,157.00	1,340,304,300	0.85
日本	株式	村田製作所	電気機器	66,100	8,651.09	571,837,049	20,235.00	1,337,533,500	0.85
日本	株式	三菱商事	卸売業	476,200	2,014.73	959,414,426	2,787.00	1,327,169,400	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	115,400	7,706.85	889,370,490	11,365.00	1,311,521,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	251,800	3,173.09	798,984,062	5,144.00	1,295,259,200	0.82
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,512,000	682.78	1,032,363,360	850.00	1,285,200,000	0.82
日本	株式	三菱地所	不動産業	462,000	2,484.39	1,147,788,180	2,779.00	1,283,898,000	0.82
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	56,400	13,520.22	762,540,408	21,625.00	1,219,650,000	0.77
日本	株式	三井不動産	不動産業	329,000	3,201.51	1,053,296,790	3,626.50	1,193,118,500	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	883,800	928.57	820,670,166	1,300.50	1,149,381,900	0.73
日本	株式	三菱電機	電気機器	630,000	1,191.18	750,443,400	1,705.00	1,074,150,000	0.68
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	479,200	1,692.17	810,887,864	2,236.00	1,071,491,200	0.68
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	206,600	3,617.22	747,317,652	5,176.00	1,069,361,600	0.68
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,271,000	679.37	863,479,270	823.60	1,046,795,600	0.66
日本	株式	デンソー	輸送用機器	155,700	4,718.98	734,745,186	6,511.00	1,013,762,700	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.07
		鉱業	0.41
		建設業	2.54
		食料品	3.95
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.23
		化学	5.74
		医薬品	4.52

石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.92
ガラス・土石製品	0.92
鉄鋼	1.48
非鉄金属	0.96
金属製品	0.60
機械	4.99
電気機器	12.82
輸送用機器	11.34
精密機器	1.28
その他製品	1.49
電気・ガス業	2.08
陸運業	3.84
海運業	0.29
空運業	0.60
倉庫・運輸関連業	0.20
情報・通信業	6.48
卸売業	4.09
小売業	4.26
銀行業	9.57
証券、商品先物取引業	1.34
保険業	2.61
その他金融業	1.26
不動産業	2.86
サービス業	2.99
小計	97.95
合計	97.95

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	170円		2,778,192,360	2,840,700,000	1.80

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	90,500,389,551	41.59
	イタリア	20,842,226,497	9.58
	フランス	20,286,623,718	9.32
	イギリス	18,126,362,059	8.33
	ドイツ	16,236,112,173	7.46
	スペイン	11,421,212,327	5.25
	ベルギー	5,461,679,660	2.51
	オランダ	5,426,965,119	2.49
	カナダ	4,948,574,501	2.27
	オーストラリア	3,723,736,166	1.71
	オーストリア	3,404,355,224	1.56
	メキシコ	2,318,050,284	1.07
	アイルランド	1,666,328,162	0.77
	デンマーク	1,504,954,830	0.69
	フィンランド	1,256,032,167	0.58
	ポーランド	1,234,670,573	0.57
	マレーシア	1,150,253,573	0.53
	南アフリカ	1,138,797,129	0.52
	スウェーデン	1,086,792,770	0.50
	シンガポール	796,032,963	0.37
スイス	647,084,610	0.30	
ノルウェー	593,609,511	0.27	
	小計	213,770,843,567	98.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,827,304,364	1.76
合計(純資産総額)		217,598,147,931	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	569,296,242	0.26
	買建	ドイツ	946,953,781	0.44

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		7,078,480,784	3.25

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	12,429.79	1,653,162,082	12,411.42	1,650,719,389	0.625	2016/7/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/15/16	13,000,000	12,375.96	1,608,876,037	12,402.24	1,612,291,312	0.625	2016/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	12,418.19	1,490,182,849	12,421.33	1,490,559,844	0.750	2017/1/15	0.69
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/43	11,500,000	11,589.66	1,332,811,920	12,279.96	1,412,195,498	2.875	2043/5/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/24	10,600,000	12,844.38	1,361,504,959	13,055.93	1,383,928,746	2.750	2024/2/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/17	10,000,000	12,453.23	1,245,323,123	12,444.77	1,244,477,305	0.875	2017/1/31	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/15/16	10,000,000	12,385.99	1,238,599,785	12,398.85	1,239,885,759	0.625	2016/12/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	13,162.98	1,250,483,774	12,901.26	1,225,620,561	3.000	2017/2/28	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/31/16	9,500,000	12,662.52	1,202,940,179	12,552.55	1,192,492,584	1.750	2016/5/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.75% 12/31/17	9,100,000	13,079.37	1,190,223,086	12,979.08	1,181,096,619	2.750	2017/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	12,315.48	1,157,655,576	12,417.22	1,167,219,039	1.250	2018/11/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	13,083.48	1,138,262,839	12,774.88	1,111,414,633	3.000	2016/8/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 1% 06/30/19	9,000,000	12,045.55	1,084,099,548	12,223.65	1,100,128,865	1.000	2019/6/30	0.51
アメリカ	国債証券	T 0.875% 08/15/17	8,800,000	12,394.28	1,090,696,777	12,417.46	1,092,736,961	0.875	2017/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	8,500,000	12,321.64	1,047,339,682	12,652.35	1,075,450,532	2.375	2024/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/15/24	8,400,000	12,380.49	1,039,961,910	12,792.28	1,074,551,552	2.500	2024/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.25% 01/31/20	8,520,000	12,239.12	1,042,773,377	12,257.72	1,044,358,430	1.250	2020/1/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	8,000,000	13,102.33	1,048,186,426	12,895.71	1,031,656,870	2.750	2017/5/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	8,150,000	12,764.59	1,040,314,664	12,504.22	1,019,094,051	2.250	2024/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/44	7,500,000	12,465.79	934,934,812	13,524.26	1,014,320,178	3.375	2044/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 08/31/17	7,900,000	12,768.83	1,008,738,310	12,689.81	1,002,495,502	1.875	2017/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	7,900,000	12,522.10	989,246,239	12,469.18	985,065,280	1.000	2016/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	7,000,000	13,708.89	959,622,814	13,687.14	958,100,357	3.625	2021/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 08/31/19	7,500,000	12,287.50	921,562,693	12,512.19	938,414,719	1.625	2019/8/31	0.43
イギリス	国債証券	UKT 4.75% 03/07/20	4,150,000	21,870.69	907,633,720	22,041.30	914,714,112	4.750	2020/3/7	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/16	7,300,000	12,403.93	905,487,072	12,409.24	905,875,180	0.625	2016/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/15/23	6,900,000	12,815.43	884,265,198	13,075.26	902,193,242	2.750	2023/11/15	0.41

フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000	14,939.02	911,280,825	14,574.00	889,014,409	3.750	2017/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 11/15/22	7,150,000	11,754.35	840,436,025	12,112.97	866,077,621	1.625	2022/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/31/17	7,000,000	12,209.80	854,686,009	12,346.65	864,266,130	0.625	2017/8/31	0.40

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.24
合計	98.24

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	19	アメリカドル	2,269,021.31	280,746,007	2,270,945.36	280,984,069	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	11	アメリカドル	1,400,528.42	173,287,381	1,401,296.93	173,382,469	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	6	アメリカドル	928,524.02	114,886,277	928,875	114,929,704	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	12	ユーロ	1,334,313	180,946,185	1,334,220	180,933,574	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,928,880	261,575,417	1,931,100	261,876,471	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	24	ユーロ	3,696,536	501,287,247	3,717,600	504,143,736	0.23

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	24,100,000.00	2,967,102,590	2,981,440,500	1.37
	カナダドル	買建	1,900,000.00	188,541,350	189,198,500	0.08
	メキシコペソ	買建	7,000,000.00	56,616,000	56,490,000	0.02
	ユーロ	買建	22,010,000.00	2,968,863,900	2,984,487,400	1.37

イギリスポンド	買建	3,220,000.00	610,295,070	610,292,200	0.28
スウェーデンクローナ	買建	2,720,000.00	39,565,120	39,766,400	0.01
デンマーククローネ	買建	1,750,000.00	31,671,500	31,815,000	0.01
ポーランドズロチ	買建	1,560,000.00	51,026,040	51,058,800	0.02
オーストラリアドル	買建	860,000.00	82,366,500	81,528,000	0.03
マレーシアリングギット	買建	725,720.55	24,664,338	24,659,984	0.01
南アフリカランド	買建	2,720,000.00	27,972,480	27,744,000	0.01

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	151,883,933,947	55.83
	イギリス	21,994,385,267	8.08
	スイス	11,180,554,131	4.11
	カナダ	10,452,119,674	3.84
	フランス	10,118,575,770	3.72
	ドイツ	10,072,867,249	3.70
	オーストラリア	6,931,057,998	2.55
	オランダ	4,547,691,850	1.67
	アイルランド	4,453,234,152	1.64
	スペイン	3,899,874,515	1.43
	スウェーデン	3,340,561,913	1.23
	香港	2,909,152,429	1.07
	イタリア	2,425,445,500	0.89
	デンマーク	1,854,019,366	0.68
	シンガポール	1,719,186,514	0.63
	ジャージー	1,505,728,617	0.55
	ベルギー	1,439,553,268	0.53
	バミューダ	1,053,307,383	0.39
	キュラソー	956,264,343	0.35
	フィンランド	927,646,672	0.34
	イスラエル	660,453,748	0.24
	ノルウェー	649,267,489	0.24
	ルクセンブルク	437,930,385	0.16
ケイマン	355,915,788	0.13	
オーストリア	194,631,653	0.07	



	ポルトガル	170,218,033	0.06
	パナマ	165,314,360	0.06
	ニュージーランド	155,188,696	0.06
	リベリア	106,990,024	0.04
	英ヴァージン諸島	78,847,883	0.03
	マン島	36,136,050	0.01
	モーリシャス	15,983,509	0.01
	小計	256,692,038,176	94.36
投資信託受益証券	オーストラリア	154,841,118	0.06
	香港	29,278,141	0.01
	シンガポール	27,070,268	0.01
	小計	211,189,527	0.08
投資証券	アメリカ	4,435,475,416	1.63
	オーストラリア	584,562,285	0.21
	イギリス	387,239,228	0.14
	フランス	373,664,905	0.14
	シンガポール	110,215,481	0.04
	香港	104,748,672	0.04
	カナダ	50,735,827	0.02
	小計	6,046,641,814	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,098,699,550	3.34
合計(純資産総額)		272,048,569,067	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,709,765,216	2.10
	買建	カナダ	421,087,329	0.15
	買建	ドイツ	1,591,350,910	0.58
	買建	イギリス	919,220,190	0.34
	買建	オーストラリア	461,788,909	0.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		634,515,100	0.23

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	391,468	11,547.51	4,520,482,280	16,305.13	6,382,940,311	2.35
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	524,054	5,070.09	2,657,003,904	5,870.98	3,076,715,007	1.13
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	280,380	12,283.87	3,444,152,489	10,530.66	2,952,586,535	1.09
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	186,444	12,487.35	2,328,192,165	12,515.28	2,333,400,636	0.86
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	674,756	3,258.22	2,198,509,205	3,418.65	2,306,761,279	0.85
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	328,230	6,286.43	2,063,398,190	6,954.86	2,282,794,781	0.84
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	216,451	9,209.56	1,993,418,597	9,676.73	2,094,539,509	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	250,016	6,955.18	1,738,906,794	8,190.92	2,047,862,555	0.75
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	154,415	10,881.89	1,680,328,195	12,917.62	1,994,674,987	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,126	10,037.72	1,818,093,530	9,815.50	1,777,842,416	0.65
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	410,442	3,699.52	1,518,441,260	4,261.26	1,749,000,569	0.64
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	47,181	35,012.38	1,651,919,254	37,066.82	1,748,849,870	0.64
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	278,719	6,126.83	1,707,665,534	6,129.58	1,708,431,579	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	126,154	14,914.77	1,881,558,314	12,773.88	1,611,476,714	0.59
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,311,820	1,186.64	1,556,666,173	1,182.15	1,550,779,190	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	348,231	4,336.76	1,510,196,555	4,305.80	1,499,414,433	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	108,329	10,611.81	1,149,567,658	13,675.87	1,481,494,069	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	705,869	1,901.91	1,342,501,787	2,062.57	1,455,910,647	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	278,182	5,050.64	1,404,997,380	5,090.25	1,416,016,537	0.52

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	190,497	7,031.88	1,339,553,088	7,386.68	1,407,140,570	0.52
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	26,486	39,156.71	1,037,104,875	52,779.50	1,397,917,999	0.51
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	99,903	10,716.15	1,070,575,861	13,962.93	1,394,938,646	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	77,520	16,174.49	1,253,846,697	17,908.68	1,388,280,889	0.51
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	20,686	68,624.15	1,419,559,168	66,786.97	1,381,555,456	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	203,595	5,964.06	1,214,254,785	6,749.47	1,374,158,650	0.51
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	135,496	8,325.69	1,128,098,050	9,916.34	1,343,624,520	0.49
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	63,225	22,273.40	1,408,236,026	21,245.67	1,343,258,011	0.49
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	318,104	3,497.84	1,112,679,154	4,208.05	1,338,599,859	0.49
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	19,316	70,043.02	1,352,951,040	68,568.69	1,324,472,843	0.49
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	235,003	5,120.74	1,203,391,345	5,426.79	1,275,313,763	0.47

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.73
		素材	4.92
		資本財	6.93
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.80
		耐久消費財・アパレル	1.66
		消費者サービス	1.66
		メディア	3.14
		小売	3.36
		食品・生活必需品小売り	2.06
		食品・飲料・タバコ	6.01
		家庭用品・パーソナル用品	1.62
		ヘルスケア機器・サービス	3.49
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.02
銀行	9.12		

	各種金融	4.03
	保険	4.08
	不動産	0.70
	ソフトウェア・サービス	7.08
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.43
	電気通信サービス	2.95
	公益事業	3.07
	半導体・半導体製造装置	1.79
	小計	94.36
投資信託受益証券		0.08
投資証券		2.22
合計		96.66

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 FUTU	買建	87	アメリカドル	45,386,341.5	5,615,652,033	46,146,975	5,709,765,216	2.10
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	4,213,244	419,681,234	4,227,360	421,087,329	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	39	スイスフラン	3,564,783	467,735,177	3,658,980	480,094,765	0.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	225	ユーロ	8,165,662.5	1,107,345,492	8,194,500	1,111,256,145	0.41
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	34	オーストラリアドル	4,926,963	467,223,901	4,869,650	461,788,909	0.17
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	69	イギリスポンド	4,779,923.75	906,130,145	4,848,975	919,220,190	0.34

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,880,000.00	356,175,600	356,313,600	0.13

カナダドル	買建	270,000.00	26,814,780	26,892,000	0.00
ユーロ	買建	700,000.00	94,465,700	94,920,000	0.03
イギリスポンド	買建	250,000.00	47,467,000	47,387,500	0.01
スイスフラン	買建	200,000.00	26,064,000	26,242,000	0.00
オーストラリアドル	買建	200,000.00	19,155,000	18,960,000	0.00
香港ドル	買建	4,000,000.00	63,832,000	63,800,000	0.02

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

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

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	55,905,469,900	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		492,907,733	0.87
合計(純資産総額)		56,398,377,633	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	487,026,000	0.86

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7,269	581,019.5	4,223,430,788	581,000	4,223,289,000	7.49
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6,740	566,854.8	3,820,601,353	572,000	3,855,280,000	6.84
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	12,510	225,462.47	2,820,535,576	249,400	3,119,994,000	5.53
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	13,613	184,334.54	2,509,346,102	186,100	2,533,379,300	4.49

日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	8,910	255,767.08	2,278,884,729	239,500	2,133,945,000	3.78
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	11,509	160,212.59	1,843,886,739	176,800	2,034,791,200	3.61
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	6,692	279,211.91	1,868,486,125	299,800	2,006,261,600	3.56
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	4,247	403,279.88	1,712,729,655	409,500	1,739,146,500	3.08
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	6,795	203,272.03	1,381,233,446	232,400	1,579,158,000	2.80
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,427	969,032.26	1,382,809,044	1,063,000	1,516,901,000	2.69
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	2,553	513,504.63	1,310,977,342	589,000	1,503,717,000	2.67
日本	投資証券	GLP投資法人	12,307	132,633.09	1,632,315,551	121,900	1,500,223,300	2.66
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,270	601,836.68	1,366,169,273	614,000	1,393,780,000	2.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,573	147,285.4	1,262,677,774	159,500	1,367,393,500	2.42
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	2,084	619,989.18	1,292,057,459	650,000	1,354,600,000	2.40
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	8,082	157,984.77	1,276,832,973	165,800	1,339,995,600	2.38
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	15,445	74,201.54	1,146,042,786	85,000	1,312,825,000	2.33
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	2,494	414,239.91	1,033,114,353	476,500	1,188,391,000	2.11
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	4,273	251,798.78	1,075,936,200	255,500	1,091,751,500	1.94
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,918	493,488.26	946,510,485	568,000	1,089,424,000	1.93
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	3,849	249,431.01	960,059,994	279,200	1,074,640,800	1.91
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,815	521,864.82	947,184,660	581,000	1,054,515,000	1.87
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	6,243	146,436.62	914,203,844	157,000	980,151,000	1.74
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,805	536,200.77	967,842,394	536,000	967,480,000	1.72
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,356	528,190.5	716,226,327	680,000	922,080,000	1.63
日本	投資証券	イオンリート投資法人	5,612	157,702.43	885,026,057	160,300	899,603,600	1.60
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	13,738	42,759.27	587,426,897	64,700	888,848,600	1.58
日本	投資証券	福岡リート投資法人	3,845	205,598.1	790,524,727	218,800	841,286,000	1.49
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	5,033	151,261.71	761,300,193	162,100	815,849,300	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	4,020	169,039.73	679,539,717	180,300	724,806,000	1.29

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13
合計	99.13

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	261	円	484,553,600	487,026,000	0.86

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	37,064,068,232	69.67
	オーストラリア	4,341,712,515	8.16
	イギリス	3,791,569,354	7.13
	フランス	2,566,137,277	4.82
	シンガポール	1,832,193,927	3.44
	カナダ	1,147,718,493	2.16
	香港	890,646,842	1.67
	オランダ	275,695,943	0.52
	ベルギー	261,729,117	0.49
	ニュージーランド	239,515,735	0.45
	スペイン	204,517,380	0.38
	アイルランド	132,655,125	0.25
	ドイツ	81,884,464	0.15
	イタリア	55,664,398	0.10
	マン島	44,744,967	0.08
	イスラエル	26,522,939	0.05
	小計	52,956,976,708	99.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		246,174,208	0.46
合計(純資産総額)		53,203,150,916	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		230,747,700	0.43

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	132,120	22,451.26	2,966,260,723	22,744.04	3,004,943,701	5.65
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	61,460	23,255.34	1,429,273,399	24,191.68	1,486,821,243	2.79
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	154,070	8,745.24	1,347,379,258	9,266.13	1,427,634,144	2.68
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	41,500	28,317.67	1,175,183,369	32,587.08	1,352,363,945	2.54
アメリカ	投資証券	HEALTH CARE REIT INC	148,070	8,912.85	1,319,726,765	8,763.79	1,297,655,259	2.44
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	141,040	8,664.69	1,222,068,741	8,305.99	1,171,477,521	2.20
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	56,310	19,778.76	1,113,742,170	20,759.41	1,168,962,906	2.20
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	216,160	5,166.31	1,116,751,564	4,981.36	1,076,772,896	2.02
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	64,660	16,006.70	1,034,993,513	16,276.68	1,052,450,226	1.98
アメリカ	投資証券	HCP INC	194,600	5,346.92	1,040,511,639	4,840.31	941,925,805	1.77
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	265,390	3,234.67	858,449,258	3,534.96	938,144,653	1.76
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	73,810	12,406.13	915,697,178	12,544.98	925,945,321	1.74
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	342,020	2,157.65	737,959,586	2,523.17	862,976,895	1.62
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,273,330	341.10	775,449,717	372.68	847,228,944	1.59
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	323,860	2,785.34	902,062,121	2,485.73	805,030,364	1.51
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	27,860	25,435.03	708,620,123	27,836.77	775,532,563	1.46
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	807,690	788.28	636,693,255	898.04	725,338,008	1.36
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	432,820	1,415.03	612,456,868	1,656.84	717,114,268	1.35
香港	投資証券	LINK REIT	964,000	745.53	718,692,457	715.00	689,267,712	1.30
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	42,250	14,403.66	608,555,032	14,840.17	626,997,444	1.18
アメリカ	投資証券	MACERICH CO/THE	59,990	8,883.53	532,923,259	10,134.72	607,982,111	1.14
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	95,430	5,880.39	561,165,711	5,696.52	543,619,781	1.02
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	173,090	3,105.05	537,454,455	3,009.11	520,847,473	0.98
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,500	16,616.91	490,199,125	16,785.21	495,163,748	0.93
フランス	投資証券	KLEPIERRE	87,900	5,128.66	450,809,912	5,630.52	494,923,341	0.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	57,560	8,396.53	483,304,410	8,228.04	473,606,270	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	109,990	3,791.73	417,052,607	4,097.93	450,732,157	0.85
アメリカ	投資証券	AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	384,300	1,099.89	422,690,429	1,124.70	432,224,400	0.81
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	329,960	1,168.69	385,622,955	1,282.44	423,154,249	0.80
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	47,620	7,387.23	351,780,186	8,740.28	416,212,476	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。

#### ロ. 種類別投資比率



種類	投資比率（％）
投資証券	99.54
合計	99.54

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,610,000.00	199,117,200	199,189,200	0.37
	ユーロ	買建	30,000.00	4,048,530	4,068,000	0.00
	イギリスポンド	買建	30,000.00	5,696,040	5,686,500	0.01
	オーストラリアドル	買建	230,000.00	21,910,650	21,804,000	0.04

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

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

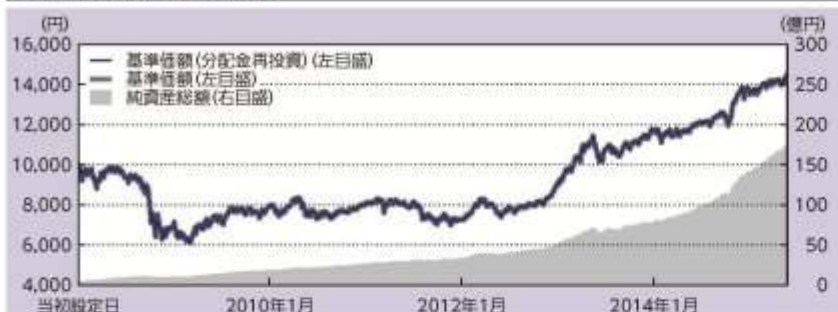
#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2008年1月9日  
作成基準日：2015年5月29日

### 基準価額・純資産の推移



基準価額	14,491円
純資産総額	177.52億円

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。  
※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:40円

決算期	2010年11月	2011年11月	2012年11月	2013年11月	2014年11月
分配金	0円	0円	0円	20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
国内株式 インデックス マザーファンド	22.0%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.0%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.6%
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	-	-	0.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	18.7%	T 0.625% 07/15/16	アメリカ	国債	-	0.625%	2016/07/15	0.1%
		T 0.625% 11/15/16	アメリカ	国債	-	0.625%	2016/11/15	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	15.0%	第118回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.2%	2019/06/20	0.2%
		第122回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.1%	2019/12/20	0.2%
グローバル REITインデックス マザーファンド	11.0%	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
		PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%
J-REIT インデックス マザーファンド	10.3%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2008年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2015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】

### < 申込手続 >

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

### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

### < 申込みの受付 >

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

### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

### < 申込手数料 >

ありません。

### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

### < 申込受付の中止等 >

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

### <その他>

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

### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行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。

### <一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

### <一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

### <解約価額>

一部解約の実行の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%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

### <一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

#### < 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けませんとします。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、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、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記< 解約価額 >の規定に準じて計算された価額とします。

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

#### < 基準価額の算出方法 >

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

##### ・ 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。

##### ・ 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。）

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（平成20年 1月 9日設定）

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

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

##### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

###### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

###### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

受益者（委託会社及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会社を除きます。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、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記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議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還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全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、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

##### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

###### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

受益者（委託会社及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会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じ、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記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議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合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全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。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンド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。

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約



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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

上記 の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社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、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記 に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が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、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(平成25年11月12日から平成26年11月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （平成25年11月11日現在）	第7期 （平成26年11月10日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	243,442,482	334,955,680
親投資信託受益証券	7,351,922,283	12,292,937,700
未収入金	-	8,700,000
未収利息	331	363
<b>流動資産合計</b>	<b>7,595,365,096</b>	<b>12,636,593,743</b>
<b>資産合計</b>	<b>7,595,365,096</b>	<b>12,636,593,743</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	13,646,679	19,186,125
未払解約金	15,614,303	49,584,655
未払受託者報酬	1,488,500	2,260,366
未払委託者報酬	23,815,970	36,165,870
その他未払費用	333,467	497,051
<b>流動負債合計</b>	<b>54,898,919</b>	<b>107,694,067</b>
<b>負債合計</b>	<b>54,898,919</b>	<b>107,694,067</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	6,823,339,843	9,593,062,711
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	717,126,334	2,935,836,965
（分配準備積立金）	1,508,410,867	2,714,479,589
<b>元本等合計</b>	<b>7,540,466,177</b>	<b>12,528,899,676</b>
<b>純資産合計</b>	<b>7,540,466,177</b>	<b>12,528,899,676</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>7,595,365,096</b>	<b>12,636,593,743</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自	平成24年11月13日 至 平成25年11月11日	自	平成25年11月12日 至 平成26年11月10日
営業収益				
受取利息		85,573		149,140
有価証券売買等損益		1,855,003,780		1,740,775,417
営業収益合計		1,855,089,353		1,740,924,557
営業費用				
受託者報酬		2,668,706		3,977,352
委託者報酬		42,699,152		63,637,567
その他費用		333,467		497,051
営業費用合計		45,701,325		68,111,970
営業利益又は営業損失（ ）		1,809,388,028		1,672,812,587
経常利益又は経常損失（ ）		1,809,388,028		1,672,812,587
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,809,388,028		1,672,812,587
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（ ）		323,696,887		111,773,424
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,122,289,219		717,126,334
剰余金増加額又は欠損金減少額		367,371,091		897,405,178
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		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		897,405,178
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		220,547,585
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		220,547,585
分配金		13,646,679		19,186,125
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		717,126,334		2,935,836,965

## ( 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 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期計算期間は平成25年11月12日から平成26年11月10日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第6期 (平成25年11月11日現在)	第7期 (平成26年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,823,339,843口	9,593,062,711口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1051円 (11,051円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3060円 (13,060円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第6期 自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11日			第7期 自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	156,178,171円	費用控除後の配当等収益額	A	214,072,626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	1,190,317,935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	1,346,966,537円
収益調整金額	C	381,251,931円	収益調整金額	C	1,492,757,565円
分配準備積立金額	D	175,561,440円	分配準備積立金額	D	1,172,626,551円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,903,309,477円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,226,423,279円
当ファンドの期末残存口数	F	6,823,339,843口	当ファンドの期末残存口数	F	9,593,062,711口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,789円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,405円
1万口当たり分配金額	H	20円	1万口当たり分配金額	H	20円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	13,646,679円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	19,186,125円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した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

	第7期 (平成26年11月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第6期	第7期
	自 平成24年11月13日 至 平成25年11月11日	自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,598,521,881円	6,823,339,843円
期中追加設定元本額	2,961,482,673円	4,666,930,535円
期中一部解約元本額	1,736,664,711円	1,897,207,667円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第6期 (平成25年11月11日現在)	第7期 (平成26年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,757,955,765	1,725,954,591
合計	1,757,955,765	1,725,954,591

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第１ 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。



## (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	942,767,201	1,310,540,686	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	938,745,673	1,426,799,548	
	国内株式インデックス マザーファンド	2,221,656,262	2,522,246,354	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,401,286,254	2,695,093,852	
	国内債券インデックス マザーファンド	1,451,689,427	1,902,874,500	
	外国債券インデックス マザーファンド	880,566,497	2,435,382,760	
合計		7,836,711,314	12,292,937,700	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

「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26年11月10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

## 貸借対照表

項目	平成26年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	903,871,056
国債証券	227,747,790,100
地方債証券	17,747,030,055
特殊債券	24,446,448,010
社債券	15,638,991,350
派生商品評価勘定	39,676

項目	平成26年11月10日現在
	金額（円）
未収利息	757,595,982
前払費用	33,341,817
差入委託証拠金	160,000
流動資産合計	287,275,268,046
資産合計	287,275,268,046
負債の部	
流動負債	
前受金	40,000
未払解約金	595,926,172
流動負債合計	595,966,172
負債合計	595,966,172
純資産の部	
元本等	
元本	218,705,326,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	67,973,975,107
元本等合計	286,679,301,874
純資産合計	286,679,301,874
負債純資産合計	287,275,268,046

## 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11月10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、社債券</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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	218,705,326,767口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 106,286,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3108円 (1万口当たり純資産額) (13,108円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	平成26年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(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> <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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	196,768,519,264円
期中追加設定元本額	56,379,050,778円
期中一部解約元本額	34,442,243,275円
期末元本額	218,705,326,767円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,451,689,427円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,268,738円

区分	平成26年11月10日現在
SMT 国内債券インデックス・オープン	5,601,717,988円
世界経済インデックスファンド	228,317,123円
マイセレクション25	146,364,813円
マイセレクション50	87,256,995円
マイセレクション75	26,335,593円
DCマイセレクション25	12,648,200,879円
DCマイセレクション50	15,368,085,969円
DCマイセレクション75	4,204,672,130円
DC日本債券インデックス・オープン	401,384,498円
DC日本債券インデックス・オープンS	51,628,265,385円
DC日本債券インデックス・オープンP	18,483,955,103円
DCマイセレクションS25	4,803,186,371円
DCマイセレクションS50	5,523,724,803円
DCマイセレクションS75	1,040,761,721円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	20,853,438円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,061,250,628円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	557,545,009円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	136,199,342円
DC世界経済インデックスファンド	237,803,629円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,166,117,738円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	29,972,342円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	232,966,416円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	33,585,726円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	6,433,644円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,096,371,977円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,517,062,687円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	2,808,151,823円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	423,474,451円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	15,936,067,586円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,811,792,648円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,582,034,617円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,902,674,735円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	3,352,501,588円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,387,375,057円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,326,087,222円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,570,613,518円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,522,159,482円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	262,291,206円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,100,150,415円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,141,262,013円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,795,808,579円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,379,202,755円
分散投資コア戦略ファンドA	1,051,785,994円

区分	平成26年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	407,500,004円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	2,960,326円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	62,058,322円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	23,763,649,755円
コア投資戦略ファンド（切替型）	330,613,711円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	15,102,979円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	14,430,629円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,374,562,800
地方債証券		103,942,120
特殊債券		140,174,215
社債券		33,513,820
合計		2,652,192,955

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成26年11月10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	146,510,324	-	146,550,000	39,676
合計		146,510,324	-	146,550,000	39,676

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第335回利付国債(2年)	1,190,000,000	1,191,166,200	
	第336回利付国債(2年)	830,000,000	830,821,700	
	第337回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,051,123,500	
	第338回利付国債(2年)	1,100,000,000	1,101,243,000	
	第339回利付国債(2年)	680,000,000	680,816,000	
	第340回利付国債(2年)	640,000,000	640,812,800	
	第341回利付国債(2年)	630,000,000	630,850,500	
	第342回利付国債(2年)	1,170,000,000	1,171,661,400	
	第343回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,301,820,000	
	第344回利付国債(2年)	1,560,000,000	1,562,293,200	
	第345回利付国債(2年)	1,070,000,000	1,071,637,100	
	第93回利付国債(5年)	1,820,000,000	1,829,737,000	
	第94回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,318,449,500	
	第95回利付国債(5年)	840,000,000	846,627,600	
	第96回利付国債(5年)	1,770,000,000	1,781,575,800	
	第97回利付国債(5年)	3,000,000,000	3,018,480,000	
	第98回利付国債(5年)	630,000,000	632,872,800	
	第99回利付国債(5年)	2,600,000,000	2,618,538,000	
	第100回利付国債(5年)	490,000,000	492,587,200	
	第101回利付国債(5年)	950,000,000	957,590,500	
	第102回利付国債(5年)	2,280,000,000	2,293,406,400	
	第103回利付国債(5年)	2,500,000,000	2,516,150,000	
	第104回利付国債(5年)	610,000,000	612,507,100	
	第105回利付国債(5年)	3,500,000,000	3,515,015,000	
	第106回利付国債(5年)	2,480,000,000	2,491,656,000	
	第107回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,125,555,200	
	第108回利付国債(5年)	590,000,000	591,097,400	
	第109回利付国債(5年)	990,000,000	991,653,300	
	第110回利付国債(5年)	700,000,000	705,852,000	
	第111回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,608,603,000	
	第112回利付国債(5年)	740,000,000	749,042,800	
	第113回利付国債(5年)	4,150,000,000	4,185,773,000	
	第114回利付国債(5年)	1,110,000,000	1,119,812,400	
第115回利付国債(5年)	1,960,000,000	1,969,780,400		
第116回利付国債(5年)	3,120,000,000	3,134,664,000		
第117回利付国債(5年)	3,670,000,000	3,685,891,100		
第118回利付国債(5年)	3,810,000,000	3,825,697,200		

第119回利付国債(5年)	400,000,000	399,816,000	
第120回利付国債(5年)	2,260,000,000	2,268,723,600	
第121回利付国債(5年)	590,000,000	589,427,700	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	182,032,500	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	348,000,000	
第3回利付国債(40年)	340,000,000	394,070,200	
第4回利付国債(40年)	530,000,000	613,660,500	
第5回利付国債(40年)	490,000,000	539,607,600	
第6回利付国債(40年)	690,000,000	739,197,000	
第7回利付国債(40年)	600,000,000	606,432,000	
第274回利付国債(10年)	730,000,000	741,964,700	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	284,278,400	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	488,395,200	
第277回利付国債(10年)	410,000,000	418,774,000	
第278回利付国債(10年)	720,000,000	737,352,000	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	451,792,000	
第280回利付国債(10年)	600,000,000	618,120,000	
第281回利付国債(10年)	700,000,000	722,260,000	
第282回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,299,362,400	
第283回利付国債(10年)	280,000,000	289,265,200	
第284回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,252,749,300	
第285回利付国債(10年)	1,990,000,000	2,068,306,500	
第286回利付国債(10年)	870,000,000	910,046,100	
第287回利付国債(10年)	540,000,000	566,260,200	
第288回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,189,233,200	
第289回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,539,981,800	
第290回利付国債(10年)	470,000,000	491,305,100	
第291回利付国債(10年)	840,000,000	875,263,200	
第292回利付国債(10年)	860,000,000	907,618,200	
第293回利付国債(10年)	370,000,000	393,143,500	
第294回利付国債(10年)	180,000,000	190,611,000	
第295回利付国債(10年)	100,000,000	105,176,000	
第296回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,215,017,000	
第297回利付国債(10年)	560,000,000	590,116,800	
第298回利付国債(10年)	1,660,000,000	1,742,485,400	
第299回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,378,382,000	
第300回利付国債(10年)	830,000,000	880,522,100	
第301回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,319,223,600	
第302回利付国債(10年)	200,000,000	211,862,000	
第303回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,476,221,700	
第304回利付国債(10年)	480,000,000	507,456,000	
第305回利付国債(10年)	2,160,000,000	2,289,297,600	



第306回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,248,951,600	
第307回利付国債(10年)	700,000,000	743,519,000	
第308回利付国債(10年)	990,000,000	1,053,835,200	
第309回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,874,980,800	
第310回利付国債(10年)	1,590,000,000	1,668,911,700	
第311回利付国債(10年)	610,000,000	633,192,200	
第312回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,881,262,200	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,659,507,500	
第314回利付国債(10年)	580,000,000	613,692,200	
第315回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,385,618,000	
第316回利付国債(10年)	720,000,000	762,724,800	
第317回利付国債(10年)	480,000,000	509,040,000	
第318回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,907,269,400	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,220,357,000	
第320回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,813,206,800	
第321回利付国債(10年)	1,930,000,000	2,034,470,900	
第322回利付国債(10年)	1,030,000,000	1,078,317,300	
第323回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,214,438,800	
第324回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,631,983,600	
第325回利付国債(10年)	2,910,000,000	3,023,955,600	
第326回利付国債(10年)	300,000,000	309,249,000	
第327回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,599,644,200	
第328回利付国債(10年)	2,010,000,000	2,054,099,400	
第329回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,117,540,400	
第330回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,323,574,400	
第331回利付国債(10年)	450,000,000	459,067,500	
第332回利付国債(10年)	3,000,000,000	3,056,730,000	
第333回利付国債(10年)	2,750,000,000	2,797,052,500	
第334回利付国債(10年)	2,950,000,000	2,996,226,500	
第335回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,727,292,800	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	50,959,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	194,843,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,249,600	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	141,999,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	59,261,500	
第6回利付国債(30年)	190,000,000	230,705,600	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	215,523,000	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	55,768,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	251,628,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	159,390,400	
第11回利付国債(30年)	90,000,000	98,415,000	

第12回利付国債(30年)	190,000,000	220,358,200	
第13回利付国債(30年)	290,000,000	330,420,200	
第14回利付国債(30年)	300,000,000	361,644,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	415,415,400	
第16回利付国債(30年)	370,000,000	451,832,900	
第17回利付国債(30年)	330,000,000	397,029,600	
第18回利付国債(30年)	445,000,000	527,218,200	
第19回利付国債(30年)	160,000,000	189,542,400	
第20回利付国債(30年)	260,000,000	317,436,600	
第21回利付国債(30年)	280,000,000	331,307,200	
第22回利付国債(30年)	400,000,000	488,376,000	
第23回利付国債(30年)	350,000,000	426,958,000	
第24回利付国債(30年)	330,000,000	402,534,000	
第25回利付国債(30年)	320,000,000	378,188,800	
第26回利付国債(30年)	580,000,000	696,522,000	
第27回利付国債(30年)	710,000,000	866,988,100	
第28回利付国債(30年)	510,000,000	623,536,200	
第29回利付国債(30年)	870,000,000	1,046,148,900	
第30回利付国債(30年)	640,000,000	756,966,400	
第31回利付国債(30年)	760,000,000	883,507,600	
第32回利付国債(30年)	810,000,000	959,866,200	
第33回利付国債(30年)	970,000,000	1,086,671,600	
第34回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,280,477,000	
第35回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,196,463,300	
第36回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,206,964,800	
第37回利付国債(30年)	1,070,000,000	1,171,339,700	
第38回利付国債(30年)	540,000,000	577,967,400	
第39回利付国債(30年)	640,000,000	699,635,200	
第40回利付国債(30年)	720,000,000	769,694,400	
第41回利付国債(30年)	580,000,000	605,955,000	
第42回利付国債(30年)	590,000,000	615,924,600	
第43回利付国債(30年)	890,000,000	928,385,700	
第44回利付国債(30年)	310,000,000	323,116,100	
第31回利付国債(20年)	80,000,000	83,766,400	
第32回利付国債(20年)	50,000,000	52,489,500	
第33回利付国債(20年)	140,000,000	149,811,200	
第34回利付国債(20年)	50,000,000	54,069,000	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	10,766,800	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	75,908,000	
第37回利付国債(20年)	70,000,000	76,107,500	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	21,772,800	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	542,645,000	

