【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年4月9日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	世界経済インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。

②委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付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。

③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。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。

(5)【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜（※）3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料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「(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。

※「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。

(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。

(7)【申込期間】

平成25年4月10日から平成26年4月18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、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】
①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。
収益分配金の受取方法により、「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。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。
②受益権の取得申込みの受付の中止等
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、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並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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖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を取り消すことができます。
③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
④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。

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】

①ファンドの目的

国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

？ ＤＲ（預託証券）とは

ＤＲ（預託証券）とは、ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

②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。

③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）
単 位 型	国　内	株　式
追 加 型	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　）	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 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） エマージング	ファミリーファンド ファンド ・オブ・ ファンズ	あり （　） なし
不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型				

（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。
※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。

（用語の定義について）
当ファンドが該当する商品分類及び属性区分に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、これ以外の用語の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページhttp://www.toushin.or.jp/をご覧ください。

商品分類
「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
「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います。
「資産複合」…目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分
「その他資産（投資信託証券）」…目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
「資産複合（株式、債券）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（株式、債券）を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
当ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて複数資産（株式、債券）に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「資産複合」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産（投資信託証券）」となってい

ます。

「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います。

「グローバル（日本を含む）」…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（日本を含みます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「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きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。

「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います。

④ファンドの特色

1.世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

・世界の債券及び株式に分散投資を行うことで、リスクの低減に努めます。

・各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数（インデックス）への連動を目指す運用を行います。

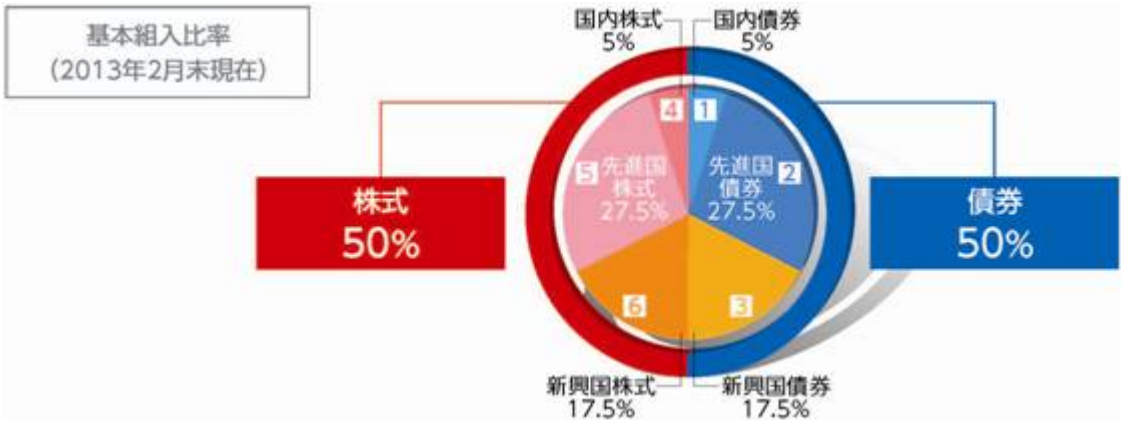
・原則として、為替ヘッジは行いません。

2.世界経済全体の発展を享受します。

・基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。

(出所)IMF World Economic Outlook Database(October 2012)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※上記のファンドの地域別構成比は、2013年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

・基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める

場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス
1 国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合)※1
2 先進国債券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)※2
3 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)※3
4 国内株式	東証株価指数(TOPIX)※4
5 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)※5
6 新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)※6

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

※1「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI 総合）」とは、野村證券株式会社（野村證券㈱）が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。
NOMURA-BPI 総合は、野村證券㈱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、野村證券㈱が有しています。なお、野村證券㈱は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、世界の新興国の債券動向を測るためにJPモルガン社が開発した債券指数で、新興国の現地通貨建て債券で構成されている時価総額を加重平均し、指数化したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン社に帰属します。
「円換算ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

※4「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下㈱東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所市場第一部に上場されている全ての銘柄の時価総額で加重平均し、指数化したものです。具体的には、1968年1月4日の東京証券取引所市場第一部上場全銘柄の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化しています。当該指数は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、下記の点をご認識ください。
①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利及びTOPIXの商標に関する全ての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
②㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
③㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
④㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。⑤当ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額と

TOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

⑥当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑦㈱東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

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

⑨前記の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

※6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、世界の新興国の株価動向を測るために、MSCI社が開発した株価指数で、各国の株式市場の時価総額等をベースに算出されます。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はMSCI社に帰属します。「円換算ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

3. 信託報酬を抑えたファンドです。

・運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して**年率0.525%（税抜0.5%）**です。

※ご換金時には信託財産留保額として換金申込受付日の翌営業日の基準価額の**0.1%**がかかります。なお、一部のマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額をファンドが負担します。詳しくは後記「4手数料等及び税金 (4)その他の手数料等」をご覧ください。

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。

+i ご参考情報

新興国は世界経済における存在感を増しています。

・世界人口が増加し人々が生活水準の向上を目指し生産と消費を拡大することで、世界経済は長期にわたり持続的な成長を実現しました。世界経済における新興国の人口やGDPの割合は年々増加しています。

(出所)国連World Population Prospects(The 2010 Revision)及びIMF World Economic Outlook Database(October 2012)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

(2)【ファンドの沿革】

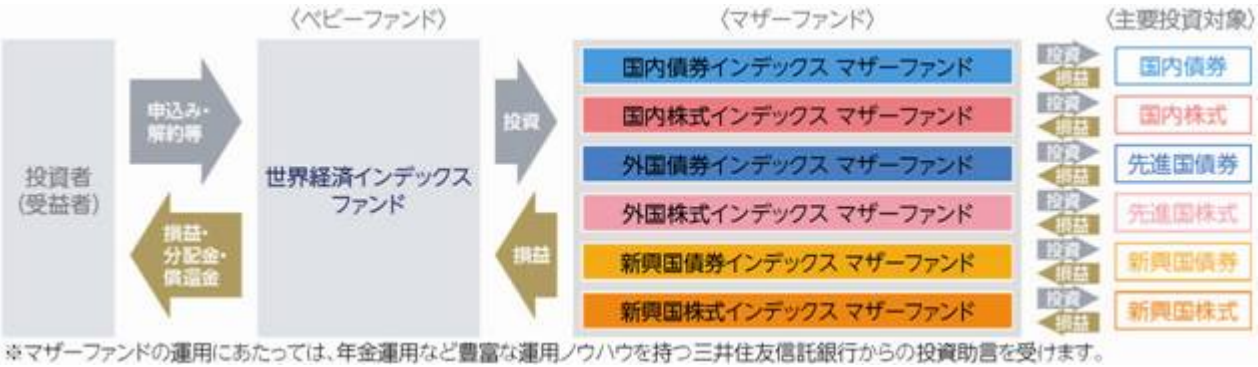
平成21年 1月16日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
平成24年 4月 1日	当ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

(3)【ファンドの仕組み】

①ファミリーファンド方式での運用

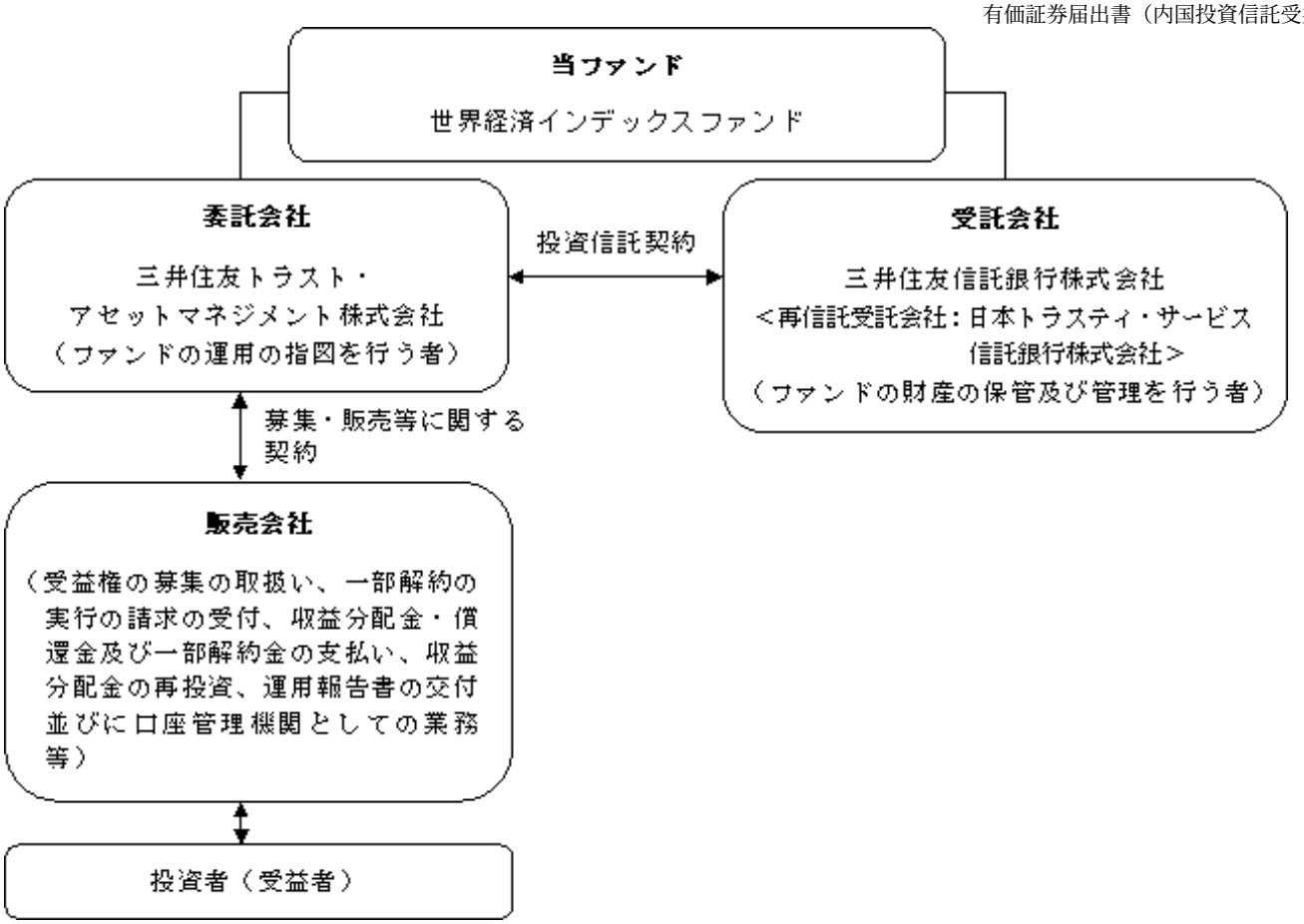
ファミリーファンド方式（※）で運用します。

※ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンド（世界経済インデックスファンド）とし、その資金をマザーファンド（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、新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



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

②当ファンドの関係法人



③委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年2月28日現在）

ロ．委託会社の沿革

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

ハ.大株主の状況（平成25年2月28日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、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」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「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、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。

②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。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）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指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、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。

ニ．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回見直しを行う場合があります。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、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。

ヘ．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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

ト．ただし、資金動向及び市況動向の急激な変化が生じたとき等並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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．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。）

1.有価証券

2.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記(5)①ヘ.、ト.及びチ.に定めるものに限ります。）

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる1.から6.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会社とし、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並びに7.から28.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きます。）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.新興国債券インデックス マザーファンド
6.新興国株式インデックス マザーファンド
7.株券又は新株引受権証書
8.国債証券
9.地方債証券
10.特別の法律により法人の発行する債券
11.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16.コマーシャル・ペーパー
17.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記7.から17.の証券又は証書の性質を有するもの
19.証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
23.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24.外国法人が発行する譲渡性預金証書
25.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。）
26.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
27.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28.外国の者に対する権利で上記27.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記7.の証券又は証書、上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記7.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記8.から12.までの証券及び上記18.並びに23.の証券又は証書のうち上記8.から12.までの証券の性質を有するもの、及び上記20.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記19.及び20.の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．当ファンドの設定、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、信託金を上記イ.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）「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並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及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並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号及び第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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

（参考）「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100％に近い状態を維持します。

③運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

（参考）「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並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及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並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑥投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（参考）「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100％に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及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、及び通貨に係る選択権取引並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、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一

定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5％以下とします。

（参考）「新興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、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）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

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入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。

③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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10％以下とします。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（参考）「新興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、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投

資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）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

取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

(2)投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④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、並びに価格変動リスク及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、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又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、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並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

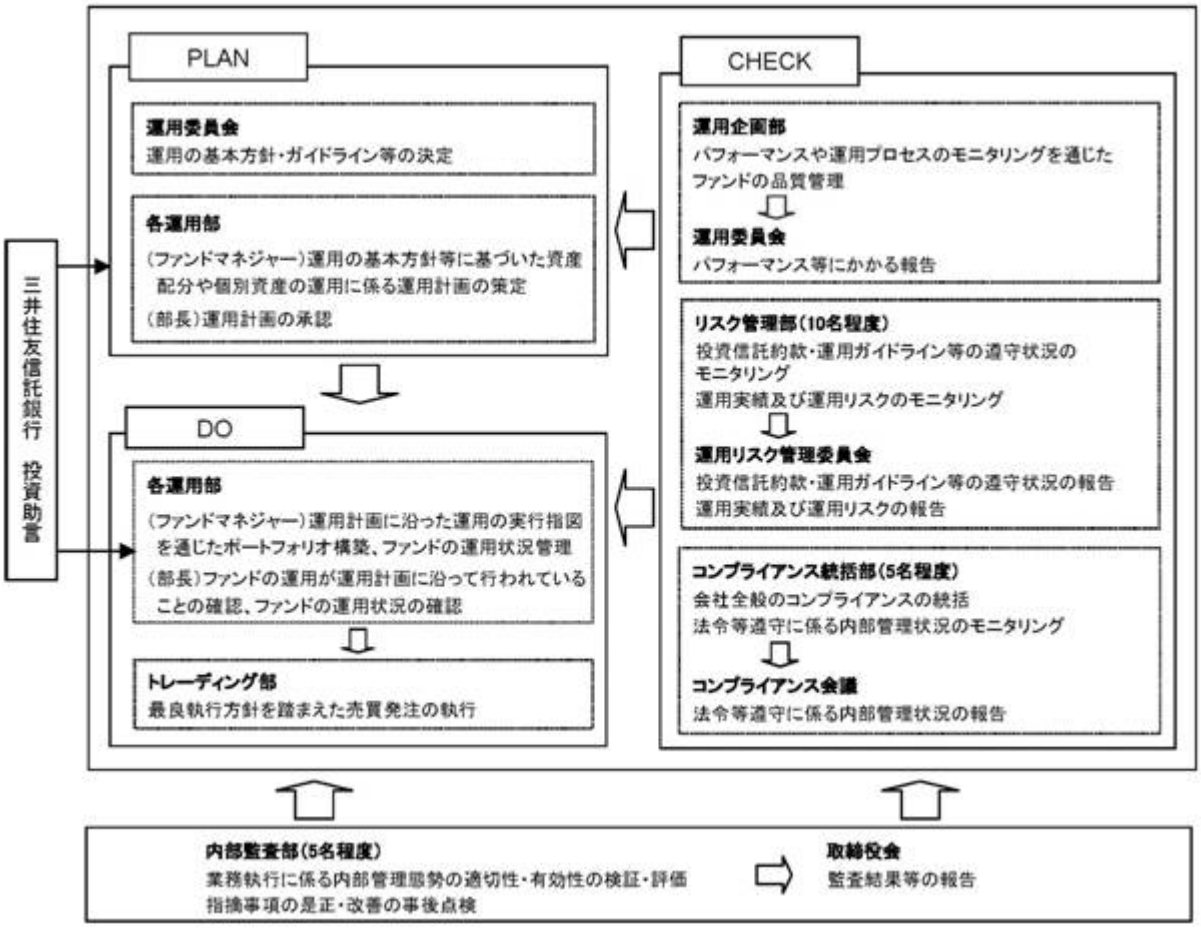
①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(3)【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年4月9日現在のものであり、今後変更されることがあります。



※三井住友信託銀行は各マザーファンド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】

①分配方針

年1回の毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として、以下の方針に基づき収益分配を行います。

イ．分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

ロ．分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

ハ．留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託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。

②収益の分配

イ．投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

（イ）投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とみなし配当等収益との合計額から諸経費（後記「4手数料等及び税金 (4)その他の手数料等 ①」の記載をご参照ください。）、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

（ロ）売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

ハ．毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(5)【投資制限】

①約款に定める投資制限

イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託

財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及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、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債

（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．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。

ヲ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ワ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並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、又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又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、解約代金及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。

②関連法令に基づく投資制限

イ．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。

ロ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

があります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②為替変動リスク

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

③金利変動リスク

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

④信用リスク

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

⑤カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

⑥流動性リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

また、分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益率を示すものではありません。

投資者の当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。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

③当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。

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

①運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。

②内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜 3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

②「分配金再投資コース」（※）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※収益分配金の受取方法により、「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。ただし、販売会社により取扱コースが異なる場合があります。

③上記①及び②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「第2 管理及び運営 1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①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 0.525%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.21%	（税抜 0.2%）
販売会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②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。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

①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。）。

②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。

③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、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用、組入資産の保管に要する費用（消費税等相当額を含みます。）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。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、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。

⑤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。

⑥ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%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。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

※「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、投資信託財産に繰入れられます。

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。

(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。

①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（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

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

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す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．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、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

②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、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

③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「④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。）

④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。

※上記は、平成25年2月28日現在のものですので、税法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】

(1)【投資状況】

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,927,505,786	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,526,452	0.83
合計(純資産総額)		2,952,032,238	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	674,705,341	1.1734	791,708,204	1.2175	821,453,752	27.83
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	375,492,578	2.1149	794,132,734	2.1493	807,046,197	27.34
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	321,055,528	1.5777	506,537,268	1.6158	518,761,522	17.57
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	250,282,268	2.0428	511,277,723	2.0371	509,850,008	17.27
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	195,528,848	0.7307	142,882,655	0.7842	153,333,722	5.19
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	92,574,603	1.2549	116,174,011	1.2645	117,060,585	3.97

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.17
合計	99.17

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成22年 1月20日)	473,632,486	473,632,486	13,329	13,329
第2期計算期間末 (平成23年 1月20日)	1,022,019,787	1,022,019,787	12,972	12,972
第3期計算期間末 (平成24年 1月20日)	1,737,011,301	1,737,011,301	12,000	12,000
第4期計算期間末 (平成25年 1月21日)	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
平成24年 2月末日	1,975,829,015	―	13,149	―
3月末日	2,013,662,586	―	13,259	―
4月末日	2,010,847,922	―	13,038	―
5月末日	1,890,941,115	―	11,914	―
6月末日	2,024,535,954	―	12,133	―
7月末日	2,129,513,160	―	12,333	―
8月末日	2,162,964,789	―	12,475	―
9月末日	2,235,590,205	―	12,753	―
10月末日	2,303,677,102	―	13,009	―
11月末日	2,378,082,002	―	13,531	―
12月末日	2,562,364,613	―	14,515	―
平成25年 1月末日	2,800,095,773	―	15,551	―
2月末日	2,952,032,238	―	15,660	―

②【分配の推移】

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成21年 1月16日～平成22年 1月20日)	0
第2期計算期間(平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	0
第3期計算期間(平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	0
第4期計算期間(平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	20

③【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成21年 1月16日～平成22年 1月20日)	33.3
第2期計算期間(平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	△2.7
第3期計算期間(平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	△7.5
第4期計算期間(平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	27.5

(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21年 1月16日～平成22年 1月20日)	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間 (平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間 (平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755
第4期計算期間 (平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112

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

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	181,638,662,800	76.82
	ポーランド	102,662,000	0.04
	小計	181,741,324,800	76.86
地方債証券	日本	15,442,293,419	6.53
特殊債券	日本	21,571,642,831	9.12
	アメリカ	209,096,000	0.09
	韓国	101,403,000	0.04
	スウェーデン	99,527,000	0.04
	小計	21,981,668,831	9.30
社債券	日本	14,679,848,450	6.21
	オーストラリア	408,384,000	0.17
	オランダ	405,560,000	0.17
	アメリカ	208,067,000	0.09
	イギリス	101,394,000	0.04
	スウェーデン	101,153,000	0.04
	韓国	100,070,000	0.04
	小計	16,004,476,450	6.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,284,464,342	0.54
合計(純資産総額)		236,454,227,842	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

ａ．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率(%)	償還期限	投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額			
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	3,670,000,000	100.36	3,683,505,600	101.48	3,724,499,500	0.8	2022/09/20	1.58

日本	国債証券	第１０５回利付国債（５年）	2,940,000,000	100.05	2,941,540,300	100.42	2,952,553,800	0.2	2017/06/20	1.25
日本	国債証券	第８７回利付国債（５年）	2,820,000,000	100.96	2,847,122,800	100.81	2,843,039,400	0.5	2014/12/20	1.20
日本	国債証券	第８８回利付国債（５年）	2,570,000,000	101.04	2,596,931,800	100.92	2,593,875,300	0.5	2015/03/20	1.10
日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	2,390,000,000	107.05	2,558,495,000	106.48	2,545,015,400	1.7	2017/03/20	1.08
日本	国債証券	第１０６回利付国債（５年）	2,440,000,000	100.11	2,442,737,400	100.40	2,449,930,800	0.2	2017/09/20	1.04
日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	2,230,000,000	106.97	2,385,557,000	107.42	2,395,622,100	1.5	2018/09/20	1.01
日本	国債証券	第９９回利付国債（５年）	2,300,000,000	100.95	2,322,062,400	101.13	2,326,036,000	0.4	2016/09/20	0.98
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	107.45	2,245,861,100	107.21	2,240,877,100	1.7	2017/09/20	0.95
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	2,010,000,000	105.76	2,125,933,500	106.76	2,146,036,800	1.3	2019/12/20	0.91
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	1,980,000,000	101.64	2,012,472,000	103.86	2,056,487,400	1.0	2021/12/20	0.87
日本	国債証券	第３２７回利付国債（１０年）	1,960,000,000	100.80	1,975,838,400	101.28	1,985,244,800	0.8	2022/12/20	0.84
日本	国債証券	第９６回利付国債（５年）	1,910,000,000	101.34	1,935,720,000	101.35	1,935,823,200	0.5	2016/03/20	0.82
日本	国債証券	第１０１回利付国債（５年）	1,820,000,000	100.90	1,836,434,600	101.17	1,841,348,600	0.4	2016/12/20	0.78
日本	国債証券	第８５回利付国債（５年）	1,780,000,000	101.30	1,803,260,000	101.01	1,798,031,400	0.7	2014/09/20	0.76
日本	国債証券	第２６４回利付国債（１０年）	1,750,000,000	103.22	1,806,350,000	102.25	1,789,375,000	1.5	2014/09/20	0.76
日本	国債証券	第２８０回利付国債（１０年）	1,680,000,000	106.81	1,794,522,000	106.05	1,781,673,600	1.9	2016/06/20	0.75
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	1,610,000,000	104.38	1,680,624,000	105.92	1,705,440,800	1.2	2020/12/20	0.72
日本	国債証券	第３２４回利付国債（１０年）	1,650,000,000	100.05	1,650,914,800	101.71	1,678,314,000	0.8	2022/06/20	0.71
日本	国債証券	第８４回利付国債（５年）	1,650,000,000	101.23	1,670,295,000	100.84	1,663,992,000	0.7	2014/06/20	0.70
日本	国債証券	第２７３回利付国債（１０年）	1,590,000,000	104.44	1,660,717,300	103.70	1,648,877,700	1.5	2015/09/20	0.70
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	1,530,000,000	106.60	1,631,067,000	106.63	1,631,484,900	1.5	2017/12/20	0.69
日本	国債証券	第１０７回利付国債（５年）	1,620,000,000	100.17	1,622,872,200	100.40	1,626,561,000	0.2	2017/12/20	0.69
日本	国債証券	第８９回利付国債（５年）	1,610,000,000	100.89	1,624,388,300	100.81	1,623,105,400	0.4	2015/06/20	0.69
日本	国債証券	第１０３回利付国債（５年）	1,600,000,000	100.39	1,606,356,000	100.82	1,613,200,000	0.3	2017/03/20	0.68
日本	国債証券	第９３回利付国債（５年）	1,590,000,000	101.31	1,610,904,400	101.27	1,610,208,900	0.5	2015/12/20	0.68
日本	国債証券	第２９９回利付国債（１０年）	1,480,000,000	105.99	1,568,761,900	106.60	1,577,680,000	1.3	2019/03/20	0.67
日本	国債証券	第３２２回利付国債（１０年）	1,490,000,000	101.24	1,508,602,000	102.83	1,532,286,200	0.9	2022/03/20	0.65
日本	国債証券	第３１８回利付国債（１０年）	1,450,000,000	101.86	1,476,970,000	104.01	1,508,188,500	1.0	2021/09/20	0.64
日本	国債証券	第２９８回利付国債（１０年）	1,410,000,000	105.81	1,491,921,000	106.48	1,501,452,600	1.3	2018/12/20	0.63

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	76.86
地方債証券	6.53
特殊債券	9.30
社債券	6.77
合計	99.46

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	137,268,819,620	98.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,933,954,309	1.39
合計(純資産総額)		139,202,773,929	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産
① 投資有価証券の主要銘柄
a．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,310,400	3,078.59	4,034,184,336	4,765.00	6,244,056,000	4.49
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	7,623,000	349.15	2,661,570,450	513.00	3,910,599,000	2.81
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	860,500	2,553.61	2,197,381,405	3,455.00	2,973,027,500	2.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	761,300	2,333.02	1,776,128,126	3,710.00	2,824,423,000	2.03
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,983,900	118.14	1,533,917,946	204.00	2,648,715,600	1.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	633,600	3,268.76	2,071,086,336	3,365.00	2,132,064,000	1.53
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	400,100	3,271.31	1,308,851,131	4,795.00	1,918,479,500	1.38
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	423,800	3,421.83	1,450,171,554	4,250.00	1,801,150,000	1.29
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	481,800	2,291.84	1,104,208,512	3,435.00	1,654,983,000	1.19
日本	株式	三菱地所	不動産業	705,000	1,254.36	884,323,800	2,310.00	1,628,550,000	1.17
日本	株式	ファナック	電気機器	106,200	13,846.88	1,470,538,656	14,310.00	1,519,722,000	1.09
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	506,700	2,237.70	1,133,842,590	2,925.00	1,482,097,500	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	785,500	1,557.23	1,223,204,165	1,839.00	1,444,534,500	1.04
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	188,100	4,651.17	874,885,077	6,840.00	1,286,604,000	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,449,000	459.81	1,126,074,690	520.00	1,273,480,000	0.91
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,288,600	756.48	974,800,128	937.00	1,207,418,200	0.87
日本	株式	三井物産	卸売業	869,000	1,125.77	978,294,130	1,374.00	1,194,006,000	0.86

日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	8,295	125,165.68	1,038,249,315	143,400.00	1,189,503,000	0.85
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	237,100	3,089.67	732,560,757	5,010.00	1,187,871,000	0.85
日本	株式	小松製作所	機械	498,200	1,947.06	970,025,292	2,338.00	1,164,791,600	0.84
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	421,100	2,373.35	999,417,685	2,706.00	1,139,496,600	0.82
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	4,515,000	174.84	789,402,600	251.00	1,133,265,000	0.81
日本	株式	三井不動産	不動産業	475,000	1,355.85	644,028,750	2,358.00	1,120,050,000	0.80
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	2,058,200	264.15	543,673,530	532.00	1,094,962,400	0.79
日本	株式	信越化学工業	化学	191,600	4,076.47	781,051,652	5,700.00	1,092,120,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	389,900	1,787.17	696,817,583	2,618.00	1,020,758,200	0.73
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	142,000	4,941.29	701,663,180	6,960.00	988,320,000	0.71
日本	株式	デンソー	輸送用機器	252,000	2,385.39	601,118,280	3,890.00	980,280,000	0.70
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	334,800	1,704.79	570,763,692	2,844.00	952,171,200	0.68
日本	株式	三菱重工業	機械	1,710,000	325.71	556,964,100	514.00	878,940,000	0.63

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.61
合計	98.61

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.57
		建設業	2.42
		食料品	3.86
		繊維製品	0.79
		パルプ・紙	0.29
		化学	5.62
		医薬品	5.10
		石油・石炭製品	0.78
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	1.75
		非鉄金属	1.06
		金属製品	0.66
		機械	5.06
		電気機器	11.49
		輸送用機器	11.45

		精密機器	1.27
		その他製品	1.31
		電気・ガス業	2.13
		陸運業	4.12
		海運業	0.35
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.26
		情報・通信業	5.94
		卸売業	5.05
		小売業	4.00
		銀行業	10.55
		証券、商品先物取引業	1.53
		保険業	2.34
		その他金融業	1.05
		不動産業	3.27
		サービス業	2.07
合計			98.61

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	149	1,413,306,775	1,446,790,000	1,446,790,000	1.04

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	93,602,150,780	40.88
	フランス	21,980,704,038	9.60
	イタリア	20,857,994,035	9.11
	ドイツ	19,937,617,423	8.71
	イギリス	16,919,498,853	7.39
	スペイン	10,474,465,214	4.58
	カナダ	6,261,242,184	2.73
	ベルギー	6,096,236,681	2.66

	オランダ	5,899,021,926	2.58
	オーストリア	3,950,656,154	1.73
	オーストラリア	3,460,507,710	1.51
	メキシコ	2,307,352,136	1.01
	デンマーク	1,819,262,195	0.79
	ポーランド	1,691,854,400	0.74
	アイルランド	1,685,262,032	0.74
	スウェーデン	1,422,789,340	0.62
	南アフリカ	1,410,847,797	0.62
	フィンランド	1,377,991,587	0.60
	マレーシア	1,245,065,228	0.54
	シンガポール	896,728,082	0.39
	スイス	880,870,422	0.38
	ノルウェー	696,693,318	0.30
	小計	224,874,811,535	98.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,072,319,347	1.78
合計(純資産総額)		228,947,130,882	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率	償還期限	投資比率
				単価	金額	単価	金額	(%)		(%)
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	9,711.74	3,632,193,024	9,568.09	3,578,469,276	2.625	2014/07/31	1.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	29,100,000	9,522.14	2,770,944,721	9,514.79	2,768,806,244	1.375	2015/11/30	1.21
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	22,900,000	9,318.21	2,133,871,868	9,365.55	2,144,711,722	0.875	2017/02/28	0.94
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/14	22,000,000	9,498.89	2,089,757,790	9,407.65	2,069,683,581	1.750	2014/03/31	0.90
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	9,769.70	2,022,328,546	9,683.91	2,004,571,012	2.500	2015/03/31	0.88
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	9,747.15	1,871,454,505	9,642.18	1,851,298,562	2.375	2015/02/28	0.81
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,322.88	1,808,638,772	9,295.99	1,803,422,099	0.750	2017/06/30	0.79
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	18,800,000	9,635.84	1,811,538,220	9,583.99	1,801,791,967	1.500	2016/07/31	0.79
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	14,500,000	10,853.27	1,573,724,614	10,755.55	1,559,555,083	3.625	2021/02/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	9,692.93	1,550,869,211	9,549.12	1,527,860,465	2.625	2014/06/30	0.67
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	9,625.66	1,443,849,825	9,575.32	1,436,299,052	1.750	2015/07/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	15,100,000	9,528.53	1,438,808,030	9,432.40	1,424,293,361	1.875	2014/04/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	10,092.26	1,412,917,441	10,019.26	1,402,697,336	2.750	2016/11/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	13,500,000	10,110.40	1,364,904,751	10,085.39	1,361,528,569	2.625	2020/08/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,522.36	1,346,862,248	10,419.48	1,333,693,537	3.125	2019/05/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,242.21	1,293,909,617	9,241.96	1,293,875,218	0.250	2015/07/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,365.81	1,295,727,438	10,145.02	1,268,127,808	4.250	2015/08/15	0.55

アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	9,655.26	1,264,840,199	9,595.92	1,257,066,176	1.875	2015/06/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	9,662.39	1,217,461,388	9,558.70	1,204,396,725	2.125	2014/11/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	9,672.35	1,209,044,412	9,550.93	1,193,866,851	2.375	2014/08/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	10,047.81	1,205,737,965	9,796.84	1,175,621,420	4.250	2014/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,500,000	10,098.39	1,161,315,034	10,068.23	1,157,846,663	2.625	2020/11/15	0.51
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000	12,173.51	1,119,963,426	12,555.37	1,155,094,486	4.250	2014/08/01	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	12,500,000	9,366.30	1,170,788,557	9,234.73	1,154,342,311	1.750	2022/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	11,500,000	9,398.66	1,080,845,948	9,423.73	1,083,729,359	1.000	2016/09/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,243.77	1,063,033,908	9,272.68	1,066,358,433	0.375	2015/04/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	10,918.55	1,070,018,441	10,751.57	1,053,654,568	4.500	2017/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.5% 03/31/19	11,000,000	9,524.54	1,047,699,610	9,505.58	1,045,614,147	1.500	2019/03/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,167.15	1,040,205,063	13,003.22	1,027,255,116	3.500	2015/04/25	0.45
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	9,768.13	1,006,117,482	9,692.22	998,299,618	2.000	2016/01/31	0.44

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.22
合計	98.22

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	15	1,857,974.07	1,858,828.20	171,960,196	0.08
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	8	1,051,063.28	1,051,500	97,274,265	0.04
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	862,867.77	861,937.50	79,737,838	0.03
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	10	1,104,925	1,107,050	134,672,632	0.06
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	9	1,138,016	1,147,860	139,637,169	0.06
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	14	2,005,286	2,031,260	247,102,779	0.11

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

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	77,611,456,202	52.31
	イギリス	13,893,469,618	9.36
	カナダ	7,270,934,503	4.90
	スイス	6,522,380,125	4.40
	フランス	5,697,205,982	3.84
	ドイツ	5,610,505,699	3.78
	オーストラリア	5,574,540,695	3.76
	スウェーデン	2,177,731,910	1.47
	オランダ	1,983,694,639	1.34
	スペイン	1,922,307,332	1.30
	香港	1,745,643,290	1.18
	イタリア	1,309,798,829	0.88
	アイルランド	1,080,248,827	0.73
	シンガポール	1,075,648,314	0.73
	デンマーク	794,605,209	0.54
	ベルギー	778,359,221	0.52
	バミューダ	616,125,924	0.42
	アンティル	595,504,317	0.40
	ジャージー	573,925,066	0.39
	フィンランド	545,895,869	0.37
	ノルウェー	494,860,172	0.33
	イスラエル	353,171,939	0.24
	ルクセンブルク	273,328,185	0.18
	オーストリア	196,500,774	0.13
	ケイマン	145,084,332	0.10
	ポルトガル	105,539,272	0.07
	ニュージーランド	94,752,172	0.06
	パナマ	94,554,290	0.06
	マン島	44,917,845	0.03
	ギリシャ	43,890,462	0.03
	ガーンジー	32,357,254	0.02
	リベリア	31,021,215	0.02
	モーリシャス	21,100,389	0.01
	小計	139,311,059,872	93.90
投資信託受益証券	オーストラリア	68,959,958	0.05
	シンガポール	24,947,634	0.02
	香港	13,986,254	0.01
	小計	107,893,846	0.07
投資証券	アメリカ	2,189,057,687	1.48

	オーストラリア	437,302,737	0.29
	フランス	186,948,802	0.13
	イギリス	164,700,315	0.11
	香港	72,007,094	0.05
	シンガポール	57,326,691	0.04
	カナダ	35,964,341	0.02
	オランダ	19,345,521	0.01
	小計	3,162,653,188	2.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,778,845,560	3.90
合計(純資産総額)		148,360,452,466	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

ａ．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	58,945	52,201.54	3,077,019,940	41,127.17	2,424,241,076	1.63
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	285,657	7,591.37	2,168,528,151	8,282.42	2,365,931,335	1.59
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	654,956	1,777.11	1,163,933,507	2,161.95	1,415,987,822	0.95
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	122,250	9,159.41	1,119,738,495	10,791.29	1,319,235,385	0.89
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	201,436	5,471.67	1,102,193,251	6,416.17	1,292,448,022	0.87
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	67,002	17,964.51	1,203,658,561	18,717.54	1,254,113,171	0.85
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	173,398	5,795.75	1,004,971,718	7,060.36	1,224,252,858	0.83
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,516	54,744.64	904,162,518	73,987.64	1,221,979,991	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	171,352	5,783.72	991,052,880	7,100.14	1,216,623,617	0.82
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	472,491	2,689.26	1,270,653,839	2,572.70	1,215,579,060	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	358,719	3,119.43	1,119,001,392	3,316.48	1,189,685,644	0.80
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,159,024	715.88	829,730,214	1,017.68	1,179,518,441	0.80
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	461,647	2,050.02	946,386,321	2,535.69	1,170,597,882	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	238,350	3,099.08	738,666,909	4,558.89	1,086,612,098	0.73
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	313,556	2,950.14	925,035,320	3,249.87	1,019,018,213	0.69
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	43,755	15,222.46	666,059,074	21,111.59	923,737,926	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	252,336	3,481.15	878,419,794	3,557.00	897,561,549	0.60
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	143,257	4,992.45	715,204,741	6,221.89	891,329,797	0.60

アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	104,534	7,902.20	826,049,013	8,458.18	884,168,360	0.60
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	240,124	2,426.53	582,669,842	3,208.24	770,377,054	0.52
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	179,001	3,840.09	687,379,967	4,287.83	767,527,379	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	190,183	3,485.77	662,935,489	3,975.15	756,006,846	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,185,348	561.47	665,549,195	627.38	743,668,030	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	183,378	2,443.18	448,027,130	3,900.22	715,214,836	0.48
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,063,071	241.43	739,536,835	231.75	709,869,368	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	233,656	2,827.05	660,557,615	3,027.07	707,295,182	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	674,679	661.44	446,264,063	1,045.36	705,284,463	0.48
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	199,860	3,037.41	607,058,201	3,480.41	695,595,422	0.47
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	104,542	6,059.40	633,462,317	6,629.26	693,036,788	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	96,829	6,348.03	614,673,997	6,982.65	676,123,481	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	93.90
投資信託受益証券	0.07
投資証券	2.13
合計	96.10

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.59
		素材	6.35
		資本財	7.22
		商業・専門サービス	0.93
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.38
		耐久消費財・アパレル	1.38
		消費者サービス	1.60
		メディア	2.63
		小売	2.88
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	6.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.88
		ヘルスケア機器・サービス	2.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.85

		銀行	7.68
		各種金融	4.93
		保険	4.30
		不動産	0.76
		ソフトウェア・サービス	5.97
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.89
		電気通信サービス	3.52
		公益事業	3.31
		半導体・半導体製造装置	1.39
合計			93.90

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	97	36,363,261.50	36,758,150	3,400,496,456	2.29
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	25	3,652,752.50	3,660,000	331,047,000	0.22
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	47	3,460,799	3,507,610	349,463,184	0.24
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	202	5,345,429	5,276,240	641,854,596	0.43
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	36	4,384,602	4,518,000	428,577,480	0.29
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	80	4,980,365	5,054,000	709,429,980	0.48

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

新興国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	1,900,880,605	9.93
	マレーシア	1,875,301,136	9.80
	ブラジル	1,865,884,371	9.75
	ポーランド	1,838,320,732	9.61
	インドネシア	1,814,896,980	9.48
	トルコ	1,813,888,331	9.48
	南アフリカ	1,811,698,069	9.47