第40回利付国債(20年)	100,000,000	108,552,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	349,935,300	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	88,663,200	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	158,823,000	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	191,459,100	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	325,063,900	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	189,538,100	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	100,741,500	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	148,486,000	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	156,990,400	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	243,931,600	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	111,880,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	124,138,300	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	90,520,000	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	227,698,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	157,803,800	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	169,458,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	269,342,400	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	337,350,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	222,152,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	380,306,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	253,168,800	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	332,163,200	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	224,592,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	362,598,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	249,755,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	371,560,200	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	147,708,600	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	221,123,900	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	450,368,100	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	473,980,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	233,182,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	729,810,900	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	414,327,600	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	232,116,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	151,139,300	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	308,412,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	334,123,500	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	194,452,800	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	311,561,100	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	256,216,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	450,461,700	

第82回利付国債(20年)	400,000,000	466,372,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	338,633,000	
第84回利付国債(20年)	670,000,000	774,908,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	338,925,900	
第86回利付国債(20年)	210,000,000	250,198,200	
第87回利付国債(20年)	410,000,000	483,824,600	
第88回利付国債(20年)	550,000,000	656,045,500	
第89回利付国債(20年)	330,000,000	389,809,200	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	686,122,600	
第91回利付国債(20年)	320,000,000	382,323,200	
第92回利付国債(20年)	960,000,000	1,125,667,200	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	476,272,400	
第94回利付国債(20年)	550,000,000	645,601,000	
第95回利付国債(20年)	570,000,000	683,532,600	
第96回利付国債(20年)	420,000,000	493,235,400	
第97回利付国債(20年)	640,000,000	760,390,400	
第98回利付国債(20年)	380,000,000	446,690,000	
第99回利付国債(20年)	970,000,000	1,141,214,700	
第100回利付国債(20年)	550,000,000	653,922,500	
第101回利付国債(20年)	325,000,000	394,868,500	
第102回利付国債(20年)	500,000,000	607,835,000	
第103回利付国債(20年)	270,000,000	324,864,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	423,648,000	
第105回利付国債(20年)	700,000,000	823,249,000	
第106回利付国債(20年)	330,000,000	392,766,000	
第107回利付国債(20年)	370,000,000	435,375,300	
第108回利付国債(20年)	680,000,000	781,734,800	
第109回利付国債(20年)	240,000,000	275,580,000	
第110回利付国債(20年)	850,000,000	999,965,500	
第111回利付国債(20年)	300,000,000	356,781,000	
第112回利付国債(20年)	620,000,000	729,194,400	
第113回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,292,434,000	
第114回利付国債(20年)	630,000,000	739,865,700	
第115回利付国債(20年)	670,000,000	796,402,200	
第116回利付国債(20年)	490,000,000	582,193,500	
第117回利付国債(20年)	910,000,000	1,068,085,200	
第118回利付国債(20年)	850,000,000	984,657,000	
第119回利付国債(20年)	380,000,000	429,137,800	
第120回利付国債(20年)	300,000,000	330,084,000	
第121回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,188,418,400	
第122回利付国債(20年)	280,000,000	315,621,600	
第123回利付国債(20年)	700,000,000	819,875,000	

	第124回利付国債(20年)	400,000,000	462,536,000	
	第125回利付国債(20年)	430,000,000	510,035,900	
	第126回利付国債(20年)	390,000,000	450,824,400	
	第127回利付国債(20年)	460,000,000	524,814,000	
	第128回利付国債(20年)	560,000,000	638,120,000	
	第129回利付国債(20年)	620,000,000	696,570,000	
	第130回利付国債(20年)	440,000,000	493,618,400	
	第131回利付国債(20年)	580,000,000	641,799,000	
	第132回利付国債(20年)	530,000,000	585,899,100	
	第133回利付国債(20年)	750,000,000	840,705,000	
	第134回利付国債(20年)	420,000,000	470,022,000	
	第135回利付国債(20年)	380,000,000	419,018,400	
	第136回利付国債(20年)	530,000,000	576,163,000	
	第137回利付国債(20年)	290,000,000	319,426,300	
	第138回利付国債(20年)	630,000,000	673,614,900	
	第139回利付国債(20年)	470,000,000	509,917,100	
	第140回利付国債(20年)	1,170,000,000	1,286,274,600	
	第141回利付国債(20年)	310,000,000	340,135,100	
	第142回利付国債(20年)	780,000,000	868,990,200	
	第143回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,132,750,500	
	第144回利付国債(20年)	440,000,000	467,227,200	
	第145回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,617,122,000	
	第146回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,460,988,600	
	第147回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,573,605,600	
	第148回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,239,483,800	
	第149回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,361,880,000	
	第150回利付国債(20年)	830,000,000	852,509,600	
	第18回メキシコ合衆国円貨債券	100,000,000	100,485,000	
	第14回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	201,422,000	
	国債証券合計	213,910,000,000	227,747,790,100	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,499,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,373,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,734,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,022,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,283,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,794,000	
	第23回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,182,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,208,000	
	第633回東京都公募公債	129,000,000	132,360,450	
	第639回東京都公募公債	50,000,000	51,654,000	
	第649回東京都公募公債	102,000,000	106,878,660	
	第650回東京都公募公債	140,000,000	147,176,400	

第 6 7 4 回東京都公募公債	100,000,000	105,959,000	
第 6 9 5 回東京都公募公債	100,000,000	106,238,000	
第 6 9 6 回東京都公募公債	100,000,000	106,311,000	
第 7 1 6 回東京都公募公債	100,000,000	103,393,000	
第 7 1 7 回東京都公募公債	100,000,000	102,149,000	
第 7 2 0 回東京都公募公債	100,000,000	104,084,000	
第 7 2 8 回東京都公募公債	100,000,000	102,019,000	
平成 1 8 年度第 1 回北海道公募公債	100,000,000	102,491,000	
平成 1 8 年度第 1 0 回北海道公募公債	100,000,000	103,839,000	
平成 1 9 年度第 9 回北海道公募公債	110,000,000	115,306,400	
平成 2 0 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	106,723,000	
平成 2 2 年度第 1 1 回北海道公募公債	100,000,000	106,734,000	
平成 2 4 年度第 1 4 回北海道公募公債	100,000,000	103,213,000	
第 4 回神奈川県公募公債（ 3 0 年 ）	100,000,000	120,724,000	
第 1 6 回神奈川県公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	115,522,000	
第 1 4 4 回神奈川県公募公債	100,000,000	103,751,000	
第 1 5 0 回神奈川県公募公債	100,000,000	104,964,000	
第 1 6 7 回神奈川県公募公債	140,000,000	149,252,600	
第 1 7 2 回神奈川県公募公債	200,000,000	212,536,000	
第 7 回大阪府公募公債（ 2 0 年 ）	200,000,000	221,240,000	
第 7 2 回大阪府公募公債（ 5 年 ）	100,000,000	100,765,000	
第 2 9 0 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	102,965,000	
第 2 9 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	103,122,000	
第 3 0 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	105,136,000	
第 3 1 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	105,147,000	
第 3 4 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	106,186,000	
第 3 4 9 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	107,148,000	
第 3 6 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	104,316,000	
第 3 7 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	101,390,000	
第 3 7 5 回大阪府公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	103,434,000	
平成 1 8 年度第 1 回京都府公募公債	100,000,000	103,475,000	
平成 2 2 年度第 2 回京都府公募公債	100,000,000	105,692,000	
平成 2 3 年度第 5 回京都府公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	110,563,000	
平成 2 5 年度第 7 回京都府公募公債	100,000,000	103,333,000	
第 3 回兵庫県公募公債（ 1 2 年 ）	100,000,000	99,824,000	
平成 1 7 年度第 1 3 回兵庫県公募公債	200,000,000	204,414,000	
平成 1 9 年度第 9 回兵庫県公募公債	100,000,000	105,110,000	
平成 2 2 年度第 1 回兵庫県公募公債	100,000,000	106,789,000	
平成 2 5 年度第 4 回兵庫県公募公債	100,000,000	103,383,000	
平成 1 9 年度第 2 回静岡県公募公債	100,000,000	104,910,000	
平成 2 0 年度第 4 回静岡県公募公債	100,000,000	105,886,000	

平成21年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	106,579,000	
平成23年度第3回静岡県公募公債	103,290,000	109,764,217	
平成23年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	105,299,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	102,498,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,453,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	118,666,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,018,000	
平成22年度第3回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	213,074,000	
平成23年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,424,000	
平成23年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,362,000	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,145,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,907,000	
平成19年度第2回広島県公募公債	200,000,000	210,400,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	119,445,000	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	106,508,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,600,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	103,029,000	
平成22年度第10回埼玉県公募公債	100,000,000	106,474,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	205,886,610	
平成24年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	105,547,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	103,907,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,845,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	106,663,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,140,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債	200,000,000	212,410,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	110,243,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,429,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	106,466,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,845,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	106,719,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	125,766,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	103,735,000	
平成22年度第1回長野県公募公債	100,000,000	100,466,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,008,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,002,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	124,188,000	

第46回共同発行市場公募地方債	136,500,000	141,752,520	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,967,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	166,741,344	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,002,000	
第62回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,836,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	174,811,843	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,887,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,288,600	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,000,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,878,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,208,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	157,690,251	
第91回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,176,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,350,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,343,000	
第95回共同発行市場公募地方債	250,000,000	266,692,500	
第97回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,816,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,185,000	
第102回共同発行市場公募地方債	150,000,000	157,959,000	
第108回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,269,000	
第109回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,545,000	
第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,388,000	
第112回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,989,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,919,000	
第119回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,000,000	
第125回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,566,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,289,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,090,000	
第130回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,923,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,667,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	207,048,000	
平成22年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	104,790,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	101,714,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	104,905,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	105,751,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,190,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	115,883,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	101,581,000	
第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	102,210,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,066,000	
平成22年度第2回京都市公募公債	102,000,000	107,337,660	



	平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	103,526,000	
	平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	103,904,000	
	平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	101,960,000	
	第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,217,000	
	第20回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	116,186,000	
	平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,022,000	
	平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	107,021,000	
	平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,206,000	
	平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	101,616,000	
	平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	103,548,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	111,781,000	
	第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,236,000	
	第82回川崎市公募公債	100,000,000	106,584,000	
	平成23年度第1回北九州市公募公債（5年）	100,000,000	100,535,000	
	平成22年度第6回広島市公募公債	100,000,000	106,222,000	
	平成23年度第2回千葉市公募公債	100,000,000	105,458,000	
	平成18年度第1回鹿児島県公募公債（10年）	100,000,000	103,614,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	119,177,000	
	地方債証券合計	16,730,190,000	17,747,030,055	
特殊債券	第42回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	100,431,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,471,000	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	109,703,640	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,552,000	
	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19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,494,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	115,255,000	
	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	101,639,000	
	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	102,025,000	
	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	110,533,000	
	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	102,138,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,138,000	
	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	221,248,000	
	第14回道路債券	100,000,000	111,768,000	
	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	103,526,000	
	第17回道路債券	100,000,000	108,823,000	

第2 1 回道路債券	100,000,000	124,214,000	
第2 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,513,000	
第3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,919,000	
第3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	303,000,000	315,638,130	
第3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,395,000	
第3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	330,135,750	
第3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,526,000	
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,880,000	
第4 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,545,000	
第4 2 回道路債券	100,000,000	116,026,000	
第4 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,952,000	
第4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,921,000	
第4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,416,000	
第4 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,464,000	
第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,758,000	
第4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,589,000	
第5 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,653,000	
第5 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,339,500	
第5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,048,280	
第6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,230,000	
第6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	191,843,710	
第8 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,825,000	
第8 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,120,000	
第8 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,515,000	
第9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	233,020,000	
第9 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,902,000	
第9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	317,883,000	

第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,217,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,861,000	
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	146,619,480	
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	114,416,000	
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	106,310,000	
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	104,733,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,237,000	
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	209,552,000	
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	208,498,000	
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	212,174,000	
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	116,082,000	
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	106,141,000	
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	106,954,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,770,000	
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	100,608,000	
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	104,463,000	
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	209,036,000	
第166回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,443,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,702,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,351,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,974,000	
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	103,868,000	
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,124,000	
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,992,000	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,404,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,718,000	
	200,000,000	207,502,000	

第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	213,913,960	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,252,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,284,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,868,000	
第2回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,415,000	
第3回政府保証公営企業債券（15年）	300,000,000	338,313,000	
第3回公営企業債券（20年）	110,000,000	115,558,300	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,040,000	
第6回地方公共団体金融機構債券（5年）	100,000,000	100,581,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	115,454,000	
第7回公営企業債券（30年）	100,000,000	121,877,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	116,791,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	46,360,800	
第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,496,000	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,508,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,590,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,976,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	105,297,550	
第19回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,082,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,913,450	
第23回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,982,130	
第23回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,392,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,946,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	105,244,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	106,607,000	
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,490,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,288,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,401,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,898,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,812,000	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	133,312,150	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,527,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,257,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,871,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,968,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,005,000	
第875回政府保証公営企業債券	212,000,000	220,804,360	
第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	127,845,020	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	107,031,420	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	83,580,000	

第5回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,644,890	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,645,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	106,029,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	115,808,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	109,988,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	21,126,800	
第190回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,095,000	
第191回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,100,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,556,000	39,452,331	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,090,000	30,263,042	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,980,000	31,507,345	
第3回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,321,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,012,000	40,228,712	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,826,000	33,121,612	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,939,000	26,507,164	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,291,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,422,000	55,787,213	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,337,000	32,400,219	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,890,000	29,072,392	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,593,000	34,812,909	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,648,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,704,000	28,918,295	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,367,000	36,589,170	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	41,397,000	43,541,778	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	41,698,000	43,774,977	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,593,000	52,873,557	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,409,000	53,957,098	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,171,000	53,537,876	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,907,000	60,092,198	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,515,000	62,843,939	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,696,000	64,926,511	
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,871,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,152,000	134,730,336	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,811,000	39,373,781	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,964,000	74,596,316	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,482,000	38,934,684	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,493,000	

第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,491,000	38,785,274	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,602,000	85,166,179	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,156,000	35,049,718	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,417,000	85,281,151	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,340,000	85,361,906	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,134,000	39,407,379	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,434,000	169,341,228	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,757,000	87,796,901	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,897,000	39,910,009	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,583,000	90,680,973	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,827,000	89,940,688	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,614,000	90,884,936	
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,587,000	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,008,000	182,557,845	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,428,000	
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,596,000	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,622,000	186,533,058	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,615,000	93,854,986	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,146,000	95,546,187	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,313,000	95,859,665	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,060,000	95,441,363	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,406,000	94,608,959	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,521,000	97,310,470	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	171,174,000	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,921,000	98,063,875	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,667,000	99,499,232	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,164,000	100,038,932	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,975,000	100,221,095	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,779,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,690,000	201,966,466	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,512,000	
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,045,000	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,258,000	
第12回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	117,374,000	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	149,951,760	
い第729号商工債	100,000,000	100,755,000	
い第731号商工債	100,000,000	100,860,000	
い第736号商工債	100,000,000	100,628,000	
い第738号商工債	100,000,000	100,671,000	
い第741号商工債	100,000,000	100,756,000	
い第750号商工債	100,000,000	100,500,000	
い第752号商工債	200,000,000	201,022,000	

	い第756号商工債	100,000,000	100,528,000	
	い第761号商工債	100,000,000	100,515,000	
	い第740号農林債	100,000,000	100,772,000	
	い第743号農林債	100,000,000	100,723,000	
	い第746号農林債	100,000,000	100,512,000	
	い第748号農林債	100,000,000	100,544,000	
	い第752号農林債	100,000,000	100,399,000	
	い第761号農林債	200,000,000	200,752,000	
	い第762号農林債	100,000,000	100,365,000	
	い第766号農林債	100,000,000	100,303,000	
	第258回信金中金債（5年）	100,000,000	100,685,000	
	第259回信金中金債（5年）	100,000,000	100,714,000	
	第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,817,000	
	第267回信金中金債（5年）	200,000,000	201,534,000	
	第274回信金中金債（5年）	100,000,000	100,502,000	
	第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,526,000	
	第290回信金中金債（5年）	100,000,000	100,503,000	
	第5回S B A B銀行A B（publ）円貨債券	100,000,000	100,816,000	
	第19回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,541,000	
	第28回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,094,000	
	第33回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,088,000	
	第43回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,646,000	
	第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,364,000	
	特殊債券合計	23,149,871,000	24,446,448,010	
社債券	第2回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,466,000	
	第4回スウェンスカ・ハンデルスパンケンA B円貨社債	100,000,000	100,036,000	
	第26回GEキャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	200,322,000	
	第9回J Pモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,416,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	103,851,000	
	第9回モルガン・スタンレー円貨社債	100,000,000	100,398,000	
	第6回ビー・エヌ・ビー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,138,000	
	第9回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,274,000	
	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	100,912,000	
	第16回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	204,124,000	
	第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	100,951,000	
	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	100,465,000	

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	105,090,000	
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	106,899,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,843,000	
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,868,000	
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	106,297,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,126,000	
第12回日本製紙株式会社無担保社債	100,000,000	101,470,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,351,000	
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	103,366,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,416,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,808,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,920,000	
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	100,489,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,048,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,209,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,374,000	
第13回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第67回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,594,000	
第22回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,076,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	102,028,000	
第16回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,377,000	
第9回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,507,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,782,000	
第59回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,942,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,877,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,890,000	
第27回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,201,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,345,000	
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,258,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,923,000	
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,523,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,474,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,338,000	
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,547,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	101,611,000	



第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,924,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,988,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,603,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,094,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,278,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,558,000	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,760,000	
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	100,856,000	
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	301,902,000	
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	100,702,000	
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	100,442,000	
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	124,323,000	
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	105,521,000	
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	107,818,000	
第151回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,398,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,585,000	
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	108,800,000	
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	108,144,000	
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	108,830,000	
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	106,157,000	
第53回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,828,000	
第56回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,761,000	
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	211,200,000	
第36回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,263,000	
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	100,844,000	
第17回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,699,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,016,000	
第47回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,844,000	
第2回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	101,038,000	
第67回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	100,337,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,850,000	

第138回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,087,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,837,000	
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	101,858,000	
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	104,361,000	
第43回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,479,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,363,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,664,000	
第31回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	108,551,000	
第103回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,688,000	
第84回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,505,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,515,000	
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	104,008,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,912,000	
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,034,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,325,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,969,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,523,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,410,000	
第56回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,247,000	
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,872,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,641,190	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,697,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,693,600	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,983,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,151,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,716,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,382,000	
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	102,343,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,555,000	
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	100,830,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,015,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,365,000	
第455回東京電力株式会社社債	120,000,000	121,828,800	
第459回東京電力株式会社社債	10,000,000	10,387,800	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,186,000	

第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,882,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,637,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,236,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,991,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,287,000	
第554回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,570,000	
第408回中部電力株式会社社債	50,000,000	51,981,500	
第499回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,866,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,867,000	
第473回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,099,000	
第474回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,323,000	
第489回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,734,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,454,000	
第358回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,691,000	
第362回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,070,000	
第371回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,949,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,752,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,517,000	
第380回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,787,000	
第382回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,410,600	
第466回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,885,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,103,000	
第276回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,076,000	
第279回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,123,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,028,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,060,000	
第417回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,054,000	
第420回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,813,000	
第423回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,845,000	
第261回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,264,860	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,297,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	205,998,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,673,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,887,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ 無担保社債	100,000,000	103,600,000	
社債券合計	15,170,000,000	15,638,991,350	
合計		285,580,259,515	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	平成26年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,874,500,888
株式	143,610,948,600
派生商品評価勘定	1,672,000
未収入金	514,219,855
未収配当金	1,065,667,158
未収利息	2,033
前払金	17,497,000
差入委託証拠金	73,480,000
流動資産合計	147,157,987,534
資産合計	147,157,987,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,169,000
未払解約金	879,299,559
流動負債合計	898,468,559
負債合計	898,468,559
純資産の部	
元本等	
元本	128,828,967,080
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	17,430,551,895
元本等合計	146,259,518,975
純資産合計	146,259,518,975
負債純資産合計	147,157,987,534

##### 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11月10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。

平成26年11月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,828,967,080口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.1353円 (1万口当たり純資産額) (11,353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26年11月10日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

	平成26年11月10日現在
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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	147,700,483,382円
期中追加設定元本額	25,212,419,191円
期中一部解約元本額	44,083,935,493円
期末元本額	128,828,967,080円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,633,736,123円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,221,656,262円
SBI資産設計オープン（分配型）	20,322,270円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,607,904,230円
世界経済インデックスファンド	406,167,742円
マイセクション25	60,368,558円
マイセクション50	94,495,018円
マイセクション75	97,039,446円
日本株式インデックス・オープン	12,465,891,192円
DCマイセクション25	5,120,060,881円
DCマイセクション50	16,569,043,306円
DCマイセクション75	15,478,938,404円
DC日本株式インデックス・オープン	4,068,281,537円
DCマイセクションS25	1,980,525,937円
DCマイセクションS50	5,943,423,936円
DCマイセクションS75	3,820,873,708円
DC日本株式インデックス・オープンS	2,047,437,339円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,478,609円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	464,634,014円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	484,614,159円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	238,871,718円
DC世界経済インデックスファンド	399,157,103円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	435,328,944円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	103,418,033円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	255,394,646円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	124,211,867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）	1,349,888,002円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	23,061,155円

区分	平成26年11月10日現在
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	645,170,669円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	2,258,347,064円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	3,576,121,310円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,849,021,764円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	7,936,881,339円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,603,123,615円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	9,013,213,719円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,937,955,700円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,862,791,842円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,838,433,880円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	3,716,379,844円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	967,289,446円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,356,441,992円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	106,258,583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）	2,944,384,337円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,085,849,980円
日本株式ファンド・シリーズ2	507,612,800円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	11,192,164円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,471,414円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	58,721,337円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	6,080,142円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	16,578,713,428
合計	16,578,713,428

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（平成26年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,493,607,000	-	2,476,110,000	17,497,000
合計		2,493,607,000	-	2,476,110,000	17,497,000



## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	34,000	260.00	8,840,000	
日本水産	99,900	374.00	37,362,600	
マルハニチロ	15,600	1,580.00	24,648,000	
サカタのタネ	12,000	1,618.00	19,416,000	
ホクト	9,000	1,992.00	17,928,000	
住石ホールディングス	22,500	122.00	2,745,000	
日鉄鉱業	23,000	414.00	9,522,000	
三井松島産業	53,000	132.00	6,996,000	
国際石油開発帝石	428,100	1,404.00	601,052,400	
日本海洋掘削	2,400	4,190.00	10,056,000	
石油資源開発	11,600	3,840.00	44,544,000	
K&Oエナジーグループ	5,500	1,439.00	7,914,500	
ショーボンドホールディングス	7,200	4,240.00	30,528,000	
ミライト・ホールディングス	25,000	1,269.00	31,725,000	
タマホーム	6,000	606.00	3,636,000	
サンヨーホームズ	1,400	658.00	921,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	1,848.00	2,217,600	
安藤・間	56,600	706.00	39,959,600	
東急建設	29,600	515.00	15,244,000	
コムシスホールディングス	36,200	1,848.00	66,897,600	
ミサワホーム	11,400	1,067.00	12,163,800	
高松コンストラクショングループ	6,300	2,120.00	13,356,000	
東建コーポレーション	3,100	5,120.00	15,872,000	
ヤマウラ	6,900	414.00	2,856,600	
大成建設	411,000	604.00	248,244,000	
大林組	244,000	746.00	182,024,000	
清水建設	249,000	800.00	199,200,000	
長谷工コーポレーション	102,100	827.00	84,436,700	
松井建設	10,000	525.00	5,250,000	
鹿島建設	358,000	479.00	171,482,000	

不動テトラ	62,900	253.00	15,913,700
鉄建建設	49,000	470.00	23,030,000
日鉄住金テックスエンジ	16,000	541.00	8,656,000
西松建設	89,000	511.00	45,479,000
三井住友建設	327,700	128.00	41,945,600
前田建設工業	55,000	913.00	50,215,000
佐田建設	28,000	142.00	3,976,000
ナカノフドー建設	10,700	359.00	3,841,300
奥村組	78,000	586.00	45,708,000
大和小田急建設	8,600	803.00	6,905,800
東鉄工業	9,800	2,466.00	24,166,800
イチケン	16,000	309.00	4,944,000
戸田建設	102,000	487.00	49,674,000
熊谷組	104,000	391.00	40,664,000
青木あすなる建設	5,600	813.00	4,552,800
北野建設	19,000	326.00	6,194,000
植木組	19,000	291.00	5,529,000
三井ホーム	11,000	492.00	5,412,000
矢作建設工業	10,700	891.00	9,533,700
ピーエス三菱	9,300	491.00	4,566,300
東日本ハウス	11,600	467.00	5,417,200
大東建託	30,900	13,845.00	427,810,500
新日本建設	14,000	380.00	5,320,000
N I P P O	19,000	1,937.00	36,803,000
東亜道路工業	16,000	429.00	6,864,000
前田道路	25,000	1,710.00	42,750,000
日本道路	24,000	602.00	14,448,000
東亜建設工業	62,000	189.00	11,718,000
若築建設	50,000	205.00	10,250,000
東洋建設	23,000	492.00	11,316,000
五洋建設	90,900	354.00	32,178,600
大林道路	10,000	777.00	7,770,000
福田組	14,000	1,158.00	16,212,000
住友林業	60,200	1,206.00	72,601,200
日本基礎技術	10,500	389.00	4,084,500
日成ビルド工業	24,000	272.00	6,528,000
巴コーポレーション	10,100	439.00	4,433,900
パナホーム	31,000	723.00	22,413,000
大和ハウス工業	238,100	2,199.50	523,700,950
ライト工業	13,200	972.00	12,830,400
積水ハウス	250,300	1,448.50	362,559,550
日特建設	11,900	540.00	6,426,000

北陸電気工事	5,000	577.00	2,885,000
ユアテック	13,000	592.00	7,696,000
西部電気工業	7,000	479.00	3,353,000
四電工	7,000	401.00	2,807,000
中電工	11,800	1,855.00	21,889,000
関電工	37,000	597.00	22,089,000
きんでん	54,000	1,152.00	62,208,000
東京エネシス	9,000	735.00	6,615,000
トーエネック	12,000	597.00	7,164,000
住友電設	6,600	1,360.00	8,976,000
日本電設工業	13,400	1,497.00	20,059,800
協和エクシオ	34,500	1,344.00	46,368,000
新日本空調	7,300	885.00	6,460,500
N D S	14,000	311.00	4,354,000
九電工	15,000	1,247.00	18,705,000
三機工業	17,000	764.00	12,988,000
日揮	82,000	2,867.50	235,135,000
中外炉工業	24,000	219.00	5,256,000
ヤマト	8,000	404.00	3,232,000
太平電業	11,000	885.00	9,735,000
高砂熱学工業	22,900	1,380.00	31,602,000
三晃金属工業	13,000	264.00	3,432,000
朝日工業社	10,000	399.00	3,990,000
明星工業	15,000	772.00	11,580,000
大気社	11,800	2,455.00	28,969,000
ダイダン	11,000	637.00	7,007,000
日比谷総合設備	9,600	1,635.00	15,696,000
東芝プラントシステム	13,400	1,801.00	24,133,400
O S J Bホールディングス	13,300	237.00	3,152,100
東洋エンジニアリング	40,000	547.00	21,880,000
千代田化工建設	59,000	1,088.00	64,192,000
新興プラントテック	16,700	819.00	13,677,300
日本製粉	50,000	532.00	26,600,000
日清製粉グループ本社	89,100	1,122.00	99,970,200
日東富士製粉	6,000	318.00	1,908,000
昭和産業	33,000	435.00	14,355,000
鳥越製粉	6,500	766.00	4,979,000
中部飼料	7,800	657.00	5,124,600
フィード・ワンホールディングス	49,200	108.00	5,313,600
東洋精糖	13,000	101.00	1,313,000
日本甜菜製糖	42,000	189.00	7,938,000
三井製糖	32,000	382.00	12,224,000

塩水港精糖	8,800	283.00	2,490,400
森永製菓	73,000	261.00	19,053,000
中村屋	19,000	427.00	8,113,000
江崎グリコ	18,800	3,695.00	69,466,000
名糖産業	3,600	1,136.00	4,089,600
不二家	47,000	200.00	9,400,000
山崎製パン	60,000	1,378.00	82,680,000
第一屋製パン	11,000	133.00	1,463,000
モロゾフ	12,000	358.00	4,296,000
亀田製菓	4,500	3,620.00	16,290,000
寿スピリッツ	1,900	2,209.00	4,197,100
カルビー	30,100	3,905.00	117,540,500
森永乳業	74,000	369.00	27,306,000
六甲バター	3,600	1,175.00	4,230,000
ヤクルト本社	43,600	6,060.00	264,216,000
明治ホールディングス	24,100	9,270.00	223,407,000
雪印メグミルク	19,100	1,441.00	27,523,100
プリマハム	46,000	254.00	11,684,000
日本ハム	60,000	2,432.00	145,920,000
伊藤ハム	45,000	583.00	26,235,000
丸大食品	42,000	428.00	17,976,000
米久	2,600	1,528.00	3,972,800
S Foods	5,100	2,169.00	11,061,900
サッポロホールディングス	133,000	479.00	63,707,000
アサヒグループホールディングス	163,400	3,424.50	559,563,300
キリンホールディングス	347,700	1,427.00	496,167,900
宝ホールディングス	63,800	829.00	52,890,200
オエノンホールディングス	21,000	233.00	4,893,000
養命酒製造	5,000	870.00	4,350,000
コカ・コーラウエスト	27,500	1,615.00	44,412,500
コカ・コーライーストジャパン	24,700	2,177.00	53,771,900
サントリー食品インターナショナル	48,700	4,175.00	203,322,500
ダイドードリンコ	4,100	4,620.00	18,942,000
伊藤園	22,100	2,202.00	48,664,200
キーコーヒー	7,200	1,617.00	11,642,400
ユニカフェ	2,200	674.00	1,482,800
ジャパンフーズ	1,100	1,087.00	1,195,700
日清オイリオグループ	39,000	399.00	15,561,000
不二製油	21,700	1,842.00	39,971,400
かどや製油	800	2,627.00	2,101,600
J - オイルミルズ	34,000	376.00	12,784,000
キッコーマン	66,000	2,707.00	178,662,000

味の素	187,000	2,139.50	400,086,500
キューピー	41,400	1,932.00	79,984,800
ハウス食品グループ本社	30,100	1,907.00	57,400,700
カゴメ	31,400	1,761.00	55,295,400
焼津水産化学工業	3,700	998.00	3,692,600
アリアケジャパン	7,400	2,555.00	18,907,000
ニチレイ	87,000	479.00	41,673,000
東洋水産	42,500	3,850.00	163,625,000
イトアンド	700	1,670.00	1,169,000
日清食品ホールディングス	34,400	5,840.00	200,896,000
永谷園	8,000	1,090.00	8,720,000
フジッコ	8,000	1,673.00	13,384,000
ロック・フィールド	4,200	1,899.00	7,975,800
日本たばこ産業	450,400	3,890.00	1,752,056,000
ケンコーマヨネーズ	2,700	1,211.00	3,269,700
わらべや日洋	4,800	1,981.00	9,508,800
なとり	3,700	1,135.00	4,199,500
ミヨシ油脂	28,000	137.00	3,836,000
片倉工業	9,500	1,270.00	12,065,000
ゲンゼ	62,000	311.00	19,282,000
東洋紡	302,000	161.00	48,622,000
ユニチカ	221,000	50.00	11,050,000
富士紡ホールディングス	37,000	290.00	10,730,000
日清紡ホールディングス	48,000	1,092.00	52,416,000
倉敷紡績	79,000	185.00	14,615,000
シキボウ	44,000	121.00	5,324,000
日本毛織	24,000	748.00	17,952,000
トーア紡コーポレーション	34,000	78.00	2,652,000
ガイドーリミテッド	8,800	497.00	4,373,600
帝国繊維	7,900	2,668.00	21,077,200
帝人	311,000	306.00	95,166,000
東レ	588,000	780.80	459,110,400
サカイオーベックス	20,000	160.00	3,200,000
住江織物	24,000	297.00	7,128,000
日本フェルト	4,500	484.00	2,178,000
イチカワ	6,000	279.00	1,674,000
日本バイリーン	8,000	631.00	5,048,000
芦森工業	21,000	180.00	3,780,000
アツギ	64,000	115.00	7,360,000
ダイニック	14,000	176.00	2,464,000
セーレン	18,900	955.00	18,049,500
東海染工	11,000	121.00	1,331,000

小松精練	13,200	534.00	7,048,800	
ワコールホールディングス	45,000	1,160.00	52,200,000	
ホギメディカル	4,800	5,710.00	27,408,000	
レナウン	18,300	110.00	2,013,000	
クラウドディア	1,500	1,280.00	1,920,000	
T S Iホールディングス	34,600	680.00	23,528,000	
三陽商会	42,000	293.00	12,306,000	
オンワードホールディングス	55,000	684.00	37,620,000	
ルック	16,000	251.00	4,016,000	
ゴールドウイン	19,000	619.00	11,761,000	
デサント	18,000	1,069.00	19,242,000	
キング	3,800	439.00	1,668,200	
ヤマトインターナショナル	5,100	403.00	2,055,300	
特種東海製紙	44,000	261.00	11,484,000	
王子ホールディングス	312,000	400.00	124,800,000	
日本製紙	36,700	1,666.00	61,142,200	
三菱製紙	116,000	86.00	9,976,000	
北越紀州製紙	47,100	463.00	21,807,300	
中越パルプ工業	29,000	183.00	5,307,000	
巴川製紙所	12,000	190.00	2,280,000	
大王製紙	34,000	953.00	32,402,000	
レンゴー	67,000	473.00	31,691,000	
トモク	24,000	279.00	6,696,000	
ザ・パック	5,400	2,303.00	12,436,200	
クラレ	129,300	1,317.00	170,288,100	
旭化成	474,000	949.00	449,826,000	
共和レザー	5,000	782.00	3,910,000	
コープケミカル	11,000	104.00	1,144,000	
昭和電工	506,000	152.00	76,912,000	
住友化学	559,000	394.00	220,246,000	
日本化成	14,000	142.00	1,988,000	
住友精化	16,000	711.00	11,376,000	
日産化学工業	50,800	2,104.00	106,883,200	
ラサ工業	29,000	137.00	3,973,000	
クレハ	53,000	517.00	27,401,000	
多木化学	5,000	756.00	3,780,000	
テイカ	13,000	450.00	5,850,000	
石原産業	127,000	91.00	11,557,000	
片倉チッカリン	5,000	265.00	1,325,000	
日本曹達	49,000	618.00	30,282,000	
東ソー	190,000	499.00	94,810,000	
トクヤマ	118,000	244.00	28,792,000	

セントラル硝子	77,000	370.00	28,490,000
東亜合成	95,000	492.00	46,740,000
ダイソー	30,000	363.00	10,890,000
関東電化工業	18,000	444.00	7,992,000
電気化学工業	157,000	382.00	59,974,000
信越化学工業	136,200	7,417.00	1,010,195,400
日本カーバイド工業	26,000	240.00	6,240,000
堺化学工業	31,000	347.00	10,757,000
エア・ウォーター	67,000	1,793.00	120,131,000
大陽日酸	98,000	1,066.00	104,468,000
日本化学工業	28,000	165.00	4,620,000
日本パーカラライジング	17,900	2,528.00	45,251,200
高圧ガス工業	11,000	598.00	6,578,000
チタン工業	9,000	250.00	2,250,000
四国化成工業	11,000	790.00	8,690,000
戸田工業	15,000	453.00	6,795,000
ステラ ケミファ	3,900	1,346.00	5,249,400
保土谷化学工業	23,000	193.00	4,439,000
日本触媒	60,000	1,382.00	82,920,000
大日精化工業	31,000	595.00	18,445,000
カネカ	102,000	644.00	65,688,000
三菱瓦斯化学	131,000	693.00	90,783,000
三井化学	345,000	318.00	109,710,000
J S R	75,000	2,042.00	153,150,000
東京応化工業	15,700	3,285.00	51,574,500
大阪有機化学工業	5,500	492.00	2,706,000
三菱ケミカルホールディングス	474,900	565.30	268,460,970
日本合成化学工業	18,000	711.00	12,798,000
ダイセル	107,000	1,293.00	138,351,000
住友ベークライト	71,000	446.00	31,666,000
積水化学工業	180,000	1,397.00	251,460,000
日本ゼオン	65,000	1,070.00	69,550,000
アイカ工業	22,800	2,232.00	50,889,600
宇部興産	383,000	172.00	65,876,000
積水樹脂	11,100	1,512.00	16,783,200
タキロン	16,000	523.00	8,368,000
旭有機材工業	27,000	280.00	7,560,000
日立化成	37,500	2,118.00	79,425,000
ニチバン	8,000	389.00	3,112,000
リケンテクノス	12,300	452.00	5,559,600
大倉工業	18,000	392.00	7,056,000
積水化成品工業	22,000	347.00	7,634,000

群栄化学工業	20,000	343.00	6,860,000
タイガースポリマー	3,700	703.00	2,601,100
ミライアル	2,600	1,706.00	4,435,600
ダイキョーニシカワ	1,800	3,075.00	5,535,000
日本化薬	49,000	1,445.00	70,805,000
カーリットホールディングス	6,300	585.00	3,685,500
日本精化	6,300	860.00	5,418,000
A D E K A	35,000	1,426.00	49,910,000
日油	63,000	729.00	45,927,000
ハリマ化成グループ	6,900	462.00	3,187,800
花王	209,200	4,313.00	902,279,600
第一工業製薬	14,000	427.00	5,978,000
三洋化成工業	24,000	709.00	17,016,000
大日本塗料	43,000	158.00	6,794,000
日本ペイントホールディングス	66,000	2,517.00	166,122,000
関西ペイント	92,000	1,653.00	152,076,000
神東塗料	6,000	207.00	1,242,000
中国塗料	22,000	859.00	18,898,000
日本特殊塗料	5,800	745.00	4,321,000
藤倉化成	10,300	585.00	6,025,500
太陽ホールディングス	6,200	3,855.00	23,901,000
D I C	304,000	238.00	72,352,000
サカタインクス	15,500	1,153.00	17,871,500
東洋インキＳＣホールディングス	75,000	528.00	39,600,000
T & K T O K A	2,500	2,465.00	6,162,500
富士フイルムホールディングス	173,800	3,718.50	646,275,300
資生堂	135,100	1,686.50	227,846,150
ライオン	88,000	631.00	55,528,000
高砂香料工業	25,000	538.00	13,450,000
マンダム	7,600	3,785.00	28,766,000
ミルボン	4,500	3,500.00	15,750,000
ファンケル	17,600	1,451.00	25,537,600
コーセー	12,300	4,110.00	50,553,000
コタ	2,200	1,295.00	2,849,000
ドクターシーラボ	5,200	3,520.00	18,304,000
シーボン	700	2,322.00	1,625,400
ポーラ・オルビスホールディングス	9,000	4,085.00	36,765,000
ノエビアホールディングス	5,100	1,976.00	10,077,600
アジュバンコスメジャパン	1,400	935.00	1,309,000
エステー	5,000	1,015.00	5,075,000
アグロ カネショウ	2,100	1,055.00	2,215,500
コニシ	6,000	1,882.00	11,292,000