	タイ	1,354,360,384	7.08
	ロシア	1,115,729,856	5.83
	ハンガリー	954,167,851	4.99
	コロンビア	695,359,126	3.63
	ペルー	375,896,816	1.96
	ナイジェリア	268,770,425	1.40
	フィリピン	115,524,385	0.60
	小計	17,800,679,067	93.02
特殊債券	ドイツ	382,468,996	2.00
	国際機関	330,780,939	1.73
	小計	713,249,935	3.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		622,008,419	3.25
合計(純資産総額)		19,135,937,421	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率	償還期限	投資比率
				単価	金額	単価	金額	(%)		(%)
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	22,950,000	5,876.80	1,348,725,924	5,524.22	1,267,809,683	12.500	2016/01/05	6.63
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	340,000,000	326.37	1,109,690,592	328.15	1,115,729,856	7.850	2018/03/10	5.83
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	6,870,000,000	6.30	433,241,409	6.14	422,223,879	12.000	2015/10/22	2.21
トルコ	国債証券	TURKGB 8% 06/04/14	7,750,000	5,255.22	407,279,849	5,303.10	410,990,991	8.000	2014/06/04	2.15
ドイツ	特殊債券	KFW 7% 06/14/16	121,000,000	313.79	379,691,804	316.09	382,468,996	7.000	2016/06/14	2.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000	1,308.02	345,319,856	1,339.50	353,629,700	10.500	2026/12/21	1.85
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	11,500,000	3,047.05	350,411,270	3,047.20	350,428,747	5.500	2015/04/25	1.83
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	29,700,000,000	1.16	345,508,416	1.16	347,311,800	8.250	2032/06/15	1.81
トルコ	国債証券	TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000	5,916.11	269,183,180	6,074.66	276,397,097	9.500	2022/01/12	1.44
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,034.62	268,564,666	3,042.27	269,241,591	4.750	2016/10/25	1.41
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	550,000,000	48.49	266,741,900	48.86	268,770,425	7.000	2019/10/23	1.40
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	8,600,000	3,039.33	261,382,406	3,036.19	261,112,498	3.741	2015/02/27	1.36

南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	22,500,000	1,095.99	246,598,631	1,105.15	248,660,532	7.250	2020/01/15	1.30
マレーシア	国債証券	MGS 5.094% 04/30/14	8,100,000	3,083.43	249,758,277	3,068.40	248,540,458	5.094	2014/04/30	1.30
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 05/15/27	22,900,000,000	1.04	240,447,187	1.05	240,450,000	7.000	2027/05/15	1.26
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	20,000,000	1,152.68	230,536,944	1,152.65	230,530,656	8.250	2017/09/15	1.20
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	7,650,000	3,009.07	230,194,052	3,005.22	229,899,684	3.314	2017/10/31	1.20
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	4,070,000	5,556.74	226,159,696	5,617.19	228,619,981	10.000	2015/06/17	1.19
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 01/27/16	3,950,000	5,502.89	217,364,185	5,576.44	220,269,547	9.000	2016/01/27	1.15
インドネシア	国債証券	INDOGB 7.375% 09/15/16	21,000,000,000	1.03	217,318,752	1.04	220,248,000	7.375	2016/09/15	1.15
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/14	4,600,000	4,803.11	220,943,268	4,754.68	218,715,658	10.000	2014/01/01	1.14
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	501,000,000	43.09	215,905,109	43.56	218,261,632	8.000	2015/02/12	1.14
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	6,350,000	3,332.36	211,605,468	3,339.53	212,060,218	5.750	2022/09/23	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	18,100,000	1,146.20	207,463,662	1,149.00	207,970,129	8.000	2018/12/21	1.09
南アフリカ	国債証券	SAGB 6.75% 03/31/21	19,100,000	1,057.23	201,931,480	1,072.07	204,766,859	6.750	2021/03/31	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 9.5% 12/18/14	25,200,000	794.12	200,118,386	792.31	199,662,835	9.500	2014/12/18	1.04
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	15,800,000	1,266.78	200,151,470	1,250.90	197,643,546	13.500	2015/09/15	1.03
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	62,900,000	313.32	197,084,192	312.45	196,537,245	3.250	2017/06/16	1.03
メキシコ	国債証券	MBONO 6.5% 06/10/21	23,500,000	788.61	185,324,383	801.32	188,312,493	6.500	2021/06/10	0.98
マレーシア	国債証券	MGS 3.58% 09/28/18	6,200,000	3,032.06	187,987,898	3,028.69	187,779,206	3.580	2018/09/28	0.98

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	93.02
特殊債券	3.73
合計	96.75

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年2月28日現在)

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	韓国	2,761,171,955	14.98
	ブラジル	2,249,451,408	12.20
	台湾	1,899,818,935	10.31
	中国	1,867,576,612	10.13
	南アフリカ	1,280,810,730	6.95
	インド	1,216,147,934	6.60
	ロシア	1,087,157,729	5.90
	メキシコ	948,778,245	5.15
	香港	779,473,335	4.23
	マレーシア	610,193,420	3.31
	ケイマン	580,942,838	3.15
	インドネシア	534,572,689	2.90
	タイ	488,426,425	2.65
	チリ	359,076,049	1.95
	トルコ	352,256,931	1.91
	ポーランド	267,838,904	1.45
	フィリピン	185,032,920	1.00
	コロンビア	184,856,785	1.00
	バミューダ	145,085,207	0.79
	チェコ	55,283,535	0.30
	エジプト	47,638,545	0.26
	ハンガリー	39,170,002	0.21
	ペルー	32,688,504	0.18
	アメリカ	22,515,287	0.12
	モロッコ	14,255,472	0.08
	ルクセンブルク	6,107,242	0.03
	小計	18,016,327,638	97.73
投資信託受益証券	南アフリカ	40,004,639	0.22
	ブラジル	30,347,899	0.16
	メキシコ	6,137,386	0.03
	小計	76,489,924	0.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		341,719,979	1.85
合計(純資産総額)		18,434,537,541	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

(平成25年2月28日現在)

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	5,552	115,955.37	643,784,259	131,016.59	727,404,163	3.95
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,242,389	286.00	355,331,239	326.03	405,068,509	2.20
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	303,000	1,028.87	311,750,512	1,013.45	307,076,410	1.67
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,623,620	68.63	248,721,653	73.72	267,160,081	1.45
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	274,050	844.77	231,511,130	827.03	226,650,147	1.23
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,266,515	60.50	197,632,734	64.42	210,435,429	1.14
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,966,340	113.69	223,566,313	97.21	191,150,664	1.04
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	114,900	1,408.58	161,846,259	1,622.08	186,377,911	1.01
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	146,151	1,024.78	149,773,644	1,258.13	183,877,834	1.00
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	102,415	1,694.40	173,532,282	1,659.05	169,912,629	0.92
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	212,540	958.64	203,750,892	786.70	167,206,918	0.91
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	51,400	3,176.01	163,246,974	3,151.90	162,007,968	0.88
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	26,964	5,526.21	149,008,882	5,966.89	160,891,356	0.87
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	898,000	190.29	170,888,671	178.71	160,482,837	0.87
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,788,200	37.75	143,010,665	42.35	160,435,952	0.87
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	97,000	1,519.98	147,438,779	1,638.00	158,886,000	0.86
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	85,719	1,763.45	151,161,506	1,840.18	157,738,663	0.86
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	37,200	3,798.23	141,294,473	4,042.58	150,384,124	0.82
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	7,842	18,478.10	144,905,319	18,447.00	144,661,374	0.78
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,068,000	122.46	130,791,339	125.98	134,547,494	0.73
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	510,048	284.45	145,088,177	254.90	130,013,275	0.71
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	19,911	5,725.10	113,992,590	6,073.15	120,922,688	0.66
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	22,156	4,124.55	91,383,748	5,035.25	111,561,032	0.61
ブラジル	株式	VALE SA	素材	62,900	1,744.23	109,712,444	1,731.60	108,917,640	0.59
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	26,349	3,865.44	101,850,562	3,981.87	104,918,450	0.57
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	385,000	274.97	105,865,235	271.40	104,491,887	0.57
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	151,500	981.95	148,765,966	689.36	104,438,646	0.57
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	19,507	5,261.40	102,634,182	5,334.12	104,052,807	0.56

中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	998,000	97.82	97,633,909	104.14	103,940,602	0.56
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	75,895	1,377.74	104,564,298	1,348.27	102,327,369	0.56

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	97.73
投資信託受益証券	0.41
合計	98.15

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	11.90
		素材	10.77
		資本財	4.70
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.71
		自動車・自動車部品	3.41
		耐久消費財・アパレル	0.90
		消費者サービス	0.54
		メディア	1.28
		小売	1.75
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	5.23
		家庭用品・パーソナル用品	1.09
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.76
		銀行	19.06
		各種金融	2.57
		保険	2.93
		不動産	1.82
		ソフトウェア・サービス	2.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.08
		電気通信サービス	7.35
		公益事業	3.36
		半導体・半導体製造装置	8.00
合計			97.73

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

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

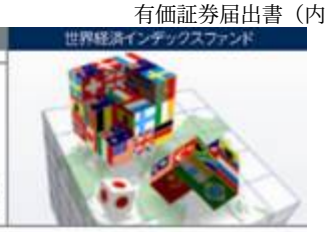
③ その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	63	3,357,941	3,315,375	306,705,341	1.66

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

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

世界経済インデックスファンド



運用実績

当初設定日：2009年1月16日
作成基準日：2013年2月28日

基準価額・純資産の推移

※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して計算しております。
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	15,660円
純資産総額	30億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	0.70%
3ヶ月	15.89%
6ヶ月	25.70%
1年	19.25%
3年	25.75%
5年	－
設定来	56.80%

※上記は作成基準日からの期間です。
※騰落率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:20円

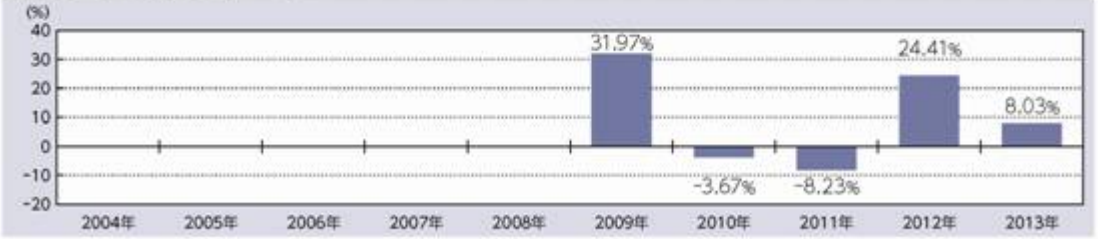
決算期	2010年1月	2011年1月	2012年1月	2013年1月	－
分配金	0円	0円	0円	20円	－

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	27.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	－	－	0.5%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	－	－	0.4%
外国債券インデックスマザーファンド	27.3%	T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	－	2.625%	2014/07/31	0.4%
		T 1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	－	1.375%	2015/11/30	0.3%
新興国債券インデックスマザーファンド	17.6%	BRAZIL 12.5% 01/05/16	ブラジル	国債証券	－	12.500%	2016/01/05	1.2%
		RUSSIA 7.85% 03/10/18	ロシア	国債証券	－	7.850%	2018/03/10	1.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	17.3%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.7%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.4%
国内株式インデックスマザーファンド	5.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	－	－	0.2%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	－	－	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	4.0%	第325回利付国債(10年)	日本	国債証券	－	0.8%	2022/09/20	0.1%
		第105回利付国債(5年)	日本	国債証券	－	0.2%	2017/06/20	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2009年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013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】

(1)申込手続

①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。

②当ファンドには、収益分配金の受取方法により、「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。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。

③「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、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差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、分配金再投資に関する契約（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を締結していただきます。

④販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。

⑤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)申込みの受付

申込期間中において、販売会社の営業日にお申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、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。

(3)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口単位とします。）。

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。販売会社の詳細につきましては、上記「(1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(4)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。

(5)申込手数料

「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料」をご覧ください。

(6)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。

(7)受付不可日

分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、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

(8)申込受付の中止等

分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖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を取り消すことができます。

(9)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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載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ます。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、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

2【換金（解約）手続等】

(1)一部解約手続

①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。
②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。

(2)一部解約の受付

一部解約の実行の請求の受付は、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受付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(3)解約単位

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

(4)解約価額

一部解約の価額は、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0.1%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。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先に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。
なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

(5)一部解約代金の支払い

一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6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。

(6)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

(7)一部解約受付の中止等

①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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、上記(2)による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消すことができます。

②上記①により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(4)の規定に準じて計算された価額とします。

(8)その他

①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。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

②一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。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

①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有価証券を除きます。）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。

②基準価額の算出頻度及び照会方法

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。

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、上記「1申込（販売）手続等 (1)申込手続」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。

③主要な投資対象資産の評価方法

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

（ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

（ハ）公社債等

計算日（※）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(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21年1月16日設定）。

ただし、下記「(5)その他 ①信託の終了」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1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は平成21年1月16日から平成22年1月20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】

①信託の終了

イ．委託会社の所定の手続きによる終了

（イ）委託会社は、信託期間中において、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、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させることができます。

（ロ）委託会社は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

（ハ）所定の手続き

a.委託会社は、上記（イ）及び（ロ）の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b.委託会社は、上記（イ）及び（ロ）の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

c.上記b.の書面決議において、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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.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。

ロ．監督官庁の命令に伴う取扱い

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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

ハ．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

（イ）委託会社が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、委託会社は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

（ロ）上記（イ）の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記②の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

ニ．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

（イ）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。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、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、下記②の規定に従い、新受託会社を選任します。

（ロ）委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②投資信託約款の変更等

イ．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、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当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は②に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

ロ．委託会社は、上記イ．の事項（上記イ．の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

ハ．上記ロ．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンド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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

ニ．上記ロ．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

ホ．書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

ヘ．上記ロ．からホ．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る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。

ト．上記イ．からヘ．までの規定にかかわらず、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、当該併合に係る一又は複数の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。

チ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、上記イ．からト．の規定に従います。

③反対者の買取請求権

投資信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記①イ．（ハ）b.又は②ロ．に規定する書面に付記します。

④運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知れている受益者に対して交付します。

⑤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。

⑥投資信託財産の管理

イ．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。以下イ．において同じ。）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。

ロ．信託財産の登記等及び記載等の留保等

（イ）信託の登記又は登録をすることができる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。

（ロ）上記（イ）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。

（ハ）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信託財産については、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。

（ニ）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。

⑦信託事務処理の再信託

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

⑧関係法人との契約の更改等に関する手続き等

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。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1)収益分配金に対する請求権

①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。

②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ます。）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。

③上記②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。

④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。

⑤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

①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。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払います。

③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。

④受益者は、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4期計算期間(平成24年1月21日から平成25年1月21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】

世界経済インデックスファンド

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (平成24年 1月20日現在)	第4期 (平成25年 1月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,959,657	41,736,624
親投資信託受益証券	1,727,149,423	2,730,719,183
未収入金	―	17,110,000
未収利息	30	63
流動資産合計	1,746,109,110	2,789,565,870
資産合計	1,746,109,110	2,789,565,870
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	―	3,600,852
未払解約金	4,097,251	28,181,609
未払受託者報酬	410,593	617,640
未払委託者報酬	4,516,484	5,558,748
その他未払費用	73,481	112,731
流動負債合計	9,097,809	38,071,580
負債合計	9,097,809	38,071,580
純資産の部		
元本等		
元本	1,447,503,755	1,800,426,112
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	289,507,546	951,068,178
（分配準備積立金）	69,319,035	450,050,332
元本等合計	1,737,011,301	2,751,494,290
純資産合計	1,737,011,301	2,751,494,290
負債純資産合計	1,746,109,110	2,789,565,870

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 (自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20日)	第4期 (自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日)
営業収益		
受取利息	8,477	11,575
有価証券売買等損益	△106,277,312	583,219,760
営業収益合計	△106,268,835	583,231,335
営業費用		
受託者報酬	736,094	1,128,523
委託者報酬	8,096,888	10,653,858
その他費用	73,481	112,731
営業費用合計	8,906,463	11,895,112
営業利益又は営業損失（△）	△115,175,298	571,336,223
経常利益又は経常損失（△）	△115,175,298	571,336,223
当期純利益又は当期純損失（△）	△115,175,298	571,336,223
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（△）	△13,141,343	57,738,692
期首剰余金又は期首欠損金（△）	234,146,083	289,507,546
剰余金増加額又は欠損金減少額	231,191,191	272,687,317
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	231,191,191	272,687,317
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,795,773	121,123,364
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	73,795,773	121,123,364
分配金	―	3,600,852
期末剰余金又は期末欠損金（△）	289,507,546	951,068,178

(3)【注記表】
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.　その他	ファンドの計算期間 第4期(自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第4期計算期間は平成24年 1月21日から平成25年 1月21日までとなっております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第3期 (平成24年 1月20日現在)	第4期 (平成25年 1月21日現在)
1.　期首元本額	787,873,704円	1,447,503,755円
期中追加設定元本額	911,791,372円	907,508,119円
期中一部解約元本額	252,161,321円	554,585,762円
2.　当該計算期間の末日における受益権総数	1,447,503,755口	1,800,426,112口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2000円 (12,000円)	1.5282円 (15,282円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)
分配金の計算過程

		第3期 自 平成23年 1月21日 至 平成24年 1月20日	第4期 自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日
費用控除後の配当等収益額	A	38,006,286円 (46,904,272円)	68,203,789円 (69,772,109円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	―円	335,457,974円
収益調整金額	C	220,188,511円	501,017,846円
分配準備積立金額	D	31,312,749円	49,989,421円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	289,507,546円	954,669,030円
当ファンドの期末残存口数	F	1,447,503,755口	1,800,426,112口

1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,000.04円	5,302.46円
1万口当たり分配金額	H	―円	20円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	―円	3,600,852円

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 (平成24年 1月20日現在)	第4期 (平成25年 1月21日現在)
	計算期間(自 平成23年1月21日 至 平成24年 1月20日)の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	△103,574,688	562,406,451
合計	△103,574,688	562,406,451

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	75,219,847	94,438,517	
	国内株式インデックス マザーファンド	174,777,630	127,098,292	
	外国債券インデックス マザーファンド	382,626,805	807,839,973	
	外国株式インデックス マザーファンド	743,968,255	870,666,048	
	新興国債券インデックス マザーファンド	267,900,711	421,247,077	
	新興国株式インデックス マザーファンド	200,690,788	409,429,276	
親投資信託受益証券 小計		1,845,184,036	2,730,719,183	
合計		1,845,184,036	2,730,719,183	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

＜参考＞
「世界経済インデックスファンド」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」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。
各マザーファンドの平成25年1月21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。
次へ

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	866,732,524
国債証券	173,934,217,000
地方債証券	14,974,306,605
特殊債券	21,507,677,260
社債券	14,975,209,610
派生商品評価勘定	719,370
未収入金	3,088,899,486
未収利息	660,196,304
前払費用	42,880,585
流動資産合計	230,050,838,744
資産合計	230,050,838,744
負債の部	
流動負債	
前受金	400,000
未払金	201,435,000
未払解約金	3,184,223,078
流動負債合計	3,386,058,078
負債合計	3,386,058,078
純資産の部	
元本等	
元本	180,543,384,070
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	46,121,396,596
元本等合計	226,664,780,666
純資産合計	226,664,780,666
負債純資産合計	230,050,838,744

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。
2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日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	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　計算期間の期首元本額	152,711,768,197円
計算期間中の追加設定元本額	50,877,678,034円
計算期間中の一部解約元本額	23,046,062,161円
計算日の元本額	180,543,384,070円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	641,402,636円
SBI資産設計オープン（分配型）	16,292,110円
SMT 国内債券インデックス・オープン	2,564,982,638円
世界経済インデックスファンド	75,219,847円
マイセレクション25	163,977,582円
マイセレクション50	144,895,799円
マイセレクション75	47,037,915円
DCマイセレクション25	9,459,834,973円
DCマイセレクション50	11,407,054,509円
DCマイセレクション75	2,875,609,205円
DC日本債券インデックス・オープン	374,321,412円
DC日本債券インデックス・オープンS	40,939,501,160円
DC日本債券インデックス・オープンP	12,857,155,092円
DCマイセレクションS25	2,843,057,046円
DCマイセレクションS50	3,376,586,898円

DCマイセレクションS75	569,513,883円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	37,765,626円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	534,963,669円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	255,601,281円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	49,926,885円
DC世界経済インデックスファンド	26,588,664円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	20,179,817,735円
国内バランス６０VA１（適格機関投資家専用）	61,281,659円
マイセレクション50ＶA1（適格機関投資家専用）	509,964,163円
マイセレクション75ＶA1（適格機関投資家専用）	67,374,362円
国内バランス３０VA2（適格機関投資家専用）	6,110,793円
国内バランス６０VA2（適格機関投資家専用）	7,920,808円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	864,493円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,194,690,005円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,506,047,718円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	9,683,881,907円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	879,450,917円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	16,222,672,658円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,760,229,716円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,645,214,870円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,749,317,542円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	5,229,276,907円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,470,409,770円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,186,488,850円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,846,497,700円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,873,713,464円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	287,797,618円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,749,858,498円
日本債券ファンド・シリーズ1	5,327,062,679円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,444,386,155円
コア投資戦略ファンド（成長型）	380,823,333円
2.　担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券　105,484,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3.　計算日における受益権総数	180,543,384,070口
4.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2555円 (12,555円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	64,072,400
地方債証券	14,475,836
特殊債券	44,293,928
社債券	90,237,660
合計	213,079,824

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	債券先物取引 買 建	288,100,630	―	288,820,000	719,370
合計		288,100,630	―	288,820,000	719,370

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在

該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第３１３回利付国債（２年）	1,100,000,000	1,100,341,000	
	第３１４回利付国債（２年）	600,000,000	600,204,000	
	第３１５回利付国債（２年）	540,000,000	540,194,400	
	第３１６回利付国債（２年）	950,000,000	950,370,500	
	第３１７回利付国債（２年）	1,030,000,000	1,030,422,300	
	第３１８回利付国債（２年）	1,060,000,000	1,060,466,400	
	第３１９回利付国債（２年）	850,000,000	850,391,000	
	第３２０回利付国債（２年）	1,280,000,000	1,280,627,200	
	第３２１回利付国債（２年）	810,000,000	810,413,100	
	第３２２回利付国債（２年）	750,000,000	750,405,000	
	第３２３回利付国債（２年）	650,000,000	650,364,000	
	第３２４回利付国債（２年）	130,000,000	130,076,700	
	第８１回利付国債（５年）	1,270,000,000	1,280,680,700	
	第８２回利付国債（５年）	1,590,000,000	1,605,200,400	
	第８３回利付国債（５年）	560,000,000	566,524,000	
	第８４回利付国債（５年）	1,650,000,000	1,664,586,000	
	第８５回利付国債（５年）	1,780,000,000	1,798,565,400	
	第８６回利付国債（５年）	300,000,000	302,631,000	
	第８７回利付国債（５年）	2,820,000,000	2,843,067,600	
	第８８回利付国債（５年）	2,340,000,000	2,361,621,600	
	第８９回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,622,751,200	
	第９０回利付国債（５年）	220,000,000	221,214,400	
	第９１回利付国債（５年）	200,000,000	201,750,000	
	第９２回利付国債（５年）	1,260,000,000	1,267,686,000	
	第９３回利付国債（５年）	1,440,000,000	1,457,956,800	
	第９４回利付国債（５年）	1,290,000,000	1,309,827,300	
	第９５回利付国債（５年）	620,000,000	630,137,000	
	第９６回利付国債（５年）	1,410,000,000	1,428,626,100	
	第９７回利付国債（５年）	1,270,000,000	1,283,360,400	
	第９９回利付国債（５年）	2,020,000,000	2,042,078,600	
	第１００回利付国債（５年）	100,000,000	100,728,000	

第１０１回利付国債（５年）	1,820,000,000	1,840,529,600	
第１０２回利付国債（５年）	1,130,000,000	1,138,350,700	
第１０３回利付国債（５年）	1,600,000,000	1,611,888,000	
第１０４回利付国債（５年）	130,000,000	130,429,000	
第１０５回利付国債（５年）	2,470,000,000	2,477,558,200	
第１０６回利付国債（５年）	2,040,000,000	2,045,650,800	
第１０７回利付国債（５年）	780,000,000	781,895,400	
第１回利付国債（４０年）	150,000,000	163,227,000	
第２回利付国債（４０年）	300,000,000	310,308,000	
第３回利付国債（４０年）	340,000,000	350,016,400	
第４回利付国債（４０年）	490,000,000	501,970,700	
第５回利付国債（４０年）	420,000,000	405,741,000	
第２５８回利付国債（１０年）	310,000,000	314,392,700	
第２５９回利付国債（１０年）	940,000,000	955,491,200	
第２６０回利付国債（１０年）	790,000,000	806,969,200	
第２６１回利付国債（１０年）	510,000,000	522,387,900	
第２６２回利付国債（１０年）	480,000,000	492,331,200	
第２６３回利付国債（１０年）	410,000,000	420,385,300	
第２６４回利付国債（１０年）	1,750,000,000	1,791,422,500	
第２６５回利付国債（１０年）	530,000,000	544,431,900	
第２６６回利付国債（１０年）	470,000,000	481,900,400	
第２６７回利付国債（１０年）	590,000,000	603,817,800	
第２６８回利付国債（１０年）	760,000,000	783,362,400	
第２６９回利付国債（１０年）	1,130,000,000	1,159,877,200	
第２７０回利付国債（１０年）	1,380,000,000	1,420,751,400	
第２７１回利付国債（１０年）	560,000,000	575,192,800	
第２７２回利付国債（１０年）	830,000,000	859,274,100	
第２７３回利付国債（１０年）	1,590,000,000	1,650,308,700	
第２７４回利付国債（１０年）	530,000,000	551,984,400	
第２７５回利付国債（１０年）	280,000,000	290,802,400	
第２７６回利付国債（１０年）	480,000,000	501,302,400	
第２７７回利付国債（１０年）	410,000,000	429,667,700	
第２７８回利付国債（１０年）	720,000,000	759,067,200	
第２７９回利付国債（１０年）	440,000,000	466,646,400	
第２８０回利付国債（１０年）	1,680,000,000	1,783,538,400	
第２８１回利付国債（１０年）	750,000,000	798,765,000	
第２８２回利付国債（１０年）	1,260,000,000	1,333,710,000	
第２８３回利付国債（１０年）	480,000,000	509,827,200	

第２８４回利付国債（１０年）	1,110,000,000	1,178,875,500	
第２８５回利付国債（１０年）	2,490,000,000	2,653,119,900	
第２８６回利付国債（１０年）	1,140,000,000	1,223,653,200	
第２８７回利付国債（１０年）	540,000,000	581,990,400	
第２８８回利付国債（１０年）	2,290,000,000	2,455,864,700	
第２８９回利付国債（１０年）	1,810,000,000	1,929,478,100	
第２９０回利付国債（１０年）	870,000,000	925,375,500	
第２９１回利付国債（１０年）	840,000,000	889,165,200	
第２９２回利付国債（１０年）	620,000,000	668,967,600	
第２９３回利付国債（１０年）	810,000,000	880,713,000	
第２９４回利付国債（１０年）	1,090,000,000	1,179,325,500	
第２９５回利付国債（１０年）	300,000,000	321,369,000	
第２９６回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,500,136,600	
第２９７回利付国債（１０年）	720,000,000	769,536,000	
第２９８回利付国債（１０年）	1,410,000,000	1,498,787,700	
第２９９回利付国債（１０年）	970,000,000	1,031,721,100	
第３００回利付国債（１０年）	730,000,000	785,297,500	
第３０１回利付国債（１０年）	1,390,000,000	1,496,696,400	
第３０２回利付国債（１０年）	200,000,000	214,094,000	
第３０３回利付国債（１０年）	980,000,000	1,049,668,200	
第３０４回利付国債（１０年）	550,000,000	585,321,000	
第３０５回利付国債（１０年）	1,860,000,000	1,979,821,200	
第３０６回利付国債（１０年）	1,180,000,000	1,263,815,400	
第３０８回利付国債（１０年）	600,000,000	638,148,000	
第３０９回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,153,713,000	
第３１０回利付国債（１０年）	1,430,000,000	1,488,215,300	
第３１１回利付国債（１０年）	160,000,000	164,083,200	
第３１２回利付国債（１０年）	1,610,000,000	1,698,292,400	(注)
第３１３回利付国債（１０年）	1,250,000,000	1,327,300,000	
第３１４回利付国債（１０年）	680,000,000	711,123,600	
第３１５回利付国債（１０年）	1,140,000,000	1,200,009,600	
第３１６回利付国債（１０年）	620,000,000	647,652,000	
第３１７回利付国債（１０年）	500,000,000	521,430,000	
第３１８回利付国債（１０年）	1,550,000,000	1,603,661,000	
第３１９回利付国債（１０年）	600,000,000	624,834,000	
第３２０回利付国債（１０年）	1,980,000,000	2,045,221,200	
第３２１回利付国債（１０年）	1,500,000,000	1,546,020,000	
第３２２回利付国債（１０年）	1,370,000,000	1,400,194,800	

第３２３回利付国債（１０年）	930,000,000	948,497,700	
第３２４回利付国債（１０年）	1,650,000,000	1,668,232,500	
第３２５回利付国債（１０年）	3,670,000,000	3,699,837,100	
第１回利付国債（３０年）	40,000,000	47,725,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	180,928,000	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	133,564,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	132,123,200	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	54,443,000	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	212,296,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	197,865,000	
第８回利付国債（３０年）	50,000,000	50,628,500	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	226,759,200	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	142,592,000	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	89,255,700	
第１２回利付国債（３０年）	120,000,000	127,046,400	
第１３回利付国債（３０年）	320,000,000	333,008,000	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	332,931,000	
第１５回利付国債（３０年）	320,000,000	360,742,400	
第１６回利付国債（３０年）	220,000,000	247,858,600	
第１７回利付国債（３０年）	250,000,000	276,827,500	
第１８回利付国債（３０年）	310,000,000	337,757,400	
第１９回利付国債（３０年）	180,000,000	195,933,600	
第２０回利付国債（３０年）	230,000,000	258,614,300	
第２１回利付国債（３０年）	220,000,000	239,197,200	
第２２回利付国債（３０年）	220,000,000	247,390,000	
第２３回利付国債（３０年）	230,000,000	258,428,000	
第２４回利付国債（３０年）	340,000,000	382,343,600	
第２５回利付国債（３０年）	280,000,000	304,161,200	
第２６回利付国債（３０年）	540,000,000	596,548,800	
第２７回利付国債（３０年）	480,000,000	539,683,200	
第２８回利付国債（３０年）	430,000,000	483,788,700	
第２９回利付国債（３０年）	670,000,000	740,551,000	
第３０回利付国債（３０年）	540,000,000	585,408,600	
第３１回利付国債（３０年）	660,000,000	700,609,800	
第３２回利付国債（３０年）	750,000,000	810,997,500	
第３３回利付国債（３０年）	730,000,000	742,556,000	
第３４回利付国債（３０年）	680,000,000	720,058,800	
第３５回利付国債（３０年）	1,000,000,000	1,013,850,000	

第３６回利付国債（３０年）	1,080,000,000	1,092,063,600	
第３７回利付国債（３０年）	830,000,000	819,890,600	
第２４回利付国債（２０年）	20,000,000	21,067,200	
第２５回利付国債（２０年）	60,000,000	62,786,400	
第２６回利付国債（２０年）	20,000,000	21,469,800	
第２７回利付国債（２０年）	50,000,000	54,090,000	
第２８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,120,000	
第２９回利付国債（２０年）	60,000,000	66,579,600	
第３０回利付国債（２０年）	80,000,000	87,710,400	
第３１回利付国債（２０年）	80,000,000	88,612,800	
第３２回利付国債（２０年）	50,000,000	55,698,000	
第３３回利付国債（２０年）	140,000,000	158,905,600	
第３４回利付国債（２０年）	50,000,000	56,996,000	
第３５回利付国債（２０年）	10,000,000	11,316,500	
第３６回利付国債（２０年）	70,000,000	79,300,200	
第３７回利付国債（２０年）	70,000,000	79,624,300	
第３８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,608,000	
第３９回利付国債（２０年）	500,000,000	562,645,000	
第４０回利付国債（２０年）	100,000,000	111,810,000	
第４１回利付国債（２０年）	330,000,000	354,997,500	
第４２回利付国債（２０年）	80,000,000	91,448,000	
第４３回利付国債（２０年）	140,000,000	163,651,600	
第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	195,029,100	
第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	330,794,300	
第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	191,885,800	
第４７回利付国債（２０年）	90,000,000	101,775,600	
第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	150,182,500	
第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	157,497,200	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	244,048,200	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	111,787,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	123,940,300	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	90,221,600	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	227,248,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	156,738,400	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	168,022,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	266,589,600	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	333,168,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	218,426,000	

第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	372,179,500	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	245,659,200	
第６２回利付国債（２０年）	250,000,000	250,480,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	220,268,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	355,612,800	
第６５回利付国債（２０年）	300,000,000	333,270,000	
第６６回利付国債（２０年）	230,000,000	253,071,300	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	144,272,700	
第６８回利付国債（２０年）	210,000,000	239,857,800	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	441,234,300	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	465,188,000	
第７１回利付国債（２０年）	220,000,000	251,141,000	
第７２回利付国債（２０年）	610,000,000	689,409,800	
第７３回利付国債（２０年）	350,000,000	391,401,500	
第７４回利付国債（２０年）	150,000,000	169,449,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	146,767,400	
第７６回利付国債（２０年）	240,000,000	265,418,400	
第７７回利付国債（２０年）	160,000,000	178,790,400	
第７８回利付国債（２０年）	250,000,000	276,050,000	
第７９回利付国債（２０年）	250,000,000	278,975,000	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	248,076,400	
第８１回利付国債（２０年）	160,000,000	178,276,800	
第８２回利付国債（２０年）	640,000,000	720,710,400	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	326,093,400	
第８４回利付国債（２０年）	520,000,000	578,448,000	
第８５回利付国債（２０年）	240,000,000	269,433,600	
第８６回利付国債（２０年）	310,000,000	355,604,100	
第８７回利付国債（２０年）	310,000,000	351,605,100	
第８８回利付国債（２０年）	480,000,000	549,859,200	
第８９回利付国債（２０年）	320,000,000	362,604,800	
第９０回利付国債（２０年）	560,000,000	633,516,800	
第９１回利付国債（２０年）	290,000,000	331,713,600	
第９２回利付国債（２０年）	960,000,000	1,071,907,200	
第９３回利付国債（２０年）	440,000,000	484,932,800	
第９４回利付国債（２０年）	500,000,000	557,135,000	
第９５回利付国債（２０年）	600,000,000	683,160,000	
第９６回利付国債（２０年）	280,000,000	311,525,200	
第９７回利付国債（２０年）	420,000,000	471,765,000	

第９８回利付国債（２０年）	320,000,000	355,232,000	
第９９回利付国債（２０年）	760,000,000	842,224,400	
第１００回利付国債（２０年）	500,000,000	559,800,000	
第１０１回利付国債（２０年）	160,000,000	183,558,400	
第１０２回利付国債（２０年）	400,000,000	458,236,000	
第１０３回利付国債（２０年）	220,000,000	249,035,600	
第１０４回利付国債（２０年）	260,000,000	287,063,400	
第１０５回利付国債（２０年）	540,000,000	594,653,400	
第１０６回利付国債（２０年）	370,000,000	412,783,100	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	285,721,800	
第１０８回利付国債（２０年）	520,000,000	556,358,400	
第１０９回利付国債（２０年）	200,000,000	213,454,000	
第１１０回利付国債（２０年）	520,000,000	570,206,000	
第１１１回利付国債（２０年）	200,000,000	221,492,000	
第１１２回利付国債（２０年）	700,000,000	764,862,000	
第１１３回利付国債（２０年）	1,270,000,000	1,384,465,100	
第１１４回利付国債（２０年）	410,000,000	445,879,100	
第１１５回利付国債（２０年）	520,000,000	573,341,600	
第１１６回利付国債（２０年）	380,000,000	418,000,000	
第１１７回利付国債（２０年）	700,000,000	759,367,000	
第１１８回利付国債（２０年）	950,000,000	1,013,460,000	
第１１９回利付国債（２０年）	380,000,000	393,828,200	
第１２１回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,111,431,200	
第１２２回利付国債（２０年）	160,000,000	165,315,200	
第１２３回利付国債（２０年）	630,000,000	678,566,700	
第１２４回利付国債（２０年）	280,000,000	297,242,400	
第１２５回利付国債（２０年）	380,000,000	414,405,200	
第１２６回利付国債（２０年）	300,000,000	317,775,000	
第１２７回利付国債（２０年）	260,000,000	271,354,200	
第１２８回利付国債（２０年）	620,000,000	645,066,600	
第１２９回利付国債（２０年）	650,000,000	666,113,500	
第１３０回利付国債（２０年）	740,000,000	756,368,800	
第１３１回利付国債（２０年）	450,000,000	452,560,500	
第１３２回利付国債（２０年）	330,000,000	331,181,400	
第１３３回利付国債（２０年）	650,000,000	662,616,500	
第１３４回利付国債（２０年）	370,000,000	376,430,600	
第１３５回利付国債（２０年）	180,000,000	180,259,200	
第１３６回利付国債（２０年）	530,000,000	521,959,900	

	第１３７回利付国債（２０年）	290,000,000	289,576,600	
	第１３８回利付国債（２０年）	810,000,000	782,929,800	
	第１３９回利付国債（２０年）	400,000,000	393,016,000	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,220,000,000	1,216,413,200	
	第１４１回利付国債（２０年）	390,000,000	387,979,800	
	第９回ポーランド共和国円貨債券	100,000,000	102,853,000	
	国債証券 小計	166,060,000,000	173,934,217,000	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,015,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,900,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	106,293,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	102,119,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,633,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,664,000	
	第２３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,864,000	
	第６１１回東京都公募公債	40,000,000	40,966,400	
	第６１８回東京都公募公債	100,000,000	102,533,000	
	第６２２回東京都公募公債	100,000,000	102,797,000	
	第６３３回東京都公募公債	129,000,000	136,496,190	
	第６３９回東京都公募公債	50,000,000	53,079,000	
	第６４９回東京都公募公債	102,000,000	109,310,340	
	第６５０回東京都公募公債	140,000,000	150,810,800	
	第６７４回東京都公募公債	100,000,000	106,673,000	
	第６７８回東京都公募公債	100,000,000	106,668,000	
	第６８３回東京都公募公債	100,000,000	105,982,000	
	第６９１回東京都公募公債	100,000,000	105,395,000	
	第６９５回東京都公募公債	100,000,000	104,951,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	104,763,000	
	平成１８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	105,225,000	
	平成１９年度第９回北海道公募公債	110,000,000	117,653,800	
	平成２０年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	108,301,000	
	平成２１年度第１回北海道公募公債（５年）	100,000,000	101,250,000	
	平成２２年度第１１回北海道公募公債	100,000,000	105,802,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	111,029,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	106,181,000	
	第１４４回神奈川県公募公債	100,000,000	106,513,000	
	第１５０回神奈川県公募公債	100,000,000	107,176,000	
	第１６７回神奈川県公募公債	140,000,000	150,568,600	
	第１７２回神奈川県公募公債	200,000,000	212,636,000	

第４７回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	101,226,000	
第５３回大阪府公募公債（５年）	200,000,000	202,086,000	
第７２回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	101,394,000	
第２７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,537,000	
第２８４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,040,000	
第２９１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,196,000	
第３０７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,549,000	
第３１１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,206,000	
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,890,000	
平成１８年度第１回京都府公募公債	100,000,000	106,016,000	
平成２２年度第２回京都府公募公債	100,000,000	104,838,000	
平成１６年度第４回兵庫県公募公債	200,000,000	203,894,000	
平成１７年度第１３回兵庫県公募公債	200,000,000	209,672,000	
平成１９年度第９回兵庫県公募公債	100,000,000	107,573,000	
平成２２年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	106,849,000	
平成１９年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	107,717,000	
平成２０年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	107,790,000	
平成２１年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	106,730,000	
平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	108,197,307	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	103,117,000	
平成２０年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	108,349,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	110,715,000	
平成２１年度第８回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,696,000	
平成２２年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,426,000	
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,309,000	
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	104,905,000	
平成１６年度第１回広島県公募公債	100,000,000	102,444,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	112,141,000	
平成２２年度第１回広島県公募公債	100,000,000	106,391,000	
平成１６年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	102,324,000	
平成１７年度第３回埼玉県公募公債	100,000,000	102,958,000	
平成１８年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	106,226,000	
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	105,457,000	
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	203,763,610	
平成２１年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	107,730,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	104,595,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	209,226,000	
平成１８年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	106,647,000	