長谷川香料	9,600	1,606.00	15,417,600
星光PMC	4,200	1,011.00	4,246,200
小林製薬	12,500	6,650.00	83,125,000
荒川化学工業	6,400	1,131.00	7,238,400
メック	5,900	1,192.00	7,032,800
日本高純度化学	2,200	2,380.00	5,236,000
JCU	2,100	5,030.00	10,563,000
新田ゼラチン	4,800	813.00	3,902,400
アース製薬	5,500	4,080.00	22,440,000
イハラケミカル工業	11,700	1,167.00	13,653,900
北興化学工業	8,000	381.00	3,048,000
大成ラミック	2,100	2,719.00	5,709,900
クミアイ化学工業	16,000	665.00	10,640,000
日本農薬	17,300	1,133.00	19,600,900
アキレス	65,000	156.00	10,140,000
有沢製作所	12,700	797.00	10,121,900
日東電工	58,700	6,076.00	356,661,200
レック	2,600	1,202.00	3,125,200
きもと	13,600	298.00	4,052,800
藤森工業	6,500	3,310.00	21,515,000
前澤化成工業	5,300	1,139.00	6,036,700
JSP	5,200	1,785.00	9,282,000
エフピコ	6,700	3,455.00	23,148,500
天馬	6,000	1,604.00	9,624,000
信越ポリマー	14,900	511.00	7,613,900
東リ	20,000	244.00	4,880,000
ニフコ	17,000	3,465.00	58,905,000
日本バルカー工業	32,000	317.00	10,144,000
ユニ・チャーム	153,800	2,511.00	386,191,800
協和発酵キリン	91,000	1,274.00	115,934,000
武田薬品工業	284,600	4,873.50	1,386,998,100
アステラス製薬	865,100	1,752.50	1,516,087,750
大日本住友製薬	53,800	1,268.00	68,218,400
塩野義製薬	118,600	2,847.00	337,654,200
田辺三菱製薬	88,500	1,750.00	154,875,000
わかもと製薬	9,000	268.00	2,412,000
あすか製薬	8,900	1,199.00	10,671,100
日本新薬	17,000	3,195.00	54,315,000
ピオフェルミン製薬	1,200	2,911.00	3,493,200
中外製薬	75,600	3,375.00	255,150,000
科研製薬	26,000	2,695.00	70,070,000
エーザイ	100,200	4,308.50	431,711,700

ロート製薬	34,500	1,553.00	53,578,500
小野薬品工業	34,500	10,920.00	376,740,000
久光製薬	21,400	3,760.00	80,464,000
有機合成薬品工業	5,000	263.00	1,315,000
持田製薬	5,400	6,730.00	36,342,000
参天製薬	27,900	6,560.00	183,024,000
扶桑薬品工業	26,000	298.00	7,748,000
日本ケミファ	10,000	564.00	5,640,000
ツムラ	23,900	2,565.00	61,303,500
日医工	17,800	1,773.00	31,559,400
キッセイ薬品工業	14,100	2,976.00	41,961,600
生化学工業	14,500	1,780.00	25,810,000
栄研化学	6,400	1,912.00	12,236,800
日水製薬	3,000	1,267.00	3,801,000
鳥居薬品	5,200	3,150.00	16,380,000
JCRファーマ	5,800	2,323.00	13,473,400
東和薬品	3,900	4,995.00	19,480,500
富士製薬工業	2,100	2,136.00	4,485,600
沢井製薬	12,000	6,410.00	76,920,000
ゼリア新薬工業	15,600	2,005.00	31,278,000
第一三共	255,500	1,700.50	434,477,750
キョーリン製薬ホールディングス	20,300	2,337.00	47,441,100
大幸薬品	3,300	1,908.00	6,296,400
ダイト	2,800	1,988.00	5,566,400
大塚ホールディングス	150,700	3,910.50	589,312,350
大正製薬ホールディングス	18,300	7,670.00	140,361,000
日本コークス工業	68,100	113.00	7,695,300
昭和シェル石油	67,900	948.00	64,369,200
コスモ石油	210,000	163.00	34,230,000
ニチレキ	9,000	842.00	7,578,000
東燃ゼネラル石油	115,000	978.00	112,470,000
ユシロ化学工業	4,400	1,493.00	6,569,200
ピーピー・カストロール	3,100	1,169.00	3,623,900
富士石油	17,600	323.00	5,684,800
MORESCO	2,000	1,769.00	3,538,000
出光興産	36,000	2,096.00	75,456,000
JXホールディングス	843,000	457.40	385,588,200
横浜ゴム	85,000	1,025.00	87,125,000
東洋ゴム工業	34,400	1,887.00	64,912,800
ブリヂストン	238,000	3,826.00	910,588,000
住友ゴム工業	59,200	1,633.00	96,673,600
藤倉ゴム工業	6,300	823.00	5,184,900

オカモト	26,000	424.00	11,024,000	
フコク	3,200	1,283.00	4,105,600	
ニッタ	7,500	2,726.00	20,445,000	
住友理工	14,100	973.00	13,719,300	
三ツ星ベルト	19,000	812.00	15,428,000	
バンドー化学	28,000	429.00	12,012,000	
日東紡績	56,000	415.00	23,240,000	
旭硝子	374,000	580.00	216,920,000	
日本板硝子	366,000	108.00	39,528,000	
石塚硝子	10,000	160.00	1,600,000	
日本山村硝子	31,000	165.00	5,115,000	
日本電気硝子	146,000	514.00	75,044,000	
オハラ	2,900	579.00	1,679,100	
住友大阪セメント	141,000	364.00	51,324,000	
太平洋セメント	474,000	398.00	188,652,000	
デイ・シイ	8,500	483.00	4,105,500	
日本ヒューム	8,000	878.00	7,024,000	
日本コンクリート工業	13,400	654.00	8,763,600	
三谷セキサン	3,800	1,919.00	7,292,200	
ジャパンパイル	10,200	792.00	8,078,400	
東海カーボン	66,000	296.00	19,536,000	
日本カーボン	40,000	187.00	7,480,000	
東洋炭素	4,200	2,109.00	8,857,800	
ノリタケカンパニーリミテド	43,000	262.00	11,266,000	
TOTO	112,000	1,304.00	146,048,000	
日本碍子	96,000	2,601.00	249,696,000	
日本特殊陶業	65,500	3,185.00	208,617,500	
MARUWA	2,200	3,205.00	7,051,000	
品川リフラクトリーズ	21,000	267.00	5,607,000	
黒崎播磨	18,000	252.00	4,536,000	
ヨータイ	4,000	378.00	1,512,000	
イソライト工業	5,500	209.00	1,149,500	
東京窯業	10,000	206.00	2,060,000	
ニッカトー	2,700	408.00	1,101,600	
フジインコーポレーテッド	7,600	1,517.00	11,529,200	
ニチアス	34,000	675.00	22,950,000	
ニチハ	10,400	1,017.00	10,576,800	
新日鐵住金	3,210,000	302.60	971,346,000	
神戸製鋼所	1,314,000	178.00	233,892,000	
合同製鐵	40,000	159.00	6,360,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	193,700	2,326.00	450,546,200	
日新製鋼	32,600	1,028.00	33,512,800	

東京製鐵	38,600	590.00	22,774,000
共英製鋼	8,200	1,869.00	15,325,800
大和工業	17,300	3,495.00	60,463,500
東京鐵鋼	15,000	501.00	7,515,000
大阪製鐵	4,000	2,012.00	8,048,000
淀川製鋼所	54,000	414.00	22,356,000
東洋鋼鋳	18,000	644.00	11,592,000
丸一鋼管	23,300	2,599.00	60,556,700
モリ工業	12,000	422.00	5,064,000
大同特殊鋼	128,000	434.00	55,552,000
日本高周波鋼業	32,000	111.00	3,552,000
日本冶金工業	60,800	282.00	17,145,600
山陽特殊製鋼	46,000	380.00	17,480,000
愛知製鋼	45,000	407.00	18,315,000
日立金属	77,000	1,948.00	149,996,000
日本金属	20,000	147.00	2,940,000
大平洋金属	49,000	342.00	16,758,000
新日本電工	46,800	299.00	13,993,200
栗本鐵工所	40,000	224.00	8,960,000
虹技	12,000	216.00	2,592,000
日本鑄鉄管	9,000	242.00	2,178,000
三菱製鋼	50,000	250.00	12,500,000
日亜鋼業	11,000	338.00	3,718,000
日本精線	6,000	681.00	4,086,000
シンニッタン	8,100	585.00	4,738,500
新家工業	16,000	181.00	2,896,000
大紀アルミニウム工業所	13,000	308.00	4,004,000
日本軽金属ホールディングス	184,200	166.00	30,577,200
三井金属鋳業	206,000	286.00	58,916,000
東邦亜鉛	43,000	372.00	15,996,000
三菱マテリアル	474,000	343.00	162,582,000
住友金属鋳山	210,000	1,527.00	320,670,000
D O W A ホールディングス	91,000	938.00	85,358,000
古河機械金属	118,000	220.00	25,960,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,500	2,105.00	15,787,500
東邦チタニウム	12,800	703.00	8,998,400
U A C J	87,000	361.00	31,407,000
古河電気工業	223,000	195.00	43,485,000
住友電気工業	286,100	1,522.00	435,444,200
フジクラ	106,000	459.00	48,654,000
昭和電線ホールディングス	83,000	100.00	8,300,000
東京特殊電線	1,100	1,690.00	1,859,000

タツタ電線	14,900	544.00	8,105,600	
沖電線	10,000	284.00	2,840,000	
カナレ電気	1,400	1,788.00	2,503,200	
平河ヒューテック	2,200	1,081.00	2,378,200	
リョービ	42,000	313.00	13,146,000	
アーレスティ	6,600	653.00	4,309,800	
アサヒホールディングス	11,400	1,819.00	20,736,600	
稲葉製作所	3,200	1,389.00	4,444,800	
宮地エンジニアリンググループ	22,000	197.00	4,334,000	
トーカロ	5,100	1,932.00	9,853,200	
アルファC o	3,100	1,119.00	3,468,900	
SUMCO	52,600	1,522.00	80,057,200	
川田テクノロジーズ	1,600	4,930.00	7,888,000	
東洋製罐グループホールディングス	54,100	1,367.00	73,954,700	
ホッカンホールディングス	21,000	282.00	5,922,000	
コロナ	4,000	1,192.00	4,768,000	
横河ブリッジホールディングス	14,600	1,339.00	19,549,400	
駒井ハルテック	16,000	265.00	4,240,000	
高田機工	8,000	216.00	1,728,000	
三和ホールディングス	73,300	823.00	60,325,900	
文化シャッター	21,000	995.00	20,895,000	
三協立山	9,400	2,001.00	18,809,400	
東洋シャッター	2,700	783.00	2,114,100	
LIXILグループ	112,800	2,322.00	261,921,600	
日本フィルコン	6,100	530.00	3,233,000	
ノーリツ	14,900	2,000.00	29,800,000	
長府製作所	8,100	3,140.00	25,434,000	
リンナイ	14,100	8,790.00	123,939,000	
ダイニチ工業	4,000	772.00	3,088,000	
日東精工	12,000	374.00	4,488,000	
三洋工業	11,000	205.00	2,255,000	
岡部	15,200	1,006.00	15,291,200	
東プレ	14,700	1,544.00	22,696,800	
高周波熱錬	12,000	788.00	9,456,000	
サンコール	5,000	656.00	3,280,000	
モリテック スチール	4,700	320.00	1,504,000	
パイオラックス	3,900	4,905.00	19,129,500	
日本発條	66,000	1,003.00	66,198,000	
中央発條	11,000	318.00	3,498,000	
アドバネクス	18,000	173.00	3,114,000	
三益半導体工業	6,400	997.00	6,380,800	
日本ドライケミカル	800	2,303.00	1,842,400	

日本製鋼所	109,000	421.00	45,889,000	
三浦工業	33,900	1,309.00	44,375,100	
タクマ	26,000	703.00	18,278,000	
ツガミ	22,000	593.00	13,046,000	
オークマ	49,000	855.00	41,895,000	
東芝機械	41,000	475.00	19,475,000	
アマダ	113,200	1,003.00	113,539,600	
アイダエンジニアリング	16,600	1,083.00	17,977,800	
滝澤鉄工所	30,000	212.00	6,360,000	
富士機械製造	24,900	1,033.00	25,721,700	
牧野フライス製作所	38,000	825.00	31,350,000	
オーエスジー	34,600	1,891.00	65,428,600	
ダイジェット工業	9,000	247.00	2,223,000	
旭ダイヤモンド工業	20,800	1,253.00	26,062,400	
D M G 森精機	47,900	1,345.00	64,425,500	
ディスコ	8,500	8,590.00	73,015,000	
日東工器	4,400	2,106.00	9,266,400	
パンチ工業	2,500	1,520.00	3,800,000	
豊和工業	4,600	749.00	3,445,400	
大阪機工	29,000	158.00	4,582,000	
東洋機械金属	7,200	462.00	3,326,400	
津田駒工業	21,000	148.00	3,108,000	
島精機製作所	10,700	1,989.00	21,282,300	
日阪製作所	9,700	1,019.00	9,884,300	
やまびこ	3,200	4,445.00	14,224,000	
ペガサスミシン製造	8,500	679.00	5,771,500	
ナプテスコ	46,200	2,817.00	130,145,400	
三井海洋開発	7,700	2,332.00	17,956,400	
レオン自動機	6,000	482.00	2,892,000	
S M C	23,300	30,840.00	718,572,000	
新川	6,300	584.00	3,679,200	
ホソカワミクロン	13,000	635.00	8,255,000	
ユニオンツール	3,800	2,863.00	10,879,400	
オイレス工業	9,500	2,034.00	19,323,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,600	2,481.00	6,450,600	
サトーホールディングス	9,500	2,797.00	26,571,500	
日本エアーテック	2,300	1,090.00	2,507,000	
日精樹脂工業	5,700	918.00	5,232,600	
ワイエイシイ	3,900	586.00	2,285,400	
小松製作所	376,400	2,732.00	1,028,324,800	
住友重機械工業	208,000	662.00	137,696,000	
日立建機	33,900	2,390.00	81,021,000	

日工	11,000	433.00	4,763,000
巴工業	2,900	1,708.00	4,953,200
井関農機	78,000	239.00	18,642,000
T O W A	7,000	669.00	4,683,000
丸山製作所	19,000	247.00	4,693,000
北川鉄工所	37,000	204.00	7,548,000
クボタ	366,000	1,757.00	643,062,000
荏原実業	2,300	1,428.00	3,284,400
三菱化工機	25,000	393.00	9,825,000
月島機械	13,400	1,239.00	16,602,600
帝国電機製作所	5,200	1,275.00	6,630,000
新東工業	17,900	785.00	14,051,500
澁谷工業	6,400	2,788.00	17,843,200
アイチ コーポレーション	10,800	551.00	5,950,800
小森コーポレーション	18,500	1,109.00	20,516,500
鶴見製作所	5,700	2,022.00	11,525,400
住友精密工業	13,000	438.00	5,694,000
酒井重工業	15,000	291.00	4,365,000
荏原製作所	157,000	571.00	89,647,000
石井鐵工所	13,000	241.00	3,133,000
西島製作所	7,500	891.00	6,682,500
北越工業	7,000	1,040.00	7,280,000
ダイキン工業	105,600	7,187.00	758,947,200
オルガノ	13,000	480.00	6,240,000
トーヨーカネツ	44,000	269.00	11,836,000
栗田工業	43,000	2,451.00	105,393,000
椿本チエイン	39,000	939.00	36,621,000
大同工業	17,000	261.00	4,437,000
日本コンベヤ	24,000	245.00	5,880,000
木村化工機	7,700	486.00	3,742,200
アネスト岩田	12,000	785.00	9,420,000
ダイフク	35,900	1,293.00	46,418,700
サムコ	1,000	991.00	991,000
加藤製作所	16,000	823.00	13,168,000
油研工業	16,000	252.00	4,032,000
タダノ	35,000	1,671.00	58,485,000
フジテック	21,200	1,082.00	22,938,400
C K D	20,400	956.00	19,502,400
キトー	8,900	1,275.00	11,347,500
平和	16,200	2,324.00	37,648,800
理想科学工業	4,400	3,540.00	15,576,000
S A N K Y O	22,000	3,900.00	85,800,000

日本金銭機械	6,900	1,658.00	11,440,200
マースエンジニアリング	4,100	2,014.00	8,257,400
福島工業	4,200	2,033.00	8,538,600
オーイズミ	3,600	864.00	3,110,400
ダイコク電機	3,000	1,847.00	5,541,000
アマノ	24,200	1,229.00	29,741,800
サンデン	46,000	669.00	30,774,000
マックス	11,000	1,255.00	13,805,000
グローリー	23,200	2,868.00	66,537,600
新晃工業	5,100	1,016.00	5,181,600
大和冷機工業	11,000	833.00	9,163,000
セガサミーホールディングス	78,300	1,678.00	131,387,400
日本ピストンリング	34,000	244.00	8,296,000
リケン	30,000	452.00	13,560,000
T P R	8,600	2,733.00	23,503,800
ホシザキ電機	15,900	5,440.00	86,496,000
大豊工業	6,300	1,221.00	7,692,300
日本精工	150,000	1,461.00	219,150,000
N T N	171,000	495.00	84,645,000
ジェイテクト	77,600	1,788.00	138,748,800
不二越	69,000	699.00	48,231,000
日本トムソン	26,000	499.00	12,974,000
T H K	48,300	2,733.00	132,003,900
ユーシン精機	3,200	2,326.00	7,443,200
前澤給装工業	2,800	1,383.00	3,872,400
イーグル工業	10,300	2,134.00	21,980,200
前澤工業	7,800	334.00	2,605,200
日本ピラー工業	8,000	855.00	6,840,000
キッツ	33,400	468.00	15,631,200
日立工機	19,500	969.00	18,895,500
マキタ	47,300	6,290.00	297,517,000
日立造船	57,100	628.00	35,858,800
三菱重工業	1,216,000	687.30	835,756,800
I H I	523,000	565.00	295,495,000
イビデン	47,600	1,699.00	80,872,400
コニカミノルタ	172,800	1,261.00	217,900,800
ブラザー工業	93,800	2,048.00	192,102,400
ミネベア	108,000	1,456.00	157,248,000
日立製作所	1,742,000	870.00	1,515,540,000
東芝	1,527,000	499.80	763,194,600
三菱電機	725,000	1,436.50	1,041,462,500
富士電機	202,000	483.00	97,566,000



東洋電機製造	15,000	397.00	5,955,000
安川電機	85,200	1,441.00	122,773,200
シンフォニアテクノロジー	50,000	164.00	8,200,000
明電舎	67,000	396.00	26,532,000
オリジン電気	11,000	449.00	4,939,000
山洋電気	16,000	783.00	12,528,000
デンヨー	6,600	1,548.00	10,216,800
東芝テック	52,000	772.00	40,144,000
芝浦メカトロニクス	12,000	345.00	4,140,000
マブチモーター	11,100	9,350.00	103,785,000
日本電産	78,400	7,216.00	565,734,400
東光高岳	3,700	1,620.00	5,994,000
ダイヘン	40,000	448.00	17,920,000
ヤーマン	900	1,335.00	1,201,500
JVCケンウッド	54,200	219.00	11,869,800
第一精工	2,600	2,055.00	5,343,000
日新電機	17,000	592.00	10,064,000
大崎電気工業	11,000	714.00	7,854,000
オムロン	81,800	5,250.00	429,450,000
日東工業	11,600	2,011.00	23,327,600
I D E C	8,600	929.00	7,989,400
不二電機工業	700	1,501.00	1,050,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	140,000	543.00	76,020,000
サクサホールディングス	18,000	160.00	2,880,000
メルコホールディングス	4,000	1,593.00	6,372,000
テクノメディカ	1,600	2,274.00	3,638,400
日本電気	939,000	381.00	357,759,000
富士通	699,000	675.40	472,104,600
沖電気工業	248,000	254.00	62,992,000
岩崎通信機	32,000	92.00	2,944,000
電気興業	21,000	542.00	11,382,000
サンケン電気	37,000	998.00	36,926,000
ナカヨ	7,000	367.00	2,569,000
アイホン	4,200	1,988.00	8,349,600
ルネサスエレクトロニクス	37,500	827.00	31,012,500
セイコーエプソン	49,500	5,260.00	260,370,000
ワコム	57,100	428.00	24,438,800
アルバック	13,300	1,368.00	18,194,400
アクセル	3,400	1,493.00	5,076,200
E I Z O	6,700	2,338.00	15,664,600
ジャパンディスプレイ	112,400	343.00	38,553,200
日本信号	20,000	1,071.00	21,420,000

京三製作所	17,000	356.00	6,052,000
能美防災	9,600	1,577.00	15,139,200
ホーチキ	5,000	937.00	4,685,000
エレコム	2,300	2,636.00	6,062,800
日本無線	16,000	396.00	6,336,000
パナソニック	883,900	1,418.00	1,253,370,200
シャープ	613,000	289.00	177,157,000
アンリツ	45,400	840.00	38,136,000
富士通ゼネラル	22,000	1,373.00	30,206,000
日立国際電気	19,000	1,722.00	32,718,000
ソニー	466,000	2,344.00	1,092,304,000
T D K	43,800	6,530.00	286,014,000
帝国通信工業	17,000	178.00	3,026,000
ミツミ電機	25,600	793.00	20,300,800
タムラ製作所	28,000	394.00	11,032,000
アルプス電気	57,200	2,081.00	119,033,200
池上通信機	25,000	122.00	3,050,000
パイオニア	109,000	258.00	28,122,000
日本電波工業	6,800	933.00	6,344,400
鈴木	800	880.00	704,000
日本トリム	1,800	2,423.00	4,361,400
ローランド ディー・ジー	2,900	4,200.00	12,180,000
フォスター電機	7,400	1,794.00	13,275,600
クラリオン	38,000	406.00	15,428,000
S M K	21,000	432.00	9,072,000
ヨコオ	5,600	579.00	3,242,400
東光	17,000	304.00	5,168,000
ホシデン	22,900	653.00	14,953,700
ヒロセ電機	11,700	14,300.00	167,310,000
日本航空電子工業	21,000	2,325.00	48,825,000
T O A	7,800	1,185.00	9,243,000
日立マクセル	10,800	1,738.00	18,770,400
古野電気	8,900	917.00	8,161,300
ユニデン	20,000	239.00	4,780,000
アルパイン	17,300	1,939.00	33,544,700
スミダコーポレーション	6,800	812.00	5,521,600
アイコム	4,000	2,788.00	11,152,000
リオン	2,100	1,444.00	3,032,400
船井電機	7,300	1,298.00	9,475,400
横河電機	72,600	1,506.00	109,335,600
新電元工業	28,000	698.00	19,544,000
アズビル	23,700	2,629.00	62,307,300

東亜ディーケーケー	3,000	578.00	1,734,000	
日本光電工業	15,500	5,650.00	87,575,000	
チノー	2,600	1,206.00	3,135,600	
共和電業	8,800	463.00	4,074,400	
日本電子材料	3,100	671.00	2,080,100	
堀場製作所	13,400	4,060.00	54,404,000	
アドバンテスト	49,400	1,334.00	65,899,600	
小野測器	3,700	963.00	3,563,100	
エスベック	8,000	1,006.00	8,048,000	
パナソニック デバイスSUNX	6,400	608.00	3,891,200	
キーエンス	16,400	53,700.00	880,680,000	
日置電機	3,800	1,690.00	6,422,000	
シスメックス	56,100	4,730.00	265,353,000	
メガチップス	6,800	1,478.00	10,050,400	
OBARA GROUP	4,700	4,235.00	19,904,500	
澤藤電機	5,000	228.00	1,140,000	
コーセル	10,500	1,298.00	13,629,000	
新日本無線	5,000	485.00	2,425,000	
オブテックス	5,000	2,002.00	10,010,000	
千代田インテグレ	3,200	1,956.00	6,259,200	
レーザーテック	7,400	1,257.00	9,301,800	
スタンレー電気	52,200	2,257.00	117,815,400	
岩崎電気	26,000	247.00	6,422,000	
ウシオ電機	44,000	1,115.00	49,060,000	
岡谷電機産業	3,900	375.00	1,462,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	6,700	318.00	2,130,600	
日本セラミック	4,200	1,669.00	7,009,800	
遠藤照明	3,300	1,326.00	4,375,800	
日本デジタル研究所	6,100	1,770.00	10,797,000	
古河電池	5,000	1,011.00	5,055,000	
双信電機	3,500	401.00	1,403,500	
山一電機	8,600	934.00	8,032,400	
図研	5,200	1,057.00	5,496,400	
日本電子	31,000	543.00	16,833,000	
カシオ計算機	72,700	1,707.00	124,098,900	
ファナック	75,500	19,660.00	1,484,330,000	
日本シイエムケイ	18,500	275.00	5,087,500	
エンブラス	3,300	3,945.00	13,018,500	
大真空	14,000	343.00	4,802,000	
ローム	35,800	7,060.00	252,748,000	
浜松ホトニクス	30,200	5,160.00	155,832,000	
三井ハイテック	9,600	684.00	6,566,400	

新光電気工業	27,400	689.00	18,878,600
京セラ	119,100	5,175.00	616,342,500
太陽誘電	38,000	1,208.00	45,904,000
村田製作所	76,100	12,370.00	941,357,000
ユーシン	10,400	725.00	7,540,000
双葉電子工業	12,400	1,622.00	20,112,800
北陸電気工業	31,000	169.00	5,239,000
ニチコン	22,800	828.00	18,878,400
日本ケミコン	59,000	308.00	18,172,000
K O A	10,000	1,018.00	10,180,000
市光工業	18,000	251.00	4,518,000
小糸製作所	43,500	3,395.00	147,682,500
ミツバ	13,500	1,824.00	24,624,000
スター精密	13,800	1,659.00	22,894,200
S C R E E Nホールディングス	69,000	666.00	45,954,000
キヤノン電子	6,700	2,041.00	13,674,700
キヤノン	420,500	3,534.00	1,486,047,000
リコー	218,100	1,208.50	263,573,850
M U T O Hホールディングス	10,000	537.00	5,370,000
東京エレクトロン	61,000	7,407.00	451,827,000
トヨタ紡織	25,400	1,287.00	32,689,800
鬼怒川ゴム工業	17,000	490.00	8,330,000
ユニプレス	13,900	2,020.00	28,078,000
豊田自動織機	66,000	5,550.00	366,300,000
モリタホールディングス	12,700	1,114.00	14,147,800
三櫻工業	9,200	738.00	6,789,600
デンソー	179,200	5,274.00	945,100,800
東海理化電機製作所	19,100	2,257.00	43,108,700
三井造船	281,000	245.00	68,845,000
川崎重工業	527,000	457.00	240,839,000
名村造船所	20,200	1,180.00	23,836,000
サノヤスホールディングス	8,800	282.00	2,481,600
日本車輛製造	26,000	345.00	8,970,000
ニチュ三菱フォークリフト	8,400	755.00	6,342,000
近畿車輛	11,000	288.00	3,168,000
日産自動車	1,018,100	1,040.50	1,059,333,050
いすゞ自動車	229,300	1,491.00	341,886,300
トヨタ自動車	1,000,600	6,712.00	6,716,027,200
日野自動車	103,500	1,599.00	165,496,500
三菱自動車工業	265,800	1,201.00	319,225,800
エフテック	3,200	1,143.00	3,657,600
レシップホールディングス	2,400	876.00	2,102,400

G M B	1,000	1,269.00	1,269,000
武蔵精密工業	7,700	2,269.00	17,471,300
日産車体	31,900	1,497.00	47,754,300
新明和工業	29,000	1,016.00	29,464,000
極東開発工業	13,500	1,545.00	20,857,500
日信工業	13,300	1,793.00	23,846,900
トビー工業	60,000	214.00	12,840,000
ティラド	28,000	246.00	6,888,000
曙ブレーキ工業	30,600	452.00	13,831,200
タチエス	11,500	1,495.00	17,192,500
N O K	35,100	2,883.00	101,193,300
フタバ産業	22,100	605.00	13,370,500
カヤバ工業	81,000	486.00	39,366,000
シロキ工業	16,000	223.00	3,568,000
大同メタル工業	10,000	1,353.00	13,530,000
プレス工業	36,000	415.00	14,940,000
カルソニックカンセイ	55,000	616.00	33,880,000
太平洋工業	14,800	837.00	12,387,600
ケーヒン	16,700	1,596.00	26,653,200
河西工業	8,900	959.00	8,535,100
アイシン精機	66,400	3,885.00	257,964,000
富士機工	8,000	535.00	4,280,000
マツダ	216,100	2,724.50	588,764,450
ダイハツ工業	86,600	1,586.00	137,347,600
今仙電機製作所	6,100	1,893.00	11,547,300
本田技研工業	652,700	3,588.50	2,342,213,950
スズキ	151,600	3,529.50	535,072,200
富士重工業	246,800	4,010.00	989,668,000
安永	2,400	592.00	1,420,800
ヤマハ発動機	110,300	2,286.00	252,145,800
ショーワ	17,100	1,192.00	20,383,200
T B K	8,300	645.00	5,353,500
エクセディ	9,800	2,930.00	28,714,000
豊田合成	23,400	2,218.00	51,901,200
愛三工業	11,200	878.00	9,833,600
盟和産業	6,000	155.00	930,000
ヨロズ	6,800	2,031.00	13,810,800
エフ・シー・シー	10,700	1,962.00	20,993,400
シマノ	31,300	15,000.00	469,500,000
テイ・エス テック	15,300	2,806.00	42,931,800
テルモ	111,200	2,763.00	307,245,600
クリエートメディック	2,400	1,045.00	2,508,000

日機装	23,500	1,175.00	27,612,500
島津製作所	87,000	970.00	84,390,000
JMS	13,000	289.00	3,757,000
ショットモリテックス	1,600	275.00	440,000
長野計器	4,700	668.00	3,139,600
ブイ・テクノロジー	1,400	2,385.00	3,339,000
東京計器	25,000	262.00	6,550,000
愛知時計電機	10,000	322.00	3,220,000
オーバル	5,400	292.00	1,576,800
東京精密	13,000	1,876.00	24,388,000
マニー	2,000	6,980.00	13,960,000
ニコン	135,400	1,530.00	207,162,000
トプコン	21,900	2,683.00	58,757,700
オリンパス	108,000	4,205.00	454,140,000
理研計器	6,400	1,089.00	6,969,600
タムロン	5,600	2,171.00	12,157,600
HOYA	172,600	3,992.00	689,019,200
ノーリツ鋼機	6,500	624.00	4,056,000
エー・アンド・デイ	6,600	517.00	3,412,200
シチズンホールディングス	89,300	759.00	67,778,700
リズム時計工業	32,000	155.00	4,960,000
大研医器	2,500	2,331.00	5,827,500
松風	3,600	1,359.00	4,892,400
セイコーホールディングス	51,000	573.00	29,223,000
ニプロ	46,400	915.00	42,456,000
パラマウントベッドホールディングス	7,600	3,165.00	24,054,000
SHO-BI	2,400	408.00	979,200
前田工織	7,200	1,214.00	8,740,800
永大産業	10,000	448.00	4,480,000
アートネイチャー	5,200	1,413.00	7,347,600
ダンロップスポーツ	4,600	1,352.00	6,219,200
パンダイナムコホールディングス	80,000	2,478.00	198,240,000
共立印刷	13,100	285.00	3,733,500
フランスベッドホールディングス	47,000	184.00	8,648,000
パイロットコーポレーション	6,300	6,330.00	39,879,000
萩原工業	1,500	1,756.00	2,634,000
トッパン・フォームズ	12,900	1,091.00	14,073,900
フジシールインターナショナル	8,800	3,460.00	30,448,000
タカラトミー	26,000	610.00	15,860,000
廣済堂	6,700	452.00	3,028,400
アーク	22,900	149.00	3,412,100
タカノ	3,200	596.00	1,907,200

プロネクサス	7,400	721.00	5,335,400
ホクシン	5,300	132.00	699,600
ウッドワン	12,000	278.00	3,336,000
大建工業	29,000	259.00	7,511,000
凸版印刷	205,000	738.00	151,290,000
大日本印刷	221,000	1,056.00	233,376,000
図書印刷	12,000	347.00	4,164,000
共同印刷	22,000	385.00	8,470,000
日本写真印刷	12,200	1,616.00	19,715,200
光村印刷	7,000	262.00	1,834,000
宝印刷	4,100	783.00	3,210,300
アシックス	72,000	2,880.00	207,360,000
ツツミ	3,600	2,525.00	9,090,000
小松ウオール工業	2,200	2,597.00	5,713,400
ヤマハ	53,300	1,532.00	81,655,600
河合楽器製作所	2,500	2,075.00	5,187,500
クリナップ	7,400	869.00	6,430,600
ピジョン	13,700	6,910.00	94,667,000
兼松日産農林	11,000	165.00	1,815,000
キングジム	6,000	748.00	4,488,000
リンテック	17,200	2,380.00	40,936,000
T A S A K I	1,400	1,167.00	1,633,800
イトーキ	15,300	591.00	9,042,300
任天堂	44,700	12,055.00	538,858,500
三菱鉛筆	6,000	3,580.00	21,480,000
タカラスタANDARD	30,000	827.00	24,810,000
コクヨ	37,700	897.00	33,816,900
ナカバヤシ	15,000	204.00	3,060,000
グローブライド	35,000	158.00	5,530,000
岡村製作所	27,800	771.00	21,433,800
美津濃	39,000	559.00	21,801,000
アデランス	9,100	1,260.00	11,466,000
東京電力	615,200	439.00	270,072,800
中部電力	221,900	1,410.00	312,879,000
関西電力	296,000	1,120.00	331,520,000
中国電力	100,300	1,514.00	151,854,200
北陸電力	71,000	1,530.00	108,630,000
東北電力	181,200	1,428.00	258,753,600
四国電力	65,300	1,539.00	100,496,700
九州電力	160,200	1,260.00	201,852,000
北海道電力	67,900	961.00	65,251,900
沖縄電力	4,700	3,500.00	16,450,000

電源開発	48,800	3,895.00	190,076,000
東京瓦斯	882,000	645.30	569,154,600
大阪瓦斯	751,000	452.10	339,527,100
東邦瓦斯	184,000	615.00	113,160,000
北海道瓦斯	14,000	290.00	4,060,000
西部瓦斯	82,000	269.00	22,058,000
静岡瓦斯	20,600	733.00	15,099,800
SBSホールディングス	5,400	957.00	5,167,800
東武鉄道	388,000	557.00	216,116,000
相鉄ホールディングス	124,000	433.00	53,692,000
東京急行電鉄	394,000	720.00	283,680,000
京浜急行電鉄	199,000	911.00	181,289,000
小田急電鉄	232,000	1,057.00	245,224,000
京王電鉄	203,000	857.00	173,971,000
京成電鉄	109,000	1,281.00	139,629,000
富士急行	20,000	1,107.00	22,140,000
新京成電鉄	9,000	385.00	3,465,000
東日本旅客鉄道	132,900	8,698.00	1,155,964,200
西日本旅客鉄道	69,800	5,425.00	378,665,000
東海旅客鉄道	64,900	16,820.00	1,091,618,000
西武ホールディングス	57,800	2,189.00	126,524,200
鴻池運輸	4,500	2,213.00	9,958,500
西日本鉄道	94,000	475.00	44,650,000
ハマキョウレックス	2,300	3,620.00	8,326,000
サカイ引越センター	1,200	3,470.00	4,164,000
近畿日本鉄道	730,000	393.00	286,890,000
阪急阪神ホールディングス	487,000	650.00	316,550,000
南海電気鉄道	151,000	544.00	82,144,000
京阪電気鉄道	162,000	579.00	93,798,000
神戸電鉄	18,000	373.00	6,714,000
名糖運輸	3,000	679.00	2,037,000
名古屋鉄道	259,000	471.00	121,989,000
山陽電気鉄道	26,000	447.00	11,622,000
日本通運	287,000	513.00	147,231,000
ヤマトホールディングス	133,100	2,423.00	322,501,300
山九	88,000	477.00	41,976,000
丸運	3,900	249.00	971,100
丸全昭和運輸	24,000	352.00	8,448,000
センコー	29,000	506.00	14,674,000
トナミホールディングス	15,000	259.00	3,885,000
日本梱包運輸倉庫	23,700	1,780.00	42,186,000
日本石油輸送	8,000	230.00	1,840,000



福山通運	44,000	592.00	26,048,000
セイノーホールディングス	56,000	923.00	51,688,000
神奈川中央交通	9,000	548.00	4,932,000
日立物流	15,100	1,561.00	23,571,100
日本郵船	613,000	302.00	185,126,000
商船三井	381,000	347.00	132,207,000
川崎汽船	318,000	283.00	89,994,000
N S ユナイテッド海運	39,000	300.00	11,700,000
飯野海運	39,700	668.00	26,519,600
共栄タンカー	15,000	211.00	3,165,000
日本航空	139,100	3,095.00	430,514,500
A N A ホールディングス	1,427,000	261.00	372,447,000
パスコ	13,000	341.00	4,433,000
トランコム	2,100	4,550.00	9,555,000
日新	27,000	279.00	7,533,000
三菱倉庫	48,000	1,718.00	82,464,000
三井倉庫ホールディングス	42,000	433.00	18,186,000
住友倉庫	53,000	633.00	33,549,000
澁澤倉庫	18,000	376.00	6,768,000
東陽倉庫	12,000	275.00	3,300,000
乾汽船	4,800	1,031.00	4,948,800
日本トランスシティ	16,000	373.00	5,968,000
ケイヒン	13,000	163.00	2,119,000
中央倉庫	4,200	905.00	3,801,000
安田倉庫	5,600	1,019.00	5,706,400
東洋埠頭	23,000	207.00	4,761,000
宇徳	5,900	614.00	3,622,600
上組	86,000	1,089.00	93,654,000
サンリツ	1,800	523.00	941,400
キムラユニティー	1,700	970.00	1,649,000
キューソー流通システム	2,000	1,281.00	2,562,000
郵船ロジスティクス	6,700	1,213.00	8,127,100
近鉄エクスプレス	6,500	4,090.00	26,585,000
東海運	3,900	269.00	1,049,100
エーアイティー	2,800	788.00	2,206,400
N E C ネットエスアイ	9,000	2,476.00	22,284,000
システナ	7,000	833.00	5,831,000
デジタルアーツ	3,800	1,132.00	4,301,600
新日鉄住金ソリューションズ	6,000	3,355.00	20,130,000
キューブシステム	3,100	526.00	1,630,600
コア	3,000	791.00	2,373,000
ソフトクリエイイトホールディングス	2,300	936.00	2,152,800