平成２１年度第１２回千葉県公募公債	100,000,000	107,028,000	
平成２１年度第２回千葉県公募公債	100,000,000	107,764,000	
平成２１年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	106,070,000	
平成２２年度第８回千葉県公募公債	120,000,000	124,254,000	
平成１６年度第１回新潟県公募公債	100,000,000	102,523,000	
平成１７年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	104,161,000	
第１４回共同発行市場公募地方債	100,200,000	102,041,676	
第１５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,105,000	
第１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,584,000	
第２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,449,000	
第２９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,614,000	
第３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,300,000	
第３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,548,000	
第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,200,000	
第４０回共同発行市場公募地方債	120,000,000	128,206,800	
第４１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,628,000	
第４６回共同発行市場公募地方債	136,500,000	145,421,640	
第５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,688,000	
第５５回共同発行市場公募地方債	158,400,000	170,801,136	
第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,313,000	
第６７回共同発行市場公募地方債	165,700,000	177,375,222	
第７５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	216,488,000	
第７７回共同発行市場公募地方債	110,000,000	118,416,100	
第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,682,000	
第８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,992,000	
第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,885,000	
第８９回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,293,964	
第９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,835,000	
第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,403,000	
第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,298,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	250,000,000	263,942,500	
第９７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,598,000	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,648,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,873,500	
平成２２年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	103,527,000	
平成１６年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	102,512,000	
平成１７年度第１０回大阪市公募公債	100,000,000	104,003,000	
平成１９年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	107,360,000	

	平成２２年度第５回大阪市公募公債	100,000,000	104,851,000	
	第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	108,531,000	
	第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	108,234,000	
	第１２回す号名古屋市公募公債	100,000,000	104,938,000	
	平成２２年度第２回京都市公募公債	102,000,000	106,438,020	
	平成１７年度第１３回神戸市公募公債	100,000,000	104,476,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	112,540,000	
	平成１７年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	102,539,000	
	平成２１年度第１回横浜市公募公債	200,000,000	215,652,000	
	平成２１年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	107,856,000	
	平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	102,888,000	
	平成１７年度第６回札幌市公募公債	100,000,000	103,997,000	
	第８１回川崎市公募公債	100,000,000	107,645,000	
	第８２回川崎市公募公債	100,000,000	107,514,000	
	平成２３年度第１回北九州市公募公債（５年）	100,000,000	100,695,000	
	平成２１年度第４回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,968,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	104,729,000	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	100,000,000	103,273,000	
	平成１８年度第１回鹿児島県公募公債（１０年）	100,000,000	106,529,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	112,113,000	
	地方債証券 小計	14,170,390,000	14,974,306,605	
特殊債券	第１１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,458,000	
	第１３回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	113,086,100	
	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,322,000	
	第１６回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	200,000,000	201,932,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,724,000	
	第１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,069,000	
	第５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,617,000	
	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	110,594,000	
	第８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,723,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,144,000	
	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	221,202,000	
	第１７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,735,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	111,480,000	
	第２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,103,000	
	第３０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,461,000	
	第３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,662,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,885,000	

第３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	231,430,300	
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,514,000	
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,078,000	
第４０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,400,000	
第４２回道路債券	100,000,000	112,135,000	
第４４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,345,000	
第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,355,000	
第４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,794,000	
第４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,452,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,233,000	
第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,035,000	
第５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,172,000	
第５４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,865,700	
第５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	117,951,930	
第６０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,602,000	
第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	195,722,540	
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,364,000	
第９８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,570,000	
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	146,451,120	
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,497,000	
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	106,119,000	
第１１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,817,000	
第１１７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,560,000	
第１２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,828,000	
第１２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,376,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,037,000	
第１２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,159,000	
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,849,000	
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,095,000	

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	102,077,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,796,000	
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	101,771,000	
第３２７回政府保証道路債券	100,000,000	101,759,000	
第３２８回政府保証道路債券	114,000,000	116,148,900	
第３３１回政府保証道路債券	102,000,000	104,766,240	
第３３３回政府保証道路債券	48,000,000	49,265,280	
第３４６回政府保証道路債券	143,000,000	147,810,520	
第３４７回政府保証道路債券	181,000,000	186,779,330	
第１回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	217,614,600	
第１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,463,000	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,857,000	
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	339,270,000	
第３回公営企業債券（２０年）	10,000,000	10,153,800	
第５回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,156,000	
第６回地方公共団体金融機構債券（５年）	100,000,000	100,873,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	112,900,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	111,580,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	108,144,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	45,384,800	
第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,827,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,586,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,756,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,152,000	
第１７回公営企業債券	100,000,000	103,754,000	
第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,968,390	
第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,204,000	
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,940,820	
第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,922,640	
第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,273,000	
第２８回公営企業債券	100,000,000	107,814,000	
第３０回公営企業債券	100,000,000	109,123,000	
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,115,000	
第８３６回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,131,700	
第８３８回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,752,000	
第８４０回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,273,780	

第８４８回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,505,000	
第８５５回政府保証公営企業債券	140,000,000	144,433,800	
第８５９回政府保証公営企業債券	131,000,000	136,484,970	
第８６２回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,924,000	
第８６６回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,668,000	
第８６７回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,092,000	
第８７２回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,474,000	
第８７４回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,531,000	
第８７５回政府保証公営企業債券	112,000,000	119,442,400	
第８７６回政府保証公営企業債券	122,000,000	131,323,240	
第３回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	109,628,050	
第５回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,940,000	
第７回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,209,000	
第８回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,649,000	
第１９０回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,478,000	
第１９３回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	106,423,200	
第２００回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,189,000	
第１４５回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,898,000	
第１回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,154,000	
第５回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	107,309,470	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	106,153,000	
第１８２回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,232,200	
第４３回都市再生債券	100,000,000	104,898,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,144,000	
第３２２回東京交通債券	10,000,000	10,837,500	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	107,543,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,440,000	
第８回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,898,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,760,000	56,259,043	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	37,248,000	39,681,039	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	38,562,000	41,424,071	
第３回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	110,382,000	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,042,000	56,987,794	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	43,019,000	45,668,540	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	32,414,000	34,152,362	
第５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,921,000	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	67,326,000	72,436,716	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	44,399,000	46,872,912	

第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	35,312,000	37,824,095	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	50,568,000	53,658,716	
第８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,747,000	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	35,145,000	37,687,389	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	55,779,000	59,221,122	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	57,039,000	60,056,933	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	57,480,000	60,393,661	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,590,000	70,331,501	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,198,000	72,406,516	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,821,000	70,714,133	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,804,000	76,924,706	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,312,000	78,549,270	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,256,000	82,297,139	
第３３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,623,000	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,810,000	82,879,748	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,037,000	55,820,912	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,208,000	88,316,508	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,385,000	55,010,012	
第４１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,865,000	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,285,000	55,285,742	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,857,000	95,249,027	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,013,000	50,499,013	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,951,000	95,804,145	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,554,000	96,692,010	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,176,000	55,973,891	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,748,000	192,711,692	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,327,000	96,694,238	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,377,000	55,662,085	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,505,000	97,172,517	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,396,000	97,099,772	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,865,000	97,790,927	
第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,335,000	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,884,000	196,191,219	
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,398,000	
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,609,000	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,860,000	197,372,527	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,828,000	98,663,007	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,229,000	

第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,540,000	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,661,000	
第１２回政府保証国民生活債券	179,000,000	181,677,840	
第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	111,375,000	
第２回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	153,739,950	
い第７１８号商工債	100,000,000	101,040,000	
い第７２１号商工債	150,000,000	151,377,000	
い第７２２号商工債	100,000,000	100,812,000	
い第７２６号商工債	100,000,000	100,808,000	
い第７２９号商工債	100,000,000	101,649,000	
い第７３１号商工債	100,000,000	101,719,000	
い第７３８号商工債	100,000,000	100,972,000	
い第７４１号商工債	100,000,000	100,996,000	
い第７０７号農林債	250,000,000	253,622,500	
い第７１０号農林債	100,000,000	101,209,000	
い第７１５号農林債	100,000,000	100,950,000	
い第７２１号農林債	100,000,000	100,966,000	
い第７２２号農林債	100,000,000	100,862,000	
い第７２３号農林債	200,000,000	201,782,000	
い第７４０号農林債	100,000,000	101,034,000	
第２３３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,488,000	
第２３７回信金中金債（５年）	100,000,000	101,330,000	
第２４３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,108,000	
第２４７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,918,000	
第２５８回信金中金債（５年）	100,000,000	101,230,000	
第２６７回信金中金債（５年）	200,000,000	201,950,000	
第１３９号商工債（３年）	100,000,000	100,215,000	
第５回ＳＢＡＢ銀行ＡＢ（ｐｕｂｌ）円貨債券	100,000,000	99,582,000	
第１０回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	101,038,000	
第１回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	104,224,000	
第１９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,096,000	
第２２回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,558,000	
第２８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,137,000	
第３３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,425,000	
第４３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,100,000	
第７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,980,000	
第２５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	107,891,000	
特殊債券 小計	20,493,140,000	21,507,677,260	

社債券	第２回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,814,000	
	第９回ＪＰモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	100,000,000	102,806,000	
	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	105,244,000	
	第９回現代キャピタル・サービシズ・インク円貨社債	100,000,000	100,102,000	
	第４回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,780,000	
	第７回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,616,000	
	第９回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,862,000	
	第６回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,589,000	
	第１６回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	203,940,000	
	第１７回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,342,000	
	第３回エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	101,509,000	
	第１回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,030,000	
	第１３回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	101,077,000	
	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	100,048,000	
	第３回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,929,000	
	第７回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,369,000	
	第５回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,235,000	
	第３回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	108,257,000	
	第８回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,222,000	
	第２８回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,275,000	
	第２回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,569,000	
	第７回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	103,744,000	
	第４回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,985,000	
	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	100,119,000	
	第５回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	100,800,000	
	第８回昭和シェル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,202,000	
	第１３回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,048,000	
	第５５回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,133,000	
	第６７回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,947,000	
	第１５回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,607,000	
	第２８回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,799,000	
	第１６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	106,151,000	

第９回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第１回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	101,119,000	
第５０回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,938,000	
第３０回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	99,962,000	
第１１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,957,000	
第２７回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	95,391,000	
第３回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	100,908,000	
第２４回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,115,000	
第１回日本生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,897,000	
第１回Ｂ号明治安田生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,788,000	
第５１回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,038,000	
第５２回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	103,067,000	
第１２回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,308,000	
第５回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	102,383,000	
第５３回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,048,000	
第７５回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,646,000	
第５３回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	102,279,000	
第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,539,000	
第７４回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,391,000	
第７７回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,131,000	
第１６回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,366,000	
第１８回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,035,000	
第２３回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,515,000	
第２５回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,656,000	
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	303,012,000	
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	100,744,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	114,782,000	
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	103,450,000	
第３２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,529,000	
第９３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	108,249,000	
第１２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,739,000	
第６回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,459,000	
第２回三菱信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,304,000	
第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,770,000	
第８回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,872,000	

第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,789,000	
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	104,359,000	
第４７回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,097,000	
第５３回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,643,000	
第５６回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,015,000	
第１５回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,195,000	
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	100,612,000	
第１７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,719,000	
第２７回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,362,000	
第４７回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,894,000	
第４０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,065,000	
第１３３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,595,000	
第１３８回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,677,000	
第９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,503,000	
第１９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,513,000	
第１５回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,087,000	
第２０回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,783,000	
第２２回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,657,000	
第２４回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,037,000	
第３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,135,000	
第１０３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,814,000	
第３回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,466,000	
第７０回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,006,000	
第７回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,701,000	
第３０回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,553,000	
第３０回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,138,000	
第２回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,843,000	
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,036,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,985,000	
第８１回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	203,282,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,529,850	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,834,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,509,200	
第１６回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,395,000	
第２１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,701,000	

第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,375,000	
第９回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,506,000	
第３９回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,652,000	
第９回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,638,000	
第１７回株式会社東京放送ホールディングス無担保社債	100,000,000	101,224,000	
第５０回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,661,000	
第５１回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,283,000	
第５９回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	108,065,000	
第７回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	103,540,000	
第４２５回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,286,000	
第４５５回東京電力株式会社社債	120,000,000	111,663,600	
第４５９回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,545,600	
第５０１回東京電力株式会社社債	30,000,000	29,973,300	
第５０５回東京電力株式会社社債	30,000,000	29,890,500	
第５１０回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,217,000	
第５１８回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,530,000	
第５２１回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,691,000	
第５２８回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,449,000	
第５３６回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,270,000	
第５４２回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,559,000	
第５４４回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,096,000	
第５５４回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,862,000	
第４０５回中部電力株式会社社債	50,000,000	54,111,000	
第４０８回中部電力株式会社社債	50,000,000	54,606,000	
第４５１回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,496,000	
第４７３回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,077,000	
第４７４回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,043,000	
第３６２回中国電力株式会社社債	100,000,000	105,375,000	
第３７１回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,062,000	
第２４８回北陸電力株式会社社債	100,000,000	111,387,000	
第３７６回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,063,000	
第３８０回東北電力株式会社社債	100,000,000	109,764,000	
第３８２回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,717,600	
第２５７回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,908,000	
第２７６回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,009,000	
第３８７回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,881,000	
第４０８回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,944,000	
第４１７回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,618,000	

	第２６１回北海道電力株式会社社債	31,000,000	34,011,960	
	第２８５回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,620,000	
	第２８６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,792,000	
	第１７回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	210,108,000	
	第３０回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,435,000	
	第９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,094,000	
社債券 小計		14,580,000,000	14,975,209,610	
合計		215,303,530,000	225,391,410,475	

（注）代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入
なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

次へ

「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,488,779,717
株式	131,438,768,832
派生商品評価勘定	53,701,625
未収入金	5,822,221
未収配当金	147,887,063
未収利息	2,271
差入委託証拠金	38,475,000
流動資産合計	133,173,436,729
資産合計	133,173,436,729
負債の部	
流動負債	
前受金	77,435,000
未払解約金	131,602,002
流動負債合計	209,037,002
負債合計	209,037,002
純資産の部	
元本等	
元本	182,835,918,854
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△49,871,519,127
元本等合計	132,964,399,727
純資産合計	132,964,399,727
負債純資産合計	133,173,436,729

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　計算期間の期首元本額	200,419,822,981円
計算期間中の追加設定元本額	30,731,857,511円
計算期間中の一部解約元本額	48,315,761,638円
計算日の元本額	182,835,918,854円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	3,232,370,977円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,399,306,960円
SBI資産設計オープン（分配型）	35,162,888円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,487,840,248円
世界経済インデックスファンド	174,777,630円
マイセレクション25	100,744,085円
マイセレクション50	231,308,198円
マイセレクション75	241,920,126円
日本株式インデックス・オープン	15,970,753,582円
DCマイセレクション25	5,933,175,215円
DCマイセレクション50	18,478,595,197円
DCマイセレクション75	16,416,229,109円
DC日本株式インデックス・オープン	3,620,510,037円
DCマイセレクションS25	1,628,311,309円
DCマイセレクションS50	5,118,614,656円
DCマイセレクションS75	3,217,736,106円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,123,404,031円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	25,972,213円

DCターゲット・イヤー ファンド2025	455,394,646円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	427,910,587円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	172,814,677円
DC世界経済インデックスファンド	69,017,016円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	419,067,890円
国内バランス６０VA１（適格機関投資家専用）	341,879,239円
マイセレクション50ＶA1（適格機関投資家専用）	829,246,198円
マイセレクション75ＶA1（適格機関投資家専用）	343,348,015円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	2,888,890,813円
国内バランス３０VA2（適格機関投資家専用）	7,998,488円
国内バランス６０VA2（適格機関投資家専用）	43,048,718円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,390,200円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,856,286,652円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,176,109,138円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	18,383,893,112円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	5,723,528,049円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	11,814,801,834円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	2,327,790,929円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	13,022,206,900円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,694,882,341円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	4,332,519,691円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,786,163,774円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	5,535,756,699円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,630,150,269円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,214,606,171円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	183,900,703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）	6,433,198,078円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,571,818,948円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,711,566,512円
2.　計算日における受益権総数	182,835,918,854口
3.　「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 49,871,519,127円
4.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7272円 (7,272円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)株式 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4.　金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	25,763,326,505
合計	25,763,326,505

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建	1,443,618,375	－	1,497,320,000	53,701,625
合計		1,443,618,375	－	1,497,320,000	53,701,625

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

銘 柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

極洋	50,000	200.00	10,000,000	
日本水産	127,100	188.00	23,894,800	
マルハニチロホールディングス	227,000	159.00	36,093,000	
サカタのタネ	17,400	1,087.00	18,913,800	
ホクト	12,000	1,733.00	20,796,000	
住石ホールディングス	34,700	96.00	3,331,200	
日鉄鉱業	30,000	406.00	12,180,000	
三井松島産業	77,000	192.00	14,784,000	
国際石油開発帝石	1,437	478,000.00	686,886,000	
日本海洋掘削	2,900	2,934.00	8,508,600	
関東天然瓦斯開発	12,000	505.00	6,060,000	
石油資源開発	16,800	3,205.00	53,844,000	
ショーボンドホールディングス	10,500	3,400.00	35,700,000	
ミライト・ホールディングス	33,700	769.00	25,915,300	
ダイセキ環境ソリューション	10	129,900.00	1,299,000	
間組	40,000	246.00	9,840,000	
東急建設	44,180	239.00	10,559,020	
コムシスホールディングス	57,400	1,087.00	62,393,800	
ミサワホーム	14,400	1,333.00	19,195,200	
高松コンストラクショングループ	9,300	1,391.00	12,936,300	
東建コーポレーション	4,540	5,090.00	23,108,600	
ヤマウラ	9,500	286.00	2,717,000	
大成建設	599,000	275.00	164,725,000	
大林組	356,000	458.00	163,048,000	
清水建設	363,000	311.00	112,893,000	
長谷工コーポレーション	739,000	93.00	68,727,000	
松井建設	17,000	374.00	6,358,000	
鹿島建設	521,000	275.00	143,275,000	
鉄建建設	72,000	126.00	9,072,000	
安藤建設	39,000	130.00	5,070,000	
太平工業	24,000	359.00	8,616,000	
西松建設	156,000	180.00	28,080,000	
三井住友建設	164,700	103.00	16,964,100	
前田建設工業	76,000	417.00	31,692,000	
ナカノフドー建設	17,000	288.00	4,896,000	
奥村組	106,000	368.00	39,008,000	
大和小田急建設	5,500	220.00	1,210,000	
東鉄工業	15,400	1,177.00	18,125,800	

イチケン	23,000	173.00	3,979,000	
戸田建設	137,000	257.00	35,209,000	
熊谷組	86,000	122.00	10,492,000	
青木あすなろ建設	7,500	571.00	4,282,500	
北野建設	29,000	236.00	6,844,000	
植木組	24,000	202.00	4,848,000	
三井ホーム	16,000	529.00	8,464,000	
矢作建設工業	18,800	455.00	8,554,000	
ピーエス三菱	7,500	587.00	4,402,500	
大東建託	44,900	8,790.00	394,671,000	
新日本建設	22,200	248.00	5,505,600	
ＮＩＰＰＯ	27,000	1,224.00	33,048,000	
東亜道路工業	29,000	320.00	9,280,000	
前田道路	34,000	1,350.00	45,900,000	
日本道路	37,000	416.00	15,392,000	
東亜建設工業	108,000	147.00	15,876,000	
五洋建設	143,500	235.00	33,722,500	
大林道路	19,000	357.00	6,783,000	
福田組	21,000	413.00	8,673,000	
住友林業	82,000	872.00	71,504,000	
日本基礎技術	16,300	344.00	5,607,200	
日成ビルド工業	48,000	195.00	9,360,000	
巴コーポレーション	16,000	430.00	6,880,000	
パナホーム	45,000	608.00	27,360,000	
大和ハウス工業	295,000	1,567.00	462,265,000	
ライト工業	29,400	475.00	13,965,000	
積水ハウス	355,000	1,004.00	356,420,000	
日特建設	15,500	385.00	5,967,500	
北陸電気工事	6,000	278.00	1,668,000	
ユアテック	19,000	312.00	5,928,000	
西部電気工業	10,000	394.00	3,940,000	
四電工	10,000	331.00	3,310,000	
中電工	17,200	846.00	14,551,200	
関電工	54,000	387.00	20,898,000	
きんでん	79,000	593.00	46,847,000	
東京エネシス	16,000	483.00	7,728,000	
トーエネック	17,000	472.00	8,024,000	
住友電設	9,600	958.00	9,196,800	

日本電設工業	21,000	893.00	18,753,000	
協和エクシオ	42,500	895.00	38,037,500	
新日本空調	9,300	532.00	4,947,600	
ＮＤＳ	18,000	266.00	4,788,000	
九電工	21,000	462.00	9,702,000	
三機工業	28,000	460.00	12,880,000	
日揮	119,000	2,562.00	304,878,000	
中外炉工業	40,000	225.00	9,000,000	
ヤマト	12,000	305.00	3,660,000	
太平電業	15,000	531.00	7,965,000	
高砂熱学工業	34,500	698.00	24,081,000	
三晃金属工業	21,000	251.00	5,271,000	
朝日工業社	14,000	294.00	4,116,000	
大氣社	17,200	1,789.00	30,770,800	
ダイダン	17,000	525.00	8,925,000	
日比谷総合設備	14,500	1,049.00	15,210,500	
東芝プラントシステム	20,000	1,281.00	25,620,000	
東洋エンジニアリング	66,000	410.00	27,060,000	
千代田化工建設	86,000	1,181.00	101,566,000	
新興プランテック	24,400	708.00	17,275,200	
日本製粉	72,000	368.00	26,496,000	
日清製粉グループ本社	107,000	1,099.00	117,593,000	
日東富士製粉	9,000	307.00	2,763,000	
昭和産業	49,000	292.00	14,308,000	
鳥越製粉	9,400	624.00	5,865,600	
協同飼料	41,000	105.00	4,305,000	
中部飼料	10,800	535.00	5,778,000	
日本配合飼料	33,000	115.00	3,795,000	
東洋精糖	21,000	98.00	2,058,000	
日本甜菜製糖	60,000	168.00	10,080,000	
三井製糖	46,000	269.00	12,374,000	
森永製菓	115,000	189.00	21,735,000	
中村屋	27,000	416.00	11,232,000	
江崎グリコ	43,000	901.00	38,743,000	
名糖産業	5,300	979.00	5,188,700	
不二家	68,000	198.00	13,464,000	
山崎製パン	87,000	997.00	86,739,000	
モロゾフ	18,000	309.00	5,562,000	

亀田製菓	6,600	1,989.00	13,127,400	
カルビー	10,700	6,740.00	72,118,000	
森永乳業	101,000	283.00	28,583,000	
ヤクルト本社	69,100	3,725.00	257,397,500	
明治ホールディングス	35,000	3,920.00	137,200,000	
雪印メグミルク	23,200	1,473.00	34,173,600	
プリマハム	67,000	161.00	10,787,000	
日本ハム	90,000	1,244.00	111,960,000	
伊藤ハム	65,000	403.00	26,195,000	
丸大食品	56,000	293.00	16,408,000	
米久	10,400	893.00	9,287,200	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	7,500	837.00	6,277,500	
サッポロホールディングス	196,000	294.00	57,624,000	
アサヒグループホールディングス	237,600	1,872.00	444,787,200	
キリンホールディングス	506,000	1,048.00	530,288,000	
宝ホールディングス	93,000	711.00	66,123,000	
オエノンホールディングス	32,000	204.00	6,528,000	
養命酒製造	9,000	780.00	7,020,000	
三国コカ・コーラボトリング	12,300	864.00	10,627,200	
コカ・コーラウエスト	40,000	1,387.00	55,480,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	14,700	1,130.00	16,611,000	
ダイドードリンコ	6,000	3,530.00	21,180,000	
伊藤園	32,100	1,715.00	55,051,500	
キーコーヒー	10,300	1,566.00	16,129,800	
ユニカフェ	3,200	476.00	1,523,200	
ジャパンフーズ	1,900	974.00	1,850,600	
日清オイリオグループ	51,000	331.00	16,881,000	
不二製油	28,700	1,219.00	34,985,300	
Ｊ－オイルミルズ	50,000	269.00	13,450,000	
キッコーマン	96,000	1,361.00	130,656,000	
味の素	311,000	1,221.00	379,731,000	
キユーピー	60,100	1,179.00	70,857,900	
ハウス食品	41,600	1,358.00	56,492,800	
カゴメ	42,400	1,713.00	72,631,200	
焼津水産化学工業	5,500	788.00	4,334,000	
アリアケジャパン	10,700	1,612.00	17,248,400	
ニチレイ	132,000	454.00	59,928,000	
東洋水産	54,000	2,477.00	133,758,000	

日清食品ホールディングス	46,200	3,320.00	153,384,000	
永谷園	11,000	857.00	9,427,000	
フジッコ	13,000	1,046.00	13,598,000	
ロック・フィールド	6,100	1,499.00	9,143,900	
日本たばこ産業	524,000	2,677.00	1,402,748,000	
ケンコーマヨネーズ	3,900	870.00	3,393,000	
わらべや日洋	7,300	1,499.00	10,942,700	
なとり	5,400	870.00	4,698,000	
ミヨシ油脂	40,000	183.00	7,320,000	
片倉工業	13,900	890.00	12,371,000	
グンゼ	83,000	243.00	20,169,000	
東洋紡	467,000	139.00	64,913,000	
ユニチカ	303,000	52.00	15,756,000	
富士紡ホールディングス	53,000	297.00	15,741,000	
日清紡ホールディングス	70,000	734.00	51,380,000	
倉敷紡績	113,000	156.00	17,628,000	
シキボウ	67,000	116.00	7,772,000	
日本毛織	35,000	594.00	20,790,000	
トーア紡コーポレーション	50,000	67.00	3,350,000	
ダイドーリミテッド	12,600	616.00	7,761,600	
帝国繊維	12,000	670.00	8,040,000	
帝人	419,000	207.00	86,733,000	
東レ	855,000	503.00	430,065,000	
サカイオーベックス	31,000	136.00	4,216,000	
住江織物	28,000	196.00	5,488,000	
日本フエルト	6,200	418.00	2,591,600	
イチカワ	9,000	166.00	1,494,000	
日本バイリーン	14,000	395.00	5,530,000	
芦森工業	31,000	137.00	4,247,000	
アツギ	93,000	112.00	10,416,000	
ダイニック	21,000	166.00	3,486,000	
セーレン	29,700	584.00	17,344,800	
東海染工	15,000	101.00	1,515,000	
小松精練	18,000	395.00	7,110,000	
ワコールホールディングス	66,000	939.00	61,974,000	
ホギメディカル	7,000	4,075.00	28,525,000	
レナウン	23,900	156.00	3,728,400	
クラウディア	1,700	1,164.00	1,978,800	

ＴＳＩホールディングス	57,000	472.00	26,904,000	
三陽商会	58,000	258.00	14,964,000	
オンワードホールディングス	74,000	670.00	49,580,000	
ルック	20,000	382.00	7,640,000	
ゴールドウイン	26,000	516.00	13,416,000	
デサント	28,000	571.00	15,988,000	
ヤマトインターナショナル	6,700	389.00	2,606,300	
特種東海製紙	64,000	225.00	14,400,000	
王子ホールディングス	488,000	289.00	141,032,000	
三菱製紙	157,000	87.00	13,659,000	
北越紀州製紙	68,500	466.00	31,921,000	
中越パルプ工業	42,000	152.00	6,384,000	
巴川製紙所	17,000	163.00	2,771,000	
大王製紙	46,000	618.00	28,428,000	
日本製紙グループ本社	53,300	1,242.00	66,198,600	
レンゴー	89,000	443.00	39,427,000	
トーモク	35,000	250.00	8,750,000	
ザ・パック	7,800	1,493.00	11,645,400	
クラレ	188,100	1,135.00	213,493,500	
旭化成	689,000	519.00	357,591,000	
共和レザー	6,400	285.00	1,824,000	
コープケミカル	17,000	115.00	1,955,000	
昭和電工	687,000	142.00	97,554,000	
住友化学	759,000	258.00	195,822,000	
日本化成	21,000	190.00	3,990,000	
住友精化	21,000	321.00	6,741,000	
日産化学工業	78,400	1,080.00	84,672,000	
ラサ工業	39,000	100.00	3,900,000	
クレハ	77,000	355.00	27,335,000	
テイカ	19,000	275.00	5,225,000	
石原産業	198,000	74.00	14,652,000	
片倉チッカリン	7,000	214.00	1,498,000	
日本曹達	66,000	407.00	26,862,000	
東ソー	295,000	210.00	61,950,000	
トクヤマ	160,000	183.00	29,280,000	
セントラル硝子	99,000	295.00	29,205,000	
東亜合成	130,000	349.00	45,370,000	
ダイソー	44,000	273.00	12,012,000	

関東電化工業	26,000	179.00	4,654,000	
電気化学工業	221,000	315.00	69,615,000	
信越化学工業	198,100	5,490.00	1,087,569,000	
日本カーバイド工業	32,000	420.00	13,440,000	
堺化学工業	41,000	269.00	11,029,000	
エア・ウォーター	91,000	1,152.00	104,832,000	
大陽日酸	145,000	602.00	87,290,000	
日本化学工業	41,000	129.00	5,289,000	
日本パーカライジング	26,000	1,451.00	37,726,000	
高圧ガス工業	16,000	507.00	8,112,000	
チタン工業	13,000	236.00	3,068,000	
四国化成工業	16,000	537.00	8,592,000	
戸田工業	16,000	363.00	5,808,000	
ステラ ケミファ	4,800	1,949.00	9,355,200	
保土谷化学工業	25,000	170.00	4,250,000	
日本触媒	80,000	900.00	72,000,000	
大日精化工業	40,000	414.00	16,560,000	
カネカ	138,000	459.00	63,342,000	
三菱瓦斯化学	174,000	574.00	99,876,000	
三井化学	469,000	207.00	97,083,000	
ＪＳＲ	108,900	1,752.00	190,792,800	
東京応化工業	21,400	1,798.00	38,477,200	
大阪有機化学工業	7,300	394.00	2,876,200	
三菱ケミカルホールディングス	690,500	424.00	292,772,000	
日本合成化学工業	23,000	659.00	15,157,000	
ダイセル	131,000	620.00	81,220,000	
住友ベークライト	86,000	370.00	31,820,000	
積水化学工業	227,000	902.00	204,754,000	
日本ゼオン	95,000	760.00	72,200,000	
アイカ工業	31,000	1,468.00	45,508,000	
宇部興産	529,000	189.00	99,981,000	
積水樹脂	16,000	1,066.00	17,056,000	
タキロン	26,000	331.00	8,606,000	
旭有機材工業	39,000	213.00	8,307,000	
日立化成	47,800	1,359.00	64,960,200	
ニチバン	11,000	269.00	2,959,000	
リケンテクノス	18,000	263.00	4,734,000	
大倉工業	26,000	280.00	7,280,000	

積水化成品工業	28,000	221.00	6,188,000	
群栄化学工業	30,000	224.00	6,720,000	
タイガースポリマー	5,400	317.00	1,711,800	
ミライアル	2,700	1,858.00	5,016,600	
日本カーリット	8,800	474.00	4,171,200	
日本化薬	78,000	993.00	77,454,000	
日本精化	9,200	581.00	5,345,200	
ＡＤＥＫＡ	47,500	743.00	35,292,500	
日油	86,000	414.00	35,604,000	
ハリマ化成グループ	9,400	490.00	4,606,000	
花王	293,000	2,420.00	709,060,000	
第一工業製薬	20,000	232.00	4,640,000	
三洋化成工業	35,000	520.00	18,200,000	
大日本塗料	63,000	151.00	9,513,000	
日本ペイント	96,000	809.00	77,664,000	
関西ペイント	125,000	1,002.00	125,250,000	
中国塗料	34,000	490.00	16,660,000	
日本特殊塗料	8,500	367.00	3,119,500	
藤倉化成	12,900	382.00	4,927,800	
太陽ホールディングス	9,000	2,477.00	22,293,000	
ＤＩＣ	391,000	161.00	62,951,000	
サカタインクス	23,000	472.00	10,856,000	
東洋インキＳＣホールディングス	99,000	380.00	37,620,000	
富士フイルムホールディングス	236,000	1,847.00	435,892,000	
資生堂	196,500	1,227.00	241,105,500	
ライオン	127,000	432.00	54,864,000	
高砂香料工業	36,000	473.00	17,028,000	
マンダム	11,900	2,492.00	29,654,800	
ミルボン	5,400	2,963.00	16,000,200	
ファンケル	27,700	979.00	27,118,300	
コーセー	19,800	1,843.00	36,491,400	
ドクターシーラボ	75	279,700.00	20,977,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	13,100	2,610.00	34,191,000	
ノエビアホールディングス	6,400	1,380.00	8,832,000	
エステー	6,800	953.00	6,480,400	
コニシ	8,000	1,591.00	12,728,000	
長谷川香料	14,000	1,203.00	16,842,000	
星光ＰＭＣ	4,500	324.00	1,458,000	

小林製薬	16,700	4,325.00	72,227,500	
荒川化学工業	8,600	710.00	6,106,000	
メック	7,900	317.00	2,504,300	
日本高純度化学	29	204,100.00	5,918,900	
ＪＣＵ	1,600	3,355.00	5,368,000	
アース製薬	7,900	2,917.00	23,044,300	
イハラケミカル工業	19,000	496.00	9,424,000	
北興化学工業	11,000	267.00	2,937,000	
大成ラミック	3,100	2,442.00	7,570,200	
クミアイ化学工業	23,000	501.00	11,523,000	
日本農薬	25,000	524.00	13,100,000	
アキレス	90,000	127.00	11,430,000	
有沢製作所	17,200	334.00	5,744,800	
日東電工	91,100	4,840.00	440,924,000	
レック	3,400	1,033.00	3,512,200	
きもと	9,900	697.00	6,900,300	
藤森工業	8,600	2,141.00	18,412,600	
前澤化成工業	7,700	900.00	6,930,000	
ＪＳＰ	7,200	1,247.00	8,978,400	
エフピコ	5,400	6,040.00	32,616,000	
天馬	8,800	962.00	8,465,600	
信越ポリマー	21,700	346.00	7,508,200	
東リ	28,000	204.00	5,712,000	
ニフコ	24,600	1,919.00	47,207,400	
日本バルカー工業	46,000	225.00	10,350,000	
ユニ・チャーム	61,000	4,820.00	294,020,000	
協和発酵キリン	132,000	864.00	114,048,000	
武田薬品工業	413,800	4,435.00	1,835,203,000	
アステラス製薬	245,200	4,455.00	1,092,366,000	
大日本住友製薬	78,200	1,117.00	87,349,400	
塩野義製薬	161,000	1,602.00	257,922,000	
田辺三菱製薬	91,900	1,177.00	108,166,300	
わかもと製薬	13,000	241.00	3,133,000	
あすか製薬	13,000	567.00	7,371,000	
日本新薬	23,000	1,097.00	25,231,000	
中外製薬	128,300	1,775.00	227,732,500	
科研製薬	43,000	1,369.00	58,867,000	
エーザイ	136,000	3,855.00	524,280,000	

ロート製薬	46,000	1,134.00	52,164,000	
小野薬品工業	54,000	4,740.00	255,960,000	
久光製薬	34,300	4,605.00	157,951,500	
有機合成薬品工業	8,000	247.00	1,976,000	
持田製薬	42,000	1,131.00	47,502,000	
参天製薬	37,700	3,600.00	135,720,000	
扶桑薬品工業	37,000	351.00	12,987,000	
日本ケミファ	15,000	556.00	8,340,000	
ツムラ	30,100	2,900.00	87,290,000	
日医工	16,000	1,858.00	29,728,000	
キッセイ薬品工業	20,500	1,709.00	35,034,500	
生化学工業	21,100	991.00	20,910,100	
栄研化学	7,800	1,176.00	9,172,800	
日水製薬	4,400	951.00	4,184,400	
鳥居薬品	6,600	2,188.00	14,440,800	
東和薬品	5,600	5,000.00	28,000,000	
富士製薬工業	2,800	1,594.00	4,463,200	
沢井製薬	7,300	9,360.00	68,328,000	
ゼリア新薬工業	16,000	1,433.00	22,928,000	
第一三共	348,300	1,479.00	515,135,700	
キョーリン製薬ホールディングス	29,500	1,855.00	54,722,500	
大幸薬品	5,100	915.00	4,666,500	
ダイト	3,100	1,390.00	4,309,000	
大塚ホールディングス	219,200	2,716.00	595,347,200	
大正製薬ホールディングス	26,600	6,210.00	165,186,000	
日本コークス工業	89,000	126.00	11,214,000	
昭和シェル石油	98,700	519.00	51,225,300	
コスモ石油	305,000	207.00	63,135,000	
ニチレキ	13,000	513.00	6,669,000	
東燃ゼネラル石油	167,000	767.00	128,089,000	
ユシロ化学工業	6,000	907.00	5,442,000	
ビーピー・カストロール	4,500	377.00	1,696,500	
ＡＯＣホールディングス	25,600	403.00	10,316,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,100	794.00	1,667,400	
出光興産	13,100	7,820.00	102,442,000	
ＪＸホールディングス	1,225,900	519.00	636,242,100	
横浜ゴム	123,000	644.00	79,212,000	
東洋ゴム工業	92,000	281.00	25,852,000	

ブリヂストン	346,200	2,368.00	819,801,600	
住友ゴム工業	86,100	1,162.00	100,048,200	
藤倉ゴム工業	6,100	269.00	1,640,900	
オカモト	39,000	309.00	12,051,000	
フコク	4,600	827.00	3,804,200	
ニッタ	10,900	1,504.00	16,393,600	
東海ゴム工業	20,400	893.00	18,217,200	
三ツ星ベルト	28,000	486.00	13,608,000	
バンドー化学	38,000	295.00	11,210,000	
日東紡績	82,000	368.00	30,176,000	
旭硝子	544,000	596.00	324,224,000	
日本板硝子	503,000	104.00	52,312,000	
石塚硝子	14,000	147.00	2,058,000	
日本山村硝子	45,000	185.00	8,325,000	
日本電気硝子	196,000	441.00	86,436,000	
オハラ	4,200	678.00	2,847,600	
住友大阪セメント	196,000	302.00	59,192,000	
太平洋セメント	610,000	237.00	144,570,000	
デイ・シイ	12,900	332.00	4,282,800	
日本ヒューム	11,000	481.00	5,291,000	
日本コンクリート工業	19,000	331.00	6,289,000	
東海カーボン	96,000	363.00	34,848,000	
日本カーボン	59,000	178.00	10,502,000	
東洋炭素	5,400	1,857.00	10,027,800	
ノリタケカンパニーリミテド	57,000	225.00	12,825,000	
ＴＯＴＯ	170,000	705.00	119,850,000	
日本碍子	144,000	1,088.00	156,672,000	
日本特殊陶業	95,000	1,146.00	108,870,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,400	2,748.00	6,595,200	
品川リフラクトリーズ	29,000	203.00	5,887,000	
黒崎播磨	24,000	236.00	5,664,000	
東京窯業	13,000	164.00	2,132,000	
ニッカトー	3,900	434.00	1,692,600	
フジミインコーポレーテッド	10,100	1,522.00	15,372,200	
ニチアス	49,000	493.00	24,157,000	
ニチハ	12,400	1,084.00	13,441,600	
新日鐵住金	4,668,000	230.00	1,073,640,000	
神戸製鋼所	1,537,000	108.00	165,996,000	

合同製鐵	64,000	176.00	11,264,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	281,700	1,707.00	480,861,900	
日新製鋼ホールディングス	47,700	732.00	34,916,400	
東京製鐵	61,800	455.00	28,119,000	
共英製鋼	10,300	1,613.00	16,613,900	
大和工業	22,800	2,578.00	58,778,400	
東京鐵鋼	22,000	357.00	7,854,000	
大阪製鐵	5,500	1,598.00	8,789,000	
淀川製鋼所	78,000	315.00	24,570,000	
東洋鋼鈑	23,000	314.00	7,222,000	
住友鋼管	7,500	717.00	5,377,500	
丸一鋼管	36,900	2,000.00	73,800,000	
モリ工業	17,000	264.00	4,488,000	
大同特殊鋼	171,000	429.00	73,359,000	
日本高周波鋼業	43,000	92.00	3,956,000	
日本冶金工業	85,500	112.00	9,576,000	
山陽特殊製鋼	55,000	302.00	16,610,000	
愛知製鋼	59,000	390.00	23,010,000	
日立金属	78,000	776.00	60,528,000	
日本金属	29,000	131.00	3,799,000	
大平洋金属	71,000	390.00	27,690,000	
日本電工	43,000	258.00	11,094,000	
栗本鐵工所	48,000	343.00	16,464,000	
日本鋳鉄管	12,000	272.00	3,264,000	
三菱製鋼	67,000	173.00	11,591,000	
日亜鋼業	15,000	235.00	3,525,000	
日本精線	7,000	328.00	2,296,000	
シンニッタン	8,600	393.00	3,379,800	
新家工業	24,000	126.00	3,024,000	
大紀アルミニウム工業所	19,000	230.00	4,370,000	
日本軽金属ホールディングス	232,800	99.00	23,047,200	
三井金属鉱業	282,000	224.00	63,168,000	
東邦亜鉛	62,000	389.00	24,118,000	
三菱マテリアル	646,000	293.00	189,278,000	
住友金属鉱山	286,000	1,362.00	389,532,000	
ＤＯＷＡホールディングス	122,000	603.00	73,566,000	
古河機械金属	185,000	93.00	17,205,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,900	2,006.00	21,865,400	

東邦チタニウム	18,800	853.00	16,036,400	
住友軽金属工業	267,000	90.00	24,030,000	
古河スカイ	37,000	261.00	9,657,000	
古河電気工業	348,000	182.00	63,336,000	
住友電気工業	390,100	1,006.00	392,440,600	
フジクラ	178,000	266.00	47,348,000	
昭和電線ホールディングス	141,000	80.00	11,280,000	
タツタ電線	21,000	744.00	15,624,000	
日立電線	86,000	151.00	12,986,000	
沖電線	12,000	138.00	1,656,000	
カナレ電気	1,600	1,298.00	2,076,800	
平河ヒューテック	2,700	727.00	1,962,900	
リョービ	62,000	224.00	13,888,000	
アサヒホールディングス	16,700	1,557.00	26,001,900	
稲葉製作所	4,700	1,136.00	5,339,200	
トーカロ	6,500	1,358.00	8,827,000	
アルファＣｏ	4,400	969.00	4,263,600	
ＳＵＭＣＯ	68,800	963.00	66,254,400	
川田テクノロジーズ	3,100	1,700.00	5,270,000	
東洋製罐	78,600	1,171.00	92,040,600	
ホッカンホールディングス	30,000	264.00	7,920,000	
コロナ	5,100	1,190.00	6,069,000	
横河ブリッジホールディングス	22,000	781.00	17,182,000	
駒井ハルテック	26,000	264.00	6,864,000	
高田機工	12,000	219.00	2,628,000	
三和ホールディングス	103,000	428.00	44,084,000	
文化シヤッター	29,000	417.00	12,093,000	
三協立山	15,000	1,740.00	26,100,000	
東洋シヤッター	4,300	503.00	2,162,900	
ＬＩＸＩＬグループ	153,800	2,098.00	322,672,400	
日本フイルコン	9,500	379.00	3,600,500	
ノーリツ	21,700	1,575.00	34,177,500	
長府製作所	10,600	1,933.00	20,489,800	
リンナイ	17,800	6,280.00	111,784,000	
ダイニチ工業	6,100	996.00	6,075,600	
日東精工	16,000	285.00	4,560,000	
三洋工業	17,000	170.00	2,890,000	
岡部	22,100	625.00	13,812,500	

東プレ	21,500	864.00	18,576,000	
高周波熱錬	15,400	597.00	9,193,800	
東京製綱	75,000	138.00	10,350,000	
パイオラックス	4,800	2,151.00	10,324,800	
日本発條	80,000	766.00	61,280,000	
中央発條	16,000	303.00	4,848,000	
三益半導体工業	9,500	761.00	7,229,500	
アタカ大機	7,000	354.00	2,478,000	
日本製鋼所	170,000	538.00	91,460,000	
三浦工業	16,400	2,320.00	38,048,000	
タクマ	37,000	548.00	20,276,000	
ツガミ	29,000	538.00	15,602,000	
オークマ	72,000	618.00	44,496,000	
東芝機械	55,000	420.00	23,100,000	
アマダ	169,000	569.00	96,161,000	
アイダエンジニアリング	25,900	719.00	18,622,100	
牧野フライス製作所	52,000	595.00	30,940,000	
オーエスジー	45,400	1,118.00	50,757,200	
ダイジェット工業	15,000	157.00	2,355,000	
旭ダイヤモンド工業	27,200	857.00	23,310,400	
森精機製作所	58,700	788.00	46,255,600	
ディスコ	12,300	4,990.00	61,377,000	
日東工器	6,500	1,855.00	12,057,500	
豊和工業	66,000	98.00	6,468,000	
大阪機工	43,000	127.00	5,461,000	
東洋機械金属	10,100	215.00	2,171,500	
津田駒工業	27,000	150.00	4,050,000	
島精機製作所	14,400	1,412.00	20,332,800	
日阪製作所	14,000	807.00	11,298,000	
やまびこ	4,800	1,550.00	7,440,000	
ペガサスミシン製造	14,800	193.00	2,856,400	
ナブテスコ	54,600	1,827.00	99,754,200	
三井海洋開発	9,100	2,039.00	18,554,900	
レオン自動機	10,000	201.00	2,010,000	
ＳＭＣ	33,000	15,200.00	501,600,000	
新川	9,300	478.00	4,445,400	
ホソカワミクロン	19,000	694.00	13,186,000	
ユニオンツール	6,100	1,695.00	10,339,500	

オイレス工業	11,500	1,816.00	20,884,000	
サトーホールディングス	11,600	1,459.00	16,924,400	
日本エアーテック	3,500	385.00	1,347,500	
日精樹脂工業	8,900	422.00	3,755,800	
ワイエイシイ	5,700	498.00	2,838,600	
小松製作所	515,200	2,353.00	1,212,265,600	
住友重機械工業	302,000	425.00	128,350,000	
日立建機	56,400	1,913.00	107,893,200	
日工	15,000	387.00	5,805,000	
巴工業	4,200	1,787.00	7,505,400	
井関農機	105,000	253.00	26,565,000	
ＴＯＷＡ	10,900	618.00	6,736,200	
丸山製作所	26,000	179.00	4,654,000	
北川鉄工所	48,000	148.00	7,104,000	
クボタ	590,000	1,030.00	607,700,000	
荏原実業	2,600	1,226.00	3,187,600	
三菱化工機	34,000	162.00	5,508,000	
月島機械	18,000	816.00	14,688,000	
帝国電機製作所	3,700	1,600.00	5,920,000	
新東工業	22,300	707.00	15,766,100	
澁谷工業	6,900	874.00	6,030,600	
アイチ コーポレーション	18,300	458.00	8,381,400	
小森コーポレーション	26,900	837.00	22,515,300	
鶴見製作所	8,000	718.00	5,744,000	
住友精密工業	18,000	388.00	6,984,000	
酒井重工業	22,000	314.00	6,908,000	
荏原製作所	208,000	359.00	74,672,000	
石井鐵工所	18,000	175.00	3,150,000	
西島製作所	13,300	748.00	9,948,400	
ダイキン工業	144,000	3,225.00	464,400,000	
オルガノ	19,000	496.00	9,424,000	
トーヨーカネツ	59,000	197.00	11,623,000	
栗田工業	60,900	1,782.00	108,523,800	
椿本チエイン	56,000	471.00	26,376,000	
大同工業	25,000	146.00	3,650,000	
日本コンベヤ	34,000	83.00	2,822,000	
木村化工機	11,600	355.00	4,118,000	
アネスト岩田	17,000	369.00	6,273,000	

ダイフク	48,500	597.00	28,954,500	
加藤製作所	26,000	277.00	7,202,000	
油研工業	23,000	160.00	3,680,000	
タダノ	51,000	771.00	39,321,000	
フジテック	31,000	652.00	20,212,000	
ＣＫＤ	30,100	557.00	16,765,700	
キトー	70	79,000.00	5,530,000	
平和	23,200	1,530.00	35,496,000	
理想科学工業	7,600	1,686.00	12,813,600	
ＳＡＮＫＹＯ	32,000	3,665.00	117,280,000	
日本金銭機械	9,800	780.00	7,644,000	
マースエンジニアリング	6,000	1,822.00	10,932,000	
福島工業	2,900	1,902.00	5,515,800	
オーイズミ	5,400	328.00	1,771,200	
ダイコク電機	4,400	1,958.00	8,615,200	
アマノ	32,000	808.00	25,856,000	
サンデン	62,000	363.00	22,506,000	
マックス	17,000	1,080.00	18,360,000	
グローリー	31,500	2,015.00	63,472,500	
大和冷機工業	17,000	498.00	8,466,000	
セガサミーホールディングス	113,400	1,529.00	173,388,600	
日本ピストンリング	38,000	179.00	6,802,000	
リケン	38,000	327.00	12,426,000	
ＴＰＲ	12,300	1,132.00	13,923,600	
ホシザキ電機	23,100	2,539.00	58,650,900	
大豊工業	8,200	995.00	8,159,000	
日本精工	235,000	622.00	146,170,000	
ＮＴＮ	231,000	245.00	56,595,000	
ジェイテクト	112,600	931.00	104,830,600	
不二越	101,000	326.00	32,926,000	
日本トムソン	39,000	389.00	15,171,000	
ＴＨＫ	70,200	1,556.00	109,231,200	
ユーシン精機	5,300	1,677.00	8,888,100	
前澤給装工業	4,000	1,198.00	4,792,000	
イーグル工業	14,000	749.00	10,486,000	
前澤工業	11,500	260.00	2,990,000	
日本ピラー工業	11,000	673.00	7,403,000	
キッツ	43,500	438.00	19,053,000	

日立工機	28,300	730.00	20,659,000	
マキタ	64,200	4,155.00	266,751,000	
日立造船	417,500	138.00	57,615,000	
三菱重工業	1,768,000	485.00	857,480,000	
ＩＨＩ	721,000	239.00	172,319,000	
イビデン	64,300	1,374.00	88,348,200	
コニカミノルタホールディングス	278,500	676.00	188,266,000	
ブラザー工業	136,400	944.00	128,761,600	
ミネベア	144,000	286.00	41,184,000	
日立製作所	2,468,000	541.00	1,335,188,000	
東芝	2,082,000	367.00	764,094,000	
三菱電機	1,055,000	760.00	801,800,000	
富士電機	318,000	213.00	67,734,000	
東洋電機製造	21,000	242.00	5,082,000	
安川電機	116,000	842.00	97,672,000	
シンフォニアテクノロジー	64,000	180.00	11,520,000	
明電舎	104,000	291.00	30,264,000	
オリジン電気	15,000	420.00	6,300,000	
デンヨー	10,400	1,080.00	11,232,000	
東芝テック	66,000	500.00	33,000,000	
芝浦メカトロニクス	19,000	220.00	4,180,000	
マブチモーター	15,700	3,985.00	62,564,500	
日本電産	57,000	5,300.00	302,100,000	
東光高岳ホールディングス	5,400	1,509.00	8,148,600	
ダイヘン	58,000	286.00	16,588,000	
ヤーマン	900	1,273.00	1,145,700	
ＪＶＣケンウッド	63,900	327.00	20,895,300	
第一精工	3,300	1,309.00	4,319,700	
日新電機	21,000	464.00	9,744,000	
大崎電気工業	14,000	512.00	7,168,000	
オムロン	117,500	2,153.00	252,977,500	
日東工業	15,500	1,200.00	18,600,000	
ＩＤＥＣ	13,800	808.00	11,150,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	203,000	318.00	64,554,000	
サクサホールディングス	27,000	174.00	4,698,000	
メルコホールディングス	6,600	1,512.00	9,979,200	
テクノメディカ	8	498,500.00	3,988,000	
日本電気	1,365,000	218.00	297,570,000	

富士通	1,017,000	351.00	356,967,000	
沖電気工業	384,000	104.00	39,936,000	
岩崎通信機	46,000	78.00	3,588,000	
電気興業	28,000	364.00	10,192,000	
サンケン電気	54,000	378.00	20,412,000	
ナカヨ通信機	10,000	267.00	2,670,000	
アイホン	6,100	1,483.00	9,046,300	
ルネサスエレクトロニクス	27,300	290.00	7,917,000	
セイコーエプソン	72,000	871.00	62,712,000	
ワコム	194	261,900.00	50,808,600	
アルバック	21,000	856.00	17,976,000	
アクセル	5,300	2,084.00	11,045,200	
ナナオ	9,000	1,402.00	12,618,000	
日本信号	26,600	659.00	17,529,400	
京三製作所	23,000	310.00	7,130,000	
能美防災	14,000	659.00	9,226,000	
ホーチキ	10,000	437.00	4,370,000	
日本無線	23,000	245.00	5,635,000	
パナソニック	1,205,100	607.00	731,495,700	
シャープ	546,000	331.00	180,726,000	
アンリツ	57,000	1,115.00	63,555,000	
富士通ゼネラル	25,000	850.00	21,250,000	
日立国際電気	24,000	650.00	15,600,000	
ソニー	662,800	1,187.00	786,743,600	
ＴＤＫ	59,400	3,305.00	196,317,000	
帝国通信工業	25,000	161.00	4,025,000	
ミツミ電機	40,200	516.00	20,743,200	
タムラ製作所	41,000	203.00	8,323,000	
アルプス電気	77,400	513.00	39,706,200	
パイオニア	128,300	224.00	28,739,200	
日本電波工業	8,900	1,152.00	10,252,800	
日本トリム	1,400	2,808.00	3,931,200	
ローランド ディー．ジー．	4,700	1,167.00	5,484,900	
フォスター電機	10,800	1,370.00	14,796,000	
クラリオン	56,000	150.00	8,400,000	
ＳＭＫ	31,000	229.00	7,099,000	
ヨコオ	8,300	411.00	3,411,300	
東光	53,000	228.00	12,084,000	

ホシデン	28,700	557.00	15,985,900	
ヒロセ電機	18,400	10,660.00	196,144,000	
日本航空電子工業	24,000	629.00	15,096,000	
ＴＯＡ	12,000	695.00	8,340,000	
ユニデン	31,000	228.00	7,068,000	
アルパイン	20,600	849.00	17,489,400	
スミダコーポレーション	6,600	542.00	3,577,200	
アイコム	5,900	1,979.00	11,676,100	
リオン	2,400	671.00	1,610,400	
船井電機	10,700	1,042.00	11,149,400	
横河電機	105,600	1,006.00	106,233,600	
新電元工業	34,000	273.00	9,282,000	
アズビル	29,500	1,794.00	52,923,000	
日本光電工業	21,000	2,913.00	61,173,000	
チノー	19,000	218.00	4,142,000	
共和電業	12,000	251.00	3,012,000	
日本電子材料	4,600	397.00	1,826,200	
堀場製作所	20,900	2,626.00	54,883,400	
アドバンテスト	71,900	1,364.00	98,071,600	
小野測器	12,000	407.00	4,884,000	
エスペック	11,000	709.00	7,799,000	
パナソニック デバイスＳＵＮＸ	9,400	382.00	3,590,800	
キーエンス	25,900	24,520.00	635,068,000	
日置電機	5,600	1,370.00	7,672,000	
シスメックス	37,200	4,230.00	157,356,000	
メガチップス	8,700	1,624.00	14,128,800	
ＯＢＡＲＡ ＧＲＯＵＰ	7,600	1,026.00	7,797,600	
日本電産コパル電子	11,000	434.00	4,774,000	
ミヤチテクノス	4,800	670.00	3,216,000	
東京電波	3,200	426.00	1,363,200	
澤藤電機	7,000	250.00	1,750,000	
コーセル	15,400	1,079.00	16,616,600	
日立メディコ	8,000	1,372.00	10,976,000	
新日本無線	8,000	220.00	1,760,000	
オプテックス	6,700	999.00	6,693,300	
千代田インテグレ	5,200	932.00	4,846,400	
スタンレー電気	82,100	1,322.00	108,536,200	
岩崎電気	39,000	227.00	8,853,000	

ウシオ電機	64,100	969.00	62,112,900	
岡谷電機産業	5,800	340.00	1,972,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	9,300	191.00	1,776,300	
日本セラミック	6,900	1,404.00	9,687,600	
日本デジタル研究所	8,900	1,022.00	9,095,800	
古河電池	8,000	504.00	4,032,000	
双信電機	5,300	335.00	1,775,500	
山一電機	11,400	158.00	1,801,200	
図研	6,200	589.00	3,651,800	
日本電子	39,000	272.00	10,608,000	
カシオ計算機	100,600	790.00	79,474,000	
ファナック	109,800	14,350.00	1,575,630,000	
日本シイエムケイ	22,900	329.00	7,534,100	
エンプラス	4,700	3,580.00	16,826,000	
ローム	55,700	2,971.00	165,484,700	
浜松ホトニクス	41,200	3,190.00	131,428,000	
三井ハイテック	15,400	675.00	10,395,000	
新光電気工業	35,500	714.00	25,347,000	
京セラ	87,700	8,280.00	726,156,000	
太陽誘電	51,400	813.00	41,788,200	
村田製作所	110,700	5,380.00	595,566,000	
ユーシン	14,800	602.00	8,909,600	
双葉電子工業	19,600	953.00	18,678,800	
北陸電気工業	42,000	116.00	4,872,000	
ニチコン	33,300	762.00	25,374,600	
日本ケミコン	61,000	195.00	11,895,000	
ＫＯＡ	13,300	704.00	9,363,200	
市光工業	26,000	146.00	3,796,000	
小糸製作所	53,000	1,311.00	69,483,000	
ミツバ	20,000	592.00	11,840,000	
スター精密	18,600	889.00	16,535,400	
大日本スクリーン製造	108,000	462.00	49,896,000	
キヤノン電子	9,700	1,956.00	18,973,200	
キヤノン	655,200	3,330.00	2,181,816,000	
リコー	317,000	1,068.00	338,556,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	15,000	242.00	3,630,000	
東京エレクトロン	88,700	4,110.00	364,557,000	
トヨタ紡織	36,900	1,127.00	41,586,300	

鬼怒川ゴム工業	20,000	494.00	9,880,000	
ユニプレス	18,500	1,917.00	35,464,500	
豊田自動織機	96,000	2,938.00	282,048,000	
モリタホールディングス	18,000	773.00	13,914,000	
三櫻工業	13,400	607.00	8,133,800	
デンソー	260,600	3,290.00	857,374,000	
東海理化電機製作所	24,700	1,290.00	31,863,000	
三井造船	408,000	141.00	57,528,000	
佐世保重工業	69,000	108.00	7,452,000	
川崎重工業	821,000	252.00	206,892,000	
日本車輌製造	38,000	364.00	13,832,000	
日本輸送機	14,000	465.00	6,510,000	
近畿車輛	18,000	329.00	5,922,000	
日産自動車	1,332,500	865.00	1,152,612,500	
いすゞ自動車	611,000	541.00	330,551,000	
トヨタ自動車	1,355,000	4,280.00	5,799,400,000	
日野自動車	132,000	885.00	116,820,000	
三菱自動車工業	2,497,000	92.00	229,724,000	
エフテック	3,700	1,258.00	4,654,600	
武蔵精密工業	11,200	1,796.00	20,115,200	
日産車体	36,000	1,129.00	40,644,000	
新明和工業	43,000	582.00	25,026,000	
極東開発工業	19,600	973.00	19,070,800	
日信工業	21,400	1,326.00	28,376,400	
トピー工業	79,000	214.00	16,906,000	
ティラド	36,000	226.00	8,136,000	
曙ブレーキ工業	49,000	449.00	22,001,000	
タチエス	14,200	1,537.00	21,825,400	
ＮＯＫ	51,000	1,343.00	68,493,000	
フタバ産業	32,100	397.00	12,743,700	
カヤバ工業	80,000	366.00	29,280,000	
シロキ工業	23,000	230.00	5,290,000	
大同メタル工業	15,000	791.00	11,865,000	
プレス工業	45,000	379.00	17,055,000	
カルソニックカンセイ	72,000	375.00	27,000,000	
太平洋工業	21,500	487.00	10,470,500	
ケーヒン	21,800	1,209.00	26,356,200	
河西工業	13,000	431.00	5,603,000	

アイシン精機	96,500	2,824.00	272,516,000	
富士機工	12,000	309.00	3,708,000	
マツダ	1,670,000	217.00	362,390,000	
ダイハツ工業	112,000	1,790.00	200,480,000	
今仙電機製作所	7,700	1,087.00	8,369,900	
本田技研工業	889,800	3,420.00	3,043,116,000	
スズキ	220,500	2,351.00	518,395,500	
富士重工業	333,000	1,127.00	375,291,000	
ヤマハ発動機	160,400	1,079.00	173,071,600	
ショーワ	24,900	887.00	22,086,300	
ＴＢＫ	11,000	483.00	5,313,000	
エクセディ	14,300	1,974.00	28,228,200	
豊田合成	29,800	1,981.00	59,033,800	
愛三工業	10,900	776.00	8,458,400	
ヨロズ	7,700	1,319.00	10,156,300	
エフ・シー・シー	17,200	1,867.00	32,112,400	
シマノ	42,500	5,840.00	248,200,000	
タカタ	19,100	1,814.00	34,647,400	
テイ・エス テック	22,300	1,630.00	36,349,000	
日本電産トーソク	5,000	684.00	3,420,000	
テルモ	80,800	3,520.00	284,416,000	
クリエートメディック	3,200	815.00	2,608,000	
日機装	37,000	880.00	32,560,000	
島津製作所	126,000	635.00	80,010,000	
ＪＭＳ	16,000	346.00	5,536,000	
モリテックス	2,300	290.00	667,000	
長野計器	7,500	699.00	5,242,500	
ブイ・テクノロジー	22	281,600.00	6,195,200	
東京計器	34,000	166.00	5,644,000	
愛知時計電機	12,000	289.00	3,468,000	
東京精密	18,900	1,565.00	29,578,500	
マニー	3,200	3,310.00	10,592,000	
ニコン	196,900	2,634.00	518,634,600	
トプコン	21,300	751.00	15,996,300	
オリンパス	124,400	1,862.00	231,632,800	
理研計器	8,600	557.00	4,790,200	
タムロン	8,100	2,572.00	20,833,200	
ＨＯＹＡ	256,500	1,778.00	456,057,000	

ノーリツ鋼機	9,600	401.00	3,849,600	
エー・アンド・デイ	9,600	352.00	3,379,200	
日本電産コパル	8,300	740.00	6,142,000	
シチズンホールディングス	119,100	484.00	57,644,400	
リズム時計工業	48,000	173.00	8,304,000	
大研医器	1,300	1,970.00	2,561,000	
松風	5,200	805.00	4,186,000	
セイコーホールディングス	67,000	283.00	18,961,000	
ニプロ	56,200	681.00	38,272,200	
パラマウントベッドホールディングス	9,100	2,909.00	26,471,900	
ＳＨＯ－ＢＩ	3,300	397.00	1,310,100	
前田工繊	1,000	2,378.00	2,378,000	
永大産業	14,000	363.00	5,082,000	
ダンロップスポーツ	5,700	1,002.00	5,711,400	
バンダイナムコホールディングス	109,100	1,220.00	133,102,000	
共立印刷	16,400	253.00	4,149,200	
フランスベッドホールディングス	66,000	181.00	11,946,000	
パイロットコーポレーション	92	184,600.00	16,983,200	
トッパン・フォームズ	18,900	815.00	15,403,500	
フジシールインターナショナル	12,800	1,934.00	24,755,200	
タカラトミー	36,100	481.00	17,364,100	
廣済堂	9,000	334.00	3,006,000	
タカノ	4,700	445.00	2,091,500	
プロネクサス	12,300	514.00	6,322,200	
ホクシン	7,400	190.00	1,406,000	
ウッドワン	20,000	307.00	6,140,000	
大建工業	44,000	253.00	11,132,000	
凸版印刷	298,000	552.00	164,496,000	
大日本印刷	321,000	702.00	225,342,000	
図書印刷	17,000	144.00	2,448,000	
共同印刷	33,000	258.00	8,514,000	
日本写真印刷	16,700	1,437.00	23,997,900	
光村印刷	10,000	265.00	2,650,000	
宝印刷	6,000	624.00	3,744,000	
アシックス	98,300	1,275.00	125,332,500	
ツツミ	5,300	2,284.00	12,105,200	
ローランド	10,100	765.00	7,726,500	
小松ウオール工業	4,000	1,323.00	5,292,000	

ヤマハ	77,600	938.00	72,788,800	
河合楽器製作所	40,000	169.00	6,760,000	
クリナップ	10,800	679.00	7,333,200	
ピジョン	8,000	4,620.00	36,960,000	
兼松日産農林	16,000	157.00	2,512,000	
キングジム	8,800	658.00	5,790,400	
リンテック	22,600	1,601.00	36,182,600	
イトーキ	23,700	454.00	10,759,800	
任天堂	60,300	9,210.00	555,363,000	
三菱鉛筆	8,700	1,548.00	13,467,600	
タカラスタンダード	49,000	649.00	31,801,000	
コクヨ	54,900	625.00	34,312,500	
ナカバヤシ	22,000	184.00	4,048,000	
グローブライド	51,000	114.00	5,814,000	
岡村製作所	41,000	623.00	25,543,000	
美津濃	52,000	412.00	21,424,000	
アデランス	13,200	1,091.00	14,401,200	
東京電力	894,700	212.00	189,676,400	
中部電力	322,700	1,160.00	374,332,000	
関西電力	430,400	887.00	381,764,800	
中国電力	145,800	1,339.00	195,226,200	
北陸電力	103,300	1,046.00	108,051,800	
東北電力	263,500	799.00	210,536,500	
四国電力	95,000	1,292.00	122,740,000	
九州電力	232,900	963.00	224,282,700	
北海道電力	98,700	1,022.00	100,871,400	
沖縄電力	6,300	3,030.00	19,089,000	
電源開発	65,500	2,134.00	139,777,000	
東京瓦斯	1,266,000	433.00	548,178,000	
大阪瓦斯	1,023,000	333.00	340,659,000	
東邦瓦斯	268,000	505.00	135,340,000	
北海道瓦斯	19,000	241.00	4,579,000	
西部瓦斯	119,000	219.00	26,061,000	
静岡瓦斯	27,500	642.00	17,655,000	
東武鉄道	599,000	482.00	288,718,000	
相鉄ホールディングス	169,000	305.00	51,545,000	
東京急行電鉄	621,000	499.00	309,879,000	
京浜急行電鉄	271,000	777.00	210,567,000	

小田急電鉄	338,000	904.00	305,552,000	
京王電鉄	295,000	665.00	196,175,000	
京成電鉄	158,000	769.00	121,502,000	
富士急行	29,000	524.00	15,196,000	
新京成電鉄	14,000	360.00	5,040,000	
東日本旅客鉄道	194,500	5,950.00	1,157,275,000	
西日本旅客鉄道	90,900	3,510.00	319,059,000	
東海旅客鉄道	87,700	7,460.00	654,242,000	
西日本鉄道	136,000	355.00	48,280,000	
ハマキョウレックス	3,000	2,812.00	8,436,000	
サカイ引越センター	1,900	1,944.00	3,693,600	
近畿日本鉄道	953,000	381.00	363,093,000	
阪急阪神ホールディングス	666,000	485.00	323,010,000	
南海電気鉄道	220,000	414.00	91,080,000	
京阪電気鉄道	236,000	402.00	94,872,000	
名糖運輸	4,300	622.00	2,674,600	
名古屋鉄道	368,000	241.00	88,688,000	
日本通運	417,000	363.00	151,371,000	
ヤマトホールディングス	199,300	1,420.00	283,006,000	
山九	128,000	348.00	44,544,000	
丸運	5,700	215.00	1,225,500	
丸全昭和運輸	35,000	261.00	9,135,000	
センコー	42,000	417.00	17,514,000	
トナミホールディングス	22,000	192.00	4,224,000	
日本梱包運輸倉庫	34,000	1,126.00	38,284,000	
日本石油輸送	12,000	205.00	2,460,000	
福山通運	64,000	466.00	29,824,000	
セイノーホールディングス	82,000	610.00	50,020,000	
神奈川中央交通	12,000	475.00	5,700,000	
日立物流	18,300	1,366.00	24,997,800	
日本郵船	837,000	220.00	184,140,000	
商船三井	519,000	300.00	155,700,000	
川崎汽船	472,000	169.00	79,768,000	
ＮＳユナイテッド海運	45,000	151.00	6,795,000	
乾汽船	13,800	326.00	4,498,800	
飯野海運	52,800	426.00	22,492,800	
共栄タンカー	19,000	211.00	4,009,000	
日本航空	89,100	3,655.00	325,660,500	

全日本空輸	2,073,000	179.00	371,067,000	
パスコ	10,000	298.00	2,980,000	
日新	40,000	222.00	8,880,000	
三菱倉庫	75,000	1,303.00	97,725,000	
三井倉庫	49,000	377.00	18,473,000	
住友倉庫	71,000	446.00	31,666,000	
澁澤倉庫	27,000	276.00	7,452,000	
東陽倉庫	17,000	210.00	3,570,000	
日本トランスシティ	24,000	344.00	8,256,000	
ケイヒン	19,000	127.00	2,413,000	
安田倉庫	8,200	633.00	5,190,600	
東洋埠頭	30,000	149.00	4,470,000	
宇徳	8,500	263.00	2,235,500	
上組	117,000	704.00	82,368,000	
サンリツ	2,800	581.00	1,626,800	
キムラユニティー	2,400	822.00	1,972,800	
キユーソー流通システム	2,900	931.00	2,699,900	
郵船ロジスティクス	8,300	908.00	7,536,400	
近鉄エクスプレス	9,400	2,931.00	27,551,400	
東海運	5,700	260.00	1,482,000	
エーアイテイー	800	1,604.00	1,283,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	9,800	1,653.00	16,199,400	
システナ	111	77,500.00	8,602,500	
新日鉄住金ソリューションズ	7,000	1,664.00	11,648,000	
コア	3,900	743.00	2,897,700	
ソフトクリエイトホールディングス	1,100	1,460.00	1,606,000	
デジタルハーツ	2,000	697.00	1,394,000	
ＩＴホールディングス	34,500	1,228.00	42,366,000	
ネオス	21	60,100.00	1,262,100	
電算システム	1,200	1,210.00	1,452,000	
グリー	53,700	1,453.00	78,026,100	
コーエーテクモホールディングス	20,600	748.00	15,408,800	
三菱総合研究所	4,100	1,902.00	7,798,200	
ボルテージ	1,700	932.00	1,584,400	
ＫＬａｂ	3,200	478.00	1,529,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,600	1,544.00	2,470,400	
ネクソン	85,400	908.00	77,543,200	
アイスタイル	1,700	748.00	1,271,600	

エイチーム	700	2,728.00	1,909,600	
ドワンゴ	54	214,100.00	11,561,400	
ベリサーブ	6	138,900.00	833,400	
マクロミル	10,200	1,000.00	10,200,000	
ティーガイア	13,000	879.00	11,427,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,400	1,311.00	4,457,400	
ザッパラス	58	97,300.00	5,643,400	
インターネットイニシアティブ	12,200	2,142.00	26,132,400	
ＳＲＡホールディングス	5,000	971.00	4,855,000	
朝日ネット	9,000	447.00	4,023,000	
パナソニック インフォメーションシステムズ	2,500	2,010.00	5,025,000	
フェイス	357	9,410.00	3,359,370	
野村総合研究所	59,000	1,871.00	110,389,000	
サイバネットシステム	86	25,130.00	2,161,180	
インテージ	3,100	2,083.00	6,457,300	
シンプレクス・ホールディングス	195	29,560.00	5,764,200	
ソースネクスト	2,600	384.00	998,400	
クレスコ	2,400	631.00	1,514,400	
フジ・メディア・ホールディングス	1,007	138,400.00	139,368,800	
オービック	3,590	18,360.00	65,912,400	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	2,100	805.00	1,690,500	
ヤフー	7,625	31,100.00	237,137,500	
トレンドマイクロ	41,400	2,602.00	107,722,800	
日本オラクル	20,800	3,700.00	76,960,000	
アルファシステムズ	3,400	1,155.00	3,927,000	
フューチャーアーキテクト	126	34,900.00	4,397,400	
シーエーシー	6,400	740.00	4,736,000	
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	844.00	2,110,000	
トーセ	2,600	565.00	1,469,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,300	5,130.00	16,929,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	12,300	3,795.00	46,678,500	
アイティフォー	11,700	351.00	4,106,700	
東計電算	1,900	1,242.00	2,359,800	
エックスネット	10	121,400.00	1,214,000	
大塚商会	9,300	7,240.00	67,332,000	
サイボウズ	174	26,500.00	4,611,000	
ソフトブレーン	155	12,050.00	1,867,750	
アグレックス	2,800	802.00	2,245,600	

電通国際情報サービス	6,500	838.00	5,447,000	
ＥＭシステムズ	1,600	1,775.00	2,840,000	
ウェザーニューズ	2,700	2,460.00	6,642,000	
ＣＩＪ	10,500	346.00	3,633,000	
WOWOW	32	197,500.00	6,320,000	
ネットワンシステムズ	37,900	886.00	33,579,400	
アルゴグラフィックス	3,800	1,195.00	4,541,000	
マーベラスＡＱＬ	120	33,250.00	3,990,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	19,700	2,000.00	39,400,000	
日本ユニシス	28,800	651.00	18,748,800	
兼松エレクトロニクス	6,600	1,053.00	6,949,800	
東京放送ホールディングス	56,200	961.00	54,008,200	
日本テレビホールディングス	95,100	1,230.00	116,973,000	
テレビ朝日	26,400	1,293.00	34,135,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	904	40,350.00	36,476,400	
テレビ東京ホールディングス	7,600	962.00	7,311,200	
アイ・ティー・シーネットワーク	9,200	671.00	6,173,200	
ＮＥＣモバイリング	3,800	3,740.00	14,212,000	
日本電信電話	438,300	3,800.00	1,665,540,000	
ＫＤＤＩ	146,900	6,200.00	910,780,000	
光通信	10,500	4,010.00	42,105,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	8,577	132,100.00	1,133,021,700	
GMOインターネット	34,800	587.00	20,427,600	
学研ホールディングス	31,000	310.00	9,610,000	
ゼンリン	13,800	1,187.00	16,380,600	
昭文社	6,300	588.00	3,704,400	
角川グループホールディングス	8,900	2,524.00	22,463,600	
インプレスホールディングス	8,600	140.00	1,204,000	
アイネット	4,500	680.00	3,060,000	
松竹	69,000	987.00	68,103,000	
東宝	74,300	1,653.00	122,817,900	
東映	44,000	470.00	20,680,000	
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	4,900	587.00	2,876,300	
エヌ・ティ・ティ・データ	643	269,000.00	172,967,000	
ＤＴＳ	9,900	1,111.00	10,998,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,800	1,090.00	41,202,000	
シーイーシー	6,800	568.00	3,862,400	
カプコン	20,000	1,435.00	28,700,000	

ジャステック	6,100	550.00	3,355,000	
ＳＣＳＫ	24,800	1,662.00	41,217,600	
日本システムウエア	4,000	363.00	1,452,000	
アイネス	14,200	628.00	8,917,600	
ＴＫＣ	9,700	1,530.00	14,841,000	
富士ソフト	14,800	1,849.00	27,365,200	
ＮＳＤ	20,600	865.00	17,819,000	
コナミ	47,000	1,762.00	82,814,000	
福井コンピュータホールディングス	1,500	555.00	832,500	
ＪＢＣＣホールディングス	8,800	674.00	5,931,200	
ミロク情報サービス	7,000	342.00	2,394,000	
ソフトバンク	497,700	2,968.00	1,477,173,600	
ホウスイ	8,000	116.00	928,000	
高千穂交易	4,400	896.00	3,942,400	
伊藤忠食品	2,600	3,075.00	7,995,000	
エレマテック	4,900	1,188.00	5,821,200	
ＪＡＬＵＸ	3,000	882.00	2,646,000	
あらた	23,000	341.00	7,843,000	
トーメンデバイス	1,600	1,815.00	2,904,000	
東京エレクトロン デバイス	21	148,300.00	3,114,300	
双日	655,800	136.00	89,188,800	
アルフレッサ ホールディングス	26,900	3,780.00	101,682,000	
横浜冷凍	25,800	629.00	16,228,200	
神栄	13,000	124.00	1,612,000	
山下医科器械	900	1,286.00	1,157,400	
ラサ商事	4,500	429.00	1,930,500	
アルコニックス	2,900	1,520.00	4,408,000	
あい ホールディングス	16,700	642.00	10,721,400	
ダイワボウホールディングス	95,000	187.00	17,765,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,600	910.00	17,836,000	
八洲電機	7,600	371.00	2,819,600	
ＵＫＣホールディングス	6,200	1,650.00	10,230,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	40,800	287.00	11,709,600	
ミタチ産業	2,500	454.00	1,135,000	
シップヘルスケアホールディングス	14,900	2,614.00	38,948,600	
富士興産	3,700	544.00	2,012,800	
協栄産業	13,000	157.00	2,041,000	
小野建	9,100	850.00	7,735,000	

佐鳥電機	7,700	441.00	3,395,700	
エコートレーディング	2,600	823.00	2,139,800	
伯東	6,400	833.00	5,331,200	
コンドーテック	8,400	494.00	4,149,600	
中山福	6,000	664.00	3,984,000	
ナガイレーベン	13,800	1,147.00	15,828,600	
三菱食品	11,400	2,469.00	28,146,600	
松田産業	7,600	1,176.00	8,937,600	
メディパルホールディングス	104,100	1,106.00	115,134,600	
アドヴァン	5,300	899.00	4,764,700	
ＳＰＫ	2,400	1,492.00	3,580,800	
アズワン	6,800	1,854.00	12,607,200	
スズデン	3,400	490.00	1,666,000	
尾家産業	3,400	843.00	2,866,200	
シモジマ	6,400	993.00	6,355,200	
ドウシシャ	5,500	2,366.00	13,013,000	
高速	6,200	786.00	4,873,200	
黒田電気	13,900	1,055.00	14,664,500	
丸文	9,300	443.00	4,119,900	
ハピネット	6,300	708.00	4,460,400	
トーメンエレクトロニクス	5,300	1,182.00	6,264,600	
エクセル	4,500	780.00	3,510,000	
マルカキカイ	3,400	1,149.00	3,906,600	
ガリバーインターナショナル	3,510	3,925.00	13,776,750	
日本エム・ディ・エム	9,600	263.00	2,524,800	
進和	6,200	1,100.00	6,820,000	
エスケイジャパン	2,600	281.00	730,600	
ダイトエレクトロン	4,800	359.00	1,723,200	
シークス	6,600	1,052.00	6,943,200	
田中商事	3,500	479.00	1,676,500	
オーハシテクニカ	5,600	656.00	3,673,600	
マクニカ	5,400	1,755.00	9,477,000	
白銅	3,400	829.00	2,818,600	
伊藤忠商事	830,500	977.00	811,398,500	
丸紅	854,000	640.00	546,560,000	
高島	20,000	313.00	6,260,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	8,000	1,025.00	8,200,000	
長瀬産業	59,000	939.00	55,401,000	