I Tホールディングス	23,700	1,827.00	43,299,900
ネオス	1,900	729.00	1,385,100
電算システム	2,500	1,581.00	3,952,500
グリー	43,300	813.00	35,202,900
コーエーテクモホールディングス	16,200	1,743.00	28,236,600
三菱総合研究所	2,800	2,685.00	7,518,000
ボルテージ	1,300	1,352.00	1,757,600
電算	700	2,121.00	1,484,700
A G S	1,200	913.00	1,095,600
ヒト・コミュニケーションズ	1,000	1,761.00	1,761,000
ブレインパッド	800	1,205.00	964,000
K L a b	7,500	1,542.00	11,565,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	4,700	844.00	3,966,800
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	1,263.00	2,020,800
ネクソン	67,700	996.00	67,429,200
アイスタイル	2,300	498.00	1,145,400
エムアップ	1,900	786.00	1,493,400
エイチーム	900	5,310.00	4,779,000
e n i s h	1,900	2,200.00	4,180,000
コロブラ	12,500	3,640.00	45,500,000
モバイルクリエイト	3,100	790.00	2,449,000
オルトプラス	1,300	811.00	1,054,300
ブロードリーフ	5,900	1,745.00	10,295,500
ハーツユナイテッドグループ	2,200	1,841.00	4,050,200
ベリサーブ	800	1,057.00	845,600
ティーガイア	7,100	1,089.00	7,731,900
豆蔵ホールディングス	5,600	650.00	3,640,000
テクマトリックス	3,100	640.00	1,984,000
G M O ペイメントゲートウェイ	6,200	2,230.00	13,826,000
ザッパラス	4,000	598.00	2,392,000
インターネットイニシアティブ	11,600	2,202.00	25,543,200
ビットアイル	8,000	469.00	3,752,000
S R A ホールディングス	3,600	1,435.00	5,166,000
システムインテグレータ	800	590.00	472,000
パイブドピッツ	700	1,653.00	1,157,100
朝日ネット	7,300	505.00	3,686,500
コムチュア	1,200	1,883.00	2,259,600
パナソニック インフォメーションシステムズ	1,500	3,055.00	4,582,500
フェイス	2,200	1,044.00	2,296,800
野村総合研究所	40,500	3,685.00	149,242,500
サイバネットシステム	5,800	474.00	2,749,200

インテージホールディングス	4,100	1,481.00	6,072,100
東邦システムサイエンス	1,100	1,226.00	1,348,600
ソースネクスト	3,600	917.00	3,301,200
ティー・ワイ・オー	7,000	176.00	1,232,000
クレスコ	1,600	1,496.00	2,393,600
フジ・メディア・ホールディングス	74,500	1,495.00	111,377,500
オービック	24,700	3,855.00	95,218,500
ジャストシステム	9,800	828.00	8,114,400
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,600	949.00	1,518,400
ヤフー	513,000	410.00	210,330,000
トレンドマイクロ	37,900	3,690.00	139,851,000
インフォメーション・ディベロプメント	1,400	902.00	1,262,800
日本オラクル	11,500	4,220.00	48,530,000
アルファシステムズ	2,300	1,512.00	3,477,600
フューチャーアーキテクト	7,500	635.00	4,762,500
CAC Holdings	4,900	1,229.00	6,022,100
ソフトバンク・テクノロジー	1,900	1,380.00	2,622,000
トーセ	1,700	722.00	1,227,400
オービックビジネスコンサルタント	4,500	3,285.00	14,782,500
伊藤忠テクノソリューションズ	8,100	4,740.00	38,394,000
アイティフォー	8,600	426.00	3,663,600
東計電算	1,300	1,605.00	2,086,500
エクスネット	700	1,411.00	987,700
大塚商会	19,300	4,040.00	77,972,000
サイボウズ	9,500	359.00	3,410,500
ソフトブレーン	9,800	198.00	1,940,400
アグレックス	1,700	1,425.00	2,422,500
電通国際情報サービス	4,400	1,279.00	5,627,600
EMシステムズ	800	1,748.00	1,398,400
ウェザーニューズ	2,100	3,010.00	6,321,000
C I J	6,000	498.00	2,988,000
東洋ビジネスエンジニアリング	700	1,373.00	961,100
日本エンタープライズ	4,500	459.00	2,065,500
WOWOW	1,700	5,110.00	8,687,000
日本コロムビア	2,400	447.00	1,072,800
イマジカ・ロボットホールディングス	3,800	490.00	1,862,000
ネットワンシステムズ	29,100	680.00	19,788,000
アルゴグラフィックス	2,900	1,933.00	5,605,700
マーベラス	12,100	1,124.00	13,600,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	14,200	1,651.00	23,444,200
日本ユニシス	19,800	1,077.00	21,324,600
兼松エレクトロニクス	4,500	1,533.00	6,898,500

東京放送ホールディングス	42,900	1,353.00	58,043,700
日本テレビホールディングス	65,400	1,698.00	111,049,200
テレビ朝日ホールディングス	19,600	1,849.00	36,240,400
スカパーJ S A Tホールディングス	54,300	686.00	37,249,800
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,244.00	13,015,200
コネクシオ	5,000	1,141.00	5,705,000
クロップス	500	498.00	249,000
日本電信電話	280,100	6,542.00	1,832,414,200
K D D I	242,400	7,313.00	1,772,671,200
光通信	6,500	7,100.00	46,150,000
N T T ドコモ	589,800	1,801.50	1,062,524,700
G M O インターネット	23,900	1,036.00	24,760,400
K A D O K A W A ・ D W A N G O	18,700	2,021.00	37,792,700
学研ホールディングス	24,000	267.00	6,408,000
ゼンリン	9,500	1,371.00	13,024,500
昭文社	4,300	780.00	3,354,000
インプレスホールディングス	5,000	128.00	640,000
アイネット	3,100	854.00	2,647,400
松竹	47,000	1,029.00	48,363,000
東宝	51,100	2,594.00	132,553,400
東映	27,000	582.00	15,714,000
A O I P r o .	3,300	721.00	2,379,300
エヌ・ティ・ティ・データ	44,200	4,320.00	190,944,000
D T S	7,400	2,256.00	16,694,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,000	2,143.00	55,718,000
シーイーシー	4,700	1,042.00	4,897,400
カプコン	18,300	1,762.00	32,244,600
ジャステック	4,100	899.00	3,685,900
S C S K	17,000	3,085.00	52,445,000
日本システムウエア	2,700	664.00	1,792,800
アイネス	9,700	838.00	8,128,600
T K C	6,000	2,152.00	12,912,000
富士ソフト	9,900	2,515.00	24,898,500
N S D	15,200	1,634.00	24,836,800
コナミ	29,100	2,128.00	61,924,800
福井コンピュータホールディングス	1,900	797.00	1,514,300
J B C C ホールディングス	6,000	766.00	4,596,000
ミロク情報サービス	4,700	590.00	2,773,000
ソフトバンク	378,500	7,721.00	2,922,398,500
ハウスイ	6,000	130.00	780,000
高千穂交易	2,800	1,047.00	2,931,600
伊藤忠食品	1,800	3,695.00	6,651,000

エレマテック	3,300	2,459.00	8,114,700
JALUX	2,000	1,337.00	2,674,000
あらた	16,000	321.00	5,136,000
トーメンデバイス	1,100	1,776.00	1,953,600
東京エレクトロン デバイス	1,500	1,499.00	2,248,500
双日	479,100	172.00	82,405,200
アルフレッサ ホールディングス	84,700	1,406.00	119,088,200
横浜冷凍	17,800	821.00	14,613,800
山下医科器械	600	1,698.00	1,018,800
ラサ商事	3,300	530.00	1,749,000
アルコニックス	4,000	1,759.00	7,036,000
神戸物産	1,200	4,910.00	5,892,000
あい ホールディングス	11,500	2,127.00	24,460,500
ディーブイエックス	2,100	1,061.00	2,228,100
ダイワボウホールディングス	65,000	205.00	13,325,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,500	854.00	11,529,000
八洲電機	5,600	556.00	3,113,600
UKCホールディングス	4,600	1,770.00	8,142,000
TOKAIホールディングス	35,000	568.00	19,880,000
三洋貿易	4,300	1,274.00	5,478,200
ウイン・パートナーズ	2,300	1,636.00	3,762,800
ミタチ産業	1,700	740.00	1,258,000
シップヘルスケアホールディングス	13,100	2,746.00	35,972,600
スターティア	600	1,785.00	1,071,000
富士興産	2,700	634.00	1,711,800
協栄産業	9,000	220.00	1,980,000
小野建	6,300	1,030.00	6,489,000
佐島電機	5,700	723.00	4,121,100
エコートレーディング	1,700	672.00	1,142,400
伯東	4,600	1,170.00	5,382,000
コンドーテック	5,200	732.00	3,806,400
中山福	4,100	812.00	3,329,200
ナガイレーベン	10,300	2,039.00	21,001,700
三菱食品	7,900	2,605.00	20,579,500
松田産業	5,200	1,271.00	6,609,200
メディバルホールディングス	71,600	1,278.00	91,504,800
アドヴァン	3,700	1,154.00	4,269,800
SPK	1,500	1,948.00	2,922,000
アズワン	5,100	3,130.00	15,963,000
スズデン	2,400	669.00	1,605,600
尾家産業	2,300	839.00	1,929,700
シモジマ	4,400	1,025.00	4,510,000

ドウシシャ	9,300	1,801.00	16,749,300
小津産業	1,400	1,768.00	2,475,200
高速	4,300	931.00	4,003,300
黒田電気	12,100	1,572.00	19,021,200
丸文	6,400	754.00	4,825,600
ハビネット	4,400	1,788.00	7,867,200
橋本総業	1,300	2,020.00	2,626,000
エクセル	3,300	1,403.00	4,629,900
マルカキカイ	2,300	1,383.00	3,180,900
ガリバーインターナショナル	21,700	972.00	21,092,400
日本エム・ディ・エム	6,000	578.00	3,468,000
進和	4,200	1,305.00	5,481,000
エスケイジャパン	1,800	267.00	480,600
ダイトエレクトロン	3,300	501.00	1,653,300
シークス	4,600	1,951.00	8,974,600
田中商事	2,200	680.00	1,496,000
オーハシテクニカ	3,800	1,318.00	5,008,400
マクニカ	3,700	3,125.00	11,562,500
白銅	2,300	1,040.00	2,392,000
伊藤忠商事	599,200	1,385.50	830,191,600
丸紅	626,200	734.20	459,756,040
高島	14,000	234.00	3,276,000
長瀬産業	43,700	1,368.00	59,781,600
蝶理	4,600	1,685.00	7,751,000
豊田通商	79,700	2,753.00	219,414,100
三共生興	12,200	419.00	5,111,800
兼松	143,000	179.00	25,597,000
ツカモトコーポレーション	13,000	131.00	1,703,000
三井物産	606,900	1,652.50	1,002,902,250
日本紙パルプ商事	37,000	328.00	12,136,000
日立ハイテクノロジーズ	24,800	3,385.00	83,948,000
カメイ	9,400	827.00	7,773,800
東都水産	12,000	196.00	2,352,000
OUGホールディングス	11,000	234.00	2,574,000
スターゼン	27,000	343.00	9,261,000
山善	27,500	858.00	23,595,000
椿本興業	8,000	307.00	2,456,000
住友商事	422,400	1,227.00	518,284,800
内田洋行	18,000	349.00	6,282,000
三菱商事	548,600	2,281.00	1,251,356,600
第一実業	18,000	547.00	9,846,000
キヤノンマーケティングジャパン	20,400	2,205.00	44,982,000

西華産業	24,000	275.00	6,600,000
佐藤商事	6,400	744.00	4,761,600
菱洋エレクトロ	8,300	1,117.00	9,271,100
東京産業	7,200	440.00	3,168,000
ユアサ商事	6,300	2,226.00	14,023,800
神鋼商事	18,000	278.00	5,004,000
小林産業	5,300	276.00	1,462,800
阪和興業	72,000	401.00	28,872,000
カナデン	7,000	796.00	5,572,000
菱電商事	11,000	821.00	9,031,000
フルサト工業	4,000	1,694.00	6,776,000
岩谷産業	79,000	732.00	57,828,000
すてきナイスグループ	31,000	196.00	6,076,000
昭光通商	26,000	171.00	4,446,000
ニチモウ	11,000	200.00	2,200,000
極東貿易	8,000	233.00	1,864,000
イワキ	11,000	237.00	2,607,000
三愛石油	17,000	795.00	13,515,000
稲畑産業	17,200	1,035.00	17,802,000
G S Iクレオス	19,000	136.00	2,584,000
明和産業	5,700	408.00	2,325,600
ワキタ	15,300	1,158.00	17,717,400
東邦ホールディングス	24,700	1,472.00	36,358,400
サンゲツ	13,600	3,205.00	43,588,000
ミツウロコグループホールディングス	11,600	546.00	6,333,600
シナネン	15,000	442.00	6,630,000
伊藤忠エネクス	15,800	732.00	11,565,600
サンリオ	20,100	3,085.00	62,008,500
サンワテクノス	4,600	1,157.00	5,322,200
リョーサン	12,100	2,425.00	29,342,500
新光商事	8,400	1,096.00	9,206,400
トーホー	16,000	424.00	6,784,000
三信電気	9,000	817.00	7,353,000
東陽テクニカ	10,500	984.00	10,332,000
モスフードサービス	9,400	2,102.00	19,758,800
加賀電子	6,500	1,370.00	8,905,000
ソーダニッカ	7,000	474.00	3,318,000
立花エレテック	4,400	1,463.00	6,437,200
P a l t a c	11,500	1,353.00	15,559,500
ヤマタネ	36,000	174.00	6,264,000
丸紅建材リース	6,000	304.00	1,824,000
日鉄住金物産	47,000	424.00	19,928,000

トラスコ中山	8,900	3,120.00	27,768,000
オートバックスセブン	26,400	1,661.00	43,850,400
加藤産業	10,300	2,403.00	24,750,900
イノテック	6,600	547.00	3,610,200
イエローハット	6,800	2,309.00	15,701,200
富士エレクトロニクス	3,700	1,312.00	4,854,400
J Kホールディングス	6,800	550.00	3,740,000
日伝	3,000	2,480.00	7,440,000
北沢産業	6,100	183.00	1,116,300
杉本商事	3,900	1,117.00	4,356,300
因幡電機産業	10,600	3,855.00	40,863,000
バイテック	2,500	802.00	2,005,000
ミスミグループ本社	26,700	3,595.00	95,986,500
江守グループホールディングス	3,100	1,111.00	3,444,100
アルテック	5,200	225.00	1,170,000
タキヒヨー	12,000	407.00	4,884,000
スズケン	29,600	3,035.00	89,836,000
ジェコス	4,900	1,853.00	9,079,700
ルネサスイーストン	3,300	784.00	2,587,200
ローソン	27,100	7,560.00	204,876,000
サンエー	5,400	3,710.00	20,034,000
ダイユーエイト	1,400	703.00	984,200
カワチ薬品	5,500	1,756.00	9,658,000
エービーシー・マート	10,200	6,040.00	61,608,000
ハードオフコーポレーション	3,500	886.00	3,101,000
アスクル	7,400	2,022.00	14,962,800
ゲオホールディングス	13,500	1,014.00	13,689,000
アダストリアホールディングス	6,000	2,230.00	13,380,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	9,000	144.00	1,296,000
くらコーポレーション	4,200	2,948.00	12,381,600
キャンドウ	3,400	1,653.00	5,620,200
パル	4,200	2,821.00	11,848,200
エディオン	32,800	788.00	25,846,400
サーラコーポレーション	6,100	607.00	3,702,700
ワッツ	2,800	856.00	2,396,800
あみやき亭	1,200	4,010.00	4,812,000
ひらまつ	9,900	609.00	6,029,100
ゲンキー	700	5,680.00	3,976,000
サッポロドラッグストアー	600	1,785.00	1,071,000
大黒天物産	1,700	3,220.00	5,474,000
ハニーズ	5,700	1,014.00	5,779,800
アルペン	6,400	1,698.00	10,867,200



クオール	5,500	725.00	3,987,500
ジェイアイエヌ	4,900	2,398.00	11,750,200
ビックカメラ	31,100	948.00	29,482,800
D C Mホールディングス	34,600	728.00	25,188,800
MonotaRO	13,900	2,987.00	41,519,300
きちり	1,400	699.00	978,600
アークランドサービス	800	3,385.00	2,708,000
J.フロント リテイリング	90,600	1,448.00	131,188,800
ドトール・日レスホールディングス	12,500	1,585.00	19,812,500
マツモトキヨシホールディングス	16,000	3,285.00	52,560,000
ブロンコビリー	1,300	3,080.00	4,004,000
スタートトゥデイ	22,300	2,277.00	50,777,100
物語コーポレーション	1,800	3,640.00	6,552,000
ココカラファイン	7,500	2,789.00	20,917,500
三越伊勢丹ホールディングス	142,300	1,483.00	211,030,900
ウエルシアホールディングス	6,400	3,650.00	23,360,000
クリエイトSDホールディングス	3,000	3,970.00	11,910,000
丸善CHIIホールディングス	6,500	369.00	2,398,500
エー・ピーカンパニー	1,000	1,671.00	1,671,000
チムニー	1,300	2,300.00	2,990,000
ネクステージ	700	500.00	350,000
ジョイフル本田	3,900	4,120.00	16,068,000
麒麟堂ホールディングス	2,300	688.00	1,582,400
ブックオフコーポレーション	4,100	823.00	3,374,300
あさひ	4,700	1,177.00	5,531,900
日本調剤	900	3,255.00	2,929,500
コスモス薬品	4,100	16,420.00	67,322,000
トーエル	3,800	662.00	2,515,600
一六堂	1,600	447.00	715,200
セブン&アイ・ホールディングス	299,400	4,298.00	1,286,821,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,000	1,415.00	7,075,000
ツルハホールディングス	14,100	6,580.00	92,778,000
サンマルクホールディングス	2,600	5,900.00	15,340,000
フェリシモ	1,800	1,109.00	1,996,200
トリドール	7,100	1,423.00	10,103,300
クスリのアオキ	3,200	5,320.00	17,024,000
メディカルシステムネットワーク	6,100	354.00	2,159,400
総合メディカル	1,700	5,490.00	9,333,000
はるやま商事	3,000	715.00	2,145,000
カッパ・クリエイトホールディングス	11,600	1,026.00	11,901,600
ライトオン	5,300	705.00	3,736,500

良品計画	8,900	13,740.00	122,286,000
三城ホールディングス	8,900	478.00	4,254,200
コナカ	8,400	638.00	5,359,200
ハウス オブ ローゼ	800	1,383.00	1,106,400
G - 7ホールディングス	1,500	926.00	1,389,000
イオン北海道	5,200	654.00	3,400,800
コジマ	10,600	295.00	3,127,000
ヒマラヤ	1,700	959.00	1,630,300
コーナン商事	10,900	1,282.00	13,973,800
エコス	2,500	860.00	2,150,000
ワタミ	8,500	1,222.00	10,387,000
マルシェ	1,700	867.00	1,473,900
ドンキホーテホールディングス	24,800	7,100.00	176,080,000
西松屋チェーン	14,100	963.00	13,578,300
ゼンショーホールディングス	36,800	998.00	36,726,400
幸楽苑	4,400	1,408.00	6,195,200
ハークスレイ	2,000	899.00	1,798,000
サイゼリヤ	10,600	1,628.00	17,256,800
ポブラ	2,900	552.00	1,600,800
ユナイテッドアローズ	9,400	3,365.00	31,631,000
ハイデイ日高	4,500	3,300.00	14,850,000
京都きもの友禅	4,500	1,008.00	4,536,000
コロワイド	23,700	1,306.00	30,952,200
壱番屋	2,900	5,250.00	15,225,000
トップカルチャー	2,900	498.00	1,444,200
P L A N T	1,800	1,172.00	2,109,600
スギホールディングス	12,800	4,740.00	60,672,000
スクロール	9,300	272.00	2,529,600
ヨンドシーホールディングス	5,500	1,975.00	10,862,500
ファミリーマート	24,200	4,455.00	107,811,000
木曽路	8,800	1,907.00	16,781,600
サトレストランシステムズ	6,700	867.00	5,808,900
千趣会	12,900	864.00	11,145,600
タカキュー	5,000	209.00	1,045,000
ケーヨー	12,600	526.00	6,627,600
上新電機	16,000	992.00	15,872,000
日本瓦斯	11,500	2,516.00	28,934,000
ベスト電器	23,000	135.00	3,105,000
マルエツ	16,000	543.00	8,688,000
ロイヤルホールディングス	12,000	1,689.00	20,268,000
東天紅	5,000	178.00	890,000
いなげや	8,000	1,149.00	9,192,000

島忠	17,400	2,878.00	50,077,200
チヨダ	8,400	2,188.00	18,379,200
ライフコーポレーション	4,700	1,771.00	8,323,700
カスミ	14,700	1,044.00	15,346,800
リンガーハット	7,000	1,728.00	12,096,000
MrMax	7,200	306.00	2,203,200
テンアライド	5,600	344.00	1,926,400
AOKIホールディングス	16,400	1,148.00	18,827,200
オークワ	11,000	978.00	10,758,000
コメリ	12,300	2,522.00	31,020,600
青山商事	18,000	2,544.00	45,792,000
しまむら	8,300	9,540.00	79,182,000
CFSコーポレーション	5,400	641.00	3,461,400
はせがわ	2,500	580.00	1,450,000
高島屋	99,000	946.00	93,654,000
松屋	15,000	1,529.00	22,935,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,900	1,814.00	61,494,600
近鉄百貨店	27,000	305.00	8,235,000
ニッセンホールディングス	15,000	353.00	5,295,000
パルコ	6,900	910.00	6,279,000
丸井グループ	86,200	971.00	83,700,200
アクシアル リテイリング	5,500	2,370.00	13,035,000
ダイエー	80,700	130.00	10,491,000
イオン	285,900	1,126.00	321,923,400
ユニーグループ・ホールディングス	68,600	586.00	40,199,600
イズミ	16,000	3,505.00	56,080,000
東武ストア	9,000	286.00	2,574,000
平和堂	14,500	2,087.00	30,261,500
フジ	8,100	2,168.00	17,560,800
ヤオコー	4,100	6,940.00	28,454,000
ゼビオ	9,700	1,782.00	17,285,400
ケーズホールディングス	16,500	2,850.00	47,025,000
Olympicグループ	4,200	978.00	4,107,600
日産東京販売ホールディングス	11,000	285.00	3,135,000
アインファーマシーズ	7,900	3,075.00	24,292,500
元気寿司	2,200	1,874.00	4,122,800
ヤマダ電機	283,000	380.00	107,540,000
アークランドサカモト	5,100	2,543.00	12,969,300
ニトリホールディングス	30,900	6,790.00	209,811,000
グルメ杵屋	5,000	869.00	4,345,000
愛眼	5,700	259.00	1,476,300
ケーユーホールディングス	3,100	597.00	1,850,700

吉野家ホールディングス	20,200	1,272.00	25,694,400
松屋フーズ	3,400	2,055.00	6,987,000
サガミチェーン	9,000	1,046.00	9,414,000
関西スーパーマーケット	5,300	786.00	4,165,800
王将フードサービス	5,200	3,985.00	20,722,000
プレナス	8,000	1,940.00	15,520,000
ミニストップ	5,300	1,564.00	8,289,200
アークス	12,400	2,439.00	30,243,600
パロー	15,400	1,755.00	27,027,000
藤久	600	1,696.00	1,017,600
ベルク	3,200	3,250.00	10,400,000
大庄	3,800	1,318.00	5,008,400
ファーストリテイリング	14,300	41,430.00	592,449,000
サンドラッグ	15,100	5,180.00	78,218,000
サクスパー ホールディングス	5,400	1,503.00	8,116,200
ヤマザワ	1,500	1,619.00	2,428,500
やまや	1,200	1,518.00	1,821,600
ベルーナ	17,900	475.00	8,502,500
島根銀行	1,500	1,365.00	2,047,500
じもとホールディングス	51,400	229.00	11,770,600
足利ホールディングス	45,000	411.00	18,495,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,200	3,485.00	32,062,000
新生銀行	681,000	240.00	163,440,000
あおぞら銀行	483,000	391.00	188,853,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,743,300	630.90	3,623,447,970
りそなホールディングス	837,400	656.10	549,418,140
三井住友トラスト・ホールディングス	1,582,000	470.80	744,805,600
三井住友フィナンシャルグループ	541,400	4,463.00	2,416,268,200
第四銀行	91,000	397.00	36,127,000
北越銀行	77,000	220.00	16,940,000
西日本シティ銀行	251,000	309.00	77,559,000
千葉銀行	276,000	811.00	223,836,000
横浜銀行	495,000	652.70	323,086,500
常陽銀行	260,000	595.00	154,700,000
群馬銀行	170,000	713.00	121,210,000
武蔵野銀行	11,400	3,820.00	43,548,000
千葉興業銀行	14,800	846.00	12,520,800
筑波銀行	29,700	385.00	11,434,500
七十七銀行	121,000	635.00	76,835,000
青森銀行	56,000	342.00	19,152,000
秋田銀行	47,000	313.00	14,711,000
山形銀行	43,000	521.00	22,403,000

岩手銀行	4,900	5,030.00	24,647,000
東邦銀行	64,000	410.00	26,240,000
東北銀行	39,000	156.00	6,084,000
みちのく銀行	36,000	217.00	7,812,000
ふくおかフィナンシャルグループ	290,000	584.00	169,360,000
静岡銀行	210,000	1,165.00	244,650,000
十六銀行	90,000	446.00	40,140,000
スルガ銀行	75,600	2,320.00	175,392,000
八十二銀行	129,000	709.00	91,461,000
山梨中央銀行	46,000	500.00	23,000,000
大垣共立銀行	90,000	309.00	27,810,000
福井銀行	61,000	268.00	16,348,000
北國銀行	80,000	371.00	29,680,000
清水銀行	2,400	2,923.00	7,015,200
滋賀銀行	72,000	608.00	43,776,000
南都銀行	69,000	428.00	29,532,000
百五銀行	69,000	472.00	32,568,000
京都銀行	137,000	975.00	133,575,000
紀陽銀行	28,100	1,592.00	44,735,200
三重銀行	32,000	265.00	8,480,000
ほくほくフィナンシャルグループ	487,000	227.00	110,549,000
広島銀行	211,000	573.00	120,903,000
山陰合同銀行	44,000	853.00	37,532,000
中国銀行	51,500	1,673.00	86,159,500
鳥取銀行	23,000	225.00	5,175,000
伊予銀行	76,600	1,224.00	93,758,400
百十四銀行	79,000	350.00	27,650,000
四国銀行	55,000	246.00	13,530,000
阿波銀行	59,000	659.00	38,881,000
鹿児島銀行	50,000	743.00	37,150,000
大分銀行	44,000	443.00	19,492,000
宮崎銀行	48,000	344.00	16,512,000
肥後銀行	58,000	649.00	37,642,000
佐賀銀行	43,000	267.00	11,481,000
十八銀行	44,000	343.00	15,092,000
沖縄銀行	5,700	4,880.00	27,816,000
琉球銀行	14,700	1,794.00	26,371,800
セブン銀行	241,400	477.00	115,147,800
みずほフィナンシャルグループ	9,887,800	203.20	2,009,200,960
高知銀行	28,000	155.00	4,340,000
山口フィナンシャルグループ	71,000	1,119.00	79,449,000
長野銀行	23,000	196.00	4,508,000

名古屋銀行	65,000	442.00	28,730,000
北洋銀行	107,800	464.00	50,019,200
愛知銀行	2,600	5,480.00	14,248,000
第三銀行	40,000	179.00	7,160,000
中京銀行	29,000	208.00	6,032,000
東日本銀行	31,000	314.00	9,734,000
大光銀行	25,000	225.00	5,625,000
愛媛銀行	42,000	253.00	10,626,000
トマト銀行	28,000	179.00	5,012,000
みなと銀行	65,000	222.00	14,430,000
京葉銀行	59,000	615.00	36,285,000
関西アーバン銀行	10,000	1,226.00	12,260,000
栃木銀行	36,000	459.00	16,524,000
北日本銀行	2,200	2,653.00	5,836,600
東和銀行	97,000	103.00	9,991,000
福島銀行	88,000	88.00	7,744,000
大東銀行	46,000	145.00	6,670,000
トモニホールディングス	54,900	479.00	26,297,100
フィデアホールディングス	41,200	231.00	9,517,200
池田泉州ホールディングス	59,100	578.00	34,159,800
F P G	6,900	1,178.00	8,128,200
S B I ホールディングス	86,300	1,354.00	116,850,200
ジャフコ	9,900	4,385.00	43,411,500
大和証券グループ本社	670,000	942.70	631,609,000
野村ホールディングス	1,463,600	715.20	1,046,766,720
岡三証券グループ	61,000	935.00	57,035,000
丸三証券	22,800	834.00	19,015,200
東洋証券	29,000	339.00	9,831,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,200	800.00	65,760,000
光世証券	18,000	234.00	4,212,000
水戸証券	22,600	423.00	9,559,800
いちよし証券	15,000	1,386.00	20,790,000
松井証券	36,400	1,101.00	40,076,400
だいこう証券ビジネス	3,800	721.00	2,739,800
マネックスグループ	84,300	305.00	25,711,500
カブドットコム証券	31,800	574.00	18,253,200
極東証券	9,700	1,917.00	18,594,900
岩井コスモホールディングス	7,400	1,272.00	9,412,800
マネースクウェアHD	2,300	1,422.00	3,270,600
マネーパートナーズグループ	7,500	400.00	3,000,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	159,000	2,891.50	459,748,500
アニコム ホールディングス	2,900	1,343.00	3,894,700

MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	228,200	2,458.00	560,915,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	68,600	1,786.00	122,519,600
第一生命保険	458,600	1,686.00	773,199,600
東京海上ホールディングス	294,600	3,582.50	1,055,404,500
T & Dホールディングス	260,900	1,420.50	370,608,450
全国保証	18,600	3,495.00	65,007,000
クレディセゾン	58,500	2,177.00	127,354,500
アクリーティブ	4,900	213.00	1,043,700
芙蓉総合リース	7,500	4,330.00	32,475,000
興銀リース	13,400	2,530.00	33,902,000
東京センチュリーリース	16,800	3,070.00	51,576,000
日本証券金融	33,800	652.00	22,037,600
アイフル	119,700	475.00	56,857,500
ポケットカード	5,400	649.00	3,504,600
リコーリース	5,600	3,120.00	17,472,000
イオンフィナンシャルサービス	46,900	2,233.00	104,727,700
アコム	143,800	341.00	49,035,800
ジャックス	39,000	585.00	22,815,000
オリエントコーポレーション	165,400	218.00	36,057,200
日立キャピタル	14,100	2,731.00	38,507,100
アプラスフィナンシャル	34,300	152.00	5,213,600
オリックス	506,700	1,570.50	795,772,350
三菱UFJリース	181,600	571.00	103,693,600
日本取引所グループ	105,100	2,991.00	314,354,100
イー・ギャランティ	2,100	1,901.00	3,992,100
アサックス	1,200	1,399.00	1,678,800
NECキャピタルソリューション	2,900	2,125.00	6,162,500
日本駐車場開発	78,100	121.00	9,450,100
ヒューリック	120,900	1,155.00	139,639,500
東京建物不動産販売	3,700	403.00	1,491,100
三栄建築設計	2,900	913.00	2,647,700
野村不動産ホールディングス	43,000	1,909.00	82,087,000
プレサンスコーポレーション	1,800	3,220.00	5,796,000
常和ホールディングス	2,500	3,350.00	8,375,000
日本管理センター	1,700	2,135.00	3,629,500
エストラスト	800	685.00	548,000
フージャースホールディングス	10,700	541.00	5,788,700
オープンハウス	4,500	2,172.00	9,774,000
東急不動産ホールディングス	187,700	801.00	150,347,700
飯田グループホールディングス	46,400	1,251.00	58,046,400
パーク24	36,000	1,672.00	60,192,000

パラカ	2,700	868.00	2,343,600
三井不動産	380,000	3,423.50	1,300,930,000
三菱地所	532,000	2,614.50	1,390,914,000
平和不動産	13,600	1,835.00	24,956,000
東京建物	156,000	924.00	144,144,000
ダイビル	18,500	1,219.00	22,551,500
京阪神ビルディング	11,900	642.00	7,639,800
住友不動産	172,000	4,137.00	711,564,000
大京	114,000	195.00	22,230,000
テーオーシー	24,700	759.00	18,747,300
東京楽天地	12,000	507.00	6,084,000
レオパレス21	78,400	659.00	51,665,600
スターツコーポレーション	8,200	1,637.00	13,423,400
フジ住宅	9,200	628.00	5,777,600
空港施設	8,700	722.00	6,281,400
明和地所	4,100	506.00	2,074,600
住友不動産販売	5,200	2,582.00	13,426,400
ゴールドクレスト	6,500	2,013.00	13,084,500
日本エスリード	2,800	1,097.00	3,071,600
日神不動産	9,600	445.00	4,272,000
タカラレーベン	32,300	521.00	16,828,300
サンヨーハウジング名古屋	4,100	1,220.00	5,002,000
イオンモール	46,200	1,999.00	92,353,800
ファースト住建	2,700	1,226.00	3,310,200
トーセイ	9,800	756.00	7,408,800
穴吹興産	7,000	248.00	1,736,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,500	1,224.00	54,468,000
サンフロンティア不動産	7,700	1,275.00	9,817,500
エフ・ジェー・ネクスト	4,000	512.00	2,048,000
ランドビジネス	3,600	418.00	1,504,800
グランディハウス	6,400	296.00	1,894,400
日本空港ビルデング	24,700	4,425.00	109,297,500
日本工営	25,000	464.00	11,600,000
ネクスト	9,100	677.00	6,160,700
日本M&Aセンター	11,700	3,410.00	39,897,000
ノバレーゼ	1,900	889.00	1,689,100
アコーディア・ゴルフ	28,500	1,128.00	32,148,000
タケエイ	5,600	1,014.00	5,678,400
トラスト・テック	1,300	1,828.00	2,376,400
パソナグループ	5,800	529.00	3,068,200
CDS	1,700	1,010.00	1,717,000
リンクアンドモチベーション	10,500	161.00	1,690,500



G C Aサヴィアン	5,900	1,121.00	6,613,900
エス・エム・エス	4,200	2,639.00	11,083,800
テンプホールディングス	14,900	3,580.00	53,342,000
リニカル	2,000	851.00	1,702,000
クックパッド	3,700	3,840.00	14,208,000
エスクリ	3,300	1,039.00	3,428,700
アイ・ケイ・ケイ	2,000	898.00	1,796,000
学情	3,100	1,041.00	3,227,100
スタジオアリス	3,500	1,433.00	5,015,500
シミックホールディングス	2,900	1,575.00	4,567,500
総合警備保障	25,300	2,465.00	62,364,500
カカクコム	50,400	1,675.00	84,420,000
アイロムホールディングス	1,800	1,589.00	2,860,200
ルネサンス	3,900	962.00	3,751,800
ディップ	1,900	3,885.00	7,381,500
オプト	3,400	789.00	2,682,600
ツクイ	9,200	935.00	8,602,000
総合臨床ホールディングス	3,400	473.00	1,608,200
キャリアデザインセンター	2,300	1,074.00	2,470,200
エムスリー	65,500	1,878.00	123,009,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,800	865.00	5,017,000
アウトソーシング	3,300	1,748.00	5,768,400
ディー・エヌ・エー	37,400	1,628.00	60,887,200
博報堂D Yホールディングス	105,000	1,137.00	119,385,000
ぐるなび	9,400	1,617.00	15,199,800
一休	6,000	1,417.00	8,502,000
ファンコミュニケーションズ	13,600	1,063.00	14,456,800
ジェイコムホールディングス	1,600	790.00	1,264,000
P G Mホールディングス	11,000	1,113.00	12,243,000
W D Bホールディングス	1,000	1,795.00	1,795,000
ティア	2,600	688.00	1,788,800
パリュコマース	6,400	640.00	4,096,000
J Pホールディングス	18,800	369.00	6,937,200
イービーエス	9,000	1,214.00	10,926,000
プレステージ・インターナショナル	5,700	981.00	5,591,700
アミューズ	2,300	3,450.00	7,935,000
ドリームインキュベータ	2,700	1,830.00	4,941,000
クイック	3,300	971.00	3,204,300
T A C	6,500	233.00	1,514,500
ケネディクス	109,100	554.00	60,441,400
電通	84,400	4,130.00	348,572,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,600	1,115.00	4,014,000

ぴあ	2,200	1,894.00	4,166,800
イオンファンタジー	2,500	1,447.00	3,617,500
ネクシィーズ	3,800	633.00	2,405,400
みらかホールディングス	19,900	4,630.00	92,137,000
アルプス技研	3,000	1,304.00	3,912,000
ダイオーズ	1,400	920.00	1,288,000
日本空調サービス	3,700	793.00	2,934,100
オリエンタルランド	20,500	23,700.00	485,850,000
ダスキン	21,500	1,868.00	40,162,000
明光ネットワークジャパン	7,500	1,227.00	9,202,500
ファルコホールディングス	3,600	1,258.00	4,528,800
秀英予備校	3,100	277.00	858,700
田谷	1,200	772.00	926,400
ラウンドワン	22,000	658.00	14,476,000
リゾートトラスト	28,100	2,579.00	72,469,900
ビー・エム・エル	4,500	3,410.00	15,345,000
ワタベウェディング	2,500	527.00	1,317,500
もしもしホットライン	14,100	1,168.00	16,468,800
早稲田アカデミー	1,100	797.00	876,700
ユー・エス・エス	91,700	1,735.00	159,099,500
東京個別指導学院	3,700	395.00	1,461,500
サイバーエージェント	13,900	4,645.00	64,565,500
楽天	328,900	1,425.50	468,846,950
テー・オー・ダブリュー	2,500	753.00	1,882,500
セントラルスポーツ	2,600	1,792.00	4,659,200
フルキャストホールディングス	7,800	523.00	4,079,400
リゾートソリューション	9,000	241.00	2,169,000
リブセンス	5,300	782.00	4,144,600
ジャパンマテリアル	1,100	4,880.00	5,368,000
ウチヤマホールディングス	3,300	665.00	2,194,500
サクセスホールディングス	1,100	1,295.00	1,424,500
アサンテ	1,900	1,284.00	2,439,600
E R Iホールディングス	1,800	1,144.00	2,059,200
リロ・ホールディング	2,600	7,730.00	20,098,000
東祥	1,700	2,212.00	3,760,400
エイチ・アイ・エス	12,300	2,671.00	32,853,300
共立メンテナンス	3,800	4,800.00	18,240,000
イチネンホールディングス	8,800	941.00	8,280,800
建設技術研究所	4,700	1,680.00	7,896,000
スペース	4,100	1,298.00	5,321,800
燦ホールディングス	1,500	1,588.00	2,382,000
スバル興業	5,000	436.00	2,180,000

東京テアトル	29,000	147.00	4,263,000	
よみうりランド	17,000	505.00	8,585,000	
東京都競馬	52,000	321.00	16,692,000	
カナモト	10,700	3,800.00	40,660,000	
東京ドーム	54,000	465.00	25,110,000	
西尾レントオール	6,100	3,905.00	23,820,500	
トランス・コスモス	9,900	2,017.00	19,968,300	
乃村工藝社	14,900	1,023.00	15,242,700	
藤田観光	27,000	381.00	10,287,000	
KNT - CTホールディングス	37,000	163.00	6,031,000	
日本管財	3,400	2,908.00	9,887,200	
トーカイ	3,300	3,440.00	11,352,000	
白洋舎	10,000	245.00	2,450,000	
セコム	73,600	6,919.00	509,238,400	
セントラル警備保障	3,300	1,183.00	3,903,900	
丹青社	9,500	996.00	9,462,000	
メイテック	10,200	3,280.00	33,456,000	
アサツー ディ・ケイ	14,200	2,822.00	40,072,400	
応用地質	8,000	1,831.00	14,648,000	
船井総研ホールディングス	8,500	1,006.00	8,551,000	
進学会	3,200	411.00	1,315,200	
ベネッセホールディングス	27,700	3,585.00	99,304,500	
イオンディライト	7,300	2,719.00	19,848,700	
ナック	4,000	1,065.00	4,260,000	
ニチイ学館	14,800	848.00	12,550,400	
ダイセキ	12,200	1,978.00	24,131,600	
ステップ	2,500	850.00	2,125,000	
合 計	119,188,000		143,610,948,600	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成26年11月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	148,780,212
コール・ローン	1,643,713,815
国債証券	237,171,752,188
派生商品評価勘定	29,279,809
未収入金	87,363,115
未収利息	2,201,035,713
前払費用	113,563,288
差入委託証拠金	91,301,112
流動資産合計	241,486,789,252
資産合計	241,486,789,252
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	401,157
前受金	1,226,442
未払金	9,106,740
未払解約金	829,551,888
流動負債合計	840,286,227
負債合計	840,286,227
純資産の部	
元本等	
元本	87,009,647,233
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	153,636,855,792
元本等合計	240,646,503,025
純資産合計	240,646,503,025
負債純資産合計	241,486,789,252