蝶理	6,700	966.00	6,472,200	
豊田通商	116,000	2,227.00	258,332,000	
三共生興	17,800	314.00	5,589,200	
兼松	221,000	132.00	29,172,000	
ツカモトコーポレーション	17,000	150.00	2,550,000	
三井物産	898,600	1,335.00	1,199,631,000	
日本紙パルプ商事	54,000	307.00	16,578,000	
日立ハイテクノロジーズ	31,600	1,932.00	61,051,200	
カメイ	12,000	815.00	9,780,000	
東都水産	19,000	142.00	2,698,000	
スターゼン	35,000	258.00	9,030,000	
山善	40,000	705.00	28,200,000	
椿本興業	12,000	247.00	2,964,000	
住友商事	614,300	1,135.00	697,230,500	
内田洋行	22,000	254.00	5,588,000	
三菱商事	812,300	1,825.00	1,482,447,500	
第一実業	24,000	422.00	10,128,000	
キヤノンマーケティングジャパン	34,700	1,284.00	44,554,800	
西華産業	37,000	257.00	9,509,000	
佐藤商事	9,300	606.00	5,635,800	
菱洋エレクトロ	12,300	846.00	10,405,800	
東京産業	10,500	284.00	2,982,000	
ユアサ商事	106,000	173.00	18,338,000	
神鋼商事	26,000	179.00	4,654,000	
阪和興業	104,000	342.00	35,568,000	
カナデン	10,000	541.00	5,410,000	
菱電商事	15,000	566.00	8,490,000	
フルサト工業	5,600	791.00	4,429,600	
岩谷産業	115,000	340.00	39,100,000	
すてきナイスグループ	41,000	248.00	10,168,000	
昭光通商	37,000	141.00	5,217,000	
ニチモウ	15,000	203.00	3,045,000	
極東貿易	12,000	167.00	2,004,000	
イワキ	16,000	179.00	2,864,000	
三愛石油	24,000	369.00	8,856,000	
稲畑産業	25,700	616.00	15,831,200	
ＧＳＩクレオス	28,000	172.00	4,816,000	
明和産業	8,300	468.00	3,884,400	

東邦ホールディングス	33,300	1,756.00	58,474,800	
サンゲツ	18,400	2,226.00	40,958,400	
ミツウロコグループホールディングス	16,800	497.00	8,349,600	
シナネン	22,000	373.00	8,206,000	
伊藤忠エネクス	23,000	468.00	10,764,000	
サンリオ	26,300	3,255.00	85,606,500	
サンワテクノス	5,100	650.00	3,315,000	
リョーサン	17,000	1,603.00	27,251,000	
新光商事	11,400	786.00	8,960,400	
トーホー	22,000	332.00	7,304,000	
三信電気	14,900	598.00	8,910,200	
東陽テクニカ	15,100	1,035.00	15,628,500	
モスフードサービス	13,600	1,663.00	22,616,800	
加賀電子	10,400	771.00	8,018,400	
ソーダニッカ	11,000	380.00	4,180,000	
立花エレテック	6,300	731.00	4,605,300	
Ｐａｌｔａｃ	11,600	1,104.00	12,806,400	
ヤマタネ	48,000	142.00	6,816,000	
丸紅建材リース	9,000	176.00	1,584,000	
日鐵商事	23,000	241.00	5,543,000	
トラスコ中山	11,900	1,660.00	19,754,000	
オートバックスセブン	12,800	3,665.00	46,912,000	
加藤産業	15,000	1,661.00	24,915,000	
イノテック	9,000	460.00	4,140,000	
イエローハット	9,800	1,390.00	13,622,000	
富士エレクトロニクス	5,400	1,208.00	6,523,200	
ＪＫホールディングス	8,800	459.00	4,039,200	
日伝	4,700	2,159.00	10,147,300	
北沢産業	8,000	171.00	1,368,000	
杉本商事	5,600	797.00	4,463,200	
因幡電機産業	12,300	2,676.00	32,914,800	
住金物産	54,000	256.00	13,824,000	
バイテック	2,400	647.00	1,552,800	
ミスミグループ本社	38,700	2,374.00	91,873,800	
江守商事	2,400	968.00	2,323,200	
アルテック	5,100	210.00	1,071,000	
タキヒヨー	16,000	456.00	7,296,000	
スズケン	40,000	2,734.00	109,360,000	

ジェコス	7,200	670.00	4,824,000	
ローソン	39,400	6,200.00	244,280,000	
サンエー	3,900	3,565.00	13,903,500	
キリン堂	3,700	642.00	2,375,400	
ダイユーエイト	2,100	667.00	1,400,700	
カワチ薬品	7,300	1,823.00	13,307,900	
エービーシー・マート	12,300	3,380.00	41,574,000	
ハードオフコーポレーション	5,100	624.00	3,182,400	
アスクル	7,200	1,272.00	9,158,400	
ゲオホールディングス	178	93,800.00	16,696,400	
ポイント	9,600	3,030.00	29,088,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	13,000	90.00	1,170,000	
くらコーポレーション	6,100	1,239.00	7,557,900	
キャンドゥ	55	106,600.00	5,863,000	
パル	3,050	4,025.00	12,276,250	
エディオン	45,000	416.00	18,720,000	
サーラコーポレーション	9,000	498.00	4,482,000	
あみやき亭	18	202,300.00	3,641,400	
ひらまつ	36	126,400.00	4,550,400	
ゲンキー	1,000	1,851.00	1,851,000	
大黒天物産	1,800	2,313.00	4,163,400	
ハニーズ	9,160	1,152.00	10,552,320	
アルペン	8,000	1,551.00	12,408,000	
ビックカメラ	396	44,350.00	17,562,600	
ＤＣＭホールディングス	53,900	614.00	33,094,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	7,000	2,818.00	19,726,000	
Ｊ．フロント リテイリング	246,000	502.00	123,492,000	
ドトール・日レスホールディングス	18,200	1,177.00	21,421,400	
マツモトキヨシホールディングス	17,600	2,163.00	38,068,800	
ブロンコビリー	700	2,340.00	1,638,000	
スタートトゥデイ	21,600	750.00	16,200,000	
物語コーポレーション	1,300	2,185.00	2,840,500	
ココカラファイン	10,900	2,980.00	32,482,000	
三越伊勢丹ホールディングス	206,900	882.00	182,485,800	
ウエルシアホールディングス	3,600	3,165.00	11,394,000	
クリエイトＳＤホールディングス	4,400	2,872.00	12,636,800	
丸善ＣＨＩホールディングス	6,100	293.00	1,787,300	
ブックオフコーポレーション	5,800	689.00	3,996,200	

あさひ	6,000	1,249.00	7,494,000	
日本調剤	1,320	2,385.00	3,148,200	
コスモス薬品	4,600	10,020.00	46,092,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	435,500	2,683.00	1,168,446,500	
ツルハホールディングス	8,600	7,330.00	63,038,000	
サンマルクホールディングス	3,400	3,300.00	11,220,000	
フェリシモ	3,000	1,052.00	3,156,000	
トリドール	9,000	1,018.00	9,162,000	
クスリのアオキ	1,500	4,885.00	7,327,500	
メディカルシステムネットワーク	5,800	424.00	2,459,200	
総合メディカル	2,500	3,100.00	7,750,000	
はるやま商事	4,400	494.00	2,173,600	
カッパ・クリエイトホールディングス	7,650	1,995.00	15,261,750	
ライトオン	7,800	680.00	5,304,000	
良品計画	11,000	5,350.00	58,850,000	
三城ホールディングス	12,900	472.00	6,088,800	
コナカ	12,300	651.00	8,007,300	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,337.00	1,604,400	
Ｇ－７ホールディングス	3,100	475.00	1,472,500	
イオン北海道	6,500	496.00	3,224,000	
コジマ	15,400	316.00	4,866,400	
ヒマラヤ	3,100	728.00	2,256,800	
コーナン商事	13,600	1,117.00	15,191,200	
エコス	3,500	589.00	2,061,500	
ワタミ	12,300	1,717.00	21,119,100	
マルシェ	2,500	775.00	1,937,500	
ドン・キホーテ	27,800	3,595.00	99,941,000	
メガネトップ	17,900	1,138.00	20,370,200	
西松屋チェーン	20,500	716.00	14,678,000	
ゼンショーホールディングス	39,700	1,037.00	41,168,900	
幸楽苑	6,400	1,285.00	8,224,000	
ハークスレイ	2,900	684.00	1,983,600	
サイゼリヤ	15,400	1,194.00	18,387,600	
ポプラ	3,600	571.00	2,055,600	
ユナイテッドアローズ	11,200	2,225.00	24,920,000	
ハイデイ日高	5,500	1,919.00	10,554,500	
京都きもの友禅	6,900	1,019.00	7,031,100	
コロワイド	34,500	886.00	30,567,000	

壱番屋	4,200	2,954.00	12,406,800	
トップカルチャー	3,800	391.00	1,485,800	
スギホールディングス	16,600	3,115.00	51,709,000	
スクロール	13,600	274.00	3,726,400	
ファミリーマート	32,000	3,580.00	114,560,000	
木曽路	12,700	1,796.00	22,809,200	
千趣会	18,800	553.00	10,396,400	
タカキュー	8,000	308.00	2,464,000	
ケーヨー	18,100	481.00	8,706,100	
上新電機	23,000	884.00	20,332,000	
日本瓦斯	14,300	1,194.00	17,074,200	
ベスト電器	32,500	137.00	4,452,500	
マルエツ	22,000	290.00	6,380,000	
ロイヤルホールディングス	17,400	1,030.00	17,922,000	
東天紅	8,000	205.00	1,640,000	
いなげや	11,600	999.00	11,588,400	
島忠	23,600	1,896.00	44,745,600	
チヨダ	12,300	2,151.00	26,457,300	
ライフコーポレーション	6,900	1,278.00	8,818,200	
カスミ	21,400	569.00	12,176,600	
リンガーハット	9,400	1,140.00	10,716,000	
ＭｒＭａｘ	10,400	347.00	3,608,800	
テンアライド	7,800	299.00	2,332,200	
ＡＯＫＩホールディングス	9,000	2,051.00	18,459,000	
オークワ	16,000	1,087.00	17,392,000	
コメリ	16,000	2,313.00	37,008,000	
青山商事	28,700	1,682.00	48,273,400	
しまむら	12,100	8,850.00	107,085,000	
ＣＦＳコーポレーション	7,100	420.00	2,982,000	
高島屋	141,000	675.00	95,175,000	
松屋	21,900	856.00	18,746,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,000	703.00	47,804,000	
ニッセンホールディングス	18,800	324.00	6,091,200	
パルコ	20,000	953.00	19,060,000	
丸井グループ	136,000	733.00	99,688,000	
原信ナルスホールディングス	5,800	1,626.00	9,430,800	
ダイエー	60,250	207.00	12,471,750	
イズミヤ	41,000	495.00	20,295,000	

イオン	367,100	1,026.00	376,644,600	
ユニー	100,800	659.00	66,427,200	
イズミ	26,200	1,906.00	49,937,200	
東武ストア	14,000	277.00	3,878,000	
平和堂	21,300	1,303.00	27,753,900	
フジ	11,600	1,859.00	21,564,400	
ヤオコー	5,300	3,585.00	19,000,500	
ゼビオ	14,100	1,924.00	27,128,400	
ケーズホールディングス	26,000	2,289.00	59,514,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃ	6,100	787.00	4,800,700	
日産東京販売ホールディングス	15,000	333.00	4,995,000	
アインファーマシーズ	5,700	4,950.00	28,215,000	
元気寿司	3,200	1,114.00	3,564,800	
ヤマダ電機	47,480	3,560.00	169,028,800	
アークランドサカモト	6,800	1,377.00	9,363,600	
ニトリホールディングス	20,600	6,770.00	139,462,000	
グルメ杵屋	7,000	610.00	4,270,000	
愛眼	8,300	303.00	2,514,900	
吉野家ホールディングス	282	107,500.00	30,315,000	
松屋フーズ	5,000	1,603.00	8,015,000	
サガミチェーン	12,000	700.00	8,400,000	
プレナス	11,600	1,452.00	16,843,200	
ミニストップ	7,700	1,463.00	11,265,100	
アークス	17,800	1,698.00	30,224,400	
バロー	22,400	1,432.00	32,076,800	
ベルク	5,100	1,255.00	6,400,500	
大庄	4,900	1,152.00	5,644,800	
ファーストリテイリング	20,800	22,590.00	469,872,000	
サンドラッグ	19,800	3,300.00	65,340,000	
東京デリカ	3,400	1,099.00	3,736,600	
ヤマザワ	2,700	1,494.00	4,033,800	
やまや	2,100	1,243.00	2,610,300	
ベルーナ	13,000	666.00	8,658,000	
島根銀行	2,300	1,220.00	2,806,000	
じもとホールディングス	74,700	224.00	16,732,800	
新生銀行	901,000	167.00	150,467,000	
あおぞら銀行	378,000	230.00	86,940,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,882,700	473.00	3,728,517,100	

りそなホールディングス	1,070,700	399.00	427,209,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,176,000	313.00	681,088,000	
三井住友フィナンシャルグループ	787,300	3,300.00	2,598,090,000	
第四銀行	134,000	289.00	38,726,000	
北越銀行	106,000	187.00	19,822,000	
西日本シティ銀行	365,000	222.00	81,030,000	
千葉銀行	401,000	541.00	216,941,000	
横浜銀行	662,000	434.00	287,308,000	
常陽銀行	393,000	428.00	168,204,000	
群馬銀行	235,000	432.00	101,520,000	
武蔵野銀行	16,800	3,080.00	51,744,000	
千葉興業銀行	19,900	718.00	14,288,200	
筑波銀行	43,300	324.00	14,029,200	
東京都民銀行	19,700	919.00	18,104,300	
七十七銀行	163,000	361.00	58,843,000	
青森銀行	78,000	265.00	20,670,000	
秋田銀行	71,000	264.00	18,744,000	
山形銀行	63,000	405.00	25,515,000	
岩手銀行	7,500	3,885.00	29,137,500	
東邦銀行	88,000	288.00	25,344,000	
東北銀行	53,000	148.00	7,844,000	
みちのく銀行	52,000	181.00	9,412,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	422,000	365.00	154,030,000	
静岡銀行	305,000	883.00	269,315,000	
十六銀行	130,000	306.00	39,780,000	
スルガ銀行	101,000	1,141.00	115,241,000	
八十二銀行	192,000	451.00	86,592,000	
山梨中央銀行	64,000	372.00	23,808,000	
大垣共立銀行	139,000	296.00	41,144,000	
福井銀行	90,000	181.00	16,290,000	
北國銀行	121,000	342.00	41,382,000	
清水銀行	3,500	2,703.00	9,460,500	
滋賀銀行	98,000	542.00	53,116,000	
南都銀行	104,000	406.00	42,224,000	
百五銀行	94,000	396.00	37,224,000	
京都銀行	186,000	745.00	138,570,000	
三重銀行	43,000	201.00	8,643,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	729,000	142.00	103,518,000	

広島銀行	307,000	385.00	118,195,000	
山陰合同銀行	61,000	670.00	40,870,000	
中国銀行	80,000	1,259.00	100,720,000	
鳥取銀行	33,000	191.00	6,303,000	
伊予銀行	111,000	713.00	79,143,000	
百十四銀行	114,000	326.00	37,164,000	
四国銀行	75,000	239.00	17,925,000	
阿波銀行	86,000	522.00	44,892,000	
鹿児島銀行	72,000	584.00	42,048,000	
大分銀行	61,000	329.00	20,069,000	
宮崎銀行	69,000	231.00	15,939,000	
肥後銀行	86,000	499.00	42,914,000	
佐賀銀行	63,000	207.00	13,041,000	
十八銀行	67,000	235.00	15,745,000	
沖縄銀行	7,700	3,500.00	26,950,000	
琉球銀行	21,600	1,019.00	22,010,400	
八千代銀行	5,300	2,088.00	11,066,400	
セブン銀行	351,000	229.00	80,379,000	
みずほフィナンシャルグループ	13,414,300	170.00	2,280,431,000	
紀陽ホールディングス	415,000	131.00	54,365,000	
山口フィナンシャルグループ	104,000	824.00	85,696,000	
長野銀行	36,000	165.00	5,940,000	
名古屋銀行	94,000	319.00	29,986,000	
北洋銀行	156,800	261.00	40,924,800	
愛知銀行	3,800	4,965.00	18,867,000	
第三銀行	59,000	170.00	10,030,000	
中京銀行	43,000	201.00	8,643,000	
東日本銀行	45,000	220.00	9,900,000	
大光銀行	37,000	227.00	8,399,000	
愛媛銀行	61,000	235.00	14,335,000	
トマト銀行	40,000	182.00	7,280,000	
みなと銀行	94,000	161.00	15,134,000	
京葉銀行	86,000	426.00	36,636,000	
関西アーバン銀行	145,000	117.00	16,965,000	
栃木銀行	52,000	325.00	16,900,000	
北日本銀行	3,000	2,462.00	7,386,000	
東和銀行	112,000	102.00	11,424,000	
福島銀行	128,000	93.00	11,904,000	

大東銀行	66,000	101.00	6,666,000	
トモニホールディングス	79,900	400.00	31,960,000	
フィデアホールディングス	59,900	206.00	12,339,400	
池田泉州ホールディングス	85,900	503.00	43,207,700	
ＦＰＧ	2,200	1,320.00	2,904,000	
ＳＢＩホールディングス	133,400	680.00	90,712,000	
ジャフコ	14,600	2,643.00	38,587,800	
大和証券グループ本社	1,032,000	451.00	465,432,000	
野村ホールディングス	2,129,900	484.00	1,030,871,600	
岡三証券グループ	89,000	447.00	39,783,000	
丸三証券	33,100	501.00	16,583,100	
東洋証券	41,000	234.00	9,594,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120,000	406.00	48,720,000	
水戸証券	34,000	259.00	8,806,000	
いちよし証券	24,200	635.00	15,367,000	
松井証券	61,800	802.00	49,563,600	
だいこう証券ビジネス	7,000	476.00	3,332,000	
マネックスグループ	1,203	23,150.00	27,849,450	
カブドットコム証券	43,400	393.00	17,056,200	
極東証券	14,500	1,013.00	14,688,500	
岩井コスモホールディングス	11,100	488.00	5,416,800	
ＮＫＳＪホールディングス	231,200	1,894.00	437,892,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	311,100	1,863.00	579,579,300	
ソニーフィナンシャルホールディングス	99,700	1,553.00	154,834,100	
第一生命保険	5,567	131,400.00	731,503,800	
東京海上ホールディングス	403,200	2,656.00	1,070,899,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	357,100	1,145.00	408,879,500	
クレディセゾン	92,700	1,923.00	178,262,100	
芙蓉総合リース	10,800	2,990.00	32,292,000	
興銀リース	16,800	2,455.00	41,244,000	
東京センチュリーリース	25,800	1,914.00	49,381,200	
日本証券金融	45,800	579.00	26,518,200	
大阪証券金融	27,700	247.00	6,841,900	
ポケットカード	17,800	490.00	8,722,000	
リコーリース	7,800	2,169.00	16,918,200	
イオンクレジットサービス	39,200	1,811.00	70,991,200	
アコム	22,580	2,465.00	55,659,700	
ジャックス	66,000	441.00	29,106,000	

オリエントコーポレーション	218,000	340.00	74,120,000	
日立キャピタル	22,100	1,677.00	37,061,700	
オリックス	54,190	9,530.00	516,430,700	
三菱ＵＦＪリース	26,780	3,900.00	104,442,000	
アサックス	18	117,600.00	2,116,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,800	1,300.00	7,540,000	
日本駐車場開発	1,157	5,140.00	5,946,980	
ヒューリック	134,900	583.00	78,646,700	
東京建物不動産販売	5,400	382.00	2,062,800	
三栄建築設計	2,700	832.00	2,246,400	
野村不動産ホールディングス	50,400	1,632.00	82,252,800	
常和ホールディングス	2,800	1,810.00	5,068,000	
パーク２４	54,300	1,577.00	85,631,100	
三井不動産	491,000	1,981.00	972,671,000	
三菱地所	729,000	2,100.00	1,530,900,000	
平和不動産	21,300	1,210.00	25,773,000	
東京建物	205,000	418.00	85,690,000	
ダイビル	28,500	831.00	23,683,500	
東急不動産	230,000	666.00	153,180,000	
京阪神ビルディング	17,000	485.00	8,245,000	
住友不動産	250,000	2,650.00	662,500,000	
東宝不動産	9,600	804.00	7,718,400	
大京	161,000	244.00	39,284,000	
テーオーシー	36,100	573.00	20,685,300	
東京楽天地	17,000	375.00	6,375,000	
フジ住宅	13,800	495.00	6,831,000	
空港施設	12,900	444.00	5,727,600	
明和地所	5,500	484.00	2,662,000	
住友不動産販売	3,780	4,310.00	16,291,800	
ゴールドクレスト	8,300	1,460.00	12,118,000	
東栄住宅	7,300	1,355.00	9,891,500	
日本エスリード	4,800	882.00	4,233,600	
東急リバブル	11,100	1,389.00	15,417,900	
飯田産業	10,000	1,183.00	11,830,000	
日神不動産	6,600	555.00	3,663,000	
アーネストワン	17,300	1,620.00	28,026,000	
タカラレーベン	11,800	952.00	11,233,600	
サンヨーハウジング名古屋	55	113,300.00	6,231,500	

イオンモール	47,500	2,139.00	101,602,500	
フージャースコーポレーション	151	70,100.00	10,585,100	
タクトホーム	57	136,200.00	7,763,400	
トーセイ	174	54,100.00	9,413,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	670	86,500.00	57,955,000	
サンフロンティア不動産	126	44,800.00	5,644,800	
ランドビジネス	70	36,950.00	2,586,500	
グランディハウス	2,400	790.00	1,896,000	
日本空港ビルデング	36,100	946.00	34,150,600	
日本工営	37,000	329.00	12,173,000	
ネクスト	5,300	929.00	4,923,700	
日本M＆Aセンター	5,700	2,914.00	16,609,800	
ノバレーゼ	29	55,900.00	1,621,100	
アコーディア・ゴルフ	489	82,500.00	40,342,500	
タケエイ	1,300	2,500.00	3,250,000	
パソナグループ	110	50,000.00	5,500,000	
リンクアンドモチベーション	45	40,100.00	1,804,500	
ＧＣＡサヴィアングループ	5,000	1,061.00	5,305,000	
エス・エム・エス	31	187,500.00	5,812,500	
テンプホールディングス	15,100	1,123.00	16,957,300	
クックパッド	2,200	2,689.00	5,915,800	
エスクリ	3,200	826.00	2,643,200	
学情	3,700	301.00	1,113,700	
スタジオアリス	5,100	1,288.00	6,568,800	
シミックホールディングス	4,200	1,340.00	5,628,000	
ＮＥＣフィールディング	9,000	1,079.00	9,711,000	
綜合警備保障	40,100	1,173.00	47,037,300	
カカクコム	15,000	3,305.00	49,575,000	
ルネサンス	5,000	697.00	3,485,000	
ツクイ	5,200	1,778.00	9,245,600	
エムスリー	260	150,900.00	39,234,000	
ベストブライダル	33	86,700.00	2,861,100	
ディー・エヌ・エー	54,300	3,120.00	169,416,000	
博報堂ＤＹホールディングス	15,280	5,920.00	90,457,600	
ぐるなび	7,700	1,024.00	7,884,800	
一休	69	72,900.00	5,030,100	
ジャパンベストレスキューシステム	14	81,900.00	1,146,600	
ジェイコムホールディングス	2,000	709.00	1,418,000	

ＰＧＭホールディングス	164	68,800.00	11,283,200	
バリューコマース	41	50,600.00	2,074,600	
ＪＰホールディングス	3,300	1,148.00	3,788,400	
イーピーエス	65	251,900.00	16,373,500	
アミューズ	3,400	1,933.00	6,572,200	
ドリームインキュベータ	41	102,000.00	4,182,000	
ケネディクス	1,050	20,670.00	21,703,500	
電通	100,200	2,420.00	242,484,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	516	9,390.00	4,845,240	
ぴあ	3,200	1,235.00	3,952,000	
イオンファンタジー	3,600	1,380.00	4,968,000	
ネクシィーズ	406	2,502.00	1,015,812	
みらかホールディングス	28,800	3,780.00	108,864,000	
アルプス技研	4,500	636.00	2,862,000	
サニックス	16,000	392.00	6,272,000	
ダイオーズ	2,000	536.00	1,072,000	
日本空調サービス	2,700	799.00	2,157,300	
オリエンタルランド	32,800	11,320.00	371,296,000	
ダスキン	30,400	1,638.00	49,795,200	
明光ネットワークジャパン	10,100	996.00	10,059,600	
ファルコＳＤホールディングス	6,000	1,007.00	6,042,000	
秀英予備校	3,800	356.00	1,352,800	
田谷	1,700	717.00	1,218,900	
ラウンドワン	35,700	535.00	19,099,500	
リゾートトラスト	18,800	1,811.00	34,046,800	
ビー・エム・エル	6,500	2,284.00	14,846,000	
ワタベウェディング	3,300	678.00	2,237,400	
もしもしホットライン	18,200	1,284.00	23,368,800	
東急コミュニティー	2,800	3,315.00	9,282,000	
リソー教育	1,123	7,230.00	8,119,290	
ウェアハウス	3,700	222.00	821,400	
ユー・エス・エス	12,310	9,730.00	119,776,300	
東京個別指導学院	5,500	246.00	1,353,000	
テー・オー・ダブリュー	3,700	524.00	1,938,800	
セントラルスポーツ	3,400	1,415.00	4,811,000	
フルキャストホールディングス	104	16,080.00	1,672,320	
リゾートソリューション	12,000	187.00	2,244,000	
リブセンス	900	3,885.00	3,496,500	

リロ・ホールディング	3,800	3,225.00	12,255,000	
エイチ・アイ・エス	9,000	3,180.00	28,620,000	
共立メンテナンス	5,700	2,096.00	11,947,200	
イチネンホールディングス	12,800	614.00	7,859,200	
建設技術研究所	6,100	630.00	3,843,000	
スペース	6,000	686.00	4,116,000	
燦ホールディングス	2,400	1,269.00	3,045,600	
スバル興業	8,000	327.00	2,616,000	
東京テアトル	42,000	137.00	5,754,000	
よみうりランド	22,000	385.00	8,470,000	
東京都競馬	85,000	220.00	18,700,000	
カナモト	13,000	1,377.00	17,901,000	
東京ドーム	84,000	350.00	29,400,000	
トランス・コスモス	14,400	1,046.00	15,062,400	
乃村工藝社	24,000	382.00	9,168,000	
藤田観光	28,000	299.00	8,372,000	
日本管財	4,100	1,636.00	6,707,600	
トーカイ	4,900	2,565.00	12,568,500	
白洋舎	13,000	210.00	2,730,000	
セコム	114,600	4,420.00	506,532,000	
セントラル警備保障	4,900	841.00	4,120,900	
丹青社	11,000	369.00	4,059,000	
メイテック	17,100	2,078.00	35,533,800	
アサツー ディ・ケイ	18,200	2,204.00	40,112,800	
応用地質	11,600	1,123.00	13,026,800	
船井総合研究所	11,300	562.00	6,350,600	
進学会	5,300	323.00	1,711,900	
ベネッセホールディングス	33,600	3,900.00	131,040,000	
イオンディライト	10,700	1,732.00	18,532,400	
ナック	2,500	2,360.00	5,900,000	
ニチイ学館	21,600	778.00	16,804,800	
ダイセキ	16,300	1,253.00	20,423,900	
ステップ	3,300	737.00	2,432,100	
合計	161,842,772	―	131,438,768,832	

B. 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

次へ

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	317,600,205
コール・ローン	452,370,308
国債証券	222,525,299,087
派生商品評価勘定	3,740,011
未収入金	2,814,188,831
未収利息	2,548,926,032
前払費用	119,318,161
差入委託証拠金	32,640,328
流動資産合計	228,814,082,963
資産合計	228,814,082,963
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	320,288
未払解約金	188,979,756
流動負債合計	189,300,044
負債合計	189,300,044
純資産の部	
元本等	
元本	108,288,582,697
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	120,336,200,222
元本等合計	228,624,782,919
純資産合計	228,624,782,919
負債純資産合計	228,814,082,963

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3.　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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。
4.　収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　計算期間の期首元本額	115,838,047,298円
計算期間中の追加設定元本額	12,038,175,538円
計算期間中の一部解約元本額	19,587,640,139円
計算日の元本額	108,288,582,697円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	6,470,479,080円
外国債券オープン（3ケ月決算型）	305,759,596円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	2,487,026,689円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	477,257,238円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,326,010円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,170,874,976円
世界経済インデックスファンド	382,626,805円
マイセレクション25	17,130,623円
マイセレクション50	11,390,469円

マイセレクション75	8,476,885円
DCマイセレクション25	999,511,634円
DCマイセレクション50	897,793,532円
DCマイセレクション75	540,634,398円
DC外国債券インデックス・オープン	1,119,713,141円
DCマイセレクションS25	281,109,132円
DCマイセレクションS50	252,019,177円
DCマイセレクションS75	104,865,873円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,207,686円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	33,712,727円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	22,040,130円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	6,839,256円
DC世界経済インデックスファンド	137,806,926円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	6,819,530,047円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	4,178,378,984円
マイセレクション50ＶＡ1（適格機関投資家専用）	40,291,154円
マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	11,834,688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）	488,754,919円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	67,580円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,518,428,584円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,477,411,725円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,054,691,051円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,118,918,487円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	9,665,549,078円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,305,895,196円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,318,646,321円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	4,849,619,670円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	5,165,187,731円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,465,029,093円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	3,393,463,573円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	566,259,060円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	776,525,450円
FOFｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	4,945,599,237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）	716,763,322円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	290,020,042円
外国債券ファンド・シリーズ1	1,270,000,021円
コア投資戦略ファンド（安定型）	423,419,269円
コア投資戦略ファンド（成長型）	220,548,057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）	582,863,308円

2.　計算日における受益権総数	108,288,582,697口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1113円 (21,113円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役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25年 1月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,723,894,569
合計	1,723,894,569

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	債券先物取引 買 建	765,975,373	―	765,844,467	△130,906
合計		765,975,373	―	765,844,467	△130,906

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	606,731,010	－	608,979,600	2,248,590
	カナダドル	43,342,090	－	43,420,800	78,710
	イギリスポンド	92,550,770	－	92,566,500	15,730
	ユーロ	356,343,408	－	357,514,300	1,170,892
	計	1,098,967,278	－	1,102,481,200	3,513,922
	売 建				
	アメリカドル	1,253,240,100	－	1,253,128,500	111,600
	カナダドル	85,090,680	－	85,088,800	1,880
	オーストラリアドル	33,005,700	－	33,005,000	700
	イギリスポンド	226,498,680	－	226,495,500	3,180
	マレーシアリンギット	22,559,868	－	22,589,421	△29,553
	スウェーデンクローナ	18,710,880	－	18,700,000	10,880
	ノルウェークローネ	7,527,520	－	7,524,700	2,820
	デンマーククローネ	24,669,260	－	24,670,800	△1,540
	メキシコペソ	28,769,160	－	28,785,400	△16,240
	ポーランドズロチ	22,137,500	－	22,152,900	△15,400
	南アフリカランド	24,038,000	－	24,038,000	－
	ユーロ	1,260,236,180	－	1,260,267,800	△31,620
	計	3,006,483,528	－	3,006,446,821	36,707
合計		4,105,450,806	－	4,108,928,021	3,550,629

(注)時価の算定方法

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 04/30/14	9,000,000.00	9,005,274.00	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,977,852.00	
		T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,979,531.20	
		T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	10,000,000.00	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,522,011.00	
		T 0.375% 06/15/15	10,000,000.00	10,016,410.00	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,475,776.40	
		T 0.875% 02/28/17	22,900,000.00	23,162,983.60	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,422,503.60	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,930,917.80	
		T 1% 09/30/16	11,500,000.00	11,707,092.00	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,952,422.00	
		T 1% 11/30/19	4,100,000.00	4,038,339.69	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,126,865.30	
		T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,705,246.20	
		T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,488,000.00	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,994,758.30	
		T 1.375% 11/30/15	29,100,000.00	29,932,638.30	
		T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	2,043,750.00	
		T 1.5% 03/31/19	11,000,000.00	11,290,466.00	
		T 1.5% 07/31/16	18,800,000.00	19,473,416.00	
		T 1.5% 12/31/13	6,650,000.00	6,732,606.30	
		T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,432,763.70	
		T 1.625% 11/15/22	3,000,000.00	2,941,347.60	
		T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	22,963,724.40	
		T 1.75% 03/31/14	22,000,000.00	22,404,338.00	
		T 1.75% 05/15/22	12,500,000.00	12,503,175.00	
		T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,537,885.00	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	7,944,877.20	
		T 1.875% 04/30/14	15,100,000.00	15,419,984.10	
		T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,600,970.20	
		T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,325,603.40	
		T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,160,899.00	
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,635,010.00	
		T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,798,303.70	
		T 2% 02/15/22	10,000,000.00	10,257,030.00	
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,470,874.40	

T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,363,300.40	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	13,036,325.40	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,616,000.00	
T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,378,345.90	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	6,172,941.25	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,144,218.00	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	20,043,379.20	
T 2.375% 03/31/16	9,600,000.00	10,195,123.20	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,319,376.00	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	594,021.45	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	12,928,225.00	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,225,822.00	
T 2.5% 03/31/15	20,700,000.00	21,706,703.10	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,068,574.00	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,750,686.40	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,463,085.00	
T 2.625% 06/30/14	16,000,000.00	16,553,440.00	
T 2.625% 07/31/14	37,400,000.00	38,766,708.20	
T 2.625% 08/15/20	13,500,000.00	14,716,579.50	
T 2.625% 11/15/20	11,500,000.00	12,521,752.00	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,713,147.35	
T 2.75% 02/15/19	5,300,000.00	5,842,937.30	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,173,171.40	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,726,248.00	
T 2.75% 08/15/42	8,000,000.00	7,576,406.40	
T 2.75% 11/15/42	1,500,000.00	1,418,173.80	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,180,424.00	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,310,034.30	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,426,810.50	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	7,995,781.60	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,478,754.40	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,855,400.50	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,184,528.00	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	14,417,497.60	
T 3.125% 05/15/21	9,500,000.00	10,692,326.00	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,324,763.50	
T 3.125% 11/15/41	9,300,000.00	9,550,300.20	
T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,682,001.00	

T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,680,449.00	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,867,363.50	
T 3.375% 11/15/19	7,600,000.00	8,685,371.20	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,469,944.60	
T 3.5% 02/15/39	6,000,000.00	6,662,694.00	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,977,522.60	
T 3.625% 02/15/21	18,000,000.00	20,970,360.00	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,517,908.20	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	8,078,028.00	
T 3.75% 11/15/18	10,000,000.00	11,593,160.00	
T 3.875% 08/15/40	7,000,000.00	8,264,648.00	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,671,084.70	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,751,952.00	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,861,257.40	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,289,780.90	
T 4.25% 05/15/39	600,000.00	752,320.20	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	12,754,452.00	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,750,487.50	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,255,847.60	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,366,815.40	
T 4.25% 11/15/40	8,300,000.00	10,413,744.40	
T 4.375% 02/15/38	2,800,000.00	3,570,383.60	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	6,268,173.10	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,559,922.00	
T 4.375% 11/15/39	6,500,000.00	8,310,224.00	
T 4.5% 02/15/36	3,100,000.00	4,012,624.50	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,415,471.20	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,597,890.00	
T 4.5% 08/15/39	4,000,000.00	5,211,172.00	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,458,862.20	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,811,915.00	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,527,275.90	
T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	2,012,314.50	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,568,608.60	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,538,189.90	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	693,818.50	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,692,770.80	
T 5.25% 02/15/29	1,900,000.00	2,597,136.60	

		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,772,951.70	
		T 5.375% 02/15/31	2,010,000.00	2,828,407.68	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,674,750.00	
		T 6.0% 02/15/26	2,800,000.00	4,007,172.40	
		T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,093,410.20	
		T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	3,260,192.10	
		T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,867,550.84	
		T 6.25% 08/15/23	4,900,000.00	6,963,071.50	
		T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,524,238.00	
		T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,770,190.20	
		T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,880,905.60	
		T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,440,443.20	
		T 8.0% 11/15/21	2,300,000.00	3,523,312.50	
		T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,038,355.60	
	アメリカドル小計		954,410,000.00	1,028,615,852.36 (92,410,848,176)	
	カナダドル	CAN 0.75% 05/01/14	1,300,000.00	1,293,487.00	
		CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,283.00	
		CAN 1.25% 03/01/18	400,000.00	394,968.00	
		CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	901,512.00	
		CAN 2% 03/01/14	2,900,000.00	2,927,796.50	
		CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,429,862.00	
		CAN 2% 12/01/14	5,300,000.00	5,379,844.50	
		CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,089,805.00	
		CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,141,690.00	
		CAN 2.75% 09/01/16	3,100,000.00	3,247,792.50	
		CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,047,885.00	
		CAN 3.0% 06/01/14	5,150,000.00	5,277,462.50	
		CAN 3.25% 06/01/21	2,150,000.00	2,385,672.25	
		CAN 3.5% 06/01/20	2,350,000.00	2,632,599.25	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,450,000.00	1,778,040.75	
		CAN 3.75% 06/01/19	3,300,000.00	3,717,136.50	
		CAN 4% 06/01/16	3,200,000.00	3,477,808.00	
		CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,657,712.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	2,850,000.00	3,718,893.75	
		CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,994,842.50	
		CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,228,990.00	
		CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,734,225.00	
		CAN 5% 06/01/37	2,350,000.00	3,402,870.50	

	CAN 5.75% 06/01/29	2,160,000.00	3,153,286.80	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,200,000.00	3,349,489.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	950,000.00	1,618,220.50	
	CAN 9% 06/01/25	650,000.00	1,135,465.50	
カナダドル小計		60,010,000.00	68,316,640.30 (6,184,705,446)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	950,000.00	884,378.75	
	ACGB 3.25% 04/21/29	550,000.00	507,289.75	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,375,406.50	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,150,000.00	3,427,578.00	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,000,000.00	3,089,070.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,000,000.00	1,111,380.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,900,000.00	3,081,743.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,000,000.00	1,051,790.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,800,000.00	3,146,234.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,300,000.00	2,572,596.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,000,000.00	2,364,030.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,750,000.00	3,252,356.25	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,350,000.00	2,809,566.00	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,589,264.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,900,000.00	3,117,355.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,257,636.00	
オーストラリアドル小計		33,350,000.00	36,637,673.25 (3,455,665,340)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,000,000.00	5,012,600.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	830,404.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,500,000.00	2,443,137.50	
	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,355,536.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,400,000.00	4,493,148.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	2,750,000.00	2,878,947.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,650,000.00	1,783,856.25	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,571,928.50	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,000,000.00	3,466,335.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,200,000.00	3,700,304.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,050,000.00	2,368,006.25	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	3,005,978.25	
	UKT 4% 09/07/16	6,850,000.00	7,673,507.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	3,250,000.00	3,868,036.25	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,100,000.00	3,724,572.50	

	UKT 4.25% 09/07/39	1,750,000.00	2,074,887.50	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,300,000.00	2,784,667.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,300,000.00	3,911,094.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,950,000.00	3,503,287.25	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	2,979,537.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,800,000.00	3,370,276.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,400,000.00	4,054,993.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,550,000.00	3,148,778.25	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,500,000.00	4,329,797.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,050,000.00	4,948,614.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,850,000.00	3,170,952.75	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,700,000.00	3,449,304.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,800,000.00	3,588,060.00	
	UKT 5% 03/07/18	2,800,000.00	3,353,770.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,700,000.00	3,490,911.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,100,000.00	5,481,684.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,760,000.00	2,550,354.40	
	UKT 8% 06/07/21	2,600,000.00	3,887,884.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,595,000.00	3,156,908.32	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	2,032,365.00	
イギリスポンド小計		102,005,000.00	119,444,422.97 (17,016,052,496)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	113,629.00	
	SWISS 3% 01/08/18	4,100,000.00	4,667,891.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	600,000.00	654,168.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,200,000.00	2,910,699.00	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	426,613.50	
	SWISS 4.25% 01/06/14	850,000.00	884,960.50	
スイスフラン小計		8,150,000.00	9,657,961.00 (929,578,746)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/14	800,000.00	800,328.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	616,413.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	400,000.00	432,786.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	450,000.00	488,931.75	
	SIGB 2.5% 06/01/19	650,000.00	719,306.25	
	SIGB 2.75% 04/01/42	350,000.00	365,916.25	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,329,962.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	450,000.00	498,105.00	
	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	400,554.00	

	SIGB 3.125% 09/01/22	850,000.00	987,160.25	
	SIGB 3.25% 09/01/20	750,000.00	867,367.50	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,100,000.00	1,305,309.50	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,364,694.50	
	SIGB 3.75% 09/01/16	900,000.00	1,011,703.50	
	SIGB 4% 09/01/18	750,000.00	892,942.50	
シンガポールドル小計		10,950,000.00	12,081,480.50 (884,001,928)	
マレーシアリンギット	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,562,112.50	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	398,444.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	3,000,000.00	3,022,065.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,000,000.00	1,005,490.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,148,476.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,533,300.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,800,000.00	4,869,072.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,125,465.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,150,000.00	1,173,103.50	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	722,144.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,887,225.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,764,162.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	6,100,000.00	6,331,190.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,500,000.00	3,710,822.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	300,000.00	322,800.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,354,717.00	
	MGS 5.094% 04/30/14	2,050,000.00	2,105,114.25	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,650,000.00	1,939,443.00	
マレーシアリンギット小計		39,700,000.00	40,975,146.25 (1,221,469,109)	
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	4,700,000.00	4,523,867.50	
	SGB 3% 07/12/16	8,650,000.00	9,207,146.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	7,250,000.00	8,595,563.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,050,000.00	10,371,119.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	11,450,000.00	12,720,034.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,500,000.00	13,374,385.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	5,900,000.00	6,423,979.00	
	SGB 5% 12/01/20	13,200,000.00	16,449,246.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	15,300,000.00	16,469,226.00	
スウェーデンクローナ小計		87,000,000.00	98,134,566.75 (1,350,331,638)	

ノルウェークローネ	NGB 3.75% 05/25/21	6,800,000.00	7,625,282.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	7,900,000.00	8,730,922.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	6,600,000.00	7,602,936.00	
	NGB 5% 05/15/15	11,000,000.00	11,866,800.00	
ノルウェークローネ小計		32,300,000.00	35,825,940.00 (573,931,558)	
デンマークローネ	DGB 2% 11/15/14	9,650,000.00	9,989,004.50	
	DGB 2.5% 11/15/16	2,000,000.00	2,161,520.00	
	DGB 3% 11/15/21	15,900,000.00	18,184,671.00	
	DGB 4% 11/15/15	15,300,000.00	16,927,231.50	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,415,579.00	
	DGB 4% 11/15/19	14,900,000.00	17,974,540.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	19,150,000.00	28,385,757.75	
	DGB 7% 11/10/24	4,200,000.00	6,704,964.00	
デンマーククローネ小計		90,900,000.00	111,743,268.25 (1,790,127,157)	
メキシコペソ	MBONO 5% 06/15/17	13,900,000.00	13,973,044.50	
	MBONO 6% 06/18/15	77,000,000.00	79,366,980.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	31,600,000.00	34,335,928.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	46,044,679.50	
	MBONO 8% 12/07/23	14,700,000.00	17,999,488.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	57,000,000.00	73,360,995.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,250,000.00	41,652,003.75	
メキシコペソ小計		265,150,000.00	306,733,119.25 (2,177,805,146)	
ポーランドズロチ	POLGB 4% 10/25/23	400,000.00	401,746.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,202,448.50	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,400,000.00	8,776,278.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	6,000,000.00	6,450,000.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,510,288.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,450,000.00	5,694,350.75	
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,950,000.00	4,379,305.75	
	POLGB 5.75% 04/25/14	6,500,000.00	6,684,405.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,350,000.00	1,619,163.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,600,000.00	6,410,796.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,179,050.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,400,000.00	9,015,468.00	
ポーランドズロチ小計		54,150,000.00	58,323,299.00 (1,678,544,545)	

南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,700,000.00	26,579,421.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,850,000.00	10,608,096.75	
	SAGB 6.25% 03/31/36	10,100,000.00	8,247,660.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	6,900,000.00	5,722,687.50	
	SAGB 6.75% 03/31/21	15,000,000.00	15,347,775.00	
	SAGB 7% 02/28/31	8,000,000.00	7,418,000.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	15,800,000.00	16,678,322.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	2,500,000.00	2,687,312.50	
	SAGB 8% 12/21/18	14,200,000.00	15,580,879.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	14,500,000.00	15,946,737.50	
	SAGB 8.75% 02/28/48	3,100,000.00	3,289,720.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	9,200,000.00	9,806,326.00	
南アフリカランド小計		128,850,000.00	137,912,937.25 (1,394,299,795)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,800,000.00	4,146,085.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	960,462.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	1,900,000.00	2,064,977.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	4,350,000.00	4,953,627.75	
	BGB 4% 03/28/14	2,000,000.00	2,088,840.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,630,556.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,586,250.50	
	BGB 4% 03/28/32	150,000.00	172,291.50	
	BGB 4.0% 03/28/17	3,500,000.00	3,943,572.50	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,400,000.00	2,767,356.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,000,000.00	2,401,310.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,665,112.50	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,412,058.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	1,950,000.00	2,288,266.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,250,000.00	1,509,206.25	
	BGB 5% 03/28/35	3,000,000.00	3,931,350.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,350,000.00	4,498,329.75	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	1,985,940.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,350,000.00	1,572,230.25	
	BKO 0.25% 03/14/14	3,300,000.00	3,306,765.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,100,000.00	1,145,518.00	
	BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,288,297.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	2,900,000.00	3,057,716.50	
	BTNS 2.5% 01/12/14	3,400,000.00	3,479,118.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,532,776.00	

BTNS 2.5% 07/25/16	5,900,000.00	6,290,963.50	
BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,351,137.00	
BTPS 2.75% 12/01/15	200,000.00	204,536.00	
BTPS 3% 04/01/14	1,700,000.00	1,737,340.50	
BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,905,792.00	
BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,041,193.50	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,885,162.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,750,000.00	3,862,912.50	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,615,327.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,315,896.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,050,000.00	6,331,022.50	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,000,000.00	7,365,855.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	8,035,600.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,502,822.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,400,000.00	3,911,138.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	3,597,737.50	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,644,641.50	
BTPS 4.25% 02/01/19	5,000,000.00	5,281,650.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,084,343.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000.00	9,607,054.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	3,250,000.00	3,422,217.50	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,250,000.00	3,496,203.75	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,050,000.00	7,490,307.75	
BTPS 4.5% 03/01/19	3,900,000.00	4,166,857.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,900,000.00	2,930,073.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	5,100,000.00	5,480,052.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,226,898.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,700,000.00	5,997,483.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,280,840.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,226,720.25	
BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,159,930.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,000,000.00	4,233,120.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,572,835.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,550,000.00	3,619,668.75	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,200,000.00	3,269,120.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	5,040,000.00	5,580,414.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,800,000.00	5,095,824.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,336,166.00	

BTPS 5.5% 11/01/22	2,000,000.00	2,220,380.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,600,000.00	2,906,852.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,000,000.00	5,728,475.00	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,800,000.00	4,537,466.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,411,660.50	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,119,060.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,500,000.00	2,501,612.50	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,510,528.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,734,745.00	
DBR 2.25% 09/04/20	3,900,000.00	4,221,789.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,800,000.00	4,089,845.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,517,664.00	
DBR 2.5% 07/04/44	1,000,000.00	1,040,015.00	
DBR 3% 07/04/20	5,100,000.00	5,797,450.50	
DBR 3.25% 01/04/20	1,500,000.00	1,728,045.00	
DBR 3.25% 07/04/15	5,300,000.00	5,692,518.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,471,855.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,653,838.00	
DBR 3.5% 01/04/16	5,400,000.00	5,913,918.00	
DBR 3.5% 07/04/19	4,100,000.00	4,770,965.00	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,727,658.50	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,578,269.50	
DBR 3.75% 01/04/19	3,700,000.00	4,335,734.00	
DBR 4% 07/04/16	4,400,000.00	4,953,410.00	
DBR 4.0% 01/04/18	3,000,000.00	3,497,490.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,950,000.00	5,218,305.50	
DBR 4.25% 01/04/14	4,500,000.00	4,678,537.50	
DBR 4.25% 07/04/14	7,700,000.00	8,157,842.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,727,632.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,550,000.00	5,414,682.00	
DBR 4.25% 07/04/39	2,600,000.00	3,621,943.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,100,000.00	4,222,200.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,150,000.00	4,505,303.25	
DBR 4.75% 07/04/40	2,900,000.00	4,363,586.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,950,000.00	4,418,465.75	
DBR 5.625% 01/04/28	1,470,000.00	2,160,826.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	667,315.60	
DBR 6.25% 01/04/24	1,800,000.00	2,637,504.00	

DBR 6.25% 01/04/30	1,300,000.00	2,068,020.50	
DBR 6.5% 07/04/27	2,000,000.00	3,158,350.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	1,000,000.00	1,010,470.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,200,000.00	4,452,966.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	700,000.00	709,009.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,500,000.00	7,036,867.50	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,354,425.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	5,900,000.00	6,418,580.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,599,777.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,460,307.50	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,346,844.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,650,000.00	6,260,482.50	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,861,798.50	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,600,000.00	7,590,396.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,200,000.00	7,126,311.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,345,361.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,100,000.00	4,719,633.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,400,000.00	2,813,880.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,600,000.00	1,879,128.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,943,349.00	
FRTR 4% 10/25/38	4,700,000.00	5,495,945.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,000,000.00	7,059,120.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,642,026.25	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,350,000.00	3,923,587.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,900,000.00	8,205,652.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,400,000.00	4,306,287.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,400,000.00	4,377,092.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,010,000.00	6,981,756.90	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,000,000.00	5,455,980.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,900,000.00	5,605,450.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,337,224.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,584,170.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,632,607.20	
IRISH 4% 01/15/14	450,000.00	462,465.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,600,000.00	1,655,280.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	1,500,000.00	1,598,827.50	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,000,000.00	4,118,800.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	848,036.00	

IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,149,160.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,900,000.00	1,998,819.00	
IRISH 5.5% 10/18/17	400,000.00	443,830.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,100,000.00	1,232,225.50	
NETHER 0.75% 04/15/15	2,300,000.00	2,324,690.50	
NETHER 1% 01/15/14	800,000.00	807,224.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	200,000.00	204,120.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,096,250.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,257,962.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	800,000.00	821,120.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,469,209.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,150,000.00	4,451,642.75	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,900,000.00	3,294,226.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	2,750,000.00	3,170,585.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,900,000.00	2,244,432.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,000,000.00	2,559,210.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,212,620.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,550,000.00	3,301,485.00	
NETHER 4% 07/15/16	3,100,000.00	3,476,076.50	
NETHER 4% 07/15/19	3,150,000.00	3,708,857.25	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,850,000.00	3,313,281.75	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,700,000.00	3,151,521.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	3,006,486.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	839,935.25	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,404,296.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,038,715.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	516,600.00	
OBL 1.75% 10/09/15	3,500,000.00	3,644,357.50	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,660,037.50	
OBL 2.25% 04/11/14	2,900,000.00	2,975,690.00	
OBL 2.5% 02/27/15	2,200,000.00	2,307,393.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,952,152.00	
OBL 2.75% 04/08/16	5,500,000.00	5,933,152.50	
RAGB 3.15% 06/20/44	300,000.00	328,479.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,102,985.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	800,000.00	844,672.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	750,000.00	851,887.50	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,650,000.00	2,859,217.50	

RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,670,448.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	400,000.00	463,612.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,700,000.00	3,165,088.50	
RAGB 4% 09/15/16	2,650,000.00	2,980,004.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,150,000.00	2,732,273.75	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,334,244.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	700,000.00	812,458.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,350,000.00	1,603,968.75	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,250,000.00	3,847,333.75	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,400,000.00	1,818,957.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,600,000.00	2,375,440.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	795,084.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	626,727.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	500,000.00	538,890.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,250,000.00	1,311,012.50	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,430,925.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	462,810.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,450,000.00	1,660,351.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,350,000.00	1,653,837.75	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,536,283.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,050,000.00	1,264,494.00	
SPGB 3% 04/30/15	700,000.00	707,553.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,700,000.00	6,741,875.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	1,005,750.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,140,845.00	
SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,274,587.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	400,000.00	409,832.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,000,000.00	4,055,620.00	
SPGB 4% 04/30/20	3,450,000.00	3,345,551.25	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,697,465.50	
SPGB 4.1% 07/30/18	2,900,000.00	2,927,463.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	2,247,630.00	
SPGB 4.25% 01/31/14	5,000,000.00	5,135,050.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	1,950,000.00	2,012,429.25	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,100,000.00	2,099,517.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,000,000.00	7,289,835.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,000,000.00	3,064,500.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,800,000.00	1,666,638.00	

		SPGB 4.7% 07/30/41	1,800,000.00	1,540,395.00	
		SPGB 4.75% 07/30/14	2,700,000.00	2,808,945.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,200,000.00	3,055,008.00	
		SPGB 4.85% 10/31/20	4,100,000.00	4,137,966.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,400,000.00	2,114,316.00	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,542,528.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	4,101,625.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,650,000.00	2,688,570.75	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	3,010,298.25	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,343,576.00	
		SPGB 6.0% 01/31/29	3,100,000.00	3,239,608.50	
	ユーロ小計		690,700,000.00	764,890,340.45 (91,457,938,007)	
国債証券合計				222,525,299,087 (222,525,299,087)	
合計				222,525,299,087 (222,525,299,087)	

(注)有価証券明細表注記
(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券	127銘柄	100.0%	41.5%
カナダドル	国債証券	27銘柄	100.0%	2.8%
オーストラリアドル	国債証券	16銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券	35銘柄	100.0%	7.6%
スイスフラン	国債証券	6銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	18銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券	7銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券	226銘柄	100.0%	41.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

次へ

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,125,700,228
コール・ローン	41,883,945
株式	137,527,000,506
投資信託受益証券	105,197,248
投資証券	3,144,036,700
派生商品評価勘定	64,599,872
未収入金	8,686,156,003
未収配当金	137,235,352
未収利息	63
差入委託証拠金	1,136,844,844
流動資産合計	152,968,654,761
資産合計	152,968,654,761
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,646,582
未払解約金	143,055,548
流動負債合計	149,702,130
負債合計	149,702,130
純資産の部	
元本等	
元本	130,579,100,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,239,852,182
元本等合計	152,818,952,631
純資産合計	152,818,952,631
負債純資産合計	152,968,654,761

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (2)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3.　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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。
4.　収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1. 計算期間の期首元本額	143,247,104,068円
計算期間中の追加設定元本額	19,698,704,467円
計算期間中の一部解約元本額	32,366,708,086円
計算日の元本額	130,579,100,449円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,019,551,063円
SBI資産設計オープン（分配型）	25,273,090円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,703,184,191円
世界経済インデックスファンド	743,968,255円
マイセレクション25	15,875,138円
マイセレクション50	63,427,612円
マイセレクション75	77,176,001円
外国株式インデックス・オープン	1,260,562,867円
DCマイセレクション25	936,468,913円
DCマイセレクション50	4,996,495,889円
DCマイセレクション75	5,248,557,075円
DC外国株式インデックス・オープン	5,400,527,088円
DCマイセレクションS25	255,710,558円
DCマイセレクションS50	1,371,365,821円
DCマイセレクションS75	1,029,060,459円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,257,535円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	144,649,766円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	135,892,952円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	54,834,898円
DC世界経済インデックスファンド	266,557,650円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	8,856,435,621円
マイセレクション50ＶＡ1（適格機関投資家専用）	224,148,061円
マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	107,330,670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）	497,984,827円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	380,041円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,184,789,129円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,507,092,042円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,765,875,565円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,663,003,653円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,028,031,965円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,279,282,773円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	8,067,404,064円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	17,874,135,367円

世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,158,978,133円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,333,637,800円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,417,057,286円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	441,389,617円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,092,660,639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）	6,953,405,703円
外国株式ファンド・シリーズ1	6,669,878,965円
コア投資戦略ファンド（安定型）	416,576,198円
コア投資戦略ファンド（成長型）	282,225,509円
2.　計算日における受益権総数	130,579,100,449口
3.　1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1703円 (11,703円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク（株価変動リスク、為替変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	18,314,703,857
投資信託受益証券	15,465,133
投資証券	303,306,481
合計	18,633,475,471

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在		
		契約額等(円)	時価	評価損益

			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建	5,817,524,765	－	5,880,646,250	63,121,485
合計		5,817,524,765	－	5,880,646,250	63,121,485

(注)1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売 建				
	アメリカドル	3,624,972,560	－	3,628,233,700	△3,261,140
	カナダドル	331,841,840	－	332,208,400	△366,560
	オーストラリアドル	260,074,800	－	260,268,000	△193,200
	イギリスポンド	651,979,280	－	652,421,000	△441,720
	スイスフラン	264,450,500	－	264,687,500	△237,000
	香港ドル	92,536,000	－	92,720,000	△184,000
	シンガポールドル	50,397,600	－	50,480,400	△82,800
	スウェーデンクローナ	90,717,000	－	90,750,000	△33,000
	ノルウェークローネ	28,778,400	－	28,818,000	△39,600
	デンマーククローネ	35,208,800	－	35,244,000	△35,200
	イスラエルシェケル	15,605,525	－	15,632,500	△26,975
	ユーロ	865,419,800	－	865,686,800	△267,000
	計	6,311,982,105	－	6,317,150,300	△5,168,195
合計		6,311,982,105	－	6,317,150,300	△5,168,195

(注)時価の算定方法
わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。
①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	31,994	77.55	2,481,134.70	
	APACHE CORP	25,078	81.82	2,051,881.96	
	BAKER HUGHES	28,182	44.30	1,248,462.60	
	CABOT OIL & GAS CORP	13,473	51.38	692,242.74	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	15,794	58.90	930,266.60	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	42,578	17.82	758,739.96	
	CHEVRON CORP	125,550	115.24	14,468,382.00	
	CIMAREX ENERGY CO	6,241	63.84	398,425.44	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	12,718	24.66	313,625.88	
	CONCHO RESOURCES INC	6,786	89.20	605,311.20	
	CONOCOPHILLIPS	73,933	59.27	4,382,008.91	
	CONSOL ENERGY INC	16,065	31.88	512,152.20	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	83.07	259,261.47	
	CORE LABORATORIES N.V.	3,400	114.26	388,484.00	
	DENBURY RESOURCES INC	26,636	18.19	484,508.84	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,654	54.28	1,338,219.12	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,048	73.35	370,270.80	
	ENERGEN CORP	5,220	48.70	254,214.00	
	ENSCO PLC-CL A	14,900	61.82	921,118.00	
	EOG RESOURCES INC	17,275	126.79	2,190,297.25	
	EQT CORPORATION	9,592	59.50	570,724.00	
	EXXON MOBIL	295,571	90.80	26,837,846.80	
	FMC TECHNOLOGIES INC	15,231	45.99	700,473.69	
	HALLIBURTON CO	59,422	37.50	2,228,325.00	
	HELMERICH & PAYNE	7,224	61.00	440,664.00	
	HESS CORP	19,653	57.66	1,133,191.98	
	HOLLYFRONTIER CORP	13,189	44.26	583,745.14	
	KINDER MORGAN INC	41,346	37.41	1,546,753.86	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,844	82.64	565,588.16	
	MARATHON OIL CORP	45,151	33.08	1,493,595.08	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,637	65.20	1,410,732.40	

MURPHY OIL CORP	11,792	61.33	723,203.36	
NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	15.67	312,224.75	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,338	72.76	1,989,112.88	
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,799	28.64	280,643.36	
NOBLE CORP	17,167	39.87	684,448.29	
NOBLE ENERGY INC	11,410	106.62	1,216,534.20	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,876	82.58	4,283,920.08	
OCEANEERING INTL INC	7,600	59.88	455,088.00	
PEABODY ENERGY CORP	18,869	25.97	490,027.93	
PHILLIPS 66	38,166	55.07	2,101,801.62	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,486	113.73	851,382.78	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,070	46.59	422,571.30	
QEP RESOURCES INC	12,861	29.81	383,386.41	
RANGE RESOURCES CORP	10,381	68.27	708,710.87	
ROWAN COMPANIES PLC	8,660	34.21	296,258.60	
SCHLUMBERGER	85,034	76.50	6,505,101.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	22,390	33.69	754,319.10	
SPECTRA ENERGY CORP	41,782	27.19	1,136,052.58	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,100	23.88	265,068.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	11,111	18.41	204,553.51	
VALERO ENERGY CORP	35,323	36.76	1,298,473.48	
WEATHERFORD INTL LTD	51,609	12.37	638,403.33	
WHITING PETROLEUM CORP	7,534	48.30	363,892.20	
WILLIAMS COS	44,008	34.74	1,528,837.92	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	13,572	88.69	1,203,700.68	
AIRGAS INC	4,422	93.61	413,943.42	
ALBEMARLE CORP	6,300	64.44	405,972.00	
ALCOA	68,359	9.00	615,231.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,356	29.89	219,870.84	
BALL CORP	10,006	46.65	466,779.90	
CELANESE CORP-SERIES A	11,037	47.22	521,167.14	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,972	219.06	870,106.32	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,062	37.25	374,809.50	
CROWN HOLDINGS INC	9,507	38.48	365,829.36	
DOW CHEMICAL CO	76,715	33.80	2,592,967.00	
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	59,573	46.99	2,799,335.27	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,833	71.22	700,306.26	
ECOLAB INC	18,769	73.82	1,385,527.58	

FMC CORP	8,760	60.61	530,943.60	
FREEPORT-MCMOR-B	60,777	33.64	2,044,538.28	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,209	70.56	367,547.04	
INT'L PAPER CO	26,561	41.91	1,113,171.51	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,204	62.59	1,264,568.36	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,355	98.00	328,790.00	
MEADWESTVACO CORP	11,116	32.49	361,158.84	
MONSANTO CO	34,097	102.47	3,493,919.59	
MOSAIC CO/THE	19,752	59.38	1,172,873.76	
NEWMONT MINING CORP	31,783	44.89	1,426,738.87	
NUCOR CORP	20,375	47.52	968,220.00	
OWENS-ILLINOIS INC	10,981	22.87	251,135.47	
PPG INDUSTRIES INC	9,825	142.73	1,402,322.25	
PRAXAIR INC	19,142	113.52	2,172,999.84	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,515	74.80	337,722.00	
SEALED AIR CORP	13,274	18.80	249,551.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,597	164.02	918,019.94	
SIGMA-ALDRICH	7,752	76.93	596,361.36	
UNITED STATES STEEL CORP	9,828	24.77	243,439.56	
VULCAN MATERIALS CO	8,255	56.69	467,975.95	
3 M COMPANY	42,015	98.74	4,148,561.10	
AGCO CORP	6,228	51.67	321,800.76	
AMETEK INC	15,556	39.36	612,284.16	
BOEING CO	45,708	75.04	3,429,928.32	
CATERPILLAR	41,833	97.62	4,083,737.46	
CUMMINS INC	11,549	115.59	1,334,948.91	
DANAHER CORP	37,805	60.51	2,287,580.55	
DEERE&CO	23,875	90.96	2,171,670.00	
DOVER CORP	11,694	68.03	795,542.82	
EATON CORP	29,714	56.67	1,683,892.38	
EMERSON ELECTRIC CO	46,592	55.89	2,604,026.88	
FASTENAL CO	18,050	48.60	877,230.00	
FLOWSERVE CORP	3,250	157.31	511,257.50	
FLUOR CORP	10,644	63.31	673,871.64	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,238	70.66	1,359,357.08	
GENERAL ELECTRIC CO	675,859	22.04	14,895,932.36	
GRAINGER (WW) INC	3,764	210.23	791,305.72	
HONEYWELL INTL INC	47,530	67.81	3,223,009.30	

ILLINOIS TOOL WORKS	26,975	63.72	1,718,847.00	
INGERSOLL-RAND PLC	19,772	50.63	1,001,056.36	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,267	46.05	380,695.35	
JOY GLOBAL INC	6,782	69.01	468,025.82	
KBR INC	9,414	30.58	287,880.12	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,220	78.81	490,198.20	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,689	93.97	1,662,235.33	
MASCO CORP	23,016	17.78	409,224.48	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,996	67.49	1,012,080.04	
PACCAR INC	21,555	46.37	999,505.35	
PALL CORP	7,879	67.40	531,044.60	
PARKER HANNIFIN CORP	9,601	93.70	899,613.70	
PENTAIR LTD	13,375	52.58	703,257.50	
PRECISION CASTPARTS CORP	9,340	185.36	1,731,262.40	
QUANTA SERVICES INC	14,288	28.84	412,065.92	
RAYTHEON COMPANY	21,240	58.10	1,234,044.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,089	87.74	797,468.86	
ROCKWELL COLLIN	8,686	58.99	512,387.14	
ROPER INDUSTRIES INC	6,250	116.36	727,250.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	33.70	208,940.00	
SPX CORP	3,411	71.29	243,170.19	
STANLEY BLACK&DECKER	10,228	76.95	787,044.60	
TEXTRON	17,975	27.22	489,279.50	
TRANSDIGM GROUP INC	3,100	136.22	422,282.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	55,452	86.95	4,821,551.40	
XYLEM INC	11,923	27.51	328,001.73	
ADT CORPORATION	14,844	47.98	712,215.12	
AVERY DENNISON CORP	6,957	35.93	249,965.01	
CINTAS CORP	7,706	42.41	326,811.46	
DUN & BRADSTREET CORP	2,850	79.98	227,943.00	
EQUIFAX INC	7,690	58.45	449,480.50	
IHS INC-CLASS A	3,625	99.47	360,578.75	
IRON MOUNTAIN INC	9,702	34.20	331,808.40	
MANPOWER GROUP	5,455	47.16	257,257.80	
NIELSEN HOLDINGS NV	8,925	31.63	282,297.75	
PITNEY BOWES INC	14,548	11.62	169,047.76	
REPUBLIC SERVICES INC	19,910	30.60	609,246.00	
ROBERT HALF INTL INC	8,611	34.00	292,774.00	

STERICYCLE INC	5,506	95.00	523,070.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	29,488	31.37	925,038.56	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,032	54.58	492,966.56	
WASTE MANAGEMENT INC	28,239	35.25	995,424.75	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,377	65.50	679,693.50	
CSX CORP	66,599	20.91	1,392,585.09	
DELTA AIR LINES INC	15,452	13.61	210,301.72	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,476	42.87	577,716.12	
FEDEX CORP	19,149	99.82	1,911,453.18	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	17.84	334,446.48	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,371	63.08	401,882.68	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,011	87.63	614,373.93	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,431	66.70	1,362,747.70	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	11.26	146,233.62	
UNION PACIFIC CORP	30,298	132.49	4,014,182.02	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	24.79	133,642.89	
UNITED PARCEL SERVICE B	46,481	80.25	3,730,100.25	
AUTOLIV INC	6,106	65.33	398,904.98	
BORGWARNER INC	7,364	75.63	556,939.32	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,700	38.82	764,754.00	
FORD MOTOR COMPANY	228,314	14.11	3,221,510.54	
GENERAL MOTORS CO	50,268	29.28	1,471,847.04	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	15,689	13.81	216,665.09	
HARLEY-DAVIDSON	14,685	52.11	765,235.35	
JOHNSON CONTROLS INC	43,933	31.01	1,362,362.33	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	56.00	395,024.00	
COACH INC	18,273	61.80	1,129,271.40	
DR HORTON INC	19,578	21.52	421,318.56	
FOSSIL INC	3,299	105.00	346,395.00	
GARMIN LTD	8,014	39.52	316,713.28	
HASBRO INC	8,070	39.02	314,891.40	
LEGGETT & PLATT INC	9,883	28.55	282,159.65	
LENNAR CORP-CL A	10,200	42.08	429,216.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,482	66.80	432,997.60	
MATTEL INC	21,913	38.03	833,351.39	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,720	96.30	358,236.00	
NEWELL RUBBERMAID	18,525	23.12	428,298.00	
NIKE B	46,722	53.29	2,489,815.38	

POLARIS INDUSTRIES INC	4,200	90.10	378,420.00	
PULTE GROUP INC	22,200	20.49	454,878.00	
PVH CORP	4,500	118.02	531,090.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,911	167.70	655,874.70	
TOLL BROTHERS INC	10,462	36.05	377,155.10	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,500	46.26	254,430.00	
VF CORP	5,622	147.94	831,718.68	
WHIRLPOOL CORP	5,027	102.31	514,312.37	
BLOCK H & R INC	17,408	20.56	357,908.48	
CARNIVAL CORPORATION	28,751	38.58	1,109,213.58	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,999	295.02	589,744.98	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,264	45.38	375,020.32	
INT'L GAME TECHNOLOGY	18,760	15.01	281,587.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	26,472	52.22	1,382,367.84	
MARRIOTT INTL A	16,582	39.27	651,175.14	
MCDONALD'S CORP	64,727	92.26	5,971,713.02	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,672	36.90	356,896.80	
STARBUCKS CORP	48,794	54.81	2,674,399.14	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	12,601	60.02	756,312.02	
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	9,100	56.10	510,510.00	
WYNN RESORTS LTD	5,148	124.06	638,660.88	
YUM BRANDS INC	29,285	65.15	1,907,917.75	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,601	15.33	208,503.33	
CBS CORP-CL B	38,278	40.42	1,547,196.76	
CHARTER COMMUNICATION-A	2,800	78.83	220,724.00	
COMCAST CORP-CL A	135,849	40.28	5,471,997.72	
COMCAST CORP-SPECIAL A	37,098	38.67	1,434,579.66	
DIRECTV	40,323	53.36	2,151,635.28	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,366	67.72	634,265.52	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,103	61.86	377,531.58	
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,629	37.93	516,947.97	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	29,860	11.94	356,528.40	
LIBERTY GLOBAL INC-A	8,834	69.43	613,344.62	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	7,161	65.23	467,112.03	
LIBERTY MEDIA CORP	7,086	110.55	783,357.30	
MCGRAW-HILL COS	16,178	54.34	879,112.52	
NEWS CORP -CLASS A	100,502	27.26	2,739,684.52	
NEWS CORP -CLASS B	28,156	27.83	783,581.48	

OMNICOM GROUP	17,103	53.23	910,392.69	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,475	59.02	323,134.50	
SIRIUS XM RADIO INC	246,155	3.16	777,849.80	
STARZ-LIBERTY CAPITAL	7,086	15.69	111,179.34	
THE WALT DISNEY CO	109,467	52.34	5,729,502.78	
TIME WARNER CABLE-A	19,703	100.54	1,980,939.62	
TIME WARNER INC	60,929	49.93	3,042,184.97	
VIACOM INC-CLASS B	29,789	57.88	1,724,187.32	
VIRGIN MEDIA INC	16,409	38.57	632,895.13	
ADVANCE AUTO PARTS	5,036	73.75	371,405.00	
AMAZON.COM	23,200	272.12	6,313,184.00	
AUTOZONE INC	2,205	349.60	770,868.00	
BED BATH & BEYOND INC	14,908	55.40	825,903.20	
BEST BUY COMPANY INC	18,508	14.88	275,399.04	
CARMAX INC	14,687	38.50	565,449.50	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,200	48.31	299,522.00	
DOLLAR GENERAL CORP	16,836	44.65	751,727.40	
DOLLAR TREE INC	14,766	38.52	568,786.32	
EXPEDIA INC	6,277	62.21	390,492.17	
FAMILY DOLLAR STORES	6,337	58.37	369,890.69	
GAMESTOP CORP-CLASS A	7,982	23.28	185,820.96	
GAP	20,065	32.96	661,342.40	
GENUINE PARTS CO	9,940	65.42	650,274.80	
HOME DEPOT	96,793	65.47	6,337,037.71	
J.C. PENNEY CO INC	11,122	18.87	209,872.14	
KOHLS CORP	14,348	43.83	628,872.84	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	33,040	20.98	693,179.20	
LIMITED	15,707	46.91	736,815.37	
LKQ CORP	19,000	22.64	430,160.00	
LOWES COMPANIES	75,543	36.99	2,794,335.57	
MACY'S INC	25,810	38.42	991,620.20	
NETFLIX INC	3,554	99.17	352,450.18	
NORDSTROM INC	10,373	55.52	575,908.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,607	88.91	676,338.37	
PETSMART INC	6,960	68.66	477,873.60	
PRICELINE.COM INC	3,239	672.72	2,178,940.08	
ROSS STORES INC	14,506	58.21	844,394.26	
SEARS HOLDINGS CORPORATION	2,537	46.66	118,376.42	

STAPLES INC	43,810	13.00	569,530.00	
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,992	61.53	2,460,707.76	
TIFFANY & CO	8,110	63.80	517,418.00	
TJX COMPANIES INC	47,290	44.75	2,116,227.50	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,800	94.04	451,392.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,800	94.29	358,302.00	
URBAN OUTFITTERS INC	7,459	43.39	323,646.01	
COSTCO WHOLESALE CORP	27,675	101.20	2,800,710.00	
CVS CAREMARK CORPORATION	81,526	52.11	4,248,319.86	
KROGER CO	33,129	27.08	897,133.32	
SAFEWAY INC	17,252	18.64	321,577.28	
SYSCO CORP	37,541	31.47	1,181,415.27	
WALGREEN CO	57,293	39.21	2,246,458.53	
WAL-MART STORES	119,142	69.20	8,244,626.40	
WHOLE FOODS MKT INC	11,201	90.54	1,014,138.54	
ALTRIA GROUP INC	130,191	33.27	4,331,454.57	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,161	28.64	1,207,491.04	
BEAM INC	9,155	61.73	565,138.15	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	7,852	64.62	507,396.24	
BUNGE LIMITED	9,331	77.00	718,487.00	
CAMPBELL SOUP CO (US)	12,947	36.29	469,846.63	
COCA-COLA CO	260,036	37.70	9,803,357.20	
COCA-COLA ENTERPRISES	18,820	34.28	645,149.60	
CONAGRA	26,013	31.70	824,612.10	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,792	38.74	418,082.08	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,455	45.30	609,511.50	
GENERAL MILLS INC	41,521	41.37	1,717,723.77	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,107	40.60	369,744.20	
HEINZ (H.J) CO	20,511	60.03	1,231,275.33	
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,098	78.28	790,471.44	
HORMEL FOODS CORP	9,753	34.69	338,331.57	
JM SMUCKER CO	7,111	89.56	636,861.16	
KELLOGG CO	16,009	58.21	931,883.89	
KRAFT FOODS GROUP INC	35,972	47.06	1,692,842.32	
LORILLARD INC	27,381	39.51	1,081,823.31	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,331	66.65	555,261.15	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	13,010	66.80	869,068.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,147	44.84	454,991.48	

MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,018	28.08	3,033,145.44	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,598	47.82	458,976.36	
PEPSICO INC	99,629	72.48	7,221,109.92	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	107,934	89.98	9,711,901.32	
RALCORP HOLDINGS INC	3,686	89.91	331,408.26	
REYNOLDS AMERICAN INC	21,684	42.53	922,220.52	
TYSON FOODS INC	18,671	21.85	407,961.35	
AVON PRODUCTS INC	27,701	15.97	442,384.97	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,912	57.00	507,984.00	
CLOROX COMPANY	8,419	76.84	646,915.96	
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,360	109.01	3,309,543.60	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,136	87.47	361,775.92	
ESTEE LAUDER CO-CL A	15,091	62.85	948,469.35	
HERBALIFE LTD	8,060	43.50	350,610.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,249	86.82	2,192,118.18	
PROCTER & GAMBLE CO	176,552	69.94	12,348,046.88	
AETNA INC	21,423	46.93	1,005,381.39	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,173	45.85	787,382.05	
BARD C R INC	5,544	101.59	563,214.96	
BAXTER INTERNATIONAL	35,000	67.05	2,346,750.00	
BECTON DICKINSON & CO	12,768	83.94	1,071,745.92	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	90,853	6.70	608,715.10	
CARDINAL HEALTH	21,800	44.64	973,152.00	
CAREFUSION CORP	15,118	30.72	464,424.96	
CERNER CORP	9,927	81.19	805,973.13	
CIGNA CORP	18,486	56.33	1,041,316.38	
COVENTRY HEALTH CARE INCON	9,397	45.21	424,838.37	
COVIDIEN PLC	30,755	61.00	1,876,055.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	6,279	113.23	710,971.17	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,064	40.85	411,114.40	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,927	94.56	749,577.12	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	51,903	55.15	2,862,450.45	
HCA HOLDINGS INC	12,675	36.95	468,341.25	
HENRY SCHEIN INC	5,641	84.97	479,315.77	
HOLOGIC INC	16,992	23.21	394,384.32	
HUMANA INC	10,332	71.40	737,704.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,557	508.33	1,299,799.81	
LABORATORY CRP OF AMER	6,126	88.53	542,334.78	

MCKESSON CORP	15,118	103.98	1,571,969.64	
MEDTRONIC	65,602	45.67	2,996,043.34	
OMNICARE INC	8,245	38.62	318,421.90	
PATTERSON COMPANIES INC	6,126	35.46	217,227.96	
QUEST DIAGNOSTICS	10,148	61.40	623,087.20	
RESMED INC	10,000	44.59	445,900.00	
ST JUDE MEDICAL INC	21,327	39.45	841,350.15	
STRYKER CORP	19,489	61.55	1,199,547.95	
UNITEDHEALTH GROUP INC	66,174	54.56	3,610,453.44	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,099	75.09	533,063.91	
WELLPOINT INC	20,858	62.75	1,308,839.50	
ZIMMER HOLDINGS INC	11,180	73.61	822,959.80	
ABBOTT LABORATORIES	100,553	32.74	3,292,105.22	
ABBVIE INC	100,553	37.32	3,752,637.96	
AGILENT TECHNOLOGIES	22,215	44.15	980,792.25	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,379	97.42	1,205,962.18	
ALLERGAN INC	19,694	104.98	2,067,476.12	
AMGEN	49,353	82.07	4,050,400.71	
BIOGEN IDEC INC	14,429	144.28	2,081,816.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	107,496	34.46	3,704,312.16	
CELGENE CORP	27,581	100.03	2,758,927.43	
FOREST LABORATORIES INC	18,062	36.77	664,139.74	
GILEAD SCIENCES INC	48,421	78.29	3,790,880.09	
HOSPIRA INC	12,012	34.91	419,338.92	
ILLUMINA INC	7,915	51.03	403,902.45	
JOHNSON & JOHNSON	176,598	73.23	12,932,271.54	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	11,915	60.79	724,312.85	
LILLY (ELI) & CO	66,867	53.77	3,595,438.59	
MERCK & CO	195,083	42.98	8,384,667.34	
MYLAN INC	26,016	28.00	728,448.00	
PERRIGO CO	6,008	103.93	624,411.44	
PFIZER	478,347	26.54	12,695,329.38	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,800	167.97	806,256.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	23,392	69.40	1,623,404.80	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,845	46.31	641,161.95	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	14,903	13.56	202,084.68	
WATERS CORP	6,109	91.89	561,356.01	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	8,211	85.48	701,876.28	