## 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11月10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)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数			87,009,647,233口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		2.7657円 (27,657円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		平成26年11月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	

2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	96,807,388,714円
期中追加設定元本額	27,744,304,853円
期中一部解約元本額	37,542,046,334円
期末元本額	87,009,647,233円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,748,514,000円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	187,512,945円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,504,468,640円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	1,057,675,150円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	880,566,497円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,196,812円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	4,332,632,021円
世界経済インデックスファンド	857,886,221円
マイセレクション25	12,502,252円
マイセレクション50	6,049,904円
マイセレクション75	3,959,164円
DCマイセレクション25	1,075,147,343円
DCマイセレクション50	963,633,622円
DCマイセレクション75	633,534,076円
DC外国債券インデックス・オープン	1,296,874,810円
DCマイセレクションS25	412,128,020円
DCマイセレクションS50	341,150,657円
DCマイセレクションS75	154,000,538円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	872,259円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	45,704,199円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	32,303,638円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	12,040,233円
DC世界経済インデックスファンド	872,200,336円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	16,721,591,541円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	143,301,696円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	16,211,207円

マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	5,188,239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）	193,108,240円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	613,238,967円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	903,339,176円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	6,923,720,640円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,193,345,958円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	7,714,029,632円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,081,237,749円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,740,645,576円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,954,724,125円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,630,360,115円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,150,355,778円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,775,941,396円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	401,515,714円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	565,853,043円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	2,392,568,895円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,025,427,712円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	569,647,057円
外国債券ファンド・シリーズ1	151,512,758円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,832,416,154円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,167,392,136円
分散投資コア戦略ファンドA	402,301,290円
分散投資コア戦略ファンドS	513,805,047円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	8,215,783円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	170,905,115円
コア投資戦略ファンド（切替型）	328,134,470円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	43,930,848円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	41,073,534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）	128,445,707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）	8,066,608,598円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,949,073,061
合計	3,949,073,061

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

## （デリバティブ取引に関する注記）



## 債券関連

（平成26年11月10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	643,544,924	-	644,771,366	1,226,442
合計		643,544,924	-	644,771,366	1,226,442

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成26年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	668,498,890	-	696,151,100	27,652,210
	アメリカドル	299,428,900	-	315,606,000	16,177,100
	カナダドル	10,008,500	-	10,087,000	78,500
	ユーロ	313,786,640	-	323,270,700	9,484,060
	イギリスポンド	45,274,850	-	47,187,400	1,912,550
合計		668,498,890	-	696,151,100	27,652,210

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,992,968.84	
		T 0.25% 12/31/15	25,000,000.00	25,017,578.25	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	3,005,800.77	
		T 0.375% 03/15/16	11,000,000.00	11,016,543.01	
		T 0.375% 05/31/16	1,500,000.00	1,501,230.46	
		T 0.5% 07/31/17	12,000,000.00	11,885,156.28	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,353,511.75	
		T 0.625% 08/15/16	17,300,000.00	17,361,158.26	
		T 0.625% 08/31/17	7,000,000.00	6,946,132.83	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	991,152.34	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,942,285.15	
		T 0.625% 12/15/16	10,000,000.00	10,011,523.40	
		T 0.75% 01/15/17	12,000,000.00	12,036,328.08	
		T 0.75% 02/28/18	10,100,000.00	9,980,654.25	
		T 0.75% 03/31/18	10,000,000.00	9,869,726.60	
		T 0.75% 06/30/17	6,000,000.00	5,988,867.18	
		T 0.75% 12/31/17	2,900,000.00	2,873,662.11	
		T 0.875% 01/31/17	10,000,000.00	10,052,734.40	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,464,765.62	
		T 0.875% 04/15/17	5,000,000.00	5,019,726.55	
		T 0.875% 06/15/17	5,000,000.00	5,011,132.80	
		T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,239,000.00	
		T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,936,835.94	
		T 1.125% 12/31/19	3,050,000.00	2,971,248.05	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	893,496.09	

T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,760,234.43	
T 1.25% 10/31/18	15,600,000.00	15,540,890.66	
T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,409,873.04	
T 1.25% 11/30/18	9,400,000.00	9,354,835.91	
T 1.375% 02/28/19	2,100,000.00	2,093,232.41	
T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,724,148.42	
T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,211,171.88	
T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,908,302.74	
T 1.375% 11/30/15	21,800,000.00	22,076,757.75	
T 1.375% 12/31/18	3,000,000.00	2,997,011.73	
T 1.5% 01/31/19	10,000,000.00	10,029,296.90	
T 1.5% 02/28/19	10,000,000.00	10,022,070.30	
T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,405,500.00	
T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,380,792.95	
T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,844,746.07	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,348,740.24	
T 1.625% 08/31/19	7,500,000.00	7,519,921.87	
T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	8,179,921.87	
T 1.75% 05/15/22	3,800,000.00	3,716,281.25	
T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	9,844,195.33	
T 1.75% 05/31/16	18,000,000.00	18,393,398.46	
T 1.75% 10/31/20	1,500,000.00	1,491,269.53	
T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,232,703.11	
T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,116,787.13	
T 1.875% 09/30/17	850,000.00	872,860.35	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,566,943.35	
T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,409,898.43	
T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,782,558.56	
T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,976,222.67	
T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,888,125.00	
T 1% 11/30/19	6,300,000.00	6,106,447.24	
T 2.125% 01/31/21	3,000,000.00	3,039,023.43	
T 2.125% 06/30/21	10,000,000.00	10,093,750.00	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,154,208.99	
T 2.125% 08/31/20	6,500,000.00	6,612,861.32	
T 2.25% 03/31/21	6,600,000.00	6,726,972.64	
T 2.25% 04/30/21	3,500,000.00	3,565,214.83	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,955,966.78	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,074,531.26	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,162,812.52	
T 2.375% 08/15/24	8,500,000.00	8,552,460.97	
T 2.5% 05/15/24	8,400,000.00	8,554,218.78	

T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,030,976.56	
T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,273,320.33	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,248,046.90	
T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,351,093.76	
T 2.75% 02/15/19	600,000.00	632,367.18	
T 2.75% 02/15/24	8,100,000.00	8,433,175.76	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,001,355.46	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,401,093.76	
T 2.75% 11/15/23	5,200,000.00	5,420,390.61	
T 2.75% 11/15/42	8,400,000.00	7,939,804.65	
T 2.75% 11/30/16	6,250,000.00	6,530,395.50	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,125,011.70	
T 2.875% 05/15/43	9,100,000.00	8,808,160.17	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,523,904.28	
T 2% 02/15/22	2,500,000.00	2,495,605.47	
T 2% 02/15/23	8,600,000.00	8,494,347.62	
T 2% 05/31/21	3,800,000.00	3,808,757.82	
T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,267,945.33	
T 2% 08/31/21	6,800,000.00	6,802,523.41	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,399,953.12	
T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,541,894.54	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,691,884.77	
T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	1,017,207.03	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,879,589.86	
T 3.125% 05/15/19	5,000,000.00	5,352,734.40	
T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,684,974.61	
T 3.125% 08/15/44	6,150,000.00	6,256,543.95	
T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,831,982.43	
T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	2,866,171.86	
T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,653,757.82	
T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,621,972.65	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,696,259.77	
T 3.375% 05/15/44	9,900,000.00	10,552,974.59	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,138,855.48	
T 3.5% 02/15/39	2,000,000.00	2,193,398.44	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,662,686.51	
T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,717,500.00	
T 3.625% 02/15/44	4,200,000.00	4,684,804.69	
T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,955,550.78	
T 3.75% 08/15/41	4,700,000.00	5,382,601.58	
T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,469,433.60	
T 3.75% 11/15/43	900,000.00	1,026,087.89	

T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,899,726.55	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,008,769.55	
T 3% 05/15/42	5,500,000.00	5,481,093.75	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,099,146.51	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,633,867.20	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	738,750.00	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,045,804.67	
T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	6,187,109.40	
T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,750,875.00	
T 4.375% 05/15/40	2,700,000.00	3,399,574.21	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,527,304.68	
T 4.375% 11/15/39	4,000,000.00	5,023,046.88	
T 4.5% 02/15/36	1,200,000.00	1,530,117.19	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	10,714,730.43	
T 4.5% 05/15/38	1,000,000.00	1,273,593.75	
T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,702,427.73	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,448,046.90	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,498,481.44	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,436,982.41	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	681,650.39	
T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,147,812.51	
T 5.25% 02/15/29	1,400,000.00	1,841,410.15	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,707,748.04	
T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,259,031.25	
T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,606,031.25	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,301,640.62	
T 6.125% 11/15/27	350,000.00	489,514.64	
T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,608,062.50	
T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,580,083.98	
T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,012,533.21	
T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,418,359.39	
T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,372,994.14	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,738,039.07	
アメリカドル 合計	795,350,000.00	821,091,836.14 (93,900,062,380)	
カナダドル			
CAN 1.25% 02/01/16	3,850,000.00	3,861,049.50	
CAN 1.25% 03/01/18	1,800,000.00	1,799,298.00	
CAN 1.25% 08/01/17	1,100,000.00	1,102,898.50	
CAN 1.25% 09/01/18	1,400,000.00	1,394,421.00	
CAN 1.5% 02/01/17	2,300,000.00	2,321,919.00	
CAN 1.5% 06/01/23	1,900,000.00	1,836,122.00	
CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,664,825.25	

	CAN 1.75% 03/01/19	1,000,000.00	1,012,815.00	
	CAN 1.75% 09/01/19	850,000.00	858,831.50	
	CAN 1% 05/01/16	3,300,000.00	3,299,241.00	
	CAN 1% 11/01/15	300,000.00	300,016.50	
	CAN 2.25% 06/01/25	900,000.00	908,896.50	
	CAN 2.5% 06/01/24	2,100,000.00	2,185,554.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,300,000.00	1,384,831.50	
	CAN 2.75% 09/01/16	1,550,000.00	1,597,833.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	350,000.00	366,248.75	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,421,189.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,600,000.00	1,754,248.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,650,000.00	1,817,994.75	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,400,000.00	2,861,664.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	2,973,159.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,700,000.00	1,735,462.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,100,000.00	2,663,430.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,928,753.75	
	CAN 4% 06/01/16	2,050,000.00	2,144,043.75	
	CAN 4% 06/01/17	1,400,000.00	1,504,146.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,750,000.00	2,484,825.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,750,000.00	2,601,331.25	
	CAN 5% 06/01/37	1,850,000.00	2,619,655.50	
	CAN 8.0% 06/01/27	550,000.00	897,811.75	
	<b>カナダドル 合計</b>	<b>50,300,000.00</b>	<b>55,302,514.75</b>	<b>(5,579,470,713)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,500,000.00	11,715,762.50	
	MBONO 4.75% 06/14/18	38,700,000.00	38,896,402.50	
	MBONO 5% 06/15/17	21,800,000.00	22,368,435.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	37,000,000.00	38,584,525.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	18,400,000.00	19,425,340.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	18,100,000.00	19,407,001.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	16,000,000.00	17,727,520.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	8,300,000.00	9,333,059.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	9,700,000.00	10,663,064.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	36,800,000.00	44,105,536.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	28,400,000.00	34,347,954.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	21,200,470.50	
	MBONO 8% 12/07/23	29,500,000.00	33,925,442.50	
	<b>メキシコペソ 合計</b>	<b>289,900,000.00</b>	<b>321,700,513.00</b>	<b>(2,718,369,334)</b>
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,146,183.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,050,000.00	1,164,056.25	

BGB 2.6% 06/22/24	1,750,000.00	1,985,821.25
BGB 3.25% 09/28/16	2,050,000.00	2,175,439.50
BGB 3.5% 06/28/17	350,000.00	382,137.00
BGB 3.75% 06/22/45	900,000.00	1,185,138.00
BGB 3.75% 09/28/20	2,500,000.00	2,987,575.00
BGB 3% 06/22/34	1,000,000.00	1,160,185.00
BGB 3% 09/28/19	1,550,000.00	1,757,638.00
BGB 4.0% 03/28/17	2,800,000.00	3,066,168.00
BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,984,529.00
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,611,062.25
BGB 4.25% 09/28/21	1,850,000.00	2,309,447.50
BGB 4.25% 09/28/22	1,850,000.00	2,339,556.25
BGB 4.5% 03/28/26	1,200,000.00	1,594,656.00
BGB 4% 03/28/18	2,400,000.00	2,719,860.00
BGB 4% 03/28/22	2,950,000.00	3,652,660.50
BGB 4% 03/28/32	1,150,000.00	1,511,738.25
BGB 5.5% 03/28/28	2,400,000.00	3,536,064.00
BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,200,162.00
BGB 5% 03/28/35	2,400,000.00	3,596,472.00
BKO 0.25% 03/11/16	4,100,000.00	4,116,297.50
BTNS 1.75% 02/25/17	2,500,000.00	2,600,175.00
BTNS 1% 07/25/17	3,600,000.00	3,696,246.00
BTNS 2.25% 02/25/16	5,200,000.00	5,351,294.00
BTNS 2.5% 07/25/16	4,000,000.00	4,170,180.00
BTPS 1.15% 05/15/17	2,000,000.00	2,020,980.00
BTPS 1.5% 08/01/19	1,500,000.00	1,522,995.00
BTPS 1.5% 12/15/16	1,200,000.00	1,221,036.00
BTPS 2.15% 12/15/21	2,500,000.00	2,554,162.50
BTPS 2.5% 05/01/19	2,000,000.00	2,120,620.00
BTPS 2.75% 12/01/15	2,700,000.00	2,765,880.00
BTPS 3.5% 11/01/17	2,000,000.00	2,158,110.00
BTPS 3.5% 12/01/18	3,500,000.00	3,845,782.50
BTPS 3.75% 03/01/21	3,500,000.00	3,961,300.00
BTPS 3.75% 04/15/16	3,700,000.00	3,870,570.00
BTPS 3.75% 08/01/16	4,900,000.00	5,166,535.50
BTPS 3.75% 08/01/21	4,000,000.00	4,513,080.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,600,000.00	2,915,536.00
BTPS 3% 11/01/15	1,300,000.00	1,332,727.50
BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,304,070.00
BTPS 4.25% 03/01/20	3,500,000.00	4,034,065.00
BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	3,031,798.75
BTPS 4.5% 02/01/18	2,800,000.00	3,121,216.00

BTPS 4.5% 02/01/20	2,650,000.00	3,083,182.25
BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,981,859.25
BTPS 4.5% 03/01/24	3,950,000.00	4,686,971.25
BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	3,189,469.50
BTPS 4.5% 05/01/23	2,150,000.00	2,541,697.75
BTPS 4.5% 08/01/18	7,500,000.00	8,465,662.50
BTPS 4.75% 06/01/17	3,800,000.00	4,184,750.00
BTPS 4.75% 08/01/23	3,700,000.00	4,459,887.50
BTPS 4.75% 09/01/21	4,800,000.00	5,724,768.00
BTPS 4.75% 09/01/28	1,850,000.00	2,215,523.00
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	2,005,864.00
BTPS 4.75% 09/15/16	2,400,000.00	2,581,272.00
BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,904,057.50
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,849,105.25
BTPS 4% 09/01/20	4,000,000.00	4,575,260.00
BTPS 5.0% 08/01/39	2,600,000.00	3,192,657.00
BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,417,387.75
BTPS 5.25% 11/01/29	5,000,000.00	6,296,575.00
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,625,567.00
BTPS 5.5% 11/01/22	2,950,000.00	3,691,689.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,450,000.00	3,283,673.75
BTPS 5% 03/01/22	2,800,000.00	3,391,626.00
BTPS 5% 03/01/25	3,750,000.00	4,608,393.75
BTPS 5% 08/01/34	2,800,000.00	3,450,076.00
BTPS 5% 09/01/40	3,100,000.00	3,777,954.50
BTPS 6.5% 11/01/27	3,900,000.00	5,428,527.00
BTPS 6% 05/01/31	4,000,000.00	5,467,840.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,782,018.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,246,264.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,750,000.00	2,956,222.50
DBR 1.5% 05/15/23	3,950,000.00	4,240,937.25
DBR 1.5% 05/15/24	3,850,000.00	4,106,256.00
DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	3,120,298.50
DBR 1.75% 02/15/24	1,950,000.00	2,126,660.25
DBR 1.75% 07/04/22	3,100,000.00	3,397,290.00
DBR 2.25% 09/04/20	2,500,000.00	2,796,850.00
DBR 2.25% 09/04/21	2,800,000.00	3,162,544.00
DBR 2.5% 01/04/21	2,100,000.00	2,390,346.00
DBR 2.5% 07/04/44	2,200,000.00	2,595,252.00
DBR 2.5% 08/15/46	700,000.00	826,532.00
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,894,775.00
DBR 2% 08/15/23	1,000,000.00	1,114,845.00



DBR 3.25% 01/04/20	1,200,000.00	1,392,996.00
DBR 3.25% 07/04/21	2,800,000.00	3,344,166.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,100,000.00	2,818,126.50
DBR 3.5% 01/04/16	5,800,000.00	6,037,017.00
DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	4,059,702.50
DBR 3.75% 01/04/17	3,600,000.00	3,893,634.00
DBR 3.75% 01/04/19	3,150,000.00	3,639,667.50
DBR 3% 07/04/20	3,300,000.00	3,823,528.50
DBR 4.0% 01/04/18	1,000,000.00	1,127,600.00
DBR 4.0% 01/04/37	3,200,000.00	4,614,720.00
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,564,416.00
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,797,213.25
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,883,069.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,900,370.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,800,000.00	4,329,346.00
DBR 4.75% 07/04/40	2,350,000.00	3,847,055.75
DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,840,192.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,450,000.00	3,914,597.75
DBR 5.625% 01/04/28	1,550,000.00	2,398,702.50
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,396,752.00
DBR 6.25% 01/04/30	1,150,000.00	1,940,596.25
DBR 6.5% 07/04/27	1,550,000.00	2,549,680.25
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	614,518.80
FRTR 0.25% 11/25/15	2,300,000.00	2,305,934.00
FRTR 0.5% 11/25/19	2,550,000.00	2,577,310.50
FRTR 1.75% 05/25/23	4,050,000.00	4,332,588.75
FRTR 1.75% 11/25/24	2,200,000.00	2,317,359.00
FRTR 1% 05/25/18	4,600,000.00	4,749,454.00
FRTR 1% 05/25/19	2,300,000.00	2,382,627.50
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,586,775.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,400,000.00	4,863,606.00
FRTR 2.25% 10/25/22	2,750,000.00	3,055,965.00
FRTR 2.5% 05/25/30	1,800,000.00	1,967,562.00
FRTR 2.5% 10/25/20	3,700,000.00	4,150,160.50
FRTR 2.75% 10/25/27	4,100,000.00	4,667,050.50
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,608,032.00
FRTR 3.25% 05/25/45	1,700,000.00	2,055,725.00
FRTR 3.25% 10/25/21	5,800,000.00	6,843,507.00
FRTR 3.5% 04/25/20	7,150,000.00	8,368,395.75
FRTR 3.5% 04/25/26	4,500,000.00	5,504,310.00
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,659,522.50
FRTR 3.75% 04/25/21	2,800,000.00	3,374,084.00

FRTR 3.75% 10/25/19	2,300,000.00	2,696,761.50	
FRTR 3% 04/25/22	4,150,000.00	4,841,971.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,794,402.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	2,500,000.00	2,812,637.50	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,900,000.00	4,537,981.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	6,538,200.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,200,000.00	4,681,984.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,800,000.00	4,089,302.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,800,000.00	4,317,921.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,900,000.00	2,720,401.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,650,000.00	2,383,581.75	
FRTR 4% 10/25/38	3,350,000.00	4,510,222.25	
FRTR 5.5% 04/25/29	3,700,000.00	5,515,590.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,850,000.00	6,121,115.00	
FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,489,900.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,556,956.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,626,030.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,576,058.40	
IRISH 3.4% 03/18/24	900,000.00	1,033,366.50	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,000,000.00	1,189,295.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,293,358.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,400,000.00	4,074,679.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	925,732.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,500,000.00	1,597,972.50	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,650,000.00	2,194,442.25	
IRISH 5.5% 10/18/17	350,000.00	402,942.75	
IRISH 5.9% 10/18/19	750,000.00	943,961.25	
NETHER 0.25% 01/15/20	950,000.00	951,496.25	
NETHER 1.25% 01/15/18	1,900,000.00	1,974,926.50	
NETHER 1.25% 01/15/19	2,200,000.00	2,306,018.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,000,000.00	2,157,570.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	1,800,000.00	2,018,151.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	3,250,000.00	3,426,995.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,400,000.00	1,608,509.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	350,000.00	429,933.00	
NETHER 2% 07/15/24	2,000,000.00	2,192,730.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,300,000.00	2,722,728.50	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,250,000.00	2,656,293.75	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	2,110,048.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,233,362.50	
NETHER 4.0% 07/15/18	1,400,000.00	1,603,539.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,450,000.00	2,744,343.00	

NETHER 4% 01/15/37	1,850,000.00	2,654,130.25
NETHER 4% 07/15/16	4,450,000.00	4,748,817.50
NETHER 4% 07/15/19	1,900,000.00	2,241,601.00
NETHER 5.5% 01/15/28	1,600,000.00	2,418,392.00
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	848,174.25
OBL 0.25% 04/13/18	2,100,000.00	2,119,614.00
OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	4,071,060.00
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,431,524.00
OBL 0.5% 04/12/19	3,250,000.00	3,313,797.50
OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	457,193.25
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,054,765.00
OBL 1.25% 10/14/16	1,050,000.00	1,076,370.75
OBL 1% 10/12/18	2,750,000.00	2,858,171.25
OBL 2.75% 04/08/16	5,500,000.00	5,716,342.50
RAGB 1.65% 10/21/24	200,000.00	212,238.00
RAGB 1.75% 10/20/23	1,350,000.00	1,455,131.25
RAGB 1.95% 06/18/19	400,000.00	433,184.00
RAGB 2.4% 05/23/34	500,000.00	562,520.00
RAGB 3.15% 06/20/44	800,000.00	1,033,088.00
RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,126,623.75
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,816,395.00
RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,646,787.00
RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,342,973.50
RAGB 3.8% 01/26/62	500,000.00	792,817.50
RAGB 3.9% 07/15/20	1,150,000.00	1,382,190.75
RAGB 4.15% 03/15/37	1,800,000.00	2,603,052.00
RAGB 4.3% 09/15/17	900,000.00	1,010,290.50
RAGB 4.35% 03/15/19	2,300,000.00	2,723,154.00
RAGB 4.65% 01/15/18	2,900,000.00	3,328,634.50
RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,467,753.00
RAGB 4% 09/15/16	2,050,000.00	2,201,495.00
RAGB 6.25% 07/15/27	1,200,000.00	1,908,372.00
RFGB 0.375% 09/15/20	550,000.00	551,716.00
RFGB 1.125% 09/15/18	150,000.00	156,152.25
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	688,889.50
RFGB 1.625% 09/15/22	900,000.00	964,800.00
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	615,108.00
RFGB 1.875% 04/15/17	200,000.00	209,154.00
RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	532,818.00
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	644,388.25
RFGB 2% 04/15/24	650,000.00	713,043.50
RFGB 3.375% 04/15/20	600,000.00	700,236.00

	RFGB 3.5% 04/15/21	1,150,000.00	1,372,829.75
	RFGB 3.875% 09/15/17	1,700,000.00	1,888,538.50
	RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,075,977.00
	RFGB 4% 07/04/25	850,000.00	1,099,713.00
	SPGB 2.1% 04/30/17	3,000,000.00	3,106,875.00
	SPGB 2.75% 04/30/19	2,800,000.00	3,016,580.00
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,750,000.00	1,842,636.25
	SPGB 3.15% 01/31/16	5,600,000.00	5,790,428.00
	SPGB 3.25% 04/30/16	1,100,000.00	1,145,820.50
	SPGB 3.3% 07/30/16	2,950,000.00	3,093,827.25
	SPGB 3.75% 10/31/15	200,000.00	206,666.00
	SPGB 3.75% 10/31/18	1,400,000.00	1,555,295.00
	SPGB 3.8% 01/31/17	3,700,000.00	3,966,733.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	3,550,000.00	4,082,375.75
	SPGB 4.1% 07/30/18	5,450,000.00	6,095,334.50
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,250,000.00	2,565,011.25
	SPGB 4.25% 10/31/16	1,450,000.00	1,557,010.00
	SPGB 4.3% 10/31/19	2,950,000.00	3,411,040.75
	SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,347,117.50
	SPGB 4.6% 07/30/19	3,100,000.00	3,608,849.50
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,900,000.00	2,319,748.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,062,074.50
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,500,000.00	3,088,587.50
	SPGB 4.85% 10/31/20	2,250,000.00	2,709,506.25
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,750,000.00	2,195,838.75
	SPGB 4% 04/30/20	4,000,000.00	4,588,720.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	2,000,000.00	2,526,360.00
	SPGB 5.15% 10/31/44	900,000.00	1,158,754.50
	SPGB 5.4% 01/31/23	3,650,000.00	4,647,599.75
	SPGB 5.5% 04/30/21	3,200,000.00	4,011,680.00
	SPGB 5.5% 07/30/17	3,200,000.00	3,614,208.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	3,088,856.25
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,500,000.00	3,231,062.50
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,150,000.00	2,880,580.75
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,250,000.00	3,070,293.75
	ユーロ 合計	607,880,000.00	713,856,126.20 (101,660,250,932)
イギリスポ ンド	UKT 1.25% 07/22/18	5,050,000.00	5,046,540.75
	UKT 1.75% 01/22/17	2,600,000.00	2,656,264.00
	UKT 1.75% 07/22/19	4,300,000.00	4,348,031.00
	UKT 1.75% 09/07/22	4,000,000.00	3,937,020.00
	UKT 1% 09/07/17	3,000,000.00	3,001,350.00

	UKT 2.25% 09/07/23	3,000,000.00	3,038,595.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	2,550,000.00	2,671,800.75	
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,153,878.00	
	UKT 3.25% 01/22/44	3,900,000.00	4,147,513.50	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,000,000.00	1,113,330.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,400,000.00	1,622,691.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	2,350,000.00	2,799,308.25	
	UKT 3.75% 09/07/19	2,050,000.00	2,266,305.75	
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,955,240.25	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,900,000.00	3,263,196.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,900,000.00	3,567,928.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,900,000.00	3,536,042.50	
	UKT 4.25% 09/07/39	2,200,000.00	2,742,201.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,900,000.00	2,287,362.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,748,702.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,150,000.00	2,752,376.25	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,900,000.00	2,465,535.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	2,789,524.50	
	UKT 4.5% 03/07/19	1,950,000.00	2,205,927.75	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,700,000.00	3,414,919.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,600,000.00	3,404,141.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	3,600,000.00	4,182,948.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,400,000.00	3,074,904.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,700,000.00	2,267,587.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,500,000.00	1,917,300.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,100,000.00	2,406,232.50	
	UKT 4% 09/07/16	3,350,000.00	3,553,830.75	
	UKT 5% 03/07/18	2,050,000.00	2,309,827.25	
	UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	3,019,788.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,500,000.00	2,134,822.50	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,824,802.50	
	UKT 8% 06/07/21	2,000,000.00	2,775,520.00	
	UKT 8% 12/07/15	550,000.00	594,783.75	
	イギリスポンド 合計	94,000,000.00	107,998,071.00 (19,602,729,867)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	450,000.00	503,739.00	
	SWISS 2.5% 03/12/16	200,000.00	207,053.00	
	SWISS 3% 01/08/18	3,100,000.00	3,398,390.50	
	SWISS 4% 02/11/23	1,700,000.00	2,208,359.50	
	SWISS 4% 04/08/28	400,000.00	568,440.00	
	スイスフラン 合計	5,850,000.00	6,885,982.00 (815,437,988)	

スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	9,250,000.00	9,602,055.00
	SGB 2.5% 05/12/25	6,200,000.00	6,997,258.00
	SGB 3.5% 03/30/39	6,000,000.00	8,016,450.00
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	10,020,780.00
	SGB 3.75% 08/12/17	8,650,000.00	9,524,947.50
	SGB 3% 07/12/16	6,550,000.00	6,879,006.50
	SGB 4.25% 03/12/19	13,700,000.00	16,036,740.50
	SGB 5% 12/01/20	9,050,000.00	11,409,878.00
スウェーデンクローナ 合計		67,800,000.00	78,487,115.50 (1,212,625,934)
ノルウェー クローネ	NGB 2% 05/24/23	6,700,000.00	6,762,310.00
	NGB 3.75% 05/25/21	9,300,000.00	10,502,118.00
	NGB 3% 03/14/24	5,450,000.00	5,916,683.50
	NGB 4.25% 05/19/17	8,750,000.00	9,406,643.75
	NGB 4.5% 05/22/19	7,800,000.00	8,852,844.00
ノルウェークローネ 合計		38,000,000.00	41,440,599.25 (696,616,473)
デンマーク クローネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,150,000.00	9,748,776.00
	DGB 1.75% 11/15/25	4,150,000.00	4,459,901.25
	DGB 2.5% 11/15/16	7,450,000.00	7,832,073.25
	DGB 3% 11/15/21	12,700,000.00	14,968,347.00
	DGB 4.5% 11/15/39	16,650,000.00	26,073,650.25
	DGB 4% 11/15/15	9,850,000.00	10,256,361.75
	DGB 4% 11/15/17	7,850,000.00	8,801,851.75
	DGB 4% 11/15/19	14,050,000.00	16,759,331.75
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,607,735.00
デンマーククローネ 合計		85,350,000.00	104,508,028.00 (2,001,328,736)
ポーランド ズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	3,100,000.00	3,151,692.50
	POLGB 3.25% 07/25/19	1,900,000.00	1,996,178.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,100,000.00	1,161,402.00
	POLGB 3.75% 04/25/18	3,100,000.00	3,279,583.00
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,850,000.00	3,044,099.25
	POLGB 4.75% 10/25/16	3,650,000.00	3,853,414.50
	POLGB 4% 10/25/23	3,350,000.00	3,740,392.25
	POLGB 5.25% 10/25/17	3,500,000.00	3,831,992.50
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,050,000.00	2,394,266.75
	POLGB 5.5% 10/25/19	2,600,000.00	3,010,423.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,200,000.00	1,608,948.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,500,000.00	4,326,420.00
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,250,000.00	2,741,242.50
	POLGB 5% 04/25/16	6,550,000.00	6,846,223.75

ポーランドズロチ 合計		40,700,000.00	44,986,278.00 (1,514,687,980)
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,250,000.00	2,142,326.25
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,850,000.00	1,824,664.25
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,150,000.00	1,099,411.50
	ACGB 3.25% 10/21/18	550,000.00	560,540.75
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,000,000.00	969,765.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,250,000.00	1,342,993.75
	ACGB 4.25% 07/21/17	2,650,000.00	2,763,777.75
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,550,000.00	3,829,402.75
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,150,000.00	1,257,496.25
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,850,000.00	2,079,649.75
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,300,000.00	2,378,993.50
	ACGB 5.25% 03/15/19	3,550,000.00	3,910,147.50
	ACGB 5.5% 01/21/18	3,350,000.00	3,640,813.50
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,900,000.00	3,378,427.50
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,500,000.00	2,897,650.00
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,600,000.00	3,053,141.00
ACGB 6% 02/15/17	3,350,000.00	3,601,384.00	
オーストラリアドル 合計		37,800,000.00	40,730,585.00 (4,027,847,550)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 04/01/18	150,000.00	147,531.75
	SIGB 1.125% 04/01/16	950,000.00	959,200.75
	SIGB 2.25% 06/01/21	800,000.00	818,396.00
	SIGB 2.375% 04/01/17	950,000.00	991,073.25
	SIGB 2.5% 06/01/19	900,000.00	946,332.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	400,000.00	385,828.00
	SIGB 2.75% 07/01/23	100,000.00	104,419.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	200,000.00	204,498.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	300,000.00	305,775.00
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,000,000.00	1,078,330.00
	SIGB 3.25% 09/01/20	700,000.00	759,265.50
	SIGB 3.375% 09/01/33	400,000.00	432,186.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	800,000.00	880,752.00
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	847,088.00
	SIGB 3% 09/01/24	950,000.00	1,006,985.75
	SIGB 4% 09/01/18	650,000.00	719,218.50
シンガポールドル 合計		10,050,000.00	10,586,879.50 (938,950,342)
マレーシアリンギット	MGS 3.172% 07/15/16	2,600,000.00	2,587,702.00
	MGS 3.26% 03/01/18	1,450,000.00	1,436,029.25
	MGS 3.314% 10/31/17	2,900,000.00	2,879,410.00

	MGS 3.418% 08/15/22	2,400,000.00	2,343,708.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,417,396.75	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,538,119.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,900,000.00	1,800,278.50	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,398,800.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	100,000.00	96,475.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,700,000.00	2,717,307.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,500,000.00	1,516,312.50	
	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	344,834.00	
	MGS 4.048% 09/30/21	350,000.00	356,685.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	1,900,000.00	1,870,569.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,300,000.00	2,357,500.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	950,000.00	980,756.25	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,704,497.25	
	MGS 4.262% 09/15/16	1,000,000.00	1,014,130.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,600,000.00	2,688,868.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,142,427.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	750,000.00	788,955.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,116,205.00	
	マレーシアリングット 合計	35,900,000.00	36,096,965.25 (1,238,847,847)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,650,000.00	23,335,947.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	14,900,000.00	11,452,959.50	
	SAGB 6.5% 02/28/41	11,300,000.00	8,739,137.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	13,400,000.00	12,900,448.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	10,900,000.00	10,877,600.50	
	SAGB 7.75% 02/28/23	8,700,000.00	8,728,231.50	
	SAGB 7% 02/28/31	18,500,000.00	16,095,925.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	10,450,000.00	10,841,666.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	1,700,000.00	1,667,011.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	7,200,000.00	7,191,504.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,000,000.00	12,386,280.00	
		南アフリカランド 合計	128,700,000.00	124,216,710.50 (1,264,526,112)
	合計		237,171,752,188 (237,171,752,188)	

(注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。

(注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。

(注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。

(注4)外貨建有価証券の通貨別内訳



通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 142銘柄	100.0%	39.6%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.0%	2.4%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 247銘柄	100.0%	42.9%
イギリスポンド	国債証券 38銘柄	100.0%	8.3%
スイスフラン	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
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%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 22銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,061,955,054
コール・ローン	507,248,422
株式	206,325,635,995
投資信託受益証券	162,354,822
投資証券	4,713,735,653
派生商品評価勘定	92,011,757
未収入金	49,622,831
未収配当金	269,638,053
未収利息	550
差入委託証拠金	1,643,510,922
流動資産合計	216,825,714,059
資産合計	216,825,714,059
負債の部	

	平成26年11月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	216,713
前受金	90,010,270
未払金	23,201,250
未払解約金	731,863,119
流動負債合計	845,291,352
負債合計	845,291,352
純資産の部	
元本等	
元本	112,298,706,875
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	103,681,715,832
元本等合計	215,980,422,707
純資産合計	215,980,422,707
負債純資産合計	216,825,714,059

## 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11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

平成26年11月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</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11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	112,298,706,875口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9233円 (1万口当たり純資産額) (19,233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26年11月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成26年11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成26年11月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	107,252,940,490円
期中追加設定元本額	35,466,841,575円
期中一部解約元本額	30,421,075,190円
期末元本額	112,298,706,875円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,401,286,254円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,825,241円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	20,627,781,476円
世界経済インデックスファンド	1,320,175,570円
マイセレクション25	10,310,466円
マイセレクション50	24,867,253円
マイセレクション75	29,564,568円
外国株式インデックス・オープン	1,001,238,734円
DCマイセレクション25	867,477,149円
DCマイセレクション50	4,396,065,241円

区分	平成26年11月10日現在
DCマイセレクション75	4,693,115,456円
DC外国株式インデックス・オープン	5,953,903,532円
DCマイセレクションS25	336,474,440円
DCマイセレクションS50	1,557,782,556円
DCマイセレクションS75	1,156,701,348円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,538,777円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	139,596,955円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	145,628,097円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	71,807,208円
DC世界経済インデックスファンド	1,332,564,415円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	23,495,551,296円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	68,307,495円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	38,151,764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）	214,599,747円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	397,885,709円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,325,824,682円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	2,121,473,229円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,096,826,322円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,154,362,360円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	841,695,501円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,408,385,905円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,548,737,570円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	3,200,137,298円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	823,373,790円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	891,903,699円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	248,708,765円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,652,325,529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）	4,463,059,249円
外国株式ファンド・シリーズ1	617,360,396円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,854,522,617円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,540,830,130円
分散投資コア戦略ファンドA	628,551,338円
分散投資コア戦略ファンドS	830,040,977円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	37,176,617円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	82,653,057円
コア投資戦略ファンド（切替型）	413,252,663円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	200,671,087円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,633,347円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	5,358,615,898	
投資信託受益証券	15,259,188	
投資証券	235,263,883	
合計	5,609,138,969	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成26年11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,338,605,646	-	4,428,615,916	90,010,270
	合計	4,338,605,646	-	4,428,615,916	90,010,270

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(平成26年11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	546,936,844	-	545,152,070	1,784,774
	アメリカドル	401,792,880	-	400,225,000	1,567,880
	カナダドル	13,518,322	-	13,517,920	402
	ユーロ	30,618,580	-	30,618,150	430
	イギリスポンド	84,379,512	-	84,216,000	163,512
	スウェーデンク ローナ	7,724,750	-	7,725,000	250
	香港ドル	8,902,800	-	8,850,000	52,800
	合計	546,936,844	-	545,152,070	1,784,774