BB&T CORP	44,809	31.04	1,390,871.36	
CIT GROUP INC	12,244	39.80	487,311.20	
COMERICA INC	13,567	33.66	456,665.22	
FIFTH THIRD BANCORP	58,896	16.38	964,716.48	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,400	35.89	229,696.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	8.59	283,049.09	
KEY CORP	60,410	9.28	560,604.80	
M & T BANK CORP	7,259	103.29	749,782.11	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	28,108	13.57	381,425.56	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	24,989	12.39	309,613.71	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,876	61.84	2,094,891.84	
REGIONS FINL CORP	90,530	7.43	672,637.90	
SUNTRUST BANKS	34,503	29.14	1,005,417.42	
US BANCORP	121,395	32.87	3,990,253.65	
WELLS FARGO & CO	321,356	34.93	11,224,965.08	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,300	142.42	469,986.00	
AMERICAN EXPRESS	65,391	59.78	3,909,073.98	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,527	65.90	891,429.30	
BANK NEW YORK CO	75,676	26.53	2,007,684.28	
BANK OF AMERICA CORP	690,179	11.14	7,688,594.06	
BLACKROCK INC	8,573	233.93	2,005,481.89	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,218	56.99	2,121,053.82	
CITIGROUP	187,778	41.66	7,822,831.48	
CME GROUP INC	20,185	55.50	1,120,267.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32,948	38.55	1,270,145.40	
EATON VANCE CORP	7,818	34.81	272,144.58	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,521	133.39	1,270,006.19	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,170	144.45	4,213,606.50	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,658	133.33	621,051.14	
INVESCO LTD	28,553	27.66	789,775.98	
JPMORGAN CHASE & CO	243,250	46.46	11,301,395.00	
LEGG MASON INC	9,201	27.49	252,935.49	
LEUCADIA NATIONAL CORP	14,405	24.10	347,160.50	
MOODY'S CORP	12,844	53.60	688,438.40	
MORGAN STANLEY	94,849	22.38	2,122,720.62	
NASDAQ OMX GROUP	9,473	27.12	256,907.76	
NORTHERN TRUST CORP	13,902	50.25	698,575.50	
NYSE EURONEXT	15,717	33.33	523,847.61	

PRICE T ROWE GROUP INC	16,291	71.13	1,158,778.83	
SCHWAB (CHARLES) CORP	69,374	15.45	1,071,828.30	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	24.86	257,276.14	
SLM CORP	30,051	16.88	507,260.88	
STATE STREET CORP	30,692	53.36	1,637,725.12	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,221	18.45	280,827.45	
ACE LTD	21,720	83.24	1,807,972.80	
AFLAC	30,009	51.47	1,544,563.23	
ALLEGHANY CORP	880	351.20	309,056.00	
ALLSTATE CORP	31,088	43.21	1,343,312.48	
AMERICAN INT'L GROUP	89,772	35.09	3,150,099.48	
AON PLC	19,653	57.11	1,122,382.83	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,772	44.56	390,880.32	
ASSURANT INC	5,682	37.29	211,881.78	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,295	36.88	305,919.60	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	59,151	95.16	5,628,809.16	
CHUBB CORPORATION	16,992	79.03	1,342,877.76	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,869	41.62	410,747.78	
EVEREST RE GROUP LTD	3,622	113.01	409,322.22	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	25.91	336,130.43	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	26,512	24.39	646,627.68	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,903	27.73	496,450.19	
LOEWS CORP	20,311	42.82	869,717.02	
MARSH & MCLENNAN COS	34,868	34.94	1,218,287.92	
METLIFE INC	54,413	36.31	1,975,736.03	
PARTNERRE LTD	4,403	83.53	367,782.59	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,945	29.51	559,066.95	
PROGRESSIVE CORP	37,071	22.72	842,253.12	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,724	57.71	1,715,372.04	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	82.02	301,177.44	
TORCHMARK CORP	6,464	53.76	347,504.64	
TRAVELERS COS INC/THE	24,698	76.31	1,884,704.38	
UNUM GROUP	19,659	22.50	442,327.50	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,123	34.75	386,524.25	
WR BERKLEY CORP	8,075	40.17	324,372.75	
XL GROUP PLC	19,576	27.22	532,858.72	
CBRE GROUP INC-A	19,935	20.55	409,664.25	
WEYERHAEUSER CO	34,464	30.63	1,055,632.32	

ACCENTURE PLC-CL A	40,651	70.11	2,850,041.61	
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,726	11.36	360,407.36	
ADOBE SYSTEMS INC	31,521	37.98	1,197,167.58	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	11,333	39.96	452,866.68	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,162	155.80	492,639.60	
ANSYS INC	5,900	73.08	431,172.00	
AUTODESK INC	15,451	37.50	579,412.50	
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,074	59.72	1,855,739.28	
BMC SOFTWARE	10,193	43.81	446,555.33	
CA INC	22,390	24.57	550,122.30	
CITRIX SYSTEMS INC	11,969	67.65	809,702.85	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,099	79.31	1,514,741.69	
COMPUTER SCIENCES CORP	10,567	41.87	442,440.29	
EBAY	74,280	54.21	4,026,718.80	
ELECTRONIC ARTS INC	22,359	14.46	323,311.14	
EQUINIX INC	3,100	219.96	681,876.00	
FACEBOOK INC-A	63,400	29.67	1,881,078.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,101	37.06	559,643.06	
FISERV INC	8,718	81.24	708,250.32	
GOOGLE INC-CL A	16,816	704.95	11,854,439.20	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,502	194.47	13,516,053.94	
INTUIT INC	17,901	63.68	1,139,935.68	
LINKEDIN CORP - A	5,100	119.02	607,002.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	6,903	521.00	3,596,463.00	
MICROSOFT CORP	483,191	27.25	13,166,954.75	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,387	23.23	403,900.01	
ORACLE CORP	250,124	35.11	8,781,853.64	
PAYCHEX INC	20,906	32.38	676,936.28	
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	77.78	536,682.00	
RED HAT INC	13,093	54.15	708,985.95	
SAIC INC	19,851	11.97	237,616.47	
SALESFORCE.COM INC	8,438	170.02	1,434,628.76	
SYMANTEC CORP	44,986	20.68	930,310.48	
SYNOPSYS INC	10,482	32.24	337,939.68	
TERADATA CORP	10,792	65.61	708,063.12	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	23.62	269,905.74	
VERIFONE SYSTEMS INC	7,500	32.44	243,300.00	
VERISIGN INC	9,971	39.55	394,353.05	

VISA INC-CLASS A SHARES	33,769	158.27	5,344,619.63	
VMWARE INC-CLASS A	5,218	93.81	489,500.58	
WESTERN UNION CO	38,595	13.41	517,558.95	
YAHOO	72,079	20.02	1,443,021.58	
AMPHENOL CORPORATION	10,281	67.57	694,687.17	
APPLE INC	60,100	500.00	30,050,000.00	
ARROW ELECTRONICS INC	7,742	37.92	293,576.64	
AVNET INC	10,281	32.07	329,711.67	
CISCO SYSTEMS	343,028	21.02	7,210,448.56	
CORNING	95,375	12.10	1,154,037.50	
DELL INC	94,402	12.86	1,214,009.72	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	30.42	108,690.66	
EMC CORP	134,391	24.33	3,269,733.03	
F5 NETWORKS INC	5,014	96.89	485,806.46	
FLEXTRONICS INTL LTD	42,618	6.65	283,409.70	
FLIR SYSTEMS INC	10,809	23.84	257,686.56	
HARRIS CORP	8,024	49.94	400,718.56	
HEWLETT-PACKARD CO	126,248	17.11	2,160,103.28	
JUNIPER NETWORKS INC	33,769	21.49	725,695.81	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,500	59.01	973,665.00	
NETAPP INC	23,232	34.36	798,251.52	
QUALCOMM	109,090	64.68	7,055,941.20	
SANDISK CORP	15,466	48.46	749,482.36	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,872	35.38	809,211.36	
TE CONNECTIVITY LTD	27,379	38.72	1,060,114.88	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	8,000	62.18	497,440.00	
WESTERN DIGITAL CORP	14,231	44.81	637,691.11	
XEROX CORP	83,738	7.64	639,758.32	
AT&T INC	372,519	33.44	12,457,035.36	
CENTURYLINK INC	40,211	40.02	1,609,244.22	
CROWN CASTLE INTL CORP	18,914	74.29	1,405,121.06	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	72,707	4.48	325,727.36	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	21,951	9.40	206,339.40	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,348	71.30	595,212.40	
SPRINT NEXTEL CORPORATION	193,702	5.65	1,094,416.30	
VERIZON COMMUNICATIONS	184,001	42.54	7,827,402.54	
WINDSTREAM CORP	38,003	9.63	365,968.89	
AES CORP	40,707	11.14	453,475.98	

ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,120	45.69	325,312.80	
AMEREN CORPORATION	16,496	31.70	522,923.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,087	43.51	1,352,595.37	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,962	37.91	453,479.42	
CALPINE CORP	21,301	18.82	400,884.82	
CENTERPOINT ENERGY INC	27,654	20.02	553,633.08	
CMS ENERGY CORP	18,200	25.09	456,638.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	18,783	55.78	1,047,715.74	
DOMINION RESOURCES	36,684	52.92	1,941,317.28	
DTE ENERGY COMPANY	11,016	61.90	681,890.40	
DUKE ENERGY CORP	45,069	66.81	3,011,059.89	
EDISON INTL	19,794	46.55	921,410.70	
ENTERGY CORP	11,375	63.87	726,521.25	
EXELON CORP	54,624	30.37	1,658,930.88	
FIRSTENERGY CORP	26,762	39.89	1,067,536.18	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,734	54.29	311,298.86	
MDU RESOURCES GROUP INC	12,623	22.20	280,230.60	
NEXTERA ENERGY INC	25,738	71.55	1,841,553.90	
NISOURCE INC	18,279	26.24	479,640.96	
NORTHEAST UTILITIES	20,053	39.21	786,278.13	
NRG ENERGY INC	15,935	23.89	380,687.15	
OGE ENERGY CORP	6,900	57.18	394,542.00	
ONEOK INC	12,458	46.94	584,778.52	
PEPCO HOLDINGS INC	16,574	19.04	315,568.96	
PG&E CORP	27,337	41.01	1,121,090.37	
PINNACLE WEST CAPITAL	7,000	52.44	367,080.00	
PPL CORPORATION	37,165	29.38	1,091,907.70	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	32,425	29.83	967,237.75	
SCANA CORP	8,735	46.28	404,255.80	
SEMPRA ENERGY	14,732	73.19	1,078,235.08	
SOUTHERN CO	56,028	43.49	2,436,657.72	
WISCONSIN ENERGY CORP	14,762	38.11	562,579.82	
XCEL ENERGY INC	31,224	27.01	843,360.24	
ALTERA CORPORATION	20,453	35.63	728,740.39	
ANALOG DEVICES	19,122	43.06	823,393.32	
APPLIED MATERIALS	79,289	12.65	1,003,005.85	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	16,810	34.44	578,936.40	
BROADCOM CORP-CL A	32,494	34.80	1,130,791.20	

	CREE INC	7,602	33.75	256,567.50	
	INTEL CORP	320,449	21.25	6,809,541.25	
	KLA-TENCOR CORP	10,643	51.84	551,733.12	
	LAM RESEARCH CORP	11,684	40.12	468,762.08	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,628	36.48	570,109.44	
	LSI CORP	39,045	7.33	286,199.85	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	30,622	8.68	265,798.96	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	19,904	30.53	607,669.12	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,579	33.54	455,439.66	
	MICRON TECHNOLOGY	69,687	7.89	549,830.43	
	NVIDIA CORP	39,713	12.17	483,307.21	
	TEXAS INSTRUMENTS	72,897	33.52	2,443,507.44	
	XILINX INC	17,848	37.17	663,410.16	
アメリカドル小計		19,683,963		877,908,186.63 (78,871,271,486)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	18,664	23.79	444,016.56	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	22,554	10.83	244,259.82	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,144	44.00	358,336.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	11,661	14.12	164,653.32	
	CAMECO CORP	25,291	21.35	539,962.85	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	70,000	29.95	2,096,500.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	30,993	20.60	638,455.80	
	CENOVUS ENERGY INC	48,378	33.05	1,598,892.90	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,215	38.55	856,388.25	
	ENBRIDGE	48,392	44.15	2,136,506.80	
	ENCANA CORP	47,167	19.21	906,078.07	
	ENERPLUS CORP	13,454	13.22	177,861.88	
	HUSKY ENERGY INC	22,007	31.22	687,058.54	
	IMPERIAL OIL	19,036	43.61	830,159.96	
	MEG ENERGY CORP	9,188	33.22	305,225.36	
	NEXEN INC	33,895	26.81	908,724.95	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	19,359	22.37	433,060.83	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,522	29.13	539,545.86	
	PENGROWTH ENERGY CORP	36,075	4.83	174,242.25	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	32,212	10.60	341,447.20	
	SUNCOR ENERGY	98,557	33.74	3,325,313.18	
	TALISMAN ENERGY INC	66,047	12.27	810,396.69	
	TOURMALINE OIL CORP	8,840	32.53	287,565.20	
	TRANSCANADA CORP	44,916	48.91	2,196,841.56	

VERMILION ENERGY INC	6,014	51.10	307,315.40	
AGNICO-EAGLE MINES	11,012	50.12	551,921.44	
AGRIUM INC	9,552	106.57	1,017,956.64	
BARRICK GOLD CORP	63,366	33.75	2,138,602.50	
CENTERRA GOLD INC	11,462	9.50	108,889.00	
ELDORADO GOLD CORP	43,374	12.70	550,849.80	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,545	21.25	649,081.25	
FRANCO-NEVADA CORP	9,327	54.92	512,238.84	
GOLDCORP INC	51,938	36.83	1,912,876.54	
IAMGOLD CORP	24,043	10.88	261,587.84	
INMET MINING CORPORATION	3,603	71.16	256,389.48	
KINROSS GOLD CORP	72,948	9.45	689,358.60	
NEW GOLD INC	29,614	10.85	321,311.90	
OSISKO MINING CORP	27,237	7.79	212,176.23	
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,864	18.28	198,593.92	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	54,964	41.13	2,260,669.32	
SILVER WHEATON CORP	22,635	35.95	813,728.25	
TECK RESOURCES LTD-CL B	36,978	37.07	1,370,774.46	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	25,654	8.71	223,446.34	
YAMANA GOLD INC	48,054	17.19	826,048.26	
BOMBARDIER B	92,278	4.12	380,185.36	
CAE INC	18,721	10.76	201,437.96	
FINNING INTERNATIONAL INC	10,988	26.11	286,896.68	
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,686	44.36	429,670.96	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,399	21.29	136,234.71	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,642	94.52	2,612,721.84	
CP RAILWAY LIMITED	10,745	109.17	1,173,031.65	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,295	53.02	757,920.90	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,836	36.81	288,443.16	
TIM HORTONS INC	9,922	49.99	496,000.78	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,232	23.50	569,452.00	
THOMSON REUTERS CORP	23,876	29.87	713,176.12	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,033	69.19	348,233.27	
DOLLARAMA INC	4,900	59.55	291,795.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,661	49.05	424,822.05	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	60.50	126,566.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,709	40.40	311,443.60	
METRO INC	6,626	62.60	414,787.60	

	SHOPPERS DRUG MART CORP	13,265	41.83	554,874.95	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,577	71.25	254,861.25	
	SAPUTO INC	8,240	49.88	411,011.20	
	CATAMARAN CORPORATION	13,100	51.51	674,781.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,532	63.20	1,171,222.40	
	BANK MONTREAL	41,123	63.23	2,600,207.29	
	BANK NOVA SCOTIA	73,242	57.86	4,237,782.12	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	25,782	83.00	2,139,906.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	10,325	78.76	813,197.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	92,367	61.74	5,702,738.58	
	TORONTO-DOMINION BANK	58,437	82.95	4,847,349.15	
	CI FINANCIAL CORP	10,864	25.91	281,486.24	
	IGM FINANCIAL INC	6,534	42.83	279,851.22	
	ONEX CORP	6,404	43.34	277,549.36	
	GREAT-WEST LIFECO INC	18,247	25.37	462,926.39	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	34.36	211,210.92	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,262	65.87	544,217.94	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	116,218	14.30	1,661,917.40	
	POWER CORP OF CANADA	22,360	26.06	582,701.60	
	POWER FINANCIAL CORP	15,870	28.40	450,708.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	38,074	28.71	1,093,104.54	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	35,621	36.63	1,304,797.23	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	17,731	16.63	294,866.53	
	CGI GROUP INC - CL A	13,049	24.45	319,048.05	
	OPEN TEXT CORP	3,975	59.46	236,353.50	
	RESEARCH IN MOTION	30,241	15.71	475,086.11	
	BCE INC	16,538	43.06	712,126.28	
	BELL ALIANT INC	5,225	26.23	137,051.75	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	24,690	46.23	1,141,418.70	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	9,727	65.60	638,091.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	3,632	74.55	270,765.60	
	FORTIS INC	12,903	34.49	445,024.47	
	TRANSALTA CORP	17,521	16.21	284,015.41	
カナダドル小計		2,458,215		81,660,378.86 (7,392,714,098)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	19.14	188,816.10	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	69,813	12.08	843,341.04	
	SANTOS	61,197	11.78	720,900.66	

WHITEHAVEN COAL LTD	33,110	3.57	118,202.70	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	42,213	35.30	1,490,118.90	
WORLEYPARSONS LTD	13,182	24.00	316,368.00	
ALUMINA LIMITED	163,150	1.08	177,017.75	
AMCOR	77,280	8.47	654,561.60	
BHP BILLITON LTD	206,505	36.50	7,537,432.50	
BORAL LIMITED	48,581	4.90	238,046.90	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,738	4.52	405,615.76	
ILUKA RESOURCES LTD	26,815	9.80	262,787.00	
INCITEC PIVOT LTD	110,879	3.16	350,377.64	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,080	9.60	269,568.00	
NEWCREST MINING LIMITED	48,993	23.00	1,126,839.00	
ORICA LTD	23,417	25.69	601,582.73	
OZ MINERALS LTD	21,913	7.30	159,964.90	
RIO TINTO LTD	27,907	66.35	1,851,629.45	
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	11,082	9.98	110,598.36	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	10,493	19.08	200,206.44	
ALS LTD	21,808	10.95	238,797.60	
BRAMBLES LTD	99,600	7.82	778,872.00	
ASCIANO GROUP	66,402	4.78	317,401.56	
AURIZON HOLDINGS LTD	116,346	3.97	461,893.62	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.52	117,266.48	
TOLL HOLDINGS LIMITED	47,207	4.99	235,562.93	
TRANSURBAN GROUP	84,248	6.09	513,070.32	
CROWN LTD	27,273	11.80	321,821.40	
ECHO ENTERTAIMENT GROUP LIMITED	47,591	3.54	168,472.14	
FLIGHT CENTRE LTD	3,863	28.03	108,279.89	
TABCORP HOLDINGS	51,765	3.06	158,400.90	
TATTS GROUP LTD	87,285	3.16	275,820.60	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	1.97	76,459.64	
METCASH LTD	62,759	3.59	225,304.81	
WESFARMERS LIMITED	64,465	37.69	2,429,685.85	
WOOLWORTHS LTD	78,922	30.88	2,437,111.36	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	36,568	13.45	491,839.60	
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,425	4.80	218,040.00	
COCHLEAR LIMITED	3,879	81.62	316,603.98	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,412	28.75	241,845.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	25,385	13.51	342,951.35	

	CSL LIMITED	32,378	54.61	1,768,162.58	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	173,942	25.59	4,451,175.78	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,405	9.02	229,153.10	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	101,966	62.46	6,368,796.36	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	145,580	26.35	3,836,033.00	
	WESTPAC BANKING	197,258	26.59	5,245,090.22	
	ASX LTD	11,216	33.29	373,380.64	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	20,689	36.56	756,389.84	
	AMP LTD	185,400	5.25	973,350.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	133,147	4.98	663,072.06	
	QBE INSURANCE GROUP	75,679	11.75	889,228.25	
	SUNCORP GROUP LIMITED	82,398	11.15	918,737.70	
	COMPUTERSHARE LIMITED	28,469	10.06	286,398.14	
	TELSTRA CORP	278,912	4.48	1,249,525.76	
	AGL ENERGY LTD	34,959	15.49	541,514.91	
	SP AUSNET	117,439	1.12	131,531.68	
オーストラリアドル小計		3,864,214		56,781,016.48 (5,355,585,474)	
イギリスポンド	AMEC PLC	20,017	10.94	218,985.98	
	BG GROUP	217,584	11.14	2,423,885.76	
	BP PLC	1,222,283	4.60	5,626,779.79	
	PETROFAC LTD	16,614	16.76	278,450.64	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	238,462	22.03	5,253,317.86	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	168,476	22.57	3,802,503.32	
	TULLOW OIL PLC	58,098	11.65	676,841.70	
	ANGLO AMERICAN PLC	89,045	18.85	1,678,943.47	
	ANTOFAGASTA PLC	25,255	12.70	320,738.50	
	BHP BILLTTON PLC	135,263	20.51	2,774,920.44	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	8,665	22.99	199,208.35	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	17,220	3.38	58,341.36	
	EVRAZ PLC	23,648	3.04	71,984.51	
	FRESNILLO PLC	11,483	17.50	200,952.50	
	GLENCORE INTERNATIONAL PLC	243,843	3.79	926,237.63	
	JOHNSON MATTHEY PLC	13,124	23.17	304,083.08	
	KAZAKHMYS PLC	14,727	7.76	114,355.15	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,588	58.15	324,942.20	
	REXAM	56,186	4.63	260,646.85	
	RIO TINTO PLC REG	85,848	35.02	3,006,826.20	
	VEDANTA RESOURCES PLC	7,996	11.69	93,473.24	

XSTRATA PLC	134,611	11.37	1,531,200.12	
BAE SYSTEMS PLC	208,094	3.42	712,305.76	
BALFOUR BEATTY PLC	44,080	2.90	127,876.08	
BUNZL PLC	22,567	10.97	247,559.99	
COBHAM PLC	74,736	2.22	166,586.54	
IMI PLC	20,588	11.50	236,762.00	
INVENSYS PLC	52,112	3.38	176,347.00	
MEGGITT PLC	53,259	4.37	232,848.34	
MELROSE INDUSTRIES PLC	77,063	2.47	190,885.05	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	119,905	9.22	1,105,524.10	
SMITHS GROUP PLC	25,169	12.21	307,313.49	
WEIR GROUP PLC/THE	13,610	19.06	259,406.60	
WOLSELEY LTD	17,539	29.32	514,243.48	
AGGREKO PLC	17,185	18.30	314,485.50	
BABCOCK INTL GROUP PLC	24,526	10.00	245,260.00	
CAPITA GROUP PLC	41,883	7.98	334,226.34	
EXPERIAN PLC	64,658	10.90	704,772.20	
G4S PLC	96,034	2.73	262,941.09	
INTERTEK GROUP PLC	10,297	30.15	310,454.55	
SERCO GROUP PLC	31,919	5.54	176,990.85	
NEW GKN	104,317	2.43	253,803.26	
BURBERRY GROUP PLC	28,281	13.86	391,974.66	
CARNIVAL PLC	11,677	25.76	300,799.52	
COMPASS GROUP PLC	119,205	7.55	900,593.77	
INTERCONTINENTAL HOTELS	17,431	18.15	316,372.65	
TUI TRAVEL PLC	30,444	2.92	89,018.25	
WHITBREAD PLC	11,435	24.85	284,159.75	
BRITISH SKY BROADCASTING	69,240	7.98	552,535.20	
ITV PLC	237,554	1.15	273,662.20	
PEARSON	52,279	12.38	647,214.02	
REED ELSEVIER PLC	78,112	6.91	539,753.92	
WPP PLC	80,894	9.74	787,907.56	
KINGFISHER PLC	151,749	2.72	414,123.02	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	102,953	3.65	376,705.02	
NEXT PLC	10,556	39.68	418,862.08	
MORRISON SUPERMARKETS	147,232	2.52	372,202.49	
SAINSBURY (J) PLC	83,544	3.26	272,436.98	
TESCO	514,979	3.50	1,804,228.92	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,816	16.35	373,041.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	124,460	31.70	3,946,004.30	
DIAGEO	160,515	18.43	2,958,291.45	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	63,511	23.78	1,510,291.58	
SABMILLER PLC	61,270	29.84	1,828,603.15	
TATE & LYLE	31,731	7.93	251,626.83	
UNILEVER PLC	82,197	24.28	1,995,743.16	
RECKITT BENCKISER PLC	41,681	41.15	1,715,173.15	
SMITH & NEPHEW PLC	57,588	6.97	401,676.30	
ASTRAZENECA	79,862	30.76	2,456,954.43	
GLAXOSMITHKLINE	318,537	13.76	4,383,069.12	
SHIRE PLC	36,026	20.91	753,303.66	
BARCLAYS	750,177	2.97	2,228,025.69	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,181,534	6.93	8,198,664.42	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,723,349	0.53	1,453,179.02	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	134,877	3.58	483,938.67	
STANDARD CHARTERED PLC	154,380	16.55	2,554,989.00	
3I GROUP PLC	62,671	2.49	156,050.79	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	55,623	3.93	219,098.99	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,757	7.19	120,482.83	
ICAP PLC	38,331	3.28	126,032.32	
INVESTEC PLC	37,356	4.57	170,828.98	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	11,371	11.69	132,926.99	
SCHRODERS PLC	7,582	18.87	143,072.34	
ADMIRAL GROUP PLC	13,130	11.54	151,520.20	
AVIVA PIC	188,309	3.66	689,587.55	
LEGAL & GENERAL GROUP	381,253	1.51	577,598.29	
OLD MUTUAL PLC	315,350	1.85	585,604.95	
PRUDENTIAL	164,962	9.31	1,535,796.22	
RESOLUTION LTD	89,799	2.64	237,069.36	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	229,194	1.27	291,534.76	
STANDARD LIFE PLC	152,141	3.45	525,495.01	
SAGE GROUP PLC	79,226	3.17	251,384.09	
BT GROUP PLC	504,238	2.46	1,240,425.48	
INMARSAT PLC	31,044	6.17	191,541.48	
VODAFONE GROUP PLC	3,157,618	1.61	5,110,604.73	
CENTRICA PLC	332,807	3.38	1,126,884.50	
NATIONAL GRID PLC	232,986	6.83	1,592,459.31	

	SEVERN TRENT PLC	15,263	15.70	239,629.10	
	SSE PLC	60,503	14.30	865,192.90	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	43,670	7.11	310,493.70	
	ARM HOLDINGS PLC	88,312	8.61	760,366.32	
イギリスポンド小計		18,015,149		100,615,017.60 (14,333,615,407)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	23,016	51.70	1,189,927.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	575	223.50	128,512.50	
	GIVAUDAN-REG	532	1,005.00	534,660.00	
	HOLCIM LTD	14,663	69.20	1,014,679.60	
	SIKA AG-BR	138	2,270.00	313,260.00	
	SYNGENTA AG	5,964	394.80	2,354,587.20	
	ABB LTD	140,831	19.68	2,771,554.08	
	GEBERIT AG-REG	2,362	216.30	510,900.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,379	134.30	185,199.70	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,113	135.80	422,745.40	
	SULZER AG-REG	1,662	149.00	247,638.00	
	ADECCO	8,485	50.85	431,462.25	
	SGS SA	351	2,072.00	727,272.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,458	114.60	396,286.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	33,430	78.70	2,630,941.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,975	520.00	1,027,000.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,008	88.60	266,508.80	
	ARYZTA AG	5,586	50.40	281,534.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	912.50	120,450.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	56	3,254.00	182,224.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	37,000.00	259,000.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	206,036	63.40	13,062,682.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,345	105.80	353,901.00	
	ACTELION LTD-REG	6,893	47.82	329,623.26	
	LONZA GROUP AG-REG	3,389	56.10	190,122.90	
	NOVARTIS	147,316	61.15	9,008,373.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	44,994	199.50	8,976,303.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	213	488.50	104,050.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	80,920	26.42	2,137,906.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,983	36.53	510,798.99	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	67.75	127,370.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,226	218.80	268,248.80	
	UBS AG-REG	234,965	16.02	3,764,139.30	

	BALOISE HOLDING AG	3,304	83.55	276,049.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,112	135.90	287,020.80	
	SWISS RE LTD	22,724	69.85	1,587,271.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,510	256.70	2,441,217.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,464	75.85	262,744.40	
	SWISSCOM	1,493	402.70	601,231.10	
スイスフラン小計		1,038,490		60,285,397.38 (5,802,469,497)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	32.95	1,367,425.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	137,000	85.15	11,665,550.00	
	NWS HOLDINGS LTD	101,000	13.22	1,335,220.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	15.42	1,264,440.00	
	MTR CORP	92,500	31.30	2,895,250.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	55.50	804,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	25.55	1,315,825.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	134,000	33.60	4,502,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	67,200	16.86	1,132,992.00	
	SANDS CHINA LTD	154,800	37.50	5,805,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	110,000	16.76	1,843,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	124,000	20.75	2,573,000.00	
	WYNN MACAU LTD	108,000	22.15	2,392,200.00	
	LI & FUNG	374,800	11.94	4,475,112.00	
	BANK EAST ASIA	83,360	31.40	2,617,504.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	237,000	25.95	6,150,150.00	
	HANG SENG BANK	49,000	119.40	5,850,600.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	80.85	1,010,625.00	
	FIRST PACIFIC CO	154,000	9.07	1,396,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	70,000	149.20	10,444,000.00	
	AIA GROUP LTD	694,200	29.70	20,617,740.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	89,000	130.60	11,623,400.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	143,000	30.20	4,318,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	65,000	59.35	3,857,750.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	46,000	38.70	1,780,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	46,000	42.60	1,959,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	236,500	14.36	3,396,140.00	
	SINO LAND CO	201,400	15.58	3,137,812.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,000	127.90	12,917,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	43,500	98.75	4,295,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	75,000	27.55	2,066,250.00	

	WHARF HOLDINGS	97,000	64.85	6,290,450.00	
	WHEELOCK & CO LTD	59,000	44.50	2,625,500.00	
	PCCW LTD	292,000	3.36	981,120.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	35,000	47.25	1,653,750.00	
	CLP HOLDINGS	113,500	64.95	7,371,825.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	334,061	21.30	7,115,499.30	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	89,000	65.55	5,833,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	92.70	1,279,260.00	
香港ドル小計		4,972,621		173,964,794.30 (2,016,251,965)	
シンガポールドル	FRASER AND NEAVE LTD	59,000	9.58	565,220.00	
	KEPPEL CORP LTD	92,300	11.30	1,042,990.00	
	NOBLE GROUP LTD	267,363	1.21	324,846.04	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	63,000	5.36	337,680.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	54,000	4.73	255,420.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	98,000	3.82	374,360.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.01	134,330.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.85	243,005.00	
	SINGAPORE AIRLINES	36,533	11.12	406,246.96	
	GENTING SINGAPORE PLC	391,000	1.45	566,950.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	103,000	4.08	420,240.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	7,000	49.30	345,100.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	112,000	1.61	180,320.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	485,000	0.62	303,125.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	123,000	3.68	452,640.00	
	DBS GROUP	117,000	14.38	1,682,460.00	
	OCBC BANK	165,000	9.64	1,590,600.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	81,000	18.76	1,519,560.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,000	7.45	432,100.00	
	CAPITALAND LTD	164,500	3.87	636,615.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	2.18	215,820.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	34,000	11.40	387,600.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	132,000	2.75	363,000.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	4.06	203,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	6.16	192,808.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	510,243	3.49	1,780,748.07	
	STARHUB LTD	44,000	3.88	170,720.00	
シンガポールドル小計		3,641,239		15,127,504.07 (1,106,879,472)	

ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	47,170	9.15	431,605.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.78	188,064.22	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.88	163,576.92	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	133,366	2.34	312,076.44	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.16	131,595.48	
ニュージーランドドル小計		315,847		1,226,918.56 (91,920,738)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	15,150	164.50	2,492,175.00	
	BOLIDEN AB	18,620	122.00	2,271,640.00	
	ALFA LAVAL AB	21,491	135.50	2,912,030.50	
	ASSA ABLOY B	21,397	242.20	5,182,353.40	
	ATLAS COPCO A	43,006	182.90	7,865,797.40	
	ATLAS COPCO B	24,991	163.50	4,086,028.50	
	SANDVIK AB	64,268	104.30	6,703,152.40	
	SCANIA AB-B SHS	20,494	136.90	2,805,628.60	
	SKANSKA B	25,866	107.60	2,783,181.60	
	SKF AB-B	25,109	160.00	4,017,440.00	
	VOLVO B	89,345	92.10	8,228,674.50	
	SECURITAS B	22,739	58.50	1,330,231.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	16,377	166.60	2,728,408.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	41.06	1,061,606.30	
	HENNES & MAURITZ B	60,805	225.30	13,699,366.50	
	SWEDISH MATCH AB	13,193	229.60	3,029,112.80	
	SCA SV CELLULOSA B	37,080	148.20	5,495,256.00	
	ELEKTA AB-B SHS	23,603	99.50	2,348,498.50	
	GETINGE AB-B SHS	12,818	198.80	2,548,218.40	
	NORDEA BANK AB	169,862	65.75	11,168,426.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	91,014	60.30	5,488,144.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	31,992	243.10	7,777,255.20	
	SWEDBANK AB-A	51,699	136.80	7,072,423.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	110.50	951,184.00	
	INVESTOR AB-B SHS	29,390	175.00	5,143,250.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	13,279	148.20	1,967,947.80	
	RATOS AB-B SHS	13,965	63.80	890,967.00	
	ERICSSON (LM) B	194,902	66.75	13,009,708.50	
	HEXAGON AB-B SHS	15,165	175.60	2,662,974.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,303	588.50	2,532,315.50	
	TELE2 AB-B SHS	20,353	115.30	2,346,700.90	
	TELIASONERA AB	138,656	44.79	6,210,402.24	

スウェーデンクローナ小計		1,365,395		148,810,499.14 (2,047,632,468)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	120.80	1,271,903.20	
	SEADRILL LTD	22,539	215.00	4,845,885.00	
	STATOIL ASA	71,474	144.00	10,292,256.00	
	SUBSEA 7 SA	18,024	136.90	2,467,485.60	
	NORSK HYDRO	63,383	27.54	1,745,567.82	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,975	292.00	3,496,700.00	
	ORKLA	49,422	48.36	2,390,047.92	
	DNB ASA	63,060	78.30	4,937,598.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,577	80.55	1,174,177.35	
	TELENOR ASA	44,957	120.20	5,403,831.40	
ノルウェークローネ小計		369,940		38,025,452.29 (609,167,745)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	15,635	160.80	2,514,108.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	37	44,040.00	1,629,480.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	84	46,400.00	3,897,600.00	
	DSV A/S	12,799	146.30	1,872,493.70	
	CARLSBERG AS-B	6,851	574.50	3,935,899.50	
	COLOPLAST-B	7,751	291.10	2,256,316.10	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,854	479.60	889,178.40	
	NOVO NORDISK A/S-B	26,082	982.50	25,625,565.00	
	DANSKE BANK A/S	42,303	109.00	4,611,027.00	
	TRYG A/S	1,646	423.60	697,245.60	
	TDC A/S	34,299	41.53	1,424,437.47	
デンマーククローネ小計		149,341		49,353,350.77 (790,640,679)	
イスラエルシェケル	DELEK GROUP LTD	299	912.20	272,747.80	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	28,519	47.89	1,365,774.91	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,515.00	404,915.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	60,402	139.50	8,426,079.00	
	BANK HAPOALIM BM	73,582	15.50	1,140,521.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	80,820	12.45	1,006,209.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	37.37	306,434.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	141.80	594,851.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	134,167	4.21	565,245.57	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,572	185.50	477,106.00	
イスラエルシェケル小計		392,917		14,559,883.28 (350,310,791)	

ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	10,161	20.61	209,418.21	
	ENI	162,921	19.29	3,142,746.09	
	FUGRO NV-CVA	4,431	43.90	194,543.05	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,031	12.08	193,654.48	
	NESTE OIL OYJ	8,623	10.83	93,387.09	
	OMV AG	9,432	29.90	282,016.80	
	REPSOL SA	53,929	16.82	907,085.78	
	SAIPEM	16,957	31.70	537,536.90	
	TECHNIP S.A.	6,509	81.70	531,785.30	
	TENARIS SA	30,242	15.39	465,424.38	
	TOTAL SA	136,323	39.31	5,358,857.13	
	AIR LIQUIDE	19,978	92.33	1,844,568.74	
	AKZO NOBEL	15,257	51.97	792,906.29	
	ARCELORMITTAL	63,758	13.12	836,504.96	
	ARKEMA	3,996	81.97	327,552.12	
	BASF SE	58,822	73.17	4,304,005.74	
	CRH	46,255	14.95	691,743.52	
	HEIDELBERGCEMENT AG	9,006	46.34	417,383.07	
	IMERYS SA	2,361	48.36	114,189.76	
	K+S AG	11,032	33.99	374,977.68	
	KONINKLIJKE DSM NV	9,876	46.15	455,826.78	
	LAFARGE (FRANCE)	11,958	47.44	567,287.52	
	LANXESS	5,329	62.93	335,353.97	
	LINDE AG	11,848	132.20	1,566,305.60	
	SALZGITTER AG	2,612	36.09	94,267.08	
	SOLVAY SA	3,797	114.35	434,186.95	
	STORA ENSO OYJ R	35,297	5.34	188,485.98	
	THYSSEN KRUPP	24,712	18.06	446,422.28	
	UMICORE	7,301	40.12	292,952.62	
	UPM KYMMENE CORP	35,796	9.17	328,249.32	
	VOESTALPINE AG	7,614	26.39	200,971.53	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,183	18.75	172,181.25	
	ALSTOM RGPT	13,216	32.00	422,978.08	
	ANDRITZ AG	4,662	48.60	226,573.20	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,133	34.07	174,906.97	
	BOUYGUES ORD	12,099	22.74	275,191.75	
	BRENNTAG AG	3,298	106.25	350,412.50	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	26,480	34.60	916,208.00	

FERROVIAL SA	26,081	11.60	302,670.00	
FIAT INDUSTRIAL	54,808	8.94	490,257.56	
FINMECCANICA SPA	29,572	4.96	146,677.12	
GEA GROUP AG	11,887	26.49	314,886.63	
HOCHTIEF AG	2,174	48.65	105,765.10	
KONE OYJ-B	9,972	58.05	578,874.60	
LEGRAND SA	15,181	33.26	504,920.06	
MAN SE	2,709	88.35	239,340.15	
METSO OYJ	8,700	34.28	298,236.00	
PHILIPS ELECTRS (KON.)	66,572	21.20	1,411,326.40	
PRYSMIAN SPA	14,113	15.52	219,033.76	
REXEL SA	7,590	16.28	123,565.20	
SAFRAN SA	14,689	33.95	498,764.99	
SAINT-GOBAIN	25,508	31.14	794,446.66	
SCHNEIDER ELECTRIC	33,658	54.80	1,844,458.40	
SIEMENS	52,693	82.82	4,364,034.26	
THALES SA	5,831	27.20	158,603.20	
VALLOUREC	7,038	38.90	273,778.20	
VINCI S.A.	29,478	37.69	1,111,025.82	
WARTSILA OYJ	10,737	35.67	382,988.79	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	11.39	116,189.39	
ZODIAC AEROSPACE	2,409	82.32	198,308.88	
BUREAU VERITAS SA	3,762	86.90	326,917.80	
EDENRED	10,850	23.54	255,409.00	
RANDSTAD HOLDING NV	7,714	29.27	225,827.35	
SOCIETE BIC SA	1,994	94.47	188,373.18	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	23,741	12.48	296,287.68	
ADP	2,021	59.62	120,492.02	
ATLANTIA SPA	22,528	13.40	301,875.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14,664	14.44	211,748.16	
DEUTSCHE POST AG-REG	58,072	17.26	1,002,322.72	
FRAPORT AG	2,668	42.70	113,923.60	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	35,901	6.23	223,663.23	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,369	2.50	168,422.50	
TNT EXPRESS	22,191	5.45	121,074.09	
VOPAK	4,786	50.49	241,645.14	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	21,204	73.33	1,554,889.32	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,343	50.14	167,618.02	