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	30,938	94.31	2,917,762.78	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,745	55.06	151,139.70	
	APACHE CORP	23,769	76.52	1,818,803.88	
	BAKER HUGHES	26,995	52.30	1,411,838.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	26,114	33.62	877,952.68	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,808	59.24	758,745.92	
	CHENIERE ENERGY INC	14,036	71.95	1,009,890.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	33,542	23.41	785,218.22	
	CHEVRON CORP	116,272	118.80	13,813,113.60	
	CIMAREX ENERGY CO	5,528	118.34	654,183.52	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,569	10.98	159,967.62	
	CONCHO RESOURCES INC	7,024	117.88	827,989.12	
	CONOCOPHILLIPS	74,997	72.16	5,411,783.52	
	CONSOL ENERGY INC	12,950	39.98	517,741.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5,154	55.13	284,140.02	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,702	138.89	375,280.78	
	DENBURY RESOURCES INC	18,996	11.76	223,392.96	
	DEVON ENERGY CORPORATION	23,995	65.03	1,560,394.85	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,474	38.74	134,582.76	
	ENERGEN CORP	4,802	70.78	339,885.56	
	ENSCO PLC-CL A	14,882	41.31	614,775.42	
	EOG RESOURCES INC	33,462	99.55	3,331,142.10	
	EQT CORPORATION	9,485	98.64	935,600.40	
	EXXON MOBIL	262,383	96.59	25,343,573.97	
	FMC TECHNOLOGIES INC	13,816	56.99	787,373.84	
	HALLIBURTON CO	51,737	53.86	2,786,554.82	
	HELMERICH & PAYNE	6,883	86.70	596,756.10	
	HESS CORP	17,508	84.86	1,485,728.88	
HOLLYFRONTIER CORP	11,175	44.63	498,740.25		
KINDER MORGAN INC	41,096	38.75	1,592,470.00		



KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,216	95.58	594,125.28
MARATHON OIL CORP	41,848	34.39	1,439,152.72
MARATHON PETROLEUM CORP	17,836	94.08	1,678,010.88
MURPHY OIL CORP	10,060	54.53	548,571.80
NABORS INDUSTRIES LTD	13,930	17.70	246,561.00
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,362	73.26	1,931,280.12
NOBLE CORP PLC	14,396	21.83	314,264.68
NOBLE ENERGY INC	22,390	56.51	1,265,258.90
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	48,018	88.04	4,227,504.72
OCEANEERING INTL INC	6,110	71.33	435,826.30
ONEOK INC	11,950	57.26	684,257.00
PEABODY ENERGY CORP	14,207	11.64	165,369.48
PHILLIPS 66	34,685	74.70	2,590,969.50
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,833	176.70	1,560,791.10
QEP RESOURCES INC	9,981	25.87	258,208.47
RANGE RESOURCES CORP	9,635	73.09	704,222.15
SCHLUMBERGER	79,419	98.73	7,841,037.87
SOUTHWESTERN ENERGY CO	20,624	36.50	752,776.00
SPECTRA ENERGY CORP	41,389	39.66	1,641,487.74
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	10,497	25.01	262,529.97
TESORO CORP	8,241	71.95	592,939.95
VALERO ENERGY CORP	32,949	50.72	1,671,173.28
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	48,171	15.67	754,839.57
WHITING PETROLEUM CORP	6,687	59.44	397,475.28
WILLIAMS COS	43,081	55.38	2,385,825.78
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	13,122	134.94	1,770,682.68
AIRGAS INC	3,795	114.24	433,540.80
ALBEMARLE CORP	4,304	61.18	263,318.72
ALCOA	72,694	16.33	1,187,093.02
ASHLAND INC	4,431	109.81	486,568.11
AVERY DENNISON CORP	4,954	47.74	236,503.96
BALL CORP	8,446	64.97	548,736.62
CELANESE CORP-SERIES A	9,269	59.31	549,744.39
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,263	250.92	818,751.96
CROWN HOLDINGS INC	8,966	48.85	437,989.10
DOW CHEMICAL CO	73,903	49.50	3,658,198.50
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	56,336	70.41	3,966,617.76
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,512	82.47	784,454.64
ECOLAB INC	16,690	112.48	1,877,291.20
FMC CORP	8,555	57.00	487,635.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	64,093	28.34	1,816,395.62
INT'L PAPER CO	25,530	52.87	1,349,771.10

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,822	98.79	476,365.38
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27,586	87.46	2,412,671.56
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,206	123.81	396,934.86
MEADWESTVACO CORP	10,117	44.09	446,058.53
MONSANTO CO	32,163	114.44	3,680,733.72
MOSAIC CO/THE	20,217	44.03	890,154.51
NEWMONT MINING CORP	29,365	19.19	563,514.35
NUCOR CORP	19,888	54.18	1,077,531.84
OWENS-ILLINOIS INC	11,001	26.00	286,026.00
PPG INDUSTRIES INC	8,558	206.90	1,770,650.20
PRAXAIR INC	18,037	126.67	2,284,746.79
ROCK-TENN COMPANY -CL A	8,598	55.43	476,587.14
SEALED AIR CORP	11,641	38.89	452,718.49
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,253	236.04	1,239,918.12
SIGMA-ALDRICH	7,449	135.34	1,008,147.66
VULCAN MATERIALS CO	7,408	65.11	482,334.88
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,454	68.52	168,148.08
3 M COMPANY	37,963	156.55	5,943,107.65
AGCO CORP	4,746	45.55	216,180.30
AMETEK INC	14,378	52.01	747,799.78
B/E AEROSPACE INC	6,245	73.40	458,383.00
BOEING CO	42,319	124.45	5,266,599.55
CATERPILLAR	36,270	101.76	3,690,835.20
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,158	55.58	286,681.64
CUMMINS INC	10,805	146.04	1,577,962.20
DANAHER CORP	38,547	81.19	3,129,630.93
DEERE&CO	21,285	88.66	1,887,128.10
DOVER CORP	10,404	81.53	848,238.12
EATON CORP	29,344	69.17	2,029,724.48
EMERSON ELECTRIC CO	43,004	64.86	2,789,239.44
FASTENAL CO	17,687	44.53	787,602.11
FLOWSERVE CORP	8,133	67.90	552,230.70
FLUOR CORP	10,027	66.29	664,689.83
GENERAL DYNAMICS CORP	17,882	140.14	2,505,983.48
GENERAL ELECTRIC CO	612,534	26.41	16,177,022.94
GRAINGER (WW) INC	3,835	254.81	977,196.35
HONEYWELL INTL INC	45,470	96.77	4,400,131.90
ILLINOIS TOOL WORKS	24,082	92.81	2,235,050.42
INGERSOLL-RAND PLC	15,776	63.51	1,001,933.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,917	48.26	382,074.42
JOY GLOBAL INC	6,537	54.78	358,096.86
KBR INC	8,182	19.28	157,748.96

L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	5,450	121.64	662,938.00
LOCKHEED MARTIN CORP	16,610	186.15	3,091,951.50
MASCO CORP	21,330	23.35	498,055.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,519	136.11	1,703,961.09
PACCAR INC	21,882	66.95	1,464,999.90
PALL CORP	6,924	94.29	652,863.96
PARKER HANNIFIN CORP	9,227	128.50	1,185,669.50
PENTAIR PLC	12,104	68.08	824,040.32
PRECISION CASTPARTS CORP	8,899	226.25	2,013,398.75
QUANTA SERVICES INC	12,064	33.92	409,210.88
RAYTHEON COMPANY	19,250	104.36	2,008,930.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,623	112.29	968,276.67
ROCKWELL COLLIN	7,244	84.80	614,291.20
ROPER INDUSTRIES INC	6,234	158.26	986,592.84
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,562	48.81	466,721.22
SPX CORP	1,919	92.86	178,198.34
STANLEY BLACK&DECKER	9,286	95.01	882,262.86
TEXTRON	17,592	41.89	736,928.88
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	187.33	530,518.56
UNITED RENTALS INC	6,143	113.39	696,554.77
UNITED TECHNOLOGIES CORP	53,194	109.08	5,802,401.52
XYLEM INC	10,093	37.04	373,844.72
ADT CORPORATION	9,887	36.20	357,909.40
CINTAS CORP	6,553	71.00	465,263.00
DUN & BRADSTREET CORP	2,027	123.13	249,584.51
EQUIFAX INC	7,222	77.77	561,654.94
IHS INC-CLASS A	4,024	128.90	518,693.60
MANPOWER GROUP	4,455	67.55	300,935.25
NIELSEN NV	17,686	43.34	766,511.24
REPUBLIC SERVICES INC	16,828	39.13	658,479.64
ROBERT HALF INTL INC	8,298	56.00	464,688.00
STERICYCLE INC	5,019	127.54	640,123.26
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,973	114.66	455,544.18
TYCO INTERNATIONAL LTD	28,694	43.31	1,242,737.14
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,906	64.25	572,210.50
WASTE MANAGEMENT INC	27,408	49.45	1,355,325.60
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,923	43.20	471,873.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,364	71.46	669,151.44
CSX CORP	61,703	35.45	2,187,371.35
DELTA AIR LINES INC	11,957	42.69	510,444.33
EXPEDITORS INTL WASH INC	11,078	44.24	490,146.11
FEDEX CORP	17,196	171.22	2,944,299.12

HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	26,635	21.84	581,708.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,573	79.96	445,617.08
KANSAS CITY SOUTHERN	6,896	123.32	850,414.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,027	112.86	2,147,387.22
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,854	38.24	376,816.96
UNION PACIFIC CORP	55,360	118.75	6,574,000.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	54.18	292,084.38
UNITED PARCEL SERVICE B	43,155	108.33	4,674,981.15
AUTOLIV INC	5,543	93.51	518,325.93
BORGWARNER INC	13,403	57.68	773,085.04
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	18,761	69.59	1,305,577.99
FORD MOTOR COMPANY	226,011	14.17	3,202,575.87
GENERAL MOTORS CO	78,784	31.59	2,488,786.56
HARLEY-DAVIDSON	12,738	66.04	841,217.52
JOHNSON CONTROLS INC	40,939	48.76	1,996,185.64
TESLA MOTORS INC	5,401	240.20	1,297,320.20
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,987	101.93	712,184.91
COACH INC	16,177	33.66	544,517.82
DR HORTON INC	16,578	23.13	383,449.14
FOSSIL GROUP INC	3,153	103.01	324,806.29
GARMIN LTD	6,629	54.70	362,606.30
HASBRO INC	6,979	57.98	404,642.42
LEGGETT & PLATT INC	9,020	40.08	361,521.60
LENNAR CORP-CL A	9,818	44.54	437,293.72
LULULEMON ATHLETICA INC	6,262	43.76	274,025.12
MATTEL INC	19,894	31.67	630,042.98
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,846	69.95	898,577.70
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,694	142.66	526,986.04
NEWELL RUBBERMAID	16,407	34.80	570,963.60
NIKE B	42,864	93.78	4,019,785.92
POLARIS INDUSTRIES INC	3,714	156.50	581,241.00
PULTE GROUP INC	20,589	19.96	410,956.44
PVH CORP	5,223	118.19	617,306.37
RALPH LAUREN CORPORATION	3,635	174.00	632,490.00
TOLL BROTHERS INC	9,602	32.22	309,376.44
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	10,429	66.98	698,534.42
VF CORP	21,242	69.79	1,482,479.18
WHIRLPOOL CORP	4,864	175.81	855,139.84
BLOCK H & R INC	15,457	32.69	505,289.33
CARNIVAL CORPORATION	24,004	40.40	969,761.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,923	649.03	1,248,084.69
DARDEN RESTAURANTS INC	7,865	53.50	420,777.50

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,713	24.97	417,323.61
LAS VEGAS SANDS CORP	24,886	59.53	1,481,463.58
MARRIOTT INTL A	14,631	75.50	1,104,640.50
MCDONALD'S CORP	60,426	95.10	5,746,512.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,102	21.94	484,917.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,797	67.20	658,358.40
STARBUCKS CORP	46,087	77.79	3,585,107.73
STARWOOD HOTELS & RESORTS	11,944	76.43	912,879.92
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	8,068	77.32	623,817.76
WYNN RESORTS LTD	5,061	177.18	896,707.98
YUM BRANDS INC	27,186	72.86	1,980,771.96
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	18.92	200,570.92
CBS CORP-CL B	30,077	51.31	1,543,250.87
CHARTER COMMUNICATION-A	4,754	156.37	743,382.98
COMCAST CORP-CL A	131,185	55.15	7,234,852.75
COMCAST CORP-SPECIAL A	27,458	54.99	1,509,915.42
DIRECTV	29,293	87.40	2,560,208.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,963	32.62	259,753.06
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	18,544	32.34	599,712.96
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,827	63.70	880,849.03
INTERPUBLIC GROUP OF COS	23,921	19.21	459,522.41
LIBERTY BROADBAND-A	1,233	49.52	61,058.16
LIBERTY BROADBAND-C	3,267	49.38	161,324.46
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13,620	46.60	634,692.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,001	45.25	1,493,295.25
LIBERTY MEDIA CORP	4,935	36.37	179,485.95
LIBERTY MEDIA CORP-C	13,068	35.68	466,266.24
NEWS CORP-CLASS A	23,149	15.15	350,707.35
OMNICOM GROUP	16,020	72.71	1,164,814.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,921	75.19	370,009.99
SIRIUS XM HOLDINGS INC	190,556	3.45	658,370.98
THE WALT DISNEY CO	100,558	90.00	9,050,220.00
TIME WARNER CABLE-A	17,106	143.60	2,456,421.60
TIME WARNER INC	53,955	77.00	4,154,535.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	87,515	34.61	3,028,894.15
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	27,391	33.24	910,476.84
VIACOM INC-CLASS B	23,312	70.63	1,646,526.56
ADVANCE AUTO PARTS	4,609	141.85	653,786.65
AMAZON.COM	23,907	299.86	7,168,753.02
AUTONATION INC	4,068	57.59	234,276.12
AUTOZONE INC	2,023	562.23	1,137,391.29
BED BATH & BEYOND INC	12,755	69.87	891,255.62

BEST BUY COMPANY INC	18,782	35.18	660,750.76
CARMAX INC	13,070	55.64	727,214.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,316	46.01	244,589.16
DOLLAR GENERAL CORP	19,270	64.41	1,241,180.70
DOLLAR TREE INC	12,181	61.56	749,862.36
EXPEDIA INC	6,698	85.11	570,100.27
FAMILY DOLLAR STORES	6,125	78.84	482,895.00
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,491	43.69	327,281.79
GAP	15,549	38.83	603,767.67
GENUINE PARTS CO	9,582	99.13	949,863.66
HOME DEPOT	83,588	97.65	8,162,368.20
KOHL'S CORP	13,086	57.22	748,780.92
L BRANDS INC	15,338	75.61	1,159,706.18
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	29,026	27.70	804,020.20
LKQ CORP	17,829	29.12	519,180.48
LOWE'S COMPANIES	61,958	57.69	3,574,357.02
MACY'S INC	22,359	59.88	1,338,856.92
NETFLIX INC	3,530	384.16	1,356,084.80
NORDSTROM INC	8,354	73.43	613,434.22
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,571	179.00	1,176,209.00
PETSMART INC	5,725	72.54	415,291.50
PRICELINE GROUP INC/THE	3,209	1,094.61	3,512,603.49
ROSS STORES INC	13,179	81.41	1,072,902.39
STAPLES INC	38,447	12.93	497,119.71
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,971	64.17	2,372,429.07
TIFFANY & CO	7,557	98.86	747,085.02
TJX COMPANIES INC	42,957	64.00	2,749,248.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,290	74.56	618,102.40
TRIPADVISOR INC	6,929	73.65	510,320.85
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,634	121.75	442,439.50
URBAN OUTFITTERS INC	6,170	31.18	192,380.60
COSTCO WHOLESALE CORP	26,905	137.71	3,705,087.55
CVS HEALTH CORP	71,409	88.38	6,311,127.42
KROGER CO	29,876	57.80	1,726,832.80
SAFEWAY INC	13,682	34.87	477,091.34
SYSCO CORP	36,183	38.14	1,380,019.62
WAL-MART STORES	98,534	78.77	7,761,523.18
WALGREEN CO	55,455	66.92	3,711,048.60
WHOLE FOODS MKT INC	21,338	46.81	998,831.78
ALTRIA GROUP INC	121,327	49.87	6,050,577.49
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,306	50.55	2,037,468.30
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,709	93.59	721,485.31

BUNGE LIMITED	8,621	88.76	765,199.96
CAMPBELL SOUP CO (US)	11,493	44.10	506,841.30
COCA-COLA CO	241,574	42.32	10,223,411.68
COCA-COLA ENTERPRISES	15,050	42.72	642,936.00
CONAGRA	24,552	34.62	849,990.24
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,481	93.56	980,602.36
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	11,466	69.95	802,046.70
GENERAL MILLS INC	37,810	51.36	1,941,921.60
HERSHEY FOODS CORPORATION	9,590	96.43	924,763.70
HORMEL FOODS CORP	8,128	54.42	442,325.76
JM SMUCKER CO	6,141	104.84	643,822.44
KELLOGG CO	16,702	63.66	1,063,249.32
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	7,601	152.90	1,162,192.90
KRAFT FOODS GROUP INC	36,570	57.87	2,116,305.90
LORILLARD INC	22,464	62.08	1,394,565.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,679	72.76	485,964.04
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	12,498	98.39	1,229,678.22
MOLSON COORS BREWING CO -B	9,598	77.18	740,773.64
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	103,450	37.76	3,906,272.00
MONSTER BEVERAGE CORP	8,862	108.39	960,552.18
PEPSICO INC	92,579	96.80	8,961,647.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	96,049	88.12	8,463,837.88
REYNOLDS AMERICAN INC	19,870	64.58	1,283,204.60
TYSON FOODS INC	19,183	41.11	788,613.13
AVON PRODUCTS INC	24,395	10.58	258,099.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,612	73.27	631,001.24
CLOROX COMPANY	7,549	100.79	760,863.71
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,977	68.05	3,809,234.85
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,469	123.50	428,421.50
ESTEE LAUDER CO-CL A	14,502	72.58	1,052,555.16
HERBALIFE LTD	4,464	37.50	167,400.00
KIMBERLY-CLARK CORP	23,094	113.24	2,615,164.56
PROCTER & GAMBLE CO	165,279	89.13	14,731,317.27
ABBOTT LABORATORIES	91,833	43.37	3,982,797.21
AETNA INC	22,013	82.29	1,811,449.77
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,982	86.73	1,212,658.86
BARD C R INC	4,457	162.38	723,727.66
BAXTER INTERNATIONAL	33,185	70.61	2,343,192.85
BECTON DICKINSON & CO	11,942	125.54	1,499,198.68
BOSTON SCIENTIFIC CORP	81,969	13.24	1,085,269.56
CARDINAL HEALTH	20,990	78.27	1,642,887.30
CAREFUSION CORP	12,989	57.28	744,009.92

CERNER CORP	19,161	63.00	1,207,238.80
CIGNA CORP	16,534	98.99	1,636,700.66
COVIDIEN PLC	27,642	92.08	2,545,275.36
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	10,713	74.49	798,011.37
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,997	51.25	409,846.25
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,190	122.76	759,884.40
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	47,438	77.87	3,693,997.06
HCA HOLDINGS INC	18,563	65.75	1,220,517.25
HENRY SCHEIN INC	5,009	128.84	645,359.56
HOLOGIC INC	14,349	26.21	376,087.29
HUMANA INC	9,553	130.58	1,247,430.74
INTUITIVE SURGICAL INC	2,387	500.02	1,193,547.74
LABORATORY CRP OF AMER	4,843	100.52	486,818.36
MCKESSON CORP	14,122	199.32	2,814,797.04
MEDTRONIC	61,067	68.10	4,158,662.70
OMNICARE INC	5,836	67.97	396,672.92
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	43.98	203,738.52
QUEST DIAGNOSTICS	8,142	61.69	502,279.98
RESMED INC	7,971	51.14	407,636.94
ST JUDE MEDICAL INC	17,655	64.76	1,143,337.80
STRYKER CORP	21,016	87.47	1,838,269.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,851	93.61	5,602,652.11
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,764	97.93	564,468.52
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,180	84.64	523,075.20
WELLPOINT INC	17,190	124.15	2,134,138.50
ZIMMER HOLDINGS INC	10,395	108.19	1,124,635.05
ABBVIE INC	97,115	61.50	5,972,572.50
ACTAVIS PLC	16,155	245.91	3,972,676.05
AGILENT TECHNOLOGIES	20,632	40.93	844,467.76
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,141	193.81	2,353,047.21
ALLERGAN INC	18,206	196.00	3,568,376.00
AMGEN	46,230	160.25	7,408,357.50
BIOGEN IDEC INC	14,493	320.75	4,648,629.75
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,158	83.91	768,447.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	101,225	58.32	5,903,442.00
CELGENE CORP	48,922	106.45	5,207,746.90
ENDO INTERNATIONAL PLC	9,181	68.96	633,121.76
GILEAD SCIENCES INC	93,782	106.45	9,983,093.90
HOSPIRA INC	10,628	56.32	598,568.96
ILLUMINA INC	7,940	186.35	1,479,619.00
JOHNSON & JOHNSON	172,824	108.20	18,699,556.80
LILLY (ELI) & CO	61,586	66.60	4,101,627.60



MALLINCKRODT PLC	6,682	91.06	608,462.92
MERCK & CO	178,471	59.34	10,590,469.14
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,700	277.69	472,073.00
MYLAN INC	23,106	53.11	1,227,159.66
PERRIGO CO PLC	8,304	155.77	1,293,514.08
PFIZER	389,102	29.92	11,641,931.84
PHARMACYCLICS INC	4,064	133.49	542,503.36
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	3,064	57.21	175,291.44
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,866	377.84	1,838,569.44
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,432	116.60	2,848,771.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,575	115.93	1,689,679.75
WATERS CORP	4,781	111.05	530,930.05
ZOETIS INC	31,098	40.23	1,251,072.54
BANK OF AMERICA CORP	642,208	17.36	11,148,730.88
BB&T CORP	44,330	38.18	1,692,519.40
CIT GROUP INC	10,896	48.63	529,872.48
CITIGROUP	185,516	53.75	9,971,485.00
COMERICA INC	10,764	48.40	520,977.60
FIFTH THIRD BANCORP	53,119	20.11	1,068,223.09
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,821	51.55	403,172.55
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.80	271,332.60
JPMORGAN CHASE & CO	231,165	61.47	14,209,712.55
KEY CORP	51,836	13.39	694,084.04
M & T BANK CORP	6,881	124.54	856,959.74
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	24,669	15.91	392,483.79
OCWEN FINANCIAL CORP	6,111	21.17	129,369.87
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	14.81	270,966.35
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,727	88.45	2,894,703.15
REGIONS FINL CORP	86,246	10.16	876,259.36
SUNTRUST BANKS	32,977	39.66	1,307,867.82
US BANCORP	110,912	43.81	4,859,054.72
WELLS FARGO & CO	305,644	53.84	16,455,872.96
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,486	196.70	685,696.20
ALLY FINANCIAL INC	17,625	22.69	399,911.25
AMERICAN EXPRESS	58,204	92.26	5,369,901.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,749	129.05	1,516,208.45
BANK NEW YORK CO	69,890	38.91	2,719,419.90
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	68,566	143.61	9,846,763.26
BLACKROCK INC	8,179	351.48	2,874,754.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,008	82.60	2,891,660.80
CME GROUP INC	19,691	85.60	1,685,549.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,700	66.03	1,895,061.00

EATON VANCE CORP	6,650	43.90	291,935.00
FRANKLIN RESOURCES INC	25,198	56.98	1,435,782.04
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,956	190.71	4,950,068.76
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	7,111	218.54	1,554,037.94
INVESCO LTD	26,850	41.28	1,108,368.00
LEGG MASON INC	6,202	54.23	336,334.46
LEUCADIA NATIONAL CORP	18,806	23.80	447,582.80
MCGRAW-HILL FINANCIAL	16,769	89.94	1,508,203.86
MOODY'S CORP	11,919	98.95	1,179,385.05
MORGAN STANLEY	90,504	35.66	3,227,372.64
NASDAQ OMX GROUP	6,376	43.88	279,778.88
NAVIENT CORP	25,310	20.21	511,515.10
NORTHERN TRUST CORP	14,001	66.90	936,666.90
PRICE T ROWE GROUP INC	16,242	83.23	1,351,821.66
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,569	56.44	427,194.36
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,067	28.58	2,059,674.86
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,203	39.24	321,885.72
STATE STREET CORP	26,516	77.81	2,063,209.96
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,322	34.59	564,577.98
VOYA FINANCIAL INC	9,982	40.51	404,370.82
ACE LTD	20,733	110.81	2,297,423.73
AFLAC	28,019	58.89	1,650,038.91
ALLEGHANY CORP	983	448.71	441,081.93
ALLSTATE CORP	26,762	66.25	1,772,982.50
AMERICAN INT'L GROUP	83,990	54.03	4,537,979.70
AON PLC	17,411	89.82	1,563,856.02
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,944	57.48	456,621.12
ASSURANT INC	4,030	67.97	273,919.10
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	49.46	293,841.86
CHUBB CORPORATION	15,064	101.14	1,523,572.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,700	51.11	444,657.00
EVEREST RE GROUP LTD	2,941	172.34	506,851.94
FNF GROUP	14,901	29.15	434,364.15
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	29,919	8.41	251,618.79
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,961	40.20	1,124,032.20
LINCOLN NATIONAL CORP	16,471	55.78	918,752.38
LOEWS CORP	21,655	43.51	942,209.05
MARSH & MCLENNAN COS	33,861	55.80	1,889,443.80
METLIFE INC	58,570	54.61	3,198,507.70
PARTNERRE LTD	2,555	116.35	297,274.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,316	52.82	967,451.12
PROGRESSIVE CORP	35,224	26.86	946,116.64

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28,223	85.33	2,408,268.59
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,183	101.58	221,749.14
TORCHMARK CORP	7,314	53.46	391,006.44
TRAVELERS COS INC/THE	21,351	102.37	2,185,701.87
UNUM GROUP	16,333	33.60	548,788.80
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,724	41.98	408,213.52
WR BERKLEY CORP	7,065	51.34	362,717.10
XL GROUP PLC	16,172	34.36	555,669.92
CBRE GROUP INC-A	19,000	31.88	605,720.00
REALOGY HOLDINGS CORP	9,422	42.79	403,167.38
WEYERHAEUSER CO	32,649	34.30	1,119,860.70
ACCENTURE PLC-CL A	38,810	83.48	3,239,858.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,784	20.65	656,339.60
ADOBE SYSTEMS INC	29,124	71.60	2,085,278.40
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	10,430	60.13	627,208.05
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,385	283.61	960,019.85
ANSYS INC	5,240	79.55	416,842.00
AUTODESK INC	14,317	59.42	850,716.14
AUTOMATIC DATA PROCESS	29,628	84.37	2,499,862.50
CA INC	21,128	30.05	634,896.40
CITRIX SYSTEMS INC	10,361	66.32	687,141.52
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,550	53.62	2,013,431.00
COMPUTER SCIENCES CORP	9,202	59.67	549,083.34
EBAY	69,861	53.51	3,738,611.41
ELECTRONIC ARTS INC	19,807	40.94	810,898.58
EQUINIX INC	3,157	214.03	675,692.71
FACEBOOK INC-A	121,929	75.60	9,217,832.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,899	58.38	1,044,943.62
FIREEYE INC	3,393	30.62	103,893.66
FISERV INC	15,487	69.46	1,075,727.02
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,720	149.18	704,129.60
GOOGLE INC-CL A	17,226	551.82	9,505,651.32
GOOGLE INC-CL C	17,531	541.01	9,484,446.31
INTL BUSINESS MACHINES CORP	58,811	162.07	9,531,498.77
INTUIT INC	16,712	88.81	1,484,192.72
LINKEDIN CORP - A	6,538	223.04	1,458,235.52
MASTERCARD INC-CLASS A	61,882	84.80	5,247,593.60
MICROSOFT CORP	480,137	48.68	23,373,069.16
NETSUITE INC	1,707	109.08	186,199.56
NUANCE COMMUNICATIONS INC	14,585	15.32	223,442.20
ORACLE CORP	218,144	39.94	8,712,671.36
PAYCHEX INC	20,404	47.33	965,721.32

RACKSPACE HOSTING INC	6,900	37.43	258,267.00
RED HAT INC	11,958	61.30	733,025.40
SALESFORCE.COM INC	35,880	63.97	2,295,243.60
SERVICENOW INC	7,337	67.79	497,375.23
SYMANTEC CORP	43,022	24.97	1,074,259.34
SYNOPSYS INC	9,398	41.87	393,494.26
TERADATA CORP	9,511	42.71	406,214.81
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	33.86	316,015.38
TWITTER INC	20,190	40.31	813,858.90
VANTIV INC - CL A	8,373	30.75	257,469.75
VERISIGN INC	7,532	59.80	450,413.60
VISA INC-CLASS A SHARES	30,542	252.43	7,709,717.06
VMWARE INC-CLASS A	5,459	83.14	453,861.26
WESTERN UNION CO	31,913	17.88	570,604.44
WORKDAY INC-CLASS A	5,373	94.56	508,070.88
XEROX CORP	69,639	13.45	936,644.55
YAHOO	58,723	48.55	2,851,001.65
AMPHENOL CORPORATION	19,619	50.96	999,784.24
APPLE INC	369,022	109.01	40,227,088.22
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	57.48	333,384.00
AVNET INC	7,613	43.68	332,535.84
CISCO SYSTEMS	313,279	25.33	7,935,357.07
CORNING	80,979	20.55	1,664,118.45
EMC CORP	125,402	29.12	3,651,706.24
F5 NETWORKS INC	4,271	126.66	540,964.86
FLEXTRONICS INTL LTD	33,519	10.86	364,016.34
FLIR SYSTEMS INC	9,284	33.78	313,613.52
HARRIS CORP	6,029	70.80	426,853.20
HEWLETT-PACKARD CO	116,010	36.38	4,220,443.80
JUNIPER NETWORKS INC	24,010	21.91	526,059.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,419	64.14	860,694.66
NETAPP INC	20,698	42.30	875,525.40
QUALCOMM	103,221	69.26	7,149,086.46
SANDISK CORP	14,048	92.83	1,304,075.84
SEAGATE TECHNOLOGY	20,213	61.56	1,244,312.28
TE CONNECTIVITY LTD	25,335	62.12	1,573,810.20
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,724	27.31	402,112.44
WESTERN DIGITAL CORP	13,880	97.70	1,356,076.00
AT&T INC	317,018	34.91	11,067,098.38
CENTURYLINK INC	35,446	39.43	1,397,635.78
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	60,783	6.44	391,442.52
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	10,063	45.85	461,388.55

SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,025	114.62	919,825.50
SPRINT CORP	41,934	4.72	197,928.48
T-MOBILE US INC	14,563	28.34	412,715.42
VERIZON COMMUNICATIONS	252,924	50.86	12,863,714.64
WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	9.55	316,582.50
AES CORP	40,950	13.46	551,187.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,173	62.75	387,355.75
AMEREN CORPORATION	15,288	43.31	662,123.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,085	58.32	1,754,557.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,588	52.36	554,387.68
CALPINE CORP	21,395	24.24	518,614.80
CENTERPOINT ENERGY INC	25,781	25.23	650,454.63
CMS ENERGY CORP	17,142	32.91	564,143.22
CONSOLIDATED EDISON INC	18,125	63.57	1,152,206.25
DOMINION RESOURCES	35,664	73.89	2,635,212.96
DTE ENERGY COMPANY	10,286	83.31	856,926.66
DUKE ENERGY CORP	43,260	82.08	3,550,780.80
EDISON INTL	19,141	62.38	1,194,015.58
ENTERGY CORP	10,425	82.68	861,939.00
EXELON CORP	52,862	37.77	1,996,597.74
FIRSTENERGY CORP	26,125	37.25	973,156.25
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	4,800	72.00	345,600.00
MDU RESOURCES GROUP INC	10,361	26.36	273,115.96
NEXTERA ENERGY INC	26,731	104.73	2,799,537.63
NISOURCE INC	18,381	42.38	778,986.78
NORTHEAST UTILITIES	19,653	50.70	996,407.10
NRG ENERGY INC	21,373	33.72	720,697.56
OGE ENERGY CORP	11,103	37.72	418,805.16
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	27.46	394,710.04
PG&E CORP	28,767	50.35	1,448,418.45
PINNACLE WEST CAPITAL	6,136	62.50	383,500.00
PPL CORPORATION	39,154	36.51	1,429,512.54
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	31,246	41.10	1,284,210.60
SCANA CORP	7,621	56.53	430,815.13
SEMPRA ENERGY	14,393	112.49	1,619,068.57
SOUTHERN CO	54,606	47.13	2,573,580.78
WISCONSIN ENERGY CORP	13,286	49.26	654,468.36
XCEL ENERGY INC	31,317	33.60	1,052,251.20
ALTERA CORPORATION	19,732	35.22	695,059.70
ANALOG DEVICES	19,569	50.24	983,146.56
APPLIED MATERIALS	75,265	22.43	1,688,193.95
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,444	85.04	1,313,357.76

	BROADCOM CORP-CL A	33,065	41.00	1,355,830.32	
	CREE INC	6,609	32.62	215,585.58	
	INTEL CORP	304,451	33.58	10,223,464.58	
	KLA-TENCOR CORP	9,743	80.00	779,440.00	
	LAM RESEARCH CORP	9,523	78.93	751,650.39	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,013	43.36	650,963.68	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	24,929	13.38	333,550.02	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	16,812	29.59	497,551.14	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,695	43.14	504,522.30	
	MICRON TECHNOLOGY	65,868	33.01	2,174,302.68	
	NVIDIA CORP	32,924	19.79	651,565.96	
	TEXAS INSTRUMENTS	66,158	50.90	3,367,442.20	
	XILINX INC	16,914	43.60	737,534.97	
	アメリカドル 小計	18,893,775		1,129,393,624.12	(129,157,454,854)
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	8,790	45.55	400,384.50	
	ARC RESOURCES LTD	18,796	28.37	533,242.52	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	3.54	70,991.16	
	BAYTEX ENERGY CORP	9,931	32.58	323,551.98	
	CAMECO CORP	23,878	21.24	507,168.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	67,610	40.87	2,763,220.70	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	28,980	17.61	510,337.80	
	CENOVUS ENERGY INC	47,535	28.62	1,360,451.70	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,020	36.81	957,796.20	
	ENBRIDGE	51,591	52.04	2,684,795.64	
	ENCANA CORP	43,107	21.46	925,076.22	
	ENERPLUS CORP	10,454	16.74	174,999.96	
	HUSKY ENERGY INC	20,460	27.00	552,420.00	
	IMPERIAL OIL	17,243	53.92	929,742.56	
	INTER PIPELINE LTD	19,069	35.26	672,372.94	
	KEYERA CORP	4,917	94.37	464,017.29	
	MEG ENERGY CORP	8,375	28.24	236,510.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	19,513	14.79	288,597.27	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,795	45.70	858,931.50	
	PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	4.47	140,693.25	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	23,074	4.89	112,831.86	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	9,172	35.10	321,937.20	
	SUNCOR ENERGY	90,481	39.19	3,545,950.39	
	TALISMAN ENERGY INC	62,493	6.55	409,329.15	
	TOURMALINE OIL CORP	10,102	42.63	430,648.26	
	TRANSCANADA CORP	43,832	56.05	2,456,783.60	
	VERMILION ENERGY INC	5,975	66.10	394,947.50	

AGNICO EAGLE MINES	12,166	27.83	338,579.78
AGRIUM INC	9,150	111.55	1,020,682.50
BARRICK GOLD CORP	73,795	13.79	1,017,633.05
ELDORADO GOLD CORP	45,613	6.38	291,010.94
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	33,888	17.25	584,568.00
FRANCO-NEVADA CORP	9,259	57.34	530,911.06
GOLDCORP INC	51,241	22.68	1,162,145.88
KINROSS GOLD CORP	81,986	2.84	232,840.24
METHANEX CORP	6,468	65.38	422,877.84
NEW GOLD INC	29,614	4.40	130,301.60
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	52,707	37.21	1,961,227.47
SILVER WHEATON CORP	21,380	21.38	457,104.40
TECK RESOURCES LTD-CL B	32,900	18.79	618,191.00
YAMANA GOLD INC	47,555	4.47	212,570.85
BOMBARDIER B	96,927	3.91	378,984.57
CAE INC	18,429	14.79	272,564.91
FINNING INTERNATIONAL INC	11,764	28.63	336,803.32
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,158	44.41	406,706.78
CANADIAN NATL RAILWAY CO	50,655	78.91	3,997,186.05
CP RAILWAY LIMITED	10,834	233.85	2,533,530.90
MAGNA INTERNATIONAL INC	13,632	117.20	1,597,670.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,067	66.67	471,156.89
TIM HORTONS INC	7,936	92.49	734,000.64
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22,935	29.25	670,848.75
THOMSON REUTERS CORP	21,418	42.64	913,263.52
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,548	122.64	557,766.72
DOLLARAMA INC	3,609	102.02	368,190.18
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	26,481	38.53	1,020,312.93
EMPIRE CO LTD 'A'	3,833	78.34	300,277.22
LOBLAW COMPANIES LTD	13,323	57.18	761,809.14
METRO INC	5,250	77.86	408,765.00
WESTON (GEORGE) LTD	3,518	90.08	316,901.44
SAPUTO INC	15,250	31.41	479,002.50
CATAMARAN CORPORATION	12,279	54.18	665,276.22
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	19,663	142.84	2,808,662.92
BANK MONTREAL	39,765	81.27	3,231,701.55
BANK NOVA SCOTIA	74,741	67.48	5,043,522.68
CANADIAN IMPERIAL BANK	24,581	103.15	2,535,530.15
NATIONAL BANK OF CANADA	20,682	54.09	1,118,689.38
ROYAL BANK OF CANADA	88,406	81.08	7,167,958.48
TORONTO-DOMINION BANK	113,027	55.80	6,306,906.60
CI FINANCIAL CORP	15,063	34.32	516,962.16

	IGM FINANCIAL INC	5,864	47.34	277,601.76
	ONEX CORP	5,970	63.35	378,199.50
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,225	539.21	660,532.25
	GREAT-WEST LIFECO INC	17,649	32.33	570,592.17
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,921	43.15	298,641.15
	INTACT FINANCIAL CORP	7,805	79.83	623,073.15
	MANULIFE FINANCIAL CORP	114,787	21.23	2,436,928.01
	POWER CORP OF CANADA	21,844	29.97	654,664.68
	POWER FINANCIAL CORP	14,959	33.60	502,622.40
	SUN LIFE FINANCIAL INC	38,194	40.07	1,530,433.58
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	34,463	56.18	1,936,131.34
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	18.35	101,548.90
	CGI GROUP INC - CL A	14,453	39.88	576,385.64
	OPEN TEXT CORP	7,246	65.72	476,207.12
	BCE INC	16,476	50.98	839,946.48
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	21,185	42.19	893,795.15
	TELUS CORP	16,454	41.01	674,778.54
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	45.24	180,960.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	7,267	37.49	272,439.83
	FORTIS INC	14,116	37.74	532,737.84
	TRANSALTA CORP	15,621	10.73	167,613.33
	カナダドル 小計	2,396,251		92,515,159.30 (9,333,854,421)
ユーロ	ENI	157,133	16.41	2,578,552.53
	FUGRO NV-CVA	3,638	14.07	51,204.85
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	25,823	11.33	292,574.59
	NESTE OIL OYJ	6,385	18.28	116,717.80
	OMV AG	8,150	24.70	201,345.75
	REPSOL SA	64,583	17.35	1,120,837.96
	SAIPEM	15,941	12.72	202,769.52
	TECHNIP S.A.	6,028	60.42	364,211.76
	TENARIS SA	29,111	15.00	436,665.00
	TOTAL SA	130,847	46.53	6,088,310.91
	VOPAK	3,622	39.98	144,807.56
	AIR LIQUIDE	21,154	95.67	2,023,803.18
	AKZO NOBEL	15,102	53.72	811,279.44
	ARCELORMITTAL	57,628	10.10	582,330.94
	ARKEMA	3,184	50.62	161,174.08
	BASF SE	56,148	69.96	3,928,114.08
	CRH	46,927	17.85	837,646.95
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	4,228	31.61	133,647.08
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,433	57.65	486,162.45



IMERYS SA	1,975	59.38	117,275.50
K+S AG	9,866	22.35	220,554.43
KONINKLIJKE DSM NV	9,909	50.00	495,450.00
LAFARGE (FRANCE)	10,743	55.25	593,550.75
LANXESS	4,818	37.64	181,349.52
LINDE AG	11,407	145.70	1,661,999.90
SOLVAY SA	3,601	111.05	399,891.05
STORA ENSO OYJ R	31,297	6.61	207,029.65
THYSSEN KRUPP	26,897	19.27	518,305.19
UMICORE	7,367	32.25	237,622.58
UPM KYMMENE CORP	32,348	12.63	408,555.24
VOESTALPINE AG	7,829	31.20	244,264.80
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	11,476	28.94	332,172.82
AIRBUS GROUP NV	36,200	48.24	1,746,288.00
ALSTOM RGPT	13,896	27.94	388,323.72
ANDRITZ AG	5,242	42.34	221,972.49
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,853	41.56	243,279.94
BOUYGUES ORD	11,266	27.67	311,730.22
BRENTAG AG	9,887	41.35	408,827.45
CNH INDUSTRIAL NV	59,434	6.49	386,023.83
FERROVIAL SA	26,070	15.93	415,295.10
FERROVIAL SA - RTS	26,070	0.38	10,089.09
FINMECCANICA SPA	28,941	7.47	216,333.97
GEA GROUP AG	11,636	36.09	419,943.24
HOCHTIEF AG	1,223	57.04	69,759.92
KONE OYJ-B	18,524	34.17	632,965.08
KONINKLIJKE PHILIPS	60,315	22.21	1,339,897.72
LEGRAND SA	15,351	40.20	617,110.20
MAN SE	2,329	91.80	213,802.20
METSO OYJ	6,575	25.01	164,440.75
OCI NV	5,400	28.78	155,412.00
OSRAM LICHT AG	4,722	31.27	147,680.55
PRYSMIAN SPA	14,715	14.61	214,986.15
REXEL SA	14,819	13.52	200,426.97
SAFRAN SA	16,912	51.07	863,695.84
SAINT-GOBAIN	27,612	34.46	951,647.58
SCHNEIDER ELECTRIC SE	32,060	61.75	1,979,705.00
SIEMENS	48,459	88.03	4,265,845.77
THALES SA	6,178	40.40	249,591.20
VALLOUREC	5,583	30.10	168,076.21
VINCI S.A.	29,893	45.86	1,371,042.44
WARTSILA OYJ	9,741	36.95	359,929.95

ZARDOYA OTIS SA	10,201	9.34	95,277.34
ZODIAC AEROSPACE	10,962	25.23	276,571.26
BUREAU VERITAS SA	14,517	19.89	288,743.13
EDENRED	11,350	22.14	251,289.00
RANDSTAD HOLDING NV	6,762	34.98	236,534.76
SOCIETE BIC SA	1,437	103.05	148,082.85
ABERTIS INFRASTRUCTURAS	25,753	16.13	415,524.65
ADP	1,728	94.33	163,002.24
ATLANTIA SPA	25,489	18.42	469,507.38
BOLLORE	311	400.95	124,695.45
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	12.68	154,176.12
DEUTSCHE POST AG-REG	59,656	24.97	1,489,610.32
FRAPORT AG	2,319	47.98	111,277.21
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	25,823	10.17	262,619.91
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	5.13	291,908.57
TNT EXPRESS	22,191	4.92	109,268.48
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,360	83.33	1,696,598.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,581	61.97	221,914.57
CONTINENTAL AG	6,790	156.75	1,064,332.50
DAIMLER AG	58,873	62.36	3,671,320.28
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	54,746	8.77	480,122.42
MICHELIN	11,631	70.42	819,055.02
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	22.08	136,410.24
PEUGEOT SA	20,500	9.10	186,591.00
PIRELLI & CO	16,123	10.67	172,032.41
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,612	65.98	634,199.76
RENAULT SA	12,087	58.98	712,891.26
VALEO SA	4,436	90.94	403,409.84
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,999	171.15	1,711,328.85
VOLKSWAGEN STAMM	1,589	170.55	271,003.95
ADIDAS AG	13,031	59.53	775,735.43
CHRISTIAN DIOR	3,139	141.65	444,639.35
HUGO BOSS AG	1,699	101.20	171,938.80
KERING	4,761	157.40	749,381.40
LUXOTTICA GROUP SPA	10,468	40.18	420,604.24
LVMH	17,163	133.90	2,298,125.70
ACCOR	11,075	33.18	367,468.50
SODEXO	5,517	76.80	423,705.60
ALTICE SA	5,811	50.54	293,687.94
AXEL SPRINGER SE	2,489	44.27	110,200.47
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,179	26.07	239,296.53
JC DECAUX SA	3,121	25.86	80,724.66

KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	108.00	142,884.00
LAGADERE S.C.A	5,564	20.11	111,919.86
NUMERICABLE GROUP	5,900	26.60	156,940.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	13,151	32.13	422,541.63
PUBLICIS GROUPE	10,377	56.16	582,772.32
REED ELSEVIER NV	40,758	18.44	751,781.31
RTL GROUP	2,054	75.35	154,768.90
SES	17,418	27.22	474,205.05
SKY DEUTSCHLAND AG	23,240	6.10	141,764.00
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	44.91	144,610.20
WOLTERS KLUWER	17,586	21.97	386,452.35
INDITEX	68,557	21.62	1,482,545.12
CARREFOUR	38,993	23.56	918,870.04
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,687	83.66	308,454.42
COLRUYT SA	4,415	36.61	161,633.15
DELHAIZE GROUP	6,304	55.67	350,943.68
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	46,214	5.24	242,577.28
JERONIMO MARTINS	15,262	7.79	118,997.81
KONINKLIJKE AHOLD NV	58,677	13.54	794,779.96
METRO STAMM	8,530	25.19	214,913.35
ANHEUSER-BUSCH INBEV	49,353	87.93	4,339,609.29
DANONE (GROUPE)	35,601	53.50	1,904,653.50
HEINEKEN HOLDING NV	6,633	51.73	343,125.09
HEINEKEN NV	14,470	59.30	858,071.00
KERRY GROUP PLC-A	9,660	53.90	520,674.00
PERNOD-RICARD	13,159	90.73	1,193,916.07
REMY COINTREAU	1,575	56.66	89,239.50
UNILEVER NV-CVA	100,137	30.87	3,091,729.87
BEIERSDORF AG	6,416	67.17	430,962.72
HENKEL AG & CO KGAA	6,911	72.59	501,669.49
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,055	80.26	887,274.30
LOREAL	15,460	126.70	1,958,782.00
CELESIO AG	2,526	26.31	66,471.69
ESSILOR INTERNATIONAL	12,625	85.96	1,085,245.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,460	57.32	771,527.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	23,374	40.83	954,477.29
BAYER	50,521	111.85	5,650,773.85
GRIFOLS SA	9,815	34.35	337,145.25
MERCK KGAA	7,656	71.07	544,111.92
ORION OYJ-CLASS B	5,839	26.88	156,952.32
QIAGEN N.V.	13,359	18.91	252,618.69
SANOFI	72,527	72.97	5,292,295.19

UCB (GROUPE)	7,379	64.21	473,805.59
BANCO BILBAO VIZCAYA	374,140	8.51	3,185,053.82
BANCO DE SABADELL SA	187,781	2.10	395,654.56
BANCO SANTANDER SA	771,677	6.64	5,130,108.69
BCP BANCO COMERCIAL NOM	2,440,031	0.07	190,322.41
BNP PARIBAS	66,262	48.67	3,224,971.54
CAIXABANK	104,851	4.09	429,469.69
COMMERZBANK AG	61,631	12.02	740,804.62
CREDIT AGRICOLE SA	64,020	10.67	683,093.40
ERSTE GROUP BANK AG	17,314	19.67	340,652.95
ING GROEP NV-CVA	242,476	11.37	2,756,952.12
INTESA SANPAOLO	738,871	2.21	1,632,904.91
INTESA SANPAOLO-RNC	65,000	1.95	126,880.00
KBC GROEP NV	14,819	41.20	610,542.80
NATIXIS	55,840	5.23	292,210.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,746	16.28	93,573.61
SOCIETE GENERALE	45,316	36.18	1,639,532.88
UNICREDIT SPA	280,661	5.50	1,543,635.50
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,565	5.72	312,111.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	86,459	24.27	2,098,792.22
DEUTSCHE BOERSE	12,338	55.21	681,180.98
EURAZEO	2,073	51.93	107,650.89
EXOR SPA	5,807	32.91	191,108.37
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,049	70.20	354,439.80
MEDIOBANCA	41,923	6.83	286,543.70
WENDEL	1,898	90.12	171,047.76
AEGON	107,975	6.54	706,264.47
AGEAS	13,863	27.56	382,133.59
ALLIANZ SE-REG	28,533	131.20	3,743,529.60
ASSICURAZIONI GENERALI	74,794	16.30	1,219,142.20
AXA	114,067	18.26	2,082,863.42
CNP ASSURANCES	8,550	14.76	126,198.00
DELTA LLOYD NV	11,075	18.66	206,659.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,252	67.75	220,323.00
MAPFRE SA	65,064	2.78	181,333.36
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,848	154.00	1,670,592.00
SAMPO OYJ-A SHS	28,682	37.71	1,081,598.22
SCOR SE	10,368	24.15	250,439.04
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	71,163	2.03	144,887.86
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	38.30	86,711.20
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,145	17.72	286,170.12
IMMOFINANZ AG	55,175	2.30	127,233.55

AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,199	29.46	683,558.53	
ATOS	4,325	54.40	235,280.00	
CAP GEMINI SA	8,393	54.47	457,166.71	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,319	49.99	365,876.81	
GEMALTO	4,790	61.26	293,435.40	
SAP SE	56,380	53.60	3,021,968.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,685	31.86	212,984.10	
ALCATEL-LUCENT	166,458	2.67	445,275.15	
NOKIA CORP	232,949	6.43	1,497,862.07	
BELGACOM	10,096	29.39	296,771.92	
DEUTSCHE TELEKOM	191,064	12.04	2,301,365.88	
ELISA A	10,064	21.83	219,697.12	
ILIAD SA	1,701	186.20	316,726.20	
KPN (KON.)	190,345	2.56	488,044.58	
ORANGE	114,342	12.36	1,413,838.83	
TELECOM ITALIA ORD	615,605	0.86	532,190.52	
TELECOM ITALIA RNC	412,771	0.68	283,780.06	
TELEFONICA	253,074	11.81	2,988,803.94	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	37,579	3.88	145,994.41	
VIVENDI	74,723	19.62	1,466,438.87	
ZIGGO NV	8,822	40.00	352,880.00	
E.ON SE	123,100	13.42	1,652,002.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	14,123	22.98	324,546.54	
ENAGAS	12,914	25.85	333,826.90	
ENEL	409,679	3.82	1,566,612.49	
ENEL GREEN POWER SPA	123,226	1.89	233,143.59	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	140,452	3.25	456,469.00	
FORTUM OYJ	26,516	18.15	481,265.40	
GAS NATURAL SDG SA	21,787	22.44	488,900.28	
GDF SUEZ	89,176	18.62	1,660,903.00	
IBERDROLA SA	318,767	5.52	1,759,593.84	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,766	67.12	454,133.92	
RWE STAMM	30,437	27.92	849,953.22	
SNAM SPA	124,066	3.99	495,271.47	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,532	13.67	198,652.44	
TERNA SPA	94,904	3.77	358,547.31	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,206	14.08	354,900.48	
ASML HOLDING NV	22,115	79.79	1,764,555.85	
INFINEON TECHNOLOGIES	71,173	7.59	540,345.41	
STMICROELECTRONICS	42,509	5.49	233,586.95	
ユーロ 小計	13,391,228		180,091,061.94 (25,646,768,130)	

イギリスポンド	AMEC PLC	15,243	10.57	161,118.51
	BG GROUP	207,925	10.49	2,182,172.87
	BP PLC	1,130,165	4.41	4,987,418.14
	PETROFAC LTD	16,711	11.18	186,828.98
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	241,193	22.30	5,379,809.86
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	150,176	23.26	3,493,093.76
	TULLOW OIL PLC	53,566	5.06	271,311.79
	ANGLO AMERICAN PLC	85,537	13.64	1,167,152.36
	ANTOFAGASTA PLC	25,418	7.03	178,815.63
	BHP BILLITON PLC	128,759	16.76	2,158,000.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	23.60	204,494.00
	FRESNILLO PLC	9,483	7.34	69,605.22
	GLENCORE PLC	647,783	3.25	2,107,238.09
	JOHNSON MATTHEY PLC	12,014	30.18	362,582.52
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,202	41.32	214,946.64
	REXAM PLC	44,988	4.84	217,966.86
	RIO TINTO PLC REG	77,556	30.39	2,356,926.84
	BAE SYSTEMS PLC	194,250	4.56	887,139.75
	BUNZL PLC	19,453	17.09	332,451.77
	COBHAM PLC	72,398	2.90	210,098.99
	IMI PLC	14,701	12.27	180,381.27
	MEGGITT PLC	50,990	4.76	242,814.38
	MELROSE INDUSTRIES PLC	56,502	2.59	146,453.18
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	115,538	8.67	1,001,714.46
	SMITHS GROUP PLC	24,869	12.17	302,655.73
	TRAVIS PERKINS PLC	15,233	16.50	251,344.50
	WEIR GROUP PLC/THE	13,390	22.00	294,580.00
	WOLSELEY LTD	15,365	33.62	516,571.30
	AGGREKO PLC	15,329	15.29	234,380.41
	BABCOCK INTL GROUP PLC	26,521	10.75	285,100.75
	CAPITA GROUP PLC	38,321	11.03	422,680.63
	EXPERIAN PLC	61,630	10.21	629,242.30
	G4S PLC	90,850	2.64	240,479.95
	INTERTEK GROUP PLC	10,210	27.57	281,489.70
EASYJET PLC	7,667	15.35	117,688.45	
ROYAL MAIL PLC	36,948	4.62	171,032.29	
NEW GKN	102,805	3.20	329,798.44	
BURBERRY GROUP PLC	25,903	15.19	393,466.57	
PERSIMMON PLC	17,995	14.10	253,729.50	
CARNIVAL PLC	10,842	24.98	270,833.16	
COMPASS GROUP PLC	102,652	10.05	1,031,652.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,805	24.05	356,060.25	

TUI TRAVEL PLC	32,742	3.99	130,869.77
WHITBREAD PLC	10,517	43.05	452,756.85
WILLIAM HILL	55,917	3.52	196,883.75
BRITISH SKY BROADCASTING	63,893	8.88	567,369.84
ITV PLC	220,839	2.03	448,965.68
PEARSON	50,717	11.80	598,460.60
REED ELSEVIER PLC	70,840	10.31	730,360.40
WPP PLC	81,347	12.37	1,006,262.39
ASOS PLC	3,098	26.61	82,437.78
DIXONS CARPHONE PLC	58,046	4.03	234,157.56
KINGFISHER PLC	136,908	2.91	398,402.28
MARKS & SPENCER GROUP PLC	95,169	4.66	443,677.87
NEXT PLC	9,554	64.65	617,666.10
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	14,452	6.53	94,371.56
MORRISON SUPERMARKETS	118,741	1.68	199,959.84
SAINSBURY (J) PLC	63,963	2.61	167,327.20
TESCO	499,467	1.84	921,266.88
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,988	29.57	650,185.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO	114,804	35.79	4,109,409.18
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	13.60	153,163.20
DIAGEO	153,096	18.24	2,792,471.04
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	58,441	27.80	1,624,659.80
SABMILLER PLC	58,810	35.03	2,060,114.30
TATE & LYLE	23,966	6.10	146,192.60
UNILEVER PLC	78,284	25.12	1,966,494.08
RECKITT BENCKISER PLC	39,665	51.55	2,044,730.75
SMITH & NEPHEW PLC	51,801	10.45	541,320.45
ASTRAZENECA	77,599	45.97	3,567,226.03
GLAXOSMITHKLINE	297,904	14.17	4,221,299.68
SHIRE PLC	35,966	41.71	1,500,141.86
BARCLAYS	1,021,951	2.34	2,392,898.26
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,193,679	6.30	7,520,177.70
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,557,588	0.76	2,713,372.36
ROYAL BANK OF SCOTLAND	158,655	3.74	594,797.59
STANDARD CHARTERED PLC	153,965	9.46	1,456,662.86
3I GROUP PLC	62,380	4.00	249,520.00
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	50,274	4.42	222,562.99
HARGREAVES LANSDOWN PLC	14,209	10.42	148,057.78
ICAP PLC	32,393	4.23	137,313.92
INVESTEC PLC	30,876	5.72	176,765.10
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	12,910	20.45	264,009.50
SCHRODERS PLC	7,932	25.06	198,775.92

	ADMIRAL GROUP PLC	11,529	12.15	140,077.35	
	AVIVA PIC	184,300	5.25	967,575.00	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	90,720	2.71	246,032.64	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	85,120	3.21	273,660.80	
	LEGAL & GENERAL GROUP	370,684	2.36	874,814.24	
	OLD MUTUAL PLC	309,515	1.92	596,435.40	
	PRUDENTIAL	159,810	14.37	2,297,268.75	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	61,005	4.46	272,204.31	
	STANDARD LIFE PLC	151,002	3.97	600,232.95	
	SAGE GROUP PLC	69,473	3.75	260,801.64	
	BT GROUP PLC	483,014	3.73	1,804,057.29	
	INMARSAT PLC	23,362	7.12	166,337.44	
	VODAFONE GROUP PLC	1,623,743	2.06	3,360,336.13	
	CENTRICA PLC	308,465	3.02	932,181.23	
	NATIONAL GRID PLC	227,689	9.19	2,092,461.91	
	SEVERN TRENT PLC	14,037	19.60	275,125.20	
	SSE PLC	59,649	15.69	935,892.81	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	39,961	8.55	341,866.35	
	ARM HOLDINGS PLC	86,749	8.71	756,017.53	
	イギリスポンド 小計	17,281,986		101,020,220.67 (18,336,180,253)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	22,796	28.60	651,965.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	339.75	162,060.75	
	GIVAUDAN-REG	543	1,603.00	870,429.00	
	HOLCIM LTD	14,234	68.85	980,010.90	
	SIKA AG-BR	122	3,523.00	429,806.00	
	SYNGENTA AG	5,736	303.70	1,742,023.20	
	ABB LTD	134,633	21.45	2,887,877.85	
	GEBERIT AG-REG	2,352	327.70	770,750.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,042	131.40	136,918.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,485	135.80	337,463.00	
	SULZER AG-REG	1,193	111.90	133,496.70	
	ADECCO	10,705	62.85	672,809.25	
	SGS SA	326	2,142.00	698,292.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,294	125.90	414,714.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	31,976	84.10	2,689,181.60	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,917	453.40	869,167.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,872	82.85	237,945.20	
	ARYZTA AG	4,970	78.80	391,636.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,051.00	138,732.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	4,795.00	234,955.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	57,195.00	343,170.00	



	NESTLE SA - REGISTERED	196,938	70.30	13,844,741.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,056	150.00	458,400.00	
	ACTELION LTD-REG	6,094	111.40	678,871.60	
	LONZA GROUP AG-REG	3,394	107.20	363,836.80	
	NOVARTIS	140,465	88.65	12,452,222.25	
	ROCHE HOLDING GENUSS	42,901	282.40	12,115,242.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	95,034	24.96	2,372,048.64	
	JULIUS BAER GROUP LTD	14,356	42.37	608,263.72	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,896	74.30	140,872.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	936	258.75	242,190.00	
	UBS AG-REG	228,171	16.48	3,760,258.08	
	BALOISE HOLDING AG	3,124	120.80	377,379.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,866	220.50	411,453.00	
	SWISS RE LTD	22,169	79.65	1,765,760.85	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,347	285.30	2,666,699.10	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,845	72.95	280,492.75	
	SWISSCOM	1,454	547.00	795,338.00	
	スイスフラン 小計	1,016,906		69,127,476.24 (8,186,075,736)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,307	113.30	1,281,083.10	
	BOLIDEN AB	18,196	121.90	2,218,092.40	
	ALFA LAVAL AB	19,284	157.00	3,027,588.00	
	ASSA ABLOY B	20,773	394.50	8,194,948.50	
	ATLAS COPCO A	41,719	212.70	8,873,631.30	
	ATLAS COPCO B	23,370	193.80	4,529,106.00	
	SANDVIK AB	61,350	82.05	5,033,767.50	
	SKANSKA B	22,992	155.10	3,566,059.20	
	SKF AB-B	23,955	151.80	3,636,369.00	
	VOLVO B	95,455	85.45	8,156,629.75	
	SECURITAS B	15,190	88.15	1,338,998.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	206.70	2,816,700.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,855	53.65	1,065,220.75	
	HENNES & MAURITZ B	58,387	295.00	17,224,165.00	
	SWEDISH MATCH AB	12,410	240.00	2,978,400.00	
	SCA SV CELLULOSA B	34,934	168.30	5,879,392.20	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	75.00	1,582,725.00	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	170.70	1,846,632.60	
	NORDEA BANK AB	190,776	90.95	17,351,077.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	96,309	93.15	8,971,183.35	
SVENSKA HANDELSBK A	31,647	350.10	11,079,614.70		
SWEDBANK AB-A	57,425	191.30	10,985,402.50		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	131.10	977,088.30		

	INVESTOR AB-B SHS	27,365	265.00	7,251,725.00
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,668	237.70	3,486,583.60
	ERICSSON (LM) B	187,504	87.25	16,359,724.00
	HEXAGON AB-B SHS	15,486	245.30	3,798,715.80
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,329	606.50	2,625,538.50
	TELE2 AB-B SHS	15,978	94.80	1,514,714.40
	TELIASONERA AB	148,821	50.95	7,582,429.95
	スウェーデンクローナ 小計	1,322,486		175,233,307.00 (2,707,354,593)
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	8,029	42.42	340,590.18
	SEADRILL LTD	23,438	150.30	3,522,731.40
	STATOIL ASA	68,646	152.50	10,468,515.00
	SUBSEA 7 SA	18,360	79.90	1,466,964.00
	NORSK HYDRO	83,896	37.84	3,174,624.64
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,268	316.00	3,560,688.00
	ORKLA	48,294	52.65	2,542,679.10
	DNB ASA	61,687	122.20	7,538,151.40
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,106	122.90	1,242,027.40
	TELENOR ASA	46,541	149.40	6,953,225.40
	ノルウェークローネ 小計	380,265		40,810,196.52 (686,019,403)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	15,049	274.10	4,124,930.90
	VESTAS WIND SYSEMS	14,394	236.60	3,405,620.40
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	218	12,710.00	2,770,780.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	445	12,990.00	5,780,550.00
	DSV A/S	9,332	179.00	1,670,428.00
	PANDORA A/S	7,298	493.70	3,603,022.60
	CARLSBERG AS-B	6,289	509.50	3,204,245.50
	COLOPLAST-B	6,299	509.00	3,206,191.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	448.10	664,980.40
	NOVO NORDISK A/S-B	122,822	260.20	31,958,284.40
	DANSKE BANK A/S	41,665	160.40	6,683,066.00
	TRYG A/S	1,289	674.00	868,786.00
TDC A/S	52,498	44.64	2,343,510.72	
	デンマーククローネ 小計	279,082		70,284,395.92 (1,345,946,181)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	31.48	267,233.72
	ORIGIN ENERGY LIMITED	69,132	14.54	1,005,179.28
	SANTOS	58,141	12.78	743,041.98
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	45,894	40.69	1,867,426.86
	WORLEYPARSONS LTD	10,573	12.89	136,285.97
	ALUMINA LIMITED	170,458	1.77	301,710.66

AMCOR	71,571	12.22	874,597.62
BHP BILLITON LTD	196,420	34.49	6,774,525.80
BORAL LIMITED	46,867	5.03	235,741.01
FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,478	3.15	285,005.70
ILUKA RESOURCES LTD	21,335	7.13	152,118.55
INCITEC PIVOT LTD	110,188	2.96	326,156.48
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29,448	12.26	361,032.48
NEWCREST MINING LIMITED	46,855	8.79	411,855.45
ORICA LTD	22,850	20.25	462,712.50
RIO TINTO LTD	26,929	60.70	1,634,590.30
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	5,336	21.78	116,218.08
ALS LTD	21,808	5.53	120,598.24
BRAMBLES LTD	98,225	9.80	962,605.00
SEEK LTD	21,328	16.81	358,523.68
ASCIANO GROUP	64,054	6.29	402,899.66
AURIZON HOLDINGS LTD	136,201	4.65	633,334.65
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.68	129,996.06
TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.55	231,473.85
TRANSURBAN GROUP	113,279	8.22	931,153.38
CROWN RESORTS LTD	21,269	14.15	300,956.35
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	41.38	135,022.94
TABCORP HOLDINGS	45,765	4.12	188,551.80
TATTS GROUP LTD	77,050	3.48	268,134.00
REA GROUP LTD	2,513	45.38	114,039.94
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.91	120,474.92
METCASH LTD	55,380	2.85	157,833.00
WESFARMERS LIMITED	70,229	44.80	3,146,259.20
WOOLWORTHS LTD	77,331	34.48	2,666,372.88
COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,004	9.49	360,657.96
TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.86	187,362.72
COCHLEAR LIMITED	3,856	72.27	278,673.12
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,646	53.15	406,384.90
SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	19.13	414,126.24
CSL LIMITED	29,526	79.96	2,360,898.96
AUST AND NZ BANKING GROUP	167,910	32.88	5,520,880.80
BANK OF QUEENSLAND LTD	24,377	12.33	300,568.41
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	23,591	12.82	302,436.62
COMMONWEALTH BANK OF AUST	99,122	82.76	8,203,336.72
NATIONAL AUSTRALIA BANK	144,094	33.22	4,786,802.68
WESTPAC BANKING	190,149	34.84	6,624,791.16
ASX LTD	12,620	37.24	469,968.80
MACQUARIE GROUP LIMITED	18,092	62.36	1,128,217.12

	AMP LTD	174,361	5.90	1,028,729.90
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	147,269	6.48	954,303.12
	QBE INSURANCE GROUP	79,242	11.66	923,961.72
	SUNCORP GROUP LIMITED	80,193	14.96	1,199,687.28
	COMPUTERSHARE LIMITED	25,705	12.43	319,513.15
	TELSTRA CORP	270,830	5.77	1,562,689.10
	TPG TELECOM LTD	20,000	7.32	146,400.00
	AGL ENERGY LTD	39,790	13.86	551,489.40
	AUSNET SERVICES	87,439	1.42	124,163.38
	オーストラリアドル 小計	3,732,343		64,979,705.25 (6,425,843,052)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	46,550	8.36	389,158.00
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,782	3.88	185,394.16
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,016	7.70	169,523.20
	XERO LTD	3,006	17.52	52,665.12
	SPARK NEW ZEALAND LTD	108,032	3.05	330,037.76
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	6.36	162,199.08
	ニュージーランドドル 小計	252,889		1,288,977.32 (114,525,634)
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	132,000	96.50	12,738,000.00
	NWS HOLDINGS LTD	78,000	14.14	1,102,920.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	14.76	841,320.00
	MTR CORP	84,000	30.65	2,574,600.00
	LI & FUNG	378,800	8.97	3,397,836.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	72,000	24.25	1,746,000.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	25.95	1,206,675.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	146,000	49.60	7,241,600.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	23.30	1,565,760.00
	SANDS CHINA LTD	152,000	44.25	6,726,000.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	10.74	1,052,520.00
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	15.12	1,995,840.00
	WYNN MACAU LTD	102,800	26.25	2,698,500.00
	BANK EAST ASIA	84,760	31.90	2,703,844.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	221,500	25.40	5,626,100.00
	HANG SENG BANK	45,700	130.00	5,941,000.00
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.12	1,039,360.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	68,900	175.60	12,098,840.00
	AIA GROUP LTD	738,800	42.95	31,731,460.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	86,000	135.30	11,635,800.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	139,000	22.85	3,176,150.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	61,600	50.15	3,089,240.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	35.00	1,400,000.00	

	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	26.15	1,006,775.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	323,500	9.45	3,057,075.00
	SINO LAND CO	175,400	12.56	2,203,024.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,000	113.50	11,463,500.00
	SWIRE PACIFIC A	36,500	101.80	3,715,700.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	69,200	24.20	1,674,640.00
	WHARF HOLDINGS	96,000	55.05	5,284,800.00
	WHEELLOCK & CO LTD	53,000	36.10	1,913,300.00
	PCCW LTD	232,000	4.91	1,139,120.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	41,000	55.85	2,289,850.00
	CLP HOLDINGS	112,000	67.15	7,520,800.00
	HONG KONG & CHINA GAS	396,163	18.20	7,210,166.60
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	82,500	73.75	6,084,375.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	80.20	1,106,760.00
	香港ドル 小計	4,931,123		178,999,250.60 (2,640,238,946)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	94,300	9.41	887,363.00
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.20	272,835.60
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	57,000	4.54	258,780.00
	SEMBCORP MARINE LTD	41,000	3.59	147,190.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	109,000	3.61	393,490.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.15	152,950.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	2.70	391,500.00
	SINGAPORE AIRLINES	31,533	10.12	319,113.96
	GENTING SINGAPORE PLC	425,000	1.04	444,125.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.28	398,040.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	40.16	240,960.00
	OLAM INTERNATIONAL LTD	26,000	2.11	54,860.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	419,000	0.51	213,690.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.19	354,090.00
	DBS GROUP	107,000	19.34	2,069,380.00
	OCBC BANK	172,000	10.13	1,742,360.00
	UNITED OVERSEAS BANK	80,000	23.30	1,864,000.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	7.00	294,000.00
	CAPITALAND LTD	165,500	3.15	521,325.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	9.39	225,360.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	199,000	2.65	527,350.00
KEPPEL LAND LTD	40,000	3.27	130,800.00	
UOL GROUP LIMITED	22,300	6.46	144,058.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	471,243	3.79	1,786,010.97	
STARHUB LTD	38,000	4.13	156,940.00	
		3,279,239		13,990,571.53

シンガポールドル 小計				(1,240,823,788)
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	201	1,305.00	262,305.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,756	26.40	864,758.40
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,876.00	302,036.00
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	52,871	219.80	11,621,045.80
	BANK HAPOALIM BM	58,582	19.87	1,164,024.34
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.29	941,197.80
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	42.35	347,270.00
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	171.40	575,561.20
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	6.53	728,963.49
イスラエルシェケル 小計		338,582		16,807,162.03 (504,551,004)
合 計		67,496,155		206,325,635,995 (206,325,635,995)

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	329,000	225,365.00	
		アメリカドル 小計		329,000	225,365.00 (25,772,741)
	オーストラリアドル	APA GROUP	48,718	394,615.80	
		LEND LEASE GROUP	33,337	541,059.51	
		SYDNEY AIRPORT	58,361	263,208.11	
	オーストラリアドル 小計		140,416	1,198,883.42 (118,557,581)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000	1,222,000.00	
香港ドル 小計		130,000	1,222,000.00 (18,024,500)		
投資信託受益証券合計			599,416	162,354,822 (162,354,822)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20,934	472,061.70	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	52,036	457,396.44	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	24,276	2,414,733.72	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	55,712	628,431.36	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,054	1,266,894.20	
		BOSTON PROPERTIES	9,476	1,211,222.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,160	389,838.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	20,563	1,640,927.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,628	516,949.56	

	DUKE REALTY CORP	18,853	366,313.79	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,228	1,470,888.12	
	ESSEX PROPERTY TRUST	3,643	730,567.22	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,796	504,488.40	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	33,145	846,854.75	
	HCP INC	28,469	1,229,576.11	
	HEALTH CARE REIT INC	20,017	1,413,600.54	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	47,171	1,068,894.86	
	IRON MOUNTAIN INC	11,190	425,779.50	
	KIMCO REALTY CORP	24,134	598,281.86	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318	293,625.40	
	MACERICH CO/THE	8,313	569,274.24	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,538	436,062.44	
	PROLOGIS INC	30,877	1,278,616.57	
	PUBLIC STORAGE	9,050	1,685,924.50	
	RAYONIER INC	7,016	237,842.40	
	REALTY INCOME CORP	12,964	607,622.68	
	REGENCY CENTERS CORP	5,269	324,254.26	
	SIMON PROPERTY GROUP	19,007	3,410,616.08	
	SL GREEN REALTY CORP	5,458	622,539.48	
	UDR INC	13,985	422,067.30	
	VENTAS INC	18,180	1,240,966.80	
	VORNADO REALTY TRUST	10,456	1,140,017.68	
	アメリカドル 小計	574,916	29,923,129.68	(3,422,009,110)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535	165,845.35	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,483	272,453.17	
	カナダドル 小計	18,018	438,298.52	(44,219,937)
ユーロ	CORIO NV	5,047	193,981.44	
	FONCIERE DES REGIONS	1,649	119,667.93	
	GECINA SA	1,953	208,873.35	
	ICADE	2,102	130,324.00	
	KLEPIERRE	6,825	232,698.37	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,174	1,244,061.00	
	ユーロ 小計	23,750	2,129,606.09	(303,277,203)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	55,670	404,999.25	
	HAMMERSON PLC	46,342	281,064.23	
	INTU PROPERTIES PLC	56,999	194,765.58	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,586	514,309.44	

	SEGRO PLC	48,938	185,964.40	
	イギリスポンド 小計	254,535	1,581,102.90 (286,985,987)	
オーストラリアドル	DEXUS PROPERTY GROUP	59,205	432,196.50	
	FEDERATION CENTRES	97,628	267,500.72	
	GOODMAN GROUP	104,235	588,927.75	
	GPT GROUP	109,865	458,137.05	
	MIRVAC GROUP	214,622	379,880.94	
	NOVION PROPERTY GROUP	126,802	266,284.20	
	SCENTRE GROUP	331,991	1,181,887.96	
	STOCKLAND	133,303	559,872.60	
	WESTFIELD CORP	116,415	935,976.60	
	オーストラリアドル 小計	1,294,066	5,070,664.32 (501,437,994)	
香港ドル	LINK REIT	137,500	6,331,875.00	
	香港ドル 小計	137,500	6,331,875.00 (93,395,156)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000	249,750.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000	180,400.00	
	CAPITAMALL TRUST	141,000	273,540.00	
	シンガポールドル 小計	362,000	703,690.00 (62,410,266)	
	投資証券合計	2,664,785	4,713,735,653 (4,713,735,653)	
	合計		4,876,090,475 (4,876,090,475)	

(注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。

(注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。

(注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。

(注4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 589銘柄	97.4%			61.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 32銘柄			2.6%	1.6%
カナダドル	株式 90銘柄	99.5%			4.4%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 227銘柄	98.8%			12.1%
	投資証券 6銘柄			1.2%	0.1%
イギリスポンド	株式 103銘柄	98.5%			8.7%



	投資証券 5銘柄			1.5%	0.1%
スイスフラン	株式 38銘柄	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	100.0%			1.3%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	91.2%			3.0%
	投資信託受益証券 3銘柄		1.7%		0.1%
	投資証券 9銘柄			7.1%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 37銘柄	96.0%			1.3%
	投資信託受益証券 1銘柄		0.7%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 25銘柄	95.2%			0.6%
	投資証券 3銘柄			4.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	170,338,803
投資証券	38,801,273,600
派生商品評価勘定	15,087,200
未収入金	183,553,500
未収配当金	259,221,771
未収利息	184
差入委託証拠金	10,982,500
流動資産合計	39,440,457,558
資産合計	39,440,457,558
負債の部	
流動負債	

	平成26年11月10日現在
項目	金額（円）
前受金	15,087,200
未払金	192,538,268
未払解約金	102,191,953
流動負債合計	309,817,421
負債合計	309,817,421
純資産の部	
元本等	
元本	28,149,357,979
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,981,282,158
元本等合計	39,130,640,137
純資産合計	39,130,640,137
負債純資産合計	39,440,457,558

## 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11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</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)、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>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</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>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		28,149,357,979口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3901円 (13,901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26年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	平成26年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(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>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	16,019,431,941円
期中追加設定元本額	15,236,018,128円
期中一部解約元本額	3,106,092,090円
期末元本額	28,149,357,979円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	942,767,201円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,069,801円
SMT J-REITインデックス・オープン	6,275,697,852円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	14,977,458,524円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,299,877,014円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,553,104,491円
分散投資コア戦略ファンドA	287,084,442円

区分	平成26年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	448,982,293円
コア投資戦略ファンド（切替型）	190,760,234円
J-REITインデックス・オープン	164,556,127円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		4,651,372,470
合計		4,651,372,470

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（平成26年11月10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	不動産投信指数先物 取引 買建	309,517,300	-	324,604,500	15,087,200
	合計	309,517,300	-	324,604,500	15,087,200

## (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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	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	1,925	757,487,500	

M I Dリート投資法人	766	210,113,800	
森ヒルズリート投資法人	6,550	1,015,905,000	
野村不動産レジデンシャル投資法人	671	409,310,000	
産業ファンド投資法人	691	697,910,000	
大和ハウスリート投資法人	1,224	651,168,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	5,423	1,482,648,200	
ケネディクス・レジデンシャル投資法人	1,164	333,136,800	
アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,047	976,851,000	
G L P投資法人	9,974	1,337,513,400	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,680	343,728,000	
日本プロロジスリート投資法人	7,220	1,836,046,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	6,947	1,016,346,100	
星野リゾート・リート投資法人	179	207,819,000	
S I A不動産投資法人	313	131,147,000	
イオンリート投資法人	3,963	608,716,800	
ヒューリックリート投資法人	3,233	534,091,600	
日本リート投資法人	633	213,954,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,805	180,680,500	
日本ビルファンド投資法人	5,891	3,399,107,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	5,221	2,934,202,000	
日本リテールファンド投資法人	10,138	2,206,028,800	
オリックス不動産投資法人	8,848	1,379,403,200	
日本プライムリアルティ投資法人	3,442	1,368,195,000	
プレミア投資法人	912	419,520,000	
東急リアル・エステート投資法人	4,078	608,845,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	808	278,356,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人	1,554	728,826,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	10,480	1,911,552,000	
森トラスト総合リート投資法人	5,507	1,050,184,900	
インヴィンシブル投資法人	11,133	429,733,800	
フロンティア不動産投資法人	2,069	1,030,362,000	
平和不動産リート投資法人	3,677	331,665,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,463	868,174,100	
福岡リート投資法人	2,879	572,633,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,481	882,676,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	4,227	464,547,300	
いちご不動産投資法人	4,282	342,988,200	
大和証券オフィス投資法人	1,840	1,080,080,000	
阪急リート投資法人	499	333,332,000	
スターツプロシード投資法人	725	128,905,000	
トップリート投資法人	734	329,199,000	

大和ハウス・レジデンシャル投資法人	1,560	755,040,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,645	833,782,000	
日本賃貸住宅投資法人	6,154	463,396,200	
ジャパンエクセレント投資法人	5,059	725,966,500	
合計	173,714	38,801,273,600	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	平成26年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	203,422,120
コール・ローン	131,049,776
投資証券	38,075,757,204
派生商品評価勘定	23,050,988
未収入金	5,034,463,746
未収配当金	91,745,092
未収利息	142
流動資産合計	43,559,489,068
資産合計	43,559,489,068
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,666,535
未払解約金	4,921,506,371
流動負債合計	4,923,172,906
負債合計	4,923,172,906
純資産の部	
元本等	
元本	25,420,341,407
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	13,215,974,755
元本等合計	38,636,316,162
純資産合計	38,636,316,162
負債純資産合計	43,559,489,068

### 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11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、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</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>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成26年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,420,341,407口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 1.5199円 (1万口当たり純資産額) (15,199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26年11月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	平成26年11月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成26年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成25年11月12日
期首元本額	20,717,981,137円
期中追加設定元本額	15,179,926,145円
期中一部解約元本額	10,477,565,875円
期末元本額	25,420,341,407円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	416,710,070円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	938,745,673円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,659,348円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	6,917,725,545円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	13,010,993,433円
コア投資戦略ファンド（安定型）	917,093,856円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,437,690,432円
分散投資コア戦略ファンドA	180,457,688円
分散投資コア戦略ファンドS	360,532,800円
コア投資戦略ファンド（切替型）	206,358,081円

区分	平成26年11月10日現在
グローバルREITインデックス・オープン	25,374,481円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成26年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		4,002,300,595
合計		4,002,300,595

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（平成26年11月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	30,261,725	-	30,258,100	3,625
	カナダドル	3,026,925	-	3,026,400	525
	ユーロ	9,977,800	-	9,968,700	9,100
	イギリスポンド	5,446,800	-	5,445,000	1,800
	香港ドル	2,945,200	-	2,950,000	4,800
	シンガポールドル	8,865,000	-	8,868,000	3,000
	売建	4,818,506,478	-	4,797,118,400	21,388,078
	アメリカドル	3,371,193,540	-	3,350,455,000	20,738,540
	カナダドル	118,797,680	-	119,038,400	240,720
	ユーロ	327,526,440	-	327,543,000	16,560
	イギリスポンド	309,925,300	-	308,550,000	1,375,300
	オーストラリアドル	413,922,600	-	415,254,000	1,331,400
	ニュージーランドドル	23,029,370	-	23,095,800	66,430
	香港ドル	86,070,260	-	85,550,000	520,260
	シンガポールドル	166,228,040	-	165,831,600	396,440
	イスラエルシェケル	1,813,248	-	1,800,600	12,648
	合計	4,848,768,203	-	4,827,376,500	21,384,453

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	21,840	695,167.20	
		AGREE REALTY CORP	4,930	150,858.00	
		ALEXANDER'S INC	1,150	490,475.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,990	2,058,676.20	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,610	483,971.80	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	36,550	1,442,263.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	48,080	822,168.00	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PRO	316,340	2,780,628.60	
		AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES	11,190	200,301.00	
		AMREIT INC	6,290	166,685.00	
		APARTMENT INVEST & MGMT	50,900	1,830,364.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	8,370	78,678.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME IN	8,000	140,000.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	27,030	306,249.90	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	20,060	385,954.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,710	7,190,183.00	
		AVIV REIT INC	8,540	283,271.80	
		BIOMED REALTY TRUST INC	67,980	1,457,491.20	
		BOSTON PROPERTIES	53,340	6,817,918.80	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	61,330	946,935.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	25,600	614,656.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	29,810	2,252,145.50	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	22,530	161,314.80	
		CARETRUST REIT INC	6,930	110,117.70	
		CBL & ASSOCIATES PRYS	59,310	1,125,703.80	
		CEDAR REALTY TRUST INC	23,950	163,339.00	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	82,520	668,412.00			

CHATHAM LODGING TRUST	11,510	294,656.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	18,890	627,525.80	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	43,530	1,095,650.10	
CORESITE REALTY CORP	7,520	284,256.00	
CORPORATE OFFICE PPTYS	32,210	898,336.90	
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	40,560	1,472,328.00	
COUSINS PROPERTIES INC	71,630	920,445.50	
CUBESMART	56,110	1,176,626.70	
CYRUSONE INC	12,240	330,235.20	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	116,150	986,113.50	
DDR CORPORATION	103,960	1,908,705.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	68,160	961,056.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	47,210	3,199,421.70	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	47,270	1,342,468.00	
DUKE REALTY CORP	118,860	2,309,449.80	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY INC	22,700	694,393.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	11,010	754,625.40	
EDUCATION REALTY TRUST INC	48,590	558,785.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,220	542,387.00	
EPR PROPERTIES	19,740	1,117,481.40	
EQUITY COMMONWEALTH	44,890	1,177,015.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,760	1,352,189.60	
EQUITY ONE INC	26,730	638,312.40	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	126,050	8,734,004.50	
ESSEX PROPERTY TRUST	22,120	4,435,944.80	
EXCEL TRUST INC	21,260	273,191.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,400	2,235,648.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,590	3,135,111.00	
FELCOR LODGING TRUST INC	38,510	415,137.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	38,490	758,253.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	20,460	251,044.20	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	31,030	373,911.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,300	1,000,661.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	218,660	5,586,763.00	
GEO GROUP INC/THE	25,300	1,047,420.00	
GETTY REALTY CORP	9,060	168,878.40	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,150	110,761.50	
GLIMCHER REALTY TRUST	50,616	699,513.12	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	24,470	567,214.60	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	35,590	212,828.20	
HCP INC	159,880	6,905,217.20	

HEALTH CARE REIT INC	112,910	7,973,704.20
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	33,940	893,300.80
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	83,240	1,033,008.40
HERSHA HOSPITALITY TRUST	69,888	512,977.92
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,470	1,335,901.50
HOME PROPERTIES INC	19,900	1,259,073.00
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	52,180	1,564,356.40
HOST HOTELS AND RESORTS INC	263,750	5,976,575.00
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	19,140	531,709.20
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	8,500	82,790.00
INLAND REAL ESTATE CORP	30,640	322,945.60
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	39,890	330,688.10
IRON MOUNTAIN INC	64,390	2,450,039.50
KILROY REALTY CORPORATION	28,980	1,964,554.20
KIMCO REALTY CORP	143,210	3,550,175.90
KITE REALTY GROUP TRUST	28,960	774,969.60
LASALLE HOTEL PROPERTIES	36,250	1,409,762.50
LEXINGTON CORP PROPERTIES	72,500	796,775.00
LIBERTY PROPERTY TRUST	51,590	1,821,127.00
LTC PROPERTIES INC	12,130	506,791.40
MACERICH CO/THE	49,020	3,356,889.60
MACK-CALI REALTY CORP	29,120	577,740.80
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	60,360	818,481.60
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,190	1,852,156.80
MONMOUTH REIT -CL A	19,640	226,056.40
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	43,570	1,673,523.70
NATL HEALTH INVESTORS INC	10,240	677,990.40
NEW YORK REIT INC	56,480	623,539.20
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	44,320	1,672,193.60
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,700	105,468.00
PARKWAY PROPERTIES INC	28,890	573,755.40
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,590	983,231.20
PENN REAL ESTATE INVEST TST	23,930	514,016.40
PHYSICIANS REALTY TRUST	15,230	235,608.10
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	53,750	1,044,900.00
POST PROPERTIES	18,950	1,048,314.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,500	64,950.00
PROLOGIS INC	174,220	7,214,450.20
PS BUSINESS PARKS INC	6,740	559,150.40
PUBLIC STORAGE	50,530	9,413,233.70
QTS REALTY TRUST INC	4,130	135,711.80

RAMCO-GERSHENSON PRYS	26,570	466,037.80
REALTY INCOME CORP	77,570	3,635,705.90
REGENCY CENTERS CORP	32,170	1,979,741.80
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	31,710	514,336.20
RETAIL PROPRTISE OF AME-A	82,420	1,279,982.60
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	14,020	213,384.40
RLJ LODGING TRUST	46,010	1,460,357.40
ROUSE PROPERTIES INC	12,050	216,900.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,770	875,350.20
SABRA HEALTH CARE REIT INC	18,540	524,125.80
SAUL CENTERS INC	3,900	213,525.00
SELECT INCOME REIT	12,920	310,984.40
SENIOR HOUSING PROP TRUST	70,990	1,581,657.20
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	13,380	220,770.00
SIMON PROPERTY GROUP	108,290	19,431,557.60
SL GREEN REALTY CORP	33,310	3,799,338.60
SOVRAN SELF STORAGE INC	11,590	978,080.10
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	138,940	1,628,376.80
STAG INDUSTRIAL INC	22,140	545,751.00
STARWOOD WAYPOINT RESIDE	13,610	349,777.00
STRATEGIC HOTEL CAPITAL INC	86,170	1,078,848.40
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,900	348,933.00
SUN COMMUNITIES INC	15,420	885,879.00
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	71,560	1,099,161.60
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	33,400	1,193,048.00
TAUBMAN CENTERS INC	22,050	1,685,722.50
TERRENO REALTY CORP	11,510	244,817.70
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	4,930	37,172.20
UDR INC	87,690	2,646,484.20
UMH PROPERTIES INC	7,500	74,625.00
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,490	217,944.60
URSTADT BIDDLE - CL A	9,570	209,391.60
VENTAS INC	102,560	7,000,745.60
VORNADO REALTY TRUST	60,810	6,630,114.30
WASHINGTON PRIME GROUP	54,045	960,920.10
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	23,200	642,176.00
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	39,180	1,433,988.00
WHITESTONE REIT	7,600	112,480.00
WINTHROP REALTY TRUST	11,390	193,060.50
WP CAREY INC	32,210	2,160,646.80

	アメリカドル 合計	6,495,909	232,922,381.54 (26,637,003,552)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	12,720	449,652.00
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	23,100	357,126.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,910	618,799.50
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	5,507	148,689.00
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	23,080	621,313.60
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19,020	466,941.00
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	11,820	568,660.20
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	30,160	343,824.00
	CHOICE PROPERTIES REIT	15,530	162,288.50
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	26,790	505,259.40
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,250	287,470.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,600	124,762.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18,854	167,423.52
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	12,150	110,443.50
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,370	510,134.90
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,010	330,973.20
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	46,490	1,023,244.90
	HEALTHLEASE PROPERTIES REAL	5,720	80,880.80
	INVEST REAL ESTATE INVESTME	16,090	82,541.70
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	64,020.00
	MILESTONE APARTMENTS REAL ESTATE	10,470	123,546.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	80,162.40
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	10,580	190,651.60
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTATE	5,403	151,500.12
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,890	77,243.10
	PLAZA RETAIL REIT	15,650	62,600.00
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	32,240	143,145.60	
RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,650	53,509.50	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	52,360	1,360,836.40	
	カナダドル 合計	501,304	9,267,642.44 (935,012,445)
ユーロ	AEDIFICA	3,150	169,155.00
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	26,070	258,171.21



	ALTAREA	1,000	133,500.00
	ANF IMMOBILIER	3,270	71,057.10
	AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA	12,510	118,094.40
	BEFIMMO S.C.A.	6,520	397,068.00
	BENI STABILI SPA	352,000	190,960.00
	COFINIMMO	6,030	551,684.70
	CORIO NV	35,110	1,349,452.85
	EUROCOMMERCIAL	14,890	505,515.50
	FONCIERE DES REGIONS	15,800	1,146,606.00
	GECINA SA	12,510	1,337,944.50
	GREEN REIT PLC	232,170	298,802.79
	HAMBORNER REIT AG	14,940	121,611.60
	HIBERNIA REIT PLC	233,290	256,619.00
	ICADE	11,320	701,840.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	107,540	66,190.87
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	70,000	73,500.00
	KLEPIERRE	34,740	1,184,460.30
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	13,910	130,754.00
	MERCIALYS	19,210	332,813.25
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	44,990	427,405.00
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	30,380	111,616.12
	UNIBAIL-RODAMCO SE	34,160	6,883,240.00
	VASTNED RETAIL	6,620	242,060.30
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,020	226,728.00
	WERELDHAVE NV	7,550	486,597.50
	ユーロ 合計	1,353,700	17,773,447.99 (2,531,116,728)
イギリスポ ンド	BIG YELLOW GROUP PLC	46,670	246,884.30
	BRITISH LAND CO PLC	356,530	2,593,755.75
	DERWENT LONDON PLC	35,520	1,039,670.40
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119,810	810,514.65
	HAMMERSON PLC	273,260	1,657,321.90
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	238,580	244,783.08
	INTU PROPERTIES PLC	328,950	1,124,022.15
	LAND SECURITIES GROUP PLC	271,830	3,001,003.20
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	205,550	302,158.50
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	39,967	95,920.80
	MUCKLOW A&J GROUP PLC	24,000	115,560.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	38,420	134,085.80
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	315,670	156,256.65
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	71,990	152,618.80
	SEGRO PLC	258,510	982,338.00

	SHAFTESBURY PLC	96,780	686,170.20
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	119,530	131,781.82
	WORKSPACE GROUP PLC	36,690	232,981.50
	イギリスポンド 合計	2,878,257	13,707,827.50 (2,488,107,769)
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	110,000	116,600.00
	360 CAPITAL OFFICE FUND	22,000	44,220.00
	ABACUS PROPERTY GROUP	87,730	244,766.70
	ALE PROPERTY GROUP	64,594	202,825.16
	ARENA REIT	73,057	110,316.07
	ASPEN GROUP	70,000	92,400.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	21,820	98,626.40
	AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	32,000	67,840.00
	BWP TRUST	168,270	429,088.50
	CHARTER HALL GROUP	95,560	435,753.60
	CHARTER HALL RETAIL REIT	106,460	434,356.80
	CROMWELL PROPERTY GROUP	446,650	435,483.75
	DEXUS PROPERTY GROUP	349,161	2,548,875.30
	FEDERATION CENTRES	497,240	1,362,437.60
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	73,734	138,619.92
	GALILEO JAPAN TRUST	40,590	68,191.20
	GDI PROPERTY GROUP	216,488	194,839.20
	GOODMAN GROUP	535,810	3,027,326.50
	GPT GROUP	590,520	2,462,468.40
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	65,194	183,195.14
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	53,167	128,132.47
	INDUSTRIA REIT	36,000	72,000.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	270,000	122,850.00
	INVESTA OFFICE FUND	213,850	765,583.00
	MIRVAC GROUP	1,272,380	2,252,112.60
	NATIONAL STORAGE REIT	113,217	158,503.80
NOVION PROPERTY GROUP	828,900	1,740,690.00	
SCENTRE GROUP	1,855,270	6,604,761.20	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	223,790	400,584.10	
STOCKLAND	803,390	3,374,238.00	
WESTFIELD CORP	666,100	5,355,444.00	
	オーストラリアドル 合計	10,002,942	33,673,129.41 (3,329,935,767)
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	103,280	183,322.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	348,210	386,513.10
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	367,000	445,905.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	147,000	216,825.00

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	92,460	141,463.80	
ニュージーランドドル 合計		1,057,950	1,374,028.90	(122,082,467)
香港ドル	CHAMPION REIT	899,000	3,029,630.00	
	FORTUNE REIT	468,000	3,393,000.00	
	LINK REIT	805,000	37,070,250.00	
	NEW CENTURY REIT	125,000	417,500.00	
	PROSPERITY REIT	432,000	1,127,520.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	287,000	568,260.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT	233,000	838,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	322,000	1,091,580.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	369,000	1,416,960.00	
香港ドル 合計		3,940,000	48,953,500.00	(722,064,125)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	179,000	261,340.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	285,000	205,200.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	711,266	1,600,348.50	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	319,000	397,155.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	252,000	296,100.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	401,000	274,685.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	726,000	1,190,640.00	
	CAPITAMALL TRUST	903,500	1,752,790.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	218,560	349,696.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	231,000	385,770.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	289,000	239,870.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	228,000	279,300.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	197,000	376,270.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	160,600	229,658.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	180,000	158,400.00	
	KEPPEL REIT	564,000	676,800.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	534,000	197,580.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	466,000	654,730.00	
	MAPLETREE GREATER CHINA COM	621,000	589,950.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	409,160	605,556.80	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	513,920	598,716.80	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	140,000	112,000.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	252,000	226,800.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	122,000	286,700.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	207,000	201,825.00	
			132,000	104,280.00

	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT			
	SPH REIT	330,000	351,450.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	479,000	387,990.00	
	SUNTEC REIT	870,000	1,613,850.00	
	シンガポールドル 合計	10,921,006	14,605,451.10 (1,295,357,458)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	52,370	502,228.30	
	イスラエルシェケル 合計	52,370	502,228.30 (15,076,893)	
	合計	37,203,438	38,075,757,204 (38,075,757,204)	

(注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。

(注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。

(注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。

(注4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 149銘柄	100.0%	70.0%
カナダドル	投資証券 29銘柄	100.0%	2.5%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	6.6%
イギリスポンド	投資証券 18銘柄	100.0%	6.5%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	8.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 9銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	3.4%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(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8期中間計算期間(平成26年11月11日から平成27年 5月10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）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （平成26年11月10日現在）	第8期中間計算期間 （平成27年 5月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	334,955,680	319,215,607
親投資信託受益証券	12,292,937,700	16,569,476,324
未収入金	8,700,000	77,002,860
未収利息	363	1,246
流動資産合計	12,636,593,743	16,965,696,037
資産合計	12,636,593,743	16,965,696,037
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	19,186,125	-
未払解約金	49,584,655	58,003,822
未払受託者報酬	2,260,366	3,189,202
未払委託者報酬	36,165,870	51,027,196
その他未払費用	497,051	398,586
流動負債合計	107,694,067	112,618,806
負債合計	107,694,067	112,618,806
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,593,062,711	12,000,837,629
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,935,836,965	4,852,239,602
（分配準備積立金）	2,714,479,589	2,415,897,285
元本等合計	12,528,899,676	16,853,077,231
純資産合計	12,528,899,676	16,853,077,231
負債純資産合計	12,636,593,743	16,965,696,037

## （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	第8期中間計算期間 自 平成26年11月11日 至 平成27年 5月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	71,379	75,114
有価証券売買等損益	460,746,540	1,047,398,624
営業収益合計	460,817,919	1,047,473,738
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,716,986	3,189,202
委託者報酬	27,471,697	51,027,196
その他費用	214,568	398,586
営業費用合計	29,403,251	54,614,984
営業利益又は営業損失（ ）	431,414,668	992,858,754
経常利益又は経常損失（ ）	431,414,668	992,858,754
中間純利益又は中間純損失（ ）	431,414,668	992,858,754
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	76,488,711
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	717,126,334	2,935,836,965
剰余金増加額又は欠損金減少額	310,486,915	1,389,966,974
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	1,389,966,974
剰余金減少額又は欠損金増加額	126,785,156	389,934,380
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	389,934,380
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,287,795,839	4,852,239,602

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第7期 (平成26年11月10日現在)	第8期中間計算期間 (平成27年 5月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,593,062,711口	12,000,837,629口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3060円 (13,060円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4043円 (14,043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

	第8期中間計算期間 (平成27年 5月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	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)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



	第8期中間計算期間 (平成27年 5月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第7期 自 平成25年11月12日 至 平成26年11月10日	第8期中間計算期間 自 平成26年11月11日 至 平成27年 5月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,823,339,843円	9,593,062,711円
期中追加設定元本額	4,666,930,535円	3,652,276,057円
期中一部解約元本額	1,897,207,667円	1,244,501,139円

## (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27年 5月10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

貸借対照表

	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,794,130,293
国債証券	252,358,767,850
地方債証券	19,107,872,905
特殊債券	25,842,196,856
社債券	16,359,786,740
未収利息	780,657,002
前払金	3,960,000
前払費用	23,251,081
差入委託証拠金	2,170,000
流動資産合計	316,272,792,727
資産合計	316,272,792,727
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,961,944
未払金	980,648
未払解約金	612,345,903
流動負債合計	617,288,495
負債合計	617,288,495
純資産の部	
元本等	
元本	239,120,131,090
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	76,535,373,142
元本等合計	315,655,504,232
純資産合計	315,655,504,232
負債純資産合計	316,272,792,727

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 5月10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、社債券</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>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	平成27年 5月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	平成27年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	239,120,131,090口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 105,957,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3201円 (1万口当たり純資産額) (13,201円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成27年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	218,705,326,767円
期中追加設定元本額	31,763,757,162円
期中一部解約元本額	11,348,952,839円
期末元本額	239,120,131,090円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,967,223,745円
S B I 資産設計オープン（分配型）	18,259,712円
S M T 国内債券インデックス・オープン	6,761,595,846円
世界経済インデックスファンド	358,495,750円
マイセレクション25	81,298,426円
マイセレクション50	87,726,655円
マイセレクション75	25,939,458円
D C マイセレクション25	13,586,949,968円
D C マイセレクション50	17,266,951,664円
D C マイセレクション75	4,898,352,375円
D C 日本債券インデックス・オープン	406,581,040円
D C 日本債券インデックス・オープンS	55,334,784,969円
D C 日本債券インデックス・オープンP	19,981,372,800円
D C マイセレクションS25	5,366,346,025円
D C マイセレクションS50	6,214,612,919円
D C マイセレクションS75	1,222,181,822円
D C ターゲット・イヤー ファンド2015	11,215,732円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	1,208,369,841円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	659,669,295円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	167,752,528円
D C 世界経済インデックスファンド	293,474,950円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,032,505,164円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	25,092,527円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	227,947,013円

区分	平成27年 5月10日現在
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	33,645,450円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	975,740円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	844,494,699円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,161,930,906円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	1,519,617,423円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	366,842,894円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	14,166,223,244円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,680,285,883円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,206,560,057円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,617,010,860円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,688,584,069円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,312,452,462円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,046,741,726円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,440,090,209円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,438,932,946円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	233,083,412円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,865,165,942円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,257,600,270円
コア投資戦略ファンド（安定型）	7,880,396,066円
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,203,960,340円
分散投資コア戦略ファンドA	1,152,131,680円
分散投資コア戦略ファンドS	548,058,759円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	5,544,259円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	89,596,306円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	30,420,078,390円
コア投資戦略ファンド（切替型）	646,486,548円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	29,423,743円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	23,873,881円
SMT インデックスバランス・オープン	33,324,401円
債券コア戦略ファンド	91,061円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成27年 5月10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	885,781,944	-	881,820,000	3,961,944
	合計	885,781,944	-	881,820,000	3,961,944

## (注)1.時価の算定方法

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

## 2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,418,514,280
株式	148,498,423,610
派生商品評価勘定	31,745,080
未収入金	1,103,460,770
未収配当金	1,274,312,499
未収利息	1,848
差入委託証拠金	115,200,000
流動資産合計	152,441,658,087
資産合計	152,441,658,087
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,054,160
前受金	10,719,000
未払解約金	493,494,382
流動負債合計	525,267,542
負債合計	525,267,542
純資産の部	
元本等	
元本	113,498,109,246
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	38,418,281,299
元本等合計	151,916,390,545
純資産合計	151,916,390,545
負債純資産合計	152,441,658,087

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 5月10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> <p>先物取引</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 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 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	平成27年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		113,498,109,246口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3385円 (13,385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27年 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	128,828,967,080円
期中追加設定元本額	7,407,311,112円
期中一部解約元本額	22,738,168,946円
期末元本額	113,498,109,246円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,228,301,538円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,723,018,187円
SBI資産設計オープン（分配型）	24,906,864円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,791,623,135円
世界経済インデックスファンド	544,944,614円
マイセクション25	26,698,132円
マイセクション50	79,984,599円
マイセクション75	78,460,909円
日本株式インデックス・オープン	10,534,999,220円
DCマイセクション25	4,859,537,866円
DCマイセクション50	15,131,409,921円
DCマイセクション75	14,732,835,264円
DC日本株式インデックス・オープン	4,153,366,671円
DCマイセクションS25	1,801,313,129円
DCマイセクションS50	5,463,699,020円
DCマイセクションS75	3,624,318,433円
DC日本株式インデックス・オープンS	2,390,792,878円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	3,906,956円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	438,558,972円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	477,114,900円



DCターゲット・イヤー ファンド2045	243,725,793円
DC世界経済インデックスファンド	459,763,982円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	308,782,254円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	76,020,188円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	197,379,468円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	97,139,120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)	1,093,031,554円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,951,623円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	434,829,213円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,436,636,869円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	1,533,475,441円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,269,618,829円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	6,233,352,847円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,353,502,062円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,795,408,138円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,305,733,784円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,183,954,199円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,532,980,148円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,857,063,978円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	849,122,859円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,153,452,600円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	87,299,932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)	2,137,039,928円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,028,655,550円
日本株式ファンド・シリーズ2	506,954,527円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,998,970円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	34,774,870円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	109,579,308円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,486,365円
SMT インデックスバランス・オープン	36,603,639円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(平成27年 5月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,769,184,080	-	2,779,875,000	10,690,920
合計		2,769,184,080	-	2,779,875,000	10,690,920

## (注)1. 時価の算定方法

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

## 2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	平成27年 5月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	19,694,196
コール・ローン	3,923,659,862
国債証券	198,513,879,759
派生商品評価勘定	10,659,070
未収入金	28,917,301,536
未収利息	1,972,423,261
前払金	9,581,955
前払費用	83,135,262
差入委託証拠金	46,518,646
流動資産合計	233,496,853,547
資産合計	233,496,853,547
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,037,227
未払金	4,223,320,184
未払解約金	446,496,890
流動負債合計	4,679,854,301
負債合計	4,679,854,301
純資産の部	
元本等	
元本	81,162,970,189
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	147,654,029,057
元本等合計	228,816,999,246
純資産合計	228,816,999,246
負債純資産合計	233,496,853,547

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

平成27年 5月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 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)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

		平成27年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		81,162,970,189口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8192円 (28,192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27年 5月10日現在

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

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	87,009,647,233円
期中追加設定元本額	13,651,062,550円
期中一部解約元本額	19,497,739,594円
期末元本額	81,162,970,189円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	3,387,673,560円
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	173,771,040円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,338,274,994円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	934,777,894円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,123,227,501円
SBI資産設計オープン（分配型）	10,522,704円

SMT グローバル債券インデックス・オープン	4,770,728,012円
世界経済インデックスファンド	1,233,307,604円
マイセレクション25	6,334,870円
マイセレクション50	4,987,353円
マイセレクション75	3,552,326円
DCマイセレクション25	1,068,578,113円
DCマイセレクション50	1,017,639,984円
DCマイセレクション75	668,782,735円
DC外国債券インデックス・オープン	1,351,046,223円
DCマイセレクションS25	404,313,846円
DCマイセレクションS50	364,631,473円
DCマイセレクションS75	168,786,655円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	441,255円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	47,575,532円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	34,773,738円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	13,370,799円
DC世界経済インデックスファンド	1,037,213,899円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	19,758,255,996円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	148,878,992円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	13,300,976円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,693,065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）	156,854,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	451,410,689円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	651,173,810円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	3,585,463,374円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	989,106,407円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,481,854,777円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	995,928,818円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,509,023,541円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,589,574,626円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,018,423,636円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,067,411,180円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,401,169,817円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	373,114,669円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	508,349,513円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	2,123,398,539円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,565,374,235円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	617,493,949円
外国債券ファンド・シリーズ1	151,308,240円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,864,210,842円
コア投資戦略ファンド（成長型）	7,259,094,681円
分散投資コア戦略ファンドA	417,929,425円
分散投資コア戦略ファンドS	652,699,615円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	14,786,304円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	240,624,452円
コア投資戦略ファンド（切替型）	785,984,874円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	82,583,632円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	65,581,649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）	366,796,374円
SMT インデックスバランス・オープン	86,803,210円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（平成27年 5月10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	881,201,191	-	871,619,236	9,581,955
	合計	881,201,191	-	871,619,236	9,581,955

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（平成27年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,086,224,740	-	1,094,415,500	8,190,760
	アメリカドル	483,696,670	-	485,271,000	1,574,330
	カナダドル	26,731,620	-	26,716,500	15,120
	ユーロ	494,962,490	-	501,270,000	6,307,510
	イギリスポンド	80,833,960	-	81,158,000	324,040

売建	24,789,748,816	-	24,787,735,778	2,013,038
アメリカドル	10,317,363,000	-	10,316,502,000	861,000
カナダドル	579,882,160	-	579,905,600	23,440
メキシコペソ	268,569,000	-	268,226,000	343,000
ユーロ	10,160,673,000	-	10,160,150,000	523,000
イギリスポンド	2,073,531,400	-	2,073,330,400	201,000
スイスフラン	81,260,575	-	81,258,183	2,392
スウェーデンク ローナ	125,321,617	-	125,287,614	34,003
ノルウェークロー ネ	71,101,500	-	71,057,200	44,300
デンマークロー ネ	175,314,569	-	175,280,358	34,211
ポーランドズロチ	146,599,200	-	146,608,000	8,800
オーストラリアド ル	431,234,640	-	431,148,000	86,640
シンガポールドル	91,746,960	-	91,749,000	2,040
マレーシアリン ギット	133,229,545	-	133,405,923	176,378
南アフリカランド	133,921,650	-	133,827,500	94,150
合計	25,875,973,556	-	25,882,151,278	10,203,798

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,207,179,910
コール・ローン	251,192,239
株式	241,678,949,609
投資信託受益証券	203,916,413

	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
投資証券	5,622,126,845
派生商品評価勘定	34,432,513
未収入金	20,642,862
未収配当金	444,788,495
未収利息	327
前払金	62,055,597
差入委託証拠金	877,560,256
流動資産合計	257,402,845,066
資産合計	257,402,845,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,292,052
未払株式払込金	4,931,921
未払解約金	419,955,930
流動負債合計	522,179,903
負債合計	522,179,903
純資産の部	
元本等	
元本	122,441,851,054
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	134,438,814,109
元本等合計	256,880,665,163
純資産合計	256,880,665,163
負債純資産合計	257,402,845,066

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成27年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>



平成27年 5月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

平成27年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	122,441,851,054口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.0980円
の額	(1万口当たり純資産額) (20,980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27年 5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	112,298,706,875円
期中追加設定元本額	20,100,373,397円
期中一部解約元本額	9,957,229,218円
期末元本額	122,441,851,054円

区分	平成27年 5月10日現在
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,702,909,108円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,543,318円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	23,084,543,637円
世界経済インデックスファンド	1,749,434,154円
マイセレクション25	4,278,649円
マイセレクション50	21,173,219円
マイセレクション75	24,373,242円
外国株式インデックス・オープン	1,015,170,031円
D C マイセレクション25	839,634,112円
D C マイセレクション50	4,135,575,114円
D C マイセレクション75	4,559,657,285円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,195,389,788円
D C マイセレクションS25	288,242,101円
D C マイセレクションS50	1,476,630,759円
D C マイセレクションS75	1,157,361,737円
D C ターゲット・イヤール ファンド2015	1,192,955円
D C ターゲット・イヤール ファンド2025	133,210,151円
D C ターゲット・イヤール ファンド2035	144,874,528円
D C ターゲット・イヤール ファンド2045	74,020,614円
D C 世界経済インデックスファンド	1,469,658,499円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	29,503,441,890円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	54,150,592円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	31,444,547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）	172,412,641円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	273,199,893円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	911,323,409円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	994,311,080円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	823,036,890円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,683,385,487円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	771,311,198円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,040,872,092円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	4,185,592,416円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	2,277,321,692円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	769,371,627円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	720,235,304円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	231,473,357円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,693,475,113円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	4,080,083,900円
外国株式ファンド・シリーズ1	616,298,566円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,254,679,509円
コア投資戦略ファンド（成長型）	10,813,162,204円

区分	平成27年 5月10日現在
分散投資コア戦略ファンドA	625,053,173円
分散投資コア戦略ファンドS	969,420,443円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	65,852,615円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	115,724,543円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,156,679,744円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	361,270,495円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	31,841,807円
SMT インデックスバランス・オープン	122,551,826円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（平成27年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,305,093,123	-	9,243,037,526	62,055,597
合計		9,305,093,123	-	9,243,037,526	62,055,597

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（平成27年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	27,560,900	-	27,558,600	2,300
	アメリカドル	27,560,900	-	27,558,600	2,300
	売建	166,522,358	-	167,324,000	801,642
	アメリカドル	93,066,168	-	93,459,600	393,432
	ユーロ	13,512,130	-	13,475,000	37,130
	イギリスポンド	32,721,588	-	33,204,600	483,012
	スイスフラン	18,226,572	-	18,188,800	37,772
	シンガポールドル	8,995,900	-	8,996,000	100
	合計	194,083,258	-	194,882,600	803,942

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	591,320,029
投資証券	53,400,022,100
派生商品評価勘定	4,374,000
未収入金	117,016,800
未収配当金	375,300,067
未収利息	770
前払金	228,600
差入委託証拠金	20,020,000
流動資産合計	54,508,282,366
資産合計	54,508,282,366
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,602,600
未払金	572,332,977
流動負債合計	576,935,577
負債合計	576,935,577
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	35,347,103,082
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,584,243,707
元本等合計	53,931,346,789
純資産合計	53,931,346,789
負債純資産合計	54,508,282,366

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 5月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

平成27年 5月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、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)、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>先物取引 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。</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 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

平成27年 5月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,347,103,082口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5258円 (1万口当たり純資産額) (15,258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27年 5月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

	平成27年 5月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(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> <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>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成26年11月11日
期首元本額	28,149,357,979円
期中追加設定元本額	10,597,649,473円
期中一部解約元本額	3,399,904,370円
期末元本額	35,347,103,082円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,153,687,861円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,636,050円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	8,172,902,539円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	16,514,191,746円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,899,185,027円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,869,598,238円
分散投資コア戦略ファンドA	277,204,391円
分散投資コア戦略ファンドS	524,422,730円
コア投資戦略ファンド（切替型）	623,902,336円

区分	平成27年 5月10日現在
J - R E I Tインデックス・オープン	287,883,032円
S M T インデックスバランス・オープン	14,489,132円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 投資証券関連

（平成27年 5月10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	不動産投信指数先物 取引 買建	524,752,600	-	524,524,000	228,600
合計		524,752,600	-	524,524,000	228,600

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	平成27年 5月10日現在 金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	201,078,686
コール・ローン	93,572,588
投資証券	49,381,204,836
派生商品評価勘定	201,930
未収入金	1,201,432
未収配当金	104,037,292
未収利息	121
流動資産合計	49,781,296,885
資産合計	49,781,296,885
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,555
未払株式払込金	32,956,818
未払解約金	40,439,255
流動負債合計	73,404,628
負債合計	73,404,628
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	30,345,964,285
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	19,361,927,972
元本等合計	49,707,892,257



	平成27年 5月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	49,707,892,257
負債純資産合計	49,781,296,885

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成27年 5月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、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</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>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成27年 5月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	30,345,964,285口

		平成27年 5月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6380円 (16,380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27年 5月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。		

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	平成27年 5月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	平成26年11月11日

区分	平成27年 5月10日現在
期首元本額	25,420,341,407円
期中追加設定元本額	6,928,008,130円
期中一部解約元本額	2,002,385,252円
期末元本額	30,345,964,285円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	300,680,581円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,116,105,739円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,144,897円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	8,144,008,615円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	15,014,859,015円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,163,434,749円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,586,245,921円
分散投資コア戦略ファンドA	170,465,457円
分散投資コア戦略ファンドS	320,775,741円
コア投資戦略ファンド（切替型）	394,656,358円
グローバルR E I Tインデックス・オープン	45,921,023円
S M T インデックスバランス・オープン	73,354,408円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	6,311,781円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（平成27年 5月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	103,265,475	-	103,458,850	193,375
	アメリカドル	47,726,240	-	47,928,000	201,760
	イギリスポンド	10,145,630	-	10,145,300	330
	オーストラリアドル	26,006,475	-	26,001,250	5,225
	ニュージーランドドル	4,013,550	-	4,013,550	-
	香港ドル	7,728,000	-	7,725,000	3,000
	シンガポールドル	7,645,580	-	7,645,750	170
合計		103,265,475	-	103,458,850	193,375

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【SBI資産設計オープン（資産成長型）】

## 【純資産額計算書】

（平成27年 5月29日現在）

資産総額	17,801,399,382円
負債総額	49,791,409円
純資産総額（ - ）	17,751,607,973円
発行済口数	12,250,228,919口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4491円
（1万口当たり純資産額）	（14,491円）

（参考）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年 5月29日現在）

資産総額	330,014,468,632円
負債総額	10,035,531,942円
純資産総額（ - ）	319,978,936,690円
発行済口数	242,124,189,619口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3215円
（1万口当たり純資産額）	（13,215円）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年 5月29日現在）

資産総額	157,829,520,357円
負債総額	390,850,010円
純資産総額（ - ）	157,438,670,347円
発行済口数	111,550,527,745口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4114円
（1万口当たり純資産額）	（14,114円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成27年 5月29日現在)

資産総額	223,445,616,984円
負債総額	5,847,469,053円
純資産総額( - )	217,598,147,931円
発行済口数	75,548,796,118口
1口当たり純資産額( / )	2.8802円
(1万口当たり純資産額)	(28,802円)

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成27年 5月29日現在)

資産総額	276,673,277,204円
負債総額	4,624,708,137円
純資産総額( - )	272,048,569,067円
発行済口数	123,812,745,547口
1口当たり純資産額( / )	2.1973円
(1万口当たり純資産額)	(21,973円)

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(平成27年 5月29日現在)

資産総額	57,095,854,308円
負債総額	697,476,675円
純資産総額( - )	56,398,377,633円
発行済口数	36,373,312,273口
1口当たり純資産額( / )	1.5505円
(1万口当たり純資産額)	(15,505円)

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（平成27年 5月29日現在）

資産総額	53,766,621,413円
負債総額	563,470,497円
純資産総額（ - ）	53,203,150,916円
発行済口数	31,194,713,751口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7055円
（1万口当たり純資産額）	（17,055円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

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

###### 受益権の譲渡

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

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

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

###### 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### 受益権の再分割

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

###### 償還金

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

則として取得申込者とします。)に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【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】

###### (1)資本金の額（平成27年 5月29日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

###### [ DO（実行） ]

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

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

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成27年 8月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年5月29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	423	6,957,295
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	17	92,311
単位型公社債投資信託	0	0
合計	440	7,049,606

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

す。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：千円 )

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

( 単位：千円 )

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

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：千円 )

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

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

(単位：千円)

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

営業外費用

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## 1有形固定資産の減価償却累計額

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

## (損益計算書関係)

## 1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

## 2外国税関連費用

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



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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

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

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1) 現金及び預金	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金及び預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成26年3月31日	平成27年3月31日
非上場株式	-	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日現在)

(単位:千円)

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

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

当事業年度（平成27年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
34,635	1,846	117

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

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

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

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

2. 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

### 3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

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

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

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

### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第9号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成27年法律第2号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については32.34%となります。

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

### (持分法損益等)

該当事項はありません。

### (セグメント情報等)

#### (セグメント情報)

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

### (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・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。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

## (報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

## (報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

重要性がないため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

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

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

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（平成26年3月31日）

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

当事業年度（平成27年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 4【利害関係人との取引制限】

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

### (1) 自己又はその役員との取引

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

### (2) 運用財産相互間の取引

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

### (3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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



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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成27年4月1日に取締役の役位としての会長を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成27年 8月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円(平成27年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (平成27年3月末日現在)	事業の内容
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27年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成27年 6月 5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成27年1月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 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11月10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26年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

平成27年7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

中島紀子

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26年11月11日から平成27年5月10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27年5月10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26年11月11日から平成27年5月10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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。