CONTINENTAL AG	7,045	84.40	594,598.00	
DAIMLER AG	58,095	43.34	2,518,127.77	
FIAT ORD	56,056	4.54	254,830.57	
MICHELIN	11,656	72.10	840,397.60	
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,178	31.80	228,260.40	
PEUGEOT SA	16,283	6.24	101,719.90	
PIRELLI & CO	17,274	9.37	161,943.75	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	9,807	63.33	621,077.31	
RENAULT SA	12,310	43.60	536,716.00	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,262	177.90	1,647,709.80	
VOLKSWAGEN STAMM	1,890	166.50	314,685.00	
ADIDAS AG	13,399	70.62	946,237.38	
CHRISTIAN DIOR	3,492	135.50	473,166.00	
HUGO BOSS AG	1,789	86.68	155,070.52	
LUXOTTICA GROUP SPA	10,543	33.12	349,184.16	
LVMH	16,275	141.45	2,302,098.75	
ACCOR	10,056	28.31	284,735.64	
OPAP SA	14,930	6.50	97,045.00	
SODEXO	6,038	65.67	396,515.46	
AXEL SPRINGER AG	2,751	34.26	94,249.26	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	25.68	217,243.73	
JC DECAUX SA	4,621	19.94	92,165.84	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,669	57.13	323,869.97	
LAGADERE S.C.A	8,178	25.65	209,765.70	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	6,178	23.91	147,746.87	
PUBLICIS GROUPE	11,347	48.90	554,868.30	
REED ELSEVIER NV	44,058	11.54	508,429.32	
SES	19,459	21.61	420,606.28	
WOLTERS KLUWER	20,552	15.41	316,706.32	
INDITEX	14,332	105.65	1,514,175.80	
PPR	4,841	157.15	760,763.15	
AHOLD (KON.)	64,551	10.72	692,309.47	
CARREFOUR	38,607	20.22	780,633.54	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,608	72.70	262,301.60	
COLRUYT SA	4,857	36.30	176,309.10	
DELHAIZE GROUP	6,525	36.21	236,270.25	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	39,901	5.31	211,954.11	
JERONIMO MARTINS	15,262	15.74	240,223.88	

KESKO OYJ-B SHS	4,473	24.59	109,991.07	
METRO STAMM	8,303	23.15	192,255.96	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	51,437	67.19	3,456,052.03	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	12,699	17.36	220,454.64	
DANONE (GROUPE)	37,071	49.81	1,846,506.51	
DE MASTER BLENDERS1753 NV	38,097	8.99	342,568.22	
HEINEKEN HOLDING NV	6,863	42.49	291,643.18	
HEINEKEN NV	14,756	50.81	749,752.36	
KERRY GROUP PLC-A	9,560	38.26	365,765.60	
PERNOD-RICARD	13,593	91.99	1,250,420.07	
REMY COINTREAU	1,575	93.29	146,931.75	
SUEDZUCKER AG	5,726	30.62	175,358.75	
UNILEVER NV-CVA	104,325	29.02	3,028,033.12	
BEIERSDORF AG	6,456	63.21	408,083.76	
HENKEL AG & CO KGAA	8,319	53.11	441,822.09	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,410	62.97	718,487.70	
LOREAL	15,447	108.30	1,672,910.10	
CELESIO AG	5,912	13.44	79,486.84	
ESSILOR INTERNATIONAL	12,963	75.69	981,169.47	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,539	50.11	678,439.29	
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,971	85.56	681,998.76	
BAYER	52,960	72.50	3,839,600.00	
ELAN CORPORATION PLC	34,320	7.47	256,370.40	
GRIFOLS SA	9,679	24.00	232,296.00	
MERCK KGAA	4,139	99.69	412,616.91	
ORION OYJ-CLASS B	6,894	20.41	140,706.54	
QIAGEN N.V.	15,109	14.35	216,814.15	
SANOFI	76,375	72.10	5,506,637.50	
UCB (GROUPE)	7,046	42.17	297,129.82	
BANCO BILBAO VIZCAYA	355,000	7.77	2,758,350.00	
BANCO DE SABADELL SA	144,195	2.14	309,298.27	
BANCO POPOLARE SPA	122,198	1.50	183,907.99	
BANCO SANTANDER SA	670,765	6.44	4,320,397.36	
BANCO SANTANDER SA-RTS	710,765	0.15	110,879.34	
BNP PARIBAS	64,718	46.23	2,992,236.73	
CAIXABANK	54,400	3.05	165,920.00	
COMMERZBANK AG	244,499	1.68	412,958.81	
CREDIT AGRICOLE SA	64,475	7.45	480,919.02	

ERSTE GROUP BANK AG	14,003	25.33	354,766.00	
INTESA SANPAOLO	650,149	1.50	979,774.54	
INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	1.24	80,702.01	
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	11,204	27.33	306,261.34	
NATIXIS	63,795	2.92	186,281.40	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	33.12	112,625.00	
SOCIETE GENERALE	45,313	33.24	1,506,204.12	
UNICREDIT SPA	259,437	4.42	1,146,711.54	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	3.96	214,873.56	
DEUTSCHE BANK NAMEN	59,977	36.60	2,195,458.08	
DEUTSCHE BOERSE	12,453	47.44	590,832.58	
EURAZEO	2,357	39.39	92,842.23	
EXOR SPA	4,687	20.59	96,505.33	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,206	61.36	319,440.16	
ING GROEP	247,148	7.42	1,835,321.04	
MEDIOBANCA	34,666	5.36	185,983.09	
OKO BANK-A	9,611	12.34	118,599.74	
WENDEL	2,120	80.17	169,960.40	
AEGON	112,828	4.97	561,657.78	
AGEAS	14,903	23.91	356,405.24	
ALLIANZ SE-REG	29,379	103.85	3,051,009.15	
ASSICURAZIONI GENERALI	75,344	14.01	1,055,569.44	
AXA	114,081	13.62	1,554,353.62	
CNP ASSURANCES	11,367	12.38	140,780.29	
DELTA LLOYD NV	10,040	14.29	143,471.60	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	3,891	59.39	231,086.49	
MAPFRE SA	55,064	2.39	131,602.96	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,572	133.80	1,548,333.60	
SAMPO OYJ-A SHS	27,043	25.54	690,678.22	
SCOR SE	10,530	21.19	223,183.35	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	39.25	110,214.00	
IMMOFINANZ AG	63,752	3.29	209,807.83	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,253	18.90	382,781.70	
ATOS	3,835	55.07	211,193.45	
CAP GEMINI SA	9,477	34.86	330,368.22	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,005	82.81	331,654.05	
SAP AG	59,000	58.05	3,424,950.00	

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	6,790	16.81	114,173.85	
GEMALTO	5,073	66.86	339,180.78	
NOKIA CORP	239,838	3.31	794,343.45	
BELGACOM	9,742	22.65	220,656.30	
DEUTSCHE TELEKOM	179,888	8.91	1,602,802.08	
ELISA A	9,087	17.02	154,660.74	
FRANCE TELECOM	118,750	9.00	1,069,343.75	
ILIAD SA	1,461	140.80	205,708.80	
KPN (KON.)	68,218	4.46	304,252.28	
PORTUGAL TELECOM	46,591	4.43	206,398.13	
TELECOM ITALIA ORD	601,478	0.76	459,829.93	
TELECOM ITALIA RNC	412,622	0.65	268,204.30	
TELEFONICA	265,471	10.86	2,884,342.41	
TELEKOM AUSTRIA AG	15,933	5.67	90,340.11	
TELENET GROUP HOLDING NV	4,004	35.80	143,343.20	
VIVENDI	83,328	16.69	1,390,744.32	
ZIGGO NV	8,422	22.83	192,274.26	
ACCIONA SA	1,857	61.93	115,004.01	
E.ON SE	115,335	13.84	1,596,813.07	
ELECTRICITE DE FRANCE	15,393	14.58	224,429.94	
ENAGAS	12,304	17.86	219,749.44	
ENEL	421,553	3.11	1,314,402.25	
ENEL GREEN POWER SPA	121,260	1.49	181,404.96	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,604	2.41	307,780.84	
FORTUM OYJ	28,447	13.94	396,551.18	
GAS NATURAL SDG SA	22,606	13.83	312,754.01	
GDF SUEZ	81,788	15.30	1,251,356.40	
IBERDROLA SA	260,941	4.06	1,060,464.22	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,979	42.61	297,375.19	
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	27.34	71,725.93	
RWE STAMM	31,342	29.05	910,641.81	
SNAM SPA	108,285	3.63	393,724.26	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	17,972	9.10	163,545.20	
TERNA SPA	83,672	3.10	259,885.23	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,733	8.98	195,184.07	
VERBUND AG	4,553	17.84	81,225.52	
ASML HOLDING NV	20,166	51.57	1,039,960.62	
INFINEON TECHNOLOGIES	69,629	6.70	466,792.81	

	STMICROELECTRONICS	43,392	6.27	272,154.62	
ユーロ小計		11,220,825		156,883,337.68 (18,758,540,686)	
合計		67,488,156		137,527,000,506 (137,527,000,506)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	335,000.00	279,725.00	
	アメリカドル小計		335,000.00	279,725.00 (25,130,494)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	52,986.00	307,318.80	
		LEND LEASE GROUP	37,044.00	365,624.28	
		SYDNEY AIRPORT	13,063.00	39,842.15	
	オーストラリアドル小計		103,093.00	712,785.23 (67,229,902)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	158,000.00	1,107,580.00	
	香港ドル小計		158,000.00	1,107,580.00 (12,836,852)	
投資信託受益証券合計				105,197,248 (105,197,248)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	21,900.00	689,193.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	25,277.00	2,005,729.95	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	62,459.00	923,144.02	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,757.00	936,249.92	
		BOSTON PROPERTIES	9,670.00	1,042,716.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,800.00	406,000.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,831.00	559,838.19	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	282,417.94	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,132.00	1,234,320.12	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,345.00	456,616.05	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	524,790.35	
		HCP INC	28,965.00	1,346,293.20	
		HEALTH CARE REIT INC	16,359.00	1,014,748.77	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	46,318.00	773,973.78	
		KIMCO REALTY CORP	27,708.00	550,557.96	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,458.00	325,463.84	
		MACERICH CO/THE	9,022.00	528,779.42	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	10,975.00	519,337.00	

	PROLOGIS INC	29,539.00	1,166,790.50	
	PUBLIC STORAGE	9,321.00	1,400,573.46	
	RAYONIER INC	7,845.00	431,475.00	
	REALTY INCOME CORP	8,500.00	374,340.00	
	REGENCY CENTERS CORP	6,512.00	322,083.52	
	SIMON PROPERTY GROUP	19,442.00	3,108,581.38	
	SL GREEN REALTY CORP	6,300.00	505,449.00	
	UDR INC	16,000.00	393,920.00	
	VENTAS INC	18,950.00	1,245,962.50	
	VORNADO REALTY TRUST	10,702.00	905,710.26	
アメリカドル小計		492,005.00	23,975,055.23 (2,153,918,961)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	6,113.00	142,738.55	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,483.00	258,885.90	
カナダドル小計		15,596.00	401,624.45 (36,359,061)	
オーストラリアドル	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	89,917.00	205,010.76	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	252,969.99	
	DEXUS PROPERTY GROUP	312,956.00	317,650.34	
	GOODMAN GROUP	108,981.00	487,145.07	
	GPT GROUP	96,222.00	346,399.20	
	MIRVAC GROUP	233,205.00	363,799.80	
	STOCKLAND	141,097.00	498,072.41	
	WESTFIELD GROUP	137,531.00	1,511,465.69	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	185,818.00	574,177.62	
オーストラリアドル小計		1,432,529.00	4,556,690.88 (429,787,083)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	54,509.00	309,611.12	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	40,760.00	146,776.76	
	HAMMERSON PLC	48,840.00	238,388.04	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	50,355.00	410,896.80	
	SEGRO PLC	54,059.00	132,336.43	
イギリスポンド小計		248,523.00	1,238,009.15 (176,366,783)	
香港ドル	LINK REIT	146,500.00	5,874,650.00	
香港ドル小計		146,500.00	5,874,650.00 (68,087,193)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134,000.00	336,340.00	

		CAPITACOMMERCIAL TRUST	140,000.00	237,300.00	
		CAPITAMALL TRUST	149,000.00	321,840.00	
	シンガポールドル小計		423,000.00	895,480.00 (65,522,271)	
	ユーロ	CORIO NV	4,573.00	165,222.49	
		FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	122,896.41	
		GECINA SA	1,598.00	142,573.56	
		ICADE	1,564.00	102,629.68	
		KLEPIERRE	6,998.00	210,814.75	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	5,934.00	1,045,570.80	
	ユーロ小計		22,578.00	1,789,707.69 (213,995,348)	
投資証券合計				3,144,036,700 (3,144,036,700)	
合計				3,249,233,948 (3,249,233,948)	

(注)有価証券明細表注記
(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカドル	株式	576銘柄	97.3%	56.0%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	28銘柄	2.7%	1.5%
カナダドル	株式	95銘柄	99.5%	5.3%
	投資証券	2銘柄	0.5%	0.0%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	91.5%	3.8%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.1%	0.0%
	投資証券	9銘柄	7.3%	0.3%
イギリスポンド	株式	101銘柄	98.8%	10.2%
	投資証券	5銘柄	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式	39銘柄	96.1%	1.4%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.6%	0.0%
	投資証券	1銘柄	3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	27銘柄	94.4%	0.8%
	投資証券	3銘柄	5.6%	0.0%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%	0.1%

スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	229銘柄	98.9%	13.3%
	投資証券	6銘柄	1.1%	0.2%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

次へ

「新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	474,186,347
コール・ローン	65,126,300
国債証券	17,088,061,320
特殊債券	696,713,002
派生商品評価勘定	555,781
未収入金	53,004,997
未収利息	247,790,208
前払費用	67,969,071
流動資産合計	18,693,407,026
資産合計	18,693,407,026
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,063,756
未払解約金	496,816,236
流動負債合計	503,879,992
負債合計	503,879,992
純資産の部	
元本等	
元本	11,568,259,032
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,621,268,002
元本等合計	18,189,527,034
純資産合計	18,189,527,034
負債純資産合計	18,693,407,026

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3.　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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。
4.　収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1.　計算期間の期首元本額	4,321,191,098円
計算期間中の追加設定元本額	14,539,472,366円
計算期間中の一部解約元本額	7,292,404,432円
計算日の元本額	11,568,259,032円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,495,782,463円
世界経済インデックスファンド	267,900,711円
DC新興国債券インデックス・オープン	1,238,290,997円
DC世界経済インデックスファンド	95,216,969円
新興国債券ファンド（米ドル売り円買い為替予約付）（適格機関投資家専用）	1,855,445,900円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	74,669,992円
コア投資戦略ファンド（安定型）	566,297,569円
コア投資戦略ファンド（成長型）	295,097,313円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	4,679,557,118円
2.　計算日における受益権総数	11,568,259,032口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5724円 (15,724円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券及び特殊債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	63,192,991
特殊債券	4,835,761
合計	68,028,752

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

通貨関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	52,742,126	―	53,297,907	555,781
	計	52,742,126	―	53,297,907	555,781
	売 建				
	アメリカドル	193,983,909	―	196,817,530	△2,833,621
	マレーシアリンギット	57,776,568	―	58,792,268	△1,015,700
	メキシコペソ	51,592,184	―	52,210,760	△618,576
	ハンガリーフォリント	22,827,485	―	23,336,669	△509,184
	ポーランドズロチ	48,389,656	―	48,650,070	△260,414
	南アフリカランド	34,436,406	―	34,572,300	△135,894
	ロシアルーブル	52,742,126	―	53,282,148	△540,022
	トルコリラ	53,264,499	―	54,414,844	△1,150,345
	計	515,012,833	―	522,076,589	△7,063,756

合計	567,754,959	－	575,374,496	△6,507,975

(注)時価の算定方法

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	マレーシアリンギット	MGS 3.197% 10/15/15	1,000,000.00	1,004,015.00	
		MGS 3.314% 10/31/17	7,650,000.00	7,686,337.50	
		MGS 3.418% 08/15/22	4,000,000.00	3,984,440.00	
		MGS 3.58% 09/28/18	6,200,000.00	6,282,584.00	
		MGS 3.741% 02/27/15	6,900,000.00	6,999,291.00	
		MGS 3.814% 02/15/17	1,150,000.00	1,176,622.50	
		MGS 3.835% 08/12/15	2,300,000.00	2,342,883.50	
		MGS 3.892% 03/15/27	3,800,000.00	3,876,342.00	
		MGS 4.012% 09/15/17	1,500,000.00	1,550,145.00	
		MGS 4.127% 04/15/32	1,100,000.00	1,134,798.50	
		MGS 4.16% 07/15/21	3,100,000.00	3,254,690.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	780,000.00	816,531.30	
		MGS 4.24% 02/07/18	3,900,000.00	4,068,012.00	
		MGS 4.262% 09/15/16	2,000,000.00	2,075,800.00	
		MGS 4.378% 11/29/19	3,550,000.00	3,763,834.25	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,450,000.00	2,636,200.00	
		MGS 5.094% 04/30/14	8,100,000.00	8,317,768.50	

マレーシアリンギット小計		59,480,000.00	60,970,295.05 (1,817,524,495)	
タイバーツ	THAIGB 2.8% 10/10/17	20,000,000.00	19,681,100.00	
	THAIGB 3.125% 12/11/15	24,500,000.00	24,640,140.00	
	THAIGB 3.25% 06/16/17	62,900,000.00	63,266,707.00	
	THAIGB 3.45% 03/08/19	55,600,000.00	55,951,948.00	
	THAIGB 3.58% 12/17/27	18,400,000.00	17,648,728.00	
	THAIGB 3.625% 05/22/15	57,600,000.00	58,530,240.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	35,000,000.00	34,858,950.00	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	22,500,000.00	22,727,250.00	
	THAIGB 3.875% 06/13/19	14,500,000.00	14,964,652.50	
	THAIGB 4.125% 11/18/16	15,700,000.00	16,304,057.50	
	THAIGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	13,324,931.47	
	THAIGB 5.125% 03/13/18	21,700,000.00	23,629,781.00	
	THAIGB 5.25% 05/12/14	35,100,000.00	36,193,540.50	
	THAIGB 5.85% 03/31/21	17,200,000.00	20,034,560.00	
	THAIGB 6.15% 07/07/26	2,000,000.00	2,461,840.00	
タイバーツ小計		414,962,000.00	424,218,425.97 (1,285,381,830)	
フィリピンペソ	RPGB 7.375% 03/03/21	4,000,000.00	4,725,008.00	
	RPGB 8% 07/19/31	34,000,000.00	42,961,210.00	
フィリピンペソ小計		38,000,000.00	47,686,218.00 (105,386,541)	
インドネシアルピア	INDOGB 10% 07/15/17	3,600,000,000.00	4,356,000,000.00	
	INDOGB 10% 09/15/24	2,850,000,000.00	3,835,031,250.00	
	INDOGB 10.25% 07/15/27	2,900,000,000.00	4,014,687,500.00	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,600,000,000.00	6,612,500,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	5,850,000,000.00	8,427,656,250.00	
	INDOGB 11% 10/15/14	2,000,000,000.00	2,222,500,000.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	3,400,000,000.00	4,655,875,000.00	
	INDOGB 11.5% 09/15/19	1,000,000,000.00	1,357,500,000.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	3,000,000,000.00	4,520,625,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	2,420,000,000.00	2,498,650,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	4,000,000,000.00	4,087,500,000.00	
	INDOGB 6.25% 04/15/17	12,300,000,000.00	13,038,000,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	7,550,000,000.00	7,818,968,750.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	12,100,000,000.00	13,627,625,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	22,900,000,000.00	24,746,312,500.00	
	INDOGB 7.375% 09/15/16	21,000,000,000.00	22,942,500,000.00	

	INDOGB 8.25% 06/15/32	29,700,000,000.00	35,213,062,500.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	9,200,000,000.00	11,063,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	1,600,000,000.00	1,941,000,000.00	
	INDOGB 9.5% 05/15/41	3,600,000,000.00	4,862,250,000.00	
	INDOGB 9.5% 06/15/15	3,420,000,000.00	3,809,025,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	1,200,000,000.00	1,599,750,000.00	
インドネシアルピア小計		160,190,000,000.00	187,250,018,750.00 (1,760,150,176)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,100,000.00	9,008,144.50	
	MBONO 10% 12/05/24	10,300,000.00	14,639,699.00	
	MBONO 5% 06/15/17	2,000,000.00	2,010,510.00	
	MBONO 6% 06/18/15	12,500,000.00	12,884,250.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	23,300,000.00	24,362,247.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	8,200,000.00	8,990,644.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	23,500,000.00	25,759,290.00	
	MBONO 7% 06/19/14	7,400,000.00	7,644,274.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	8,300,000.00	9,018,614.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	11,000,000.00	13,032,030.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	5,000,000.00	5,987,200.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	13,100,000.00	15,702,249.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	10,650,000.00	11,989,344.00	
	MBONO 8% 06/11/20	4,000,000.00	4,759,140.00	
	MBONO 8% 12/07/23	7,500,000.00	9,183,412.50	
	MBONO 8% 12/17/15	9,000,000.00	9,797,445.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	18,800,000.00	24,196,258.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	12,700,000.00	16,402,494.50	
	MBONO 8.5% 12/13/18	5,300,000.00	6,276,631.00	
	MBONO 9.5% 12/18/14	25,200,000.00	27,450,234.00	
メキシコペソ小計		223,850,000.00	259,094,111.00 (1,839,568,188)	
ブラジルレアル	BNTNF 10% 01/01/14	4,600,000.00	4,709,728.40	
	BNTNF 10% 01/01/17	3,600,000.00	3,762,349.20	
	BNTNF 10% 01/01/21	800,000.00	834,624.80	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,950,000.00	2,549,605.50	
	BRAZIL 12.5% 01/05/16	22,950,000.00	28,155,978.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	750,000.00	1,111,567.50	
ブラジルレアル小計		34,650,000.00	41,123,853.40 (1,810,683,265)	
コロンビアペソ	COLOM 12% 10/22/15	6,870,000,000.00	8,266,430,550.00	

	COLOM 4.375% 03/21/23	850,000,000.00	848,516,750.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	2,730,000,000.00	3,391,533,600.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	650,000,000.00	988,455,000.00	
コロンビアペソ小計		11,100,000,000.00	13,494,935,900.00 (685,542,743)	
ハンガリーフォリント	HGB 5.5% 02/12/14	126,000,000.00	126,394,380.00	
	HGB 5.5% 02/12/16	300,000,000.00	299,659,500.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	94,500,000.00	92,763,562.50	
	HGB 6.5% 06/24/19	278,500,000.00	286,445,605.00	
	HGB 6.75% 02/24/17	295,000,000.00	305,413,500.00	
	HGB 6.75% 08/22/14	42,000,000.00	42,955,920.00	
	HGB 6.75% 11/24/17	172,000,000.00	178,640,060.00	
	HGB 7% 06/24/22	124,000,000.00	130,668,720.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	196,000,000.00	213,022,600.00	
	HGB 7.75% 08/24/15	210,000,000.00	221,220,300.00	
	HGB 8% 02/12/15	501,000,000.00	527,011,920.00	
ハンガリーフォリント小計		2,339,000,000.00	2,424,196,067.50 (989,071,995)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,300,000.00	3,011,735.00	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	2,750,000.00	3,492,087.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,200,000.00	3,135,825.00	
	PERUGB 9.91% 05/05/15	910,000.00	1,067,807.65	
ペルーヌエボソル小計		8,160,000.00	10,707,455.15 (377,330,719)	
ポーランドズロチ	POLGB 4.75% 04/25/17	1,150,000.00	1,206,102.75	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000.00	9,246,435.75	
	POLGB 5% 04/25/16	3,500,000.00	3,665,270.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,181,250.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,400,000.00	5,923,611.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	11,500,000.00	12,015,602.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	5,000,000.00	5,543,425.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	4,000,000.00	4,113,480.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	6,350,000.00	7,269,384.75	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,500,000.00	2,838,437.50	
	POLGB 6.25% 10/24/15	3,500,000.00	3,756,445.00	
ポーランドズロチ小計		57,500,000.00	61,759,444.25 (1,777,436,805)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	26,400,000.00	33,898,392.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	15,800,000.00	18,938,749.00	

		SAGB 6.25% 03/31/36	10,500,000.00	8,574,300.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	15,400,000.00	12,772,375.00	
		SAGB 6.75% 03/31/21	19,100,000.00	19,542,833.50	
		SAGB 7% 02/28/31	8,800,000.00	8,159,800.00	
		SAGB 7.25% 01/15/20	22,500,000.00	23,750,775.00	
		SAGB 8% 12/21/18	18,100,000.00	19,860,134.50	
		SAGB 8.25% 09/15/17	20,000,000.00	21,995,500.00	
		SAGB 8.75% 12/21/14	6,000,000.00	6,395,430.00	
	南アフリカランド小計		162,600,000.00	173,888,289.00 (1,758,010,601)	
	ロシアルーブル	RUSSIA 7.85% 03/10/18	335,000,000.00	365,158,375.00	
	ロシアルーブル小計		335,000,000.00	365,158,375.00 (1,084,520,373)	
	トルコリラ	TURKGB 10% 06/17/15	4,070,000.00	4,415,950.00	
		TURKGB 10.5% 01/15/20	2,850,000.00	3,485,906.25	
		TURKGB 11% 08/06/14	3,200,000.00	3,432,000.00	
		TURKGB 8% 06/04/14	7,750,000.00	7,953,437.50	
		TURKGB 8.5% 09/14/22	550,000.00	625,281.25	
		TURKGB 9% 01/27/16	3,950,000.00	4,248,718.75	
		TURKGB 9% 03/05/14	3,100,000.00	3,200,750.00	
		TURKGB 9% 03/08/17	2,200,000.00	2,410,375.00	
		TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000.00	5,437,250.00	
	トルコリラ小計		32,220,000.00	35,209,668.75 (1,797,453,589)	
国債証券合計				17,088,061,320 (17,088,061,320)	
特殊債券	ロシアルーブル	EIB 6% 01/28/14	19,500,000.00	19,533,832.50	
		EIB 6.5% 09/30/16	51,000,000.00	52,238,280.00	
		EIB 6.5% 12/15/15	25,000,000.00	25,586,500.00	
		EIB 6.75% 06/13/17	11,000,000.00	11,361,295.00	
		KFW 7% 06/14/16	121,000,000.00	125,863,595.00	
	ロシアルーブル小計		227,500,000.00	234,583,502.50 (696,713,002)	
特殊債券合計				696,713,002 (696,713,002)	
合計				17,784,774,322 (17,784,774,322)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
マレーシアリンギット	国債証券	17銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券	15銘柄	100.0%	7.2%
フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.6%
インドネシアルピア	国債証券	22銘柄	100.0%	9.9%
メキシコペソ	国債証券	20銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券	6銘柄	100.0%	10.2%
コロンビアペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	3.9%
ハンガリーフォリント	国債証券	11銘柄	100.0%	5.6%
ペルーヌエボソル	国債証券	4銘柄	100.0%	2.1%
ポーランドズロチ	国債証券	11銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券	10銘柄	100.0%	9.9%
ロシアルーブル	国債証券	1銘柄	60.9%	6.1%
	特殊債券	5銘柄	39.1%	3.9%
トルコリラ	国債証券	9銘柄	100.0%	10.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

次へ

「新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年 1月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	531,004,461
コール・ローン	11,564,355
株式	17,363,281,657
投資信託受益証券	73,921,355
派生商品評価勘定	16,270,473
未収入金	429,243
未収配当金	15,131,601
未収利息	17
差入委託証拠金	114,627,059
流動資産合計	18,126,230,221
資産合計	18,126,230,221
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	394,829
未払金	7,405
未払解約金	52,271,880
流動負債合計	52,674,114
負債合計	52,674,114
純資産の部	
元本等	
元本	8,859,252,989
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,214,303,118
元本等合計	18,073,556,107
純資産合計	18,073,556,107
負債純資産合計	18,126,230,221

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 1月21日現在

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(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。 (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公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。
3.　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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。
4.　収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式及び投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 1月21日現在
1. 計算期間の期首元本額	7,250,432,676円
計算期間中の追加設定元本額	3,691,706,001円
計算期間中の一部解約元本額	2,082,885,688円
計算日の元本額	8,859,252,989円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,436,875,508円
世界経済インデックスファンド	200,690,788円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,245,863,474円
DC世界経済インデックスファンド	78,428,074円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,146,014,729円
新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	580,765,064円
コア投資戦略ファンド（安定型）	101,660,570円
コア投資戦略ファンド（成長型）	68,954,782円
2. 計算日における受益権総数	8,859,252,989口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0401円 (20,401円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(株価変動リスク、為替変動リスク)、信用リスク、カントリーリスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 1月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)株式及び投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
4.　金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年 1月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,278,979,348
投資信託受益証券	5,686,639
合計	1,284,665,987

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年11月13日から平成25年1月21日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建	632,259,332	―	648,397,290	16,137,958
合計		632,259,332	―	648,397,290	16,137,958

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 1月21日現在			
		契約額等(円)		時価	評価損益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	アメリカドル	10,386,620	―	10,385,895	△725
	計	10,386,620	―	10,385,895	△725
	売 建				
	アメリカドル	40,790,620	―	41,052,310	△261,690
	ブラジルレアル	55,676	―	55,575	101
	計	40,846,296	―	41,107,885	△261,589
合計		51,232,916	―	51,493,780	△262,314

(注)時価の算定方法

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成25年 1月21日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成25年1月21日現在)

① 有価証券明細表

A. 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	18,495	61.80	1,142,991.00	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	265,452	9.67	2,566,920.84	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	29,200	5.91	172,659.60	
	LUKOIL-SPON ADR	26,058	66.25	1,726,342.50	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4,717	114.90	541,983.30	
	ROSNEFT OJSC-GDR	65,294	8.63	563,487.22	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	53,493	9.37	501,496.87	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	11,984	44.75	536,284.00	
	TMK-GDR REG S	6,088	15.80	96,190.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	13,664	35.20	480,972.80	
	MECHEL-SPONSORED ADR	6,751	7.08	47,797.08	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	25,018	20.00	500,360.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	5,266	22.95	120,854.70	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,625	13.15	139,718.75	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,420	41.26	264,889.20	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	13,652	37.75	515,363.00	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	6,347	41.85	265,621.95	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	13,479	45.55	613,968.45	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	12,486	70.15	875,892.90	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	41,096	5.80	238,356.80	
	CREDICORP LTD	2,490	157.59	392,399.10	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	141,433	13.70	1,937,632.10	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	73,898	3.82	282,290.36	
	LSR GROUP OJSC-GDR REGS	15,764	4.85	76,455.40	
	MEGAFON-GDR	4,584	26.40	121,017.60	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	27,140	19.06	517,288.40	
	ORASCOM TELECOM-GDR REG S	29,369	3.30	96,917.70	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	9,627	24.86	239,327.22	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	6,706	21.15	141,831.90	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	72,272	2.56	185,088.59	

アメリカドル小計		1,018,868		15,902,399.73 (1,428,671,591)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	208,000	8.66	1,801,280.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	80,000	15.96	1,276,800.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	814,000	9.19	7,480,660.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	163,500	32.65	5,338,275.00	
	CNOOC LTD-R	868,000	16.38	14,217,840.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	156,000	16.70	2,605,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,026,000	11.14	11,429,640.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	96,000	13.52	1,297,920.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	180,000	3.97	714,600.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	48,000	6.09	292,320.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	59,500	28.60	1,701,700.00	
	BBMG CORPORATION - H	57,000	7.31	416,670.00	
	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	84,000	5.69	477,960.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	160,000	11.94	1,910,400.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	5.08	396,240.00	
	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	96,000	5.75	552,000.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	46,000	5.54	254,840.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	84,000	4.66	391,440.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	69,000	21.45	1,480,050.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	110,000	4.86	534,600.00	
	MMG LIMITED	88,000	3.41	300,080.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	87,000	6.65	578,550.00	
	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LIMITED	182,000	3.28	596,960.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	66,000	2.86	188,760.00	
	YINGDE GASES GROUP COMPANY	29,500	8.85	261,075.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	24,500	12.10	296,450.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	273,000	3.18	868,140.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	96,000	3.81	365,760.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	24,000	51.30	1,231,200.00	
	CHINA COMMUICATIONS CONST-H	222,000	7.99	1,773,780.00	
	CHINA INTL MARINE CO-H	18,200	14.12	256,984.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	102,500	9.06	928,650.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	170,000	4.61	783,700.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	92,000	10.12	931,040.00	
	CITIC PACIFIC LIMITED -R	71,000	12.84	911,640.00	

CSR CORP LTD-H	100,000	6.94	694,000.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	10,800	15.66	169,128.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	3.50	588,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	23,000	27.40	630,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	25,200	33.85	853,020.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	21,000	27.15	570,150.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	64,380	11.08	713,330.40	
AIR CHINA LIMITED-H	92,000	7.38	678,960.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	6.13	662,040.00	
CHINA COSCO HOLDONGS-H	142,500	4.52	644,100.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	51,513	26.10	1,344,489.30	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	2.58	567,600.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	64,000	4.81	307,840.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	140,000	4.48	627,200.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	74,000	12.28	908,720.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	48,000	8.09	388,320.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	58,000	6.60	382,800.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	120,000	10.54	1,264,800.00	
BYD CO LTD-H	18,500	26.80	495,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	148,000	12.30	1,820,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	155,000	4.12	638,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	51,250	28.80	1,476,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	102,246	7.25	741,283.50	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	31,000	8.50	263,500.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	206,000	2.35	484,100.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	64,000	10.38	664,320.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	28,000	11.82	330,960.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	226,000	17.54	3,964,040.00	
DAH CHONG HONG	28,000	8.85	247,800.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	37,000	18.06	668,220.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	411,000	0.99	406,890.00	
INTIME DEPARTMENT STORE	70,000	10.94	765,800.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	83,500	6.21	518,535.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	21,000	11.16	234,360.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	58,000	27.10	1,571,800.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	111,000	11.52	1,278,720.00	
WUMART STORES INC-H	29,000	15.40	446,600.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	0.00	0.00	

CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	92,300	5.07	467,961.00	
CHINA FOODS LTD	56,000	7.24	405,440.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	64,000	23.75	1,520,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	94,000	21.00	1,974,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	18,000	45.30	815,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	39,000	9.30	362,700.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	291,000	10.44	3,038,040.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	38,000	74.00	2,812,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	7.54	542,880.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	22,800	16.36	373,008.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	43,200	25.20	1,088,640.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	100,000	3.57	357,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,036,000	4.01	4,154,360.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,663,200	3.77	13,810,264.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	344,475	6.33	2,180,526.75	
CHINA CITIC BANK-H	361,200	5.17	1,867,404.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,521,620	6.63	23,348,340.60	
CHINA MERCHANTS BANK-H	188,289	18.50	3,483,346.50	
CHINA MINSHENG BANKING-H	252,000	10.48	2,640,960.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	90,000	5.01	450,900.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	3,170,515	5.94	18,832,859.10	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	50,000	14.94	747,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	61,500	20.20	1,242,300.00	
FAR EAST HORIZON LTD	76,000	6.23	473,480.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	56,000	13.10	733,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	365,000	26.70	9,745,500.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	111,200	32.30	3,591,760.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	54,400	16.18	880,192.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	129,200	11.98	1,547,816.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	92,000	69.80	6,421,600.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	11.04	794,880.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	199,040	25.00	4,976,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	98,000	23.15	2,268,700.00	
CHINA VANKE CO LTD-B	66,200	12.50	827,500.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	212,285	4.06	861,877.10	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	228,000	4.30	980,400.00	
FRANSHION PROPERTIES	150,000	2.88	432,000.00	

	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	45,600	14.34	653,904.00	
	LONGFOR PROPERTIES	68,500	14.90	1,020,650.00	
	POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	75,000	6.18	463,500.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	16.70	1,285,900.00	
	SHUI ON LAND LTD	156,959	3.71	582,317.89	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS-R	157,584	6.19	975,444.96	
	SOHO CHINA LTD	90,500	6.54	591,870.00	
	YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	208,000	2.69	559,520.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	49,700	270.40	13,438,880.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	26,500	27.45	727,425.00	
	LENOVO GROUP LTD	328,000	7.66	2,512,480.00	
	ZTE CORP-H	29,424	14.76	434,298.24	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	114,000	4.75	541,500.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	295,500	87.65	25,900,575.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	678,000	4.40	2,983,200.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	246,000	13.18	3,242,280.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	148,000	6.88	1,018,240.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	137,000	6.46	885,020.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	46,000	16.76	770,960.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	91,400	20.00	1,828,000.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO. LTD.-H	158,000	3.10	489,800.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	36,000	34.95	1,258,200.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	112,000	6.27	702,240.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	150,000	7.05	1,057,500.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	503,000	2.07	1,041,210.00	
香港ドル小計		29,111,680		279,871,180.34 (3,243,706,980)	
マレーシアリンギット	BUMI ARMADA BERHAD	43,800	3.84	168,192.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	9,300	23.00	213,900.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	90,600	2.96	268,176.00	
	LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	26,100	9.54	248,994.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	140,500	6.30	885,150.00	
	GAMUDA BHD	88,900	3.80	337,820.00	
	IJM CORP BHD	65,200	5.00	326,000.00	
	MALAYSIA MARINE AND HEAVY EN	26,400	4.39	115,896.00	
	MMC CORP BHD	53,800	2.62	140,956.00	
	SIME DARBY BERHAD	130,600	9.39	1,226,334.00	
	AIRASIA BHD	64,800	2.95	191,160.00	

	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	29,975	5.50	164,862.50	
	MISC BHD	56,540	4.29	242,556.60	
	UMW HOLDINGS BHD	20,000	12.60	252,000.00	
	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	30,607	4.39	134,364.73	
	GENTING BHD	97,500	9.80	955,500.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	137,300	3.66	502,518.00	
	PARKSON HOLDINGS BHD	50,285	4.90	246,396.50	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	5,400	59.90	323,460.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	51,300	4.57	234,441.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	8.83	123,620.00	
	IOI CORPORATION BHD	158,340	4.99	790,116.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	23,500	21.90	514,650.00	
	PPB GROUP BERHAD	21,100	13.02	274,722.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	92,500	3.45	319,125.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	39,200	4.38	171,696.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	239,600	7.58	1,816,168.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	23,680	14.68	347,622.40	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,100	14.52	132,132.00	
	MALAYAN BANKING BHD	191,950	9.00	1,727,550.00	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	53,300	16.16	861,328.00	
	RHB CAPITAL BHD	32,235	7.92	255,301.20	
	AMMB HOLDINGS BHD	90,500	6.54	591,870.00	
	UEM LAND HOLDINGS BHD	68,900	2.29	157,781.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	128,375	6.64	852,410.00	
	DIGI.COM BERHAD	150,100	5.14	771,514.00	
	MAXIS BHD	108,300	6.54	708,282.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	66,300	5.60	371,280.00	
	PETRONAS GAS BHD	27,400	18.98	520,052.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	141,475	6.99	988,910.25	
	YTL CORPORATION BERHAD	207,717	1.80	373,890.60	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	116,500	1.64	191,060.00	
マレーシアリンギット小計		3,222,979		20,039,758.38 (597,385,197)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,400	400.00	1,360,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	4.28	2,451,584.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	59,500	162.50	9,668,750.00	
	PTT PCL-NVDR	42,900	336.00	14,414,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	36,600	71.00	2,598,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	64,000	27.00	1,728,000.00	

	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	92,734	78.00	7,233,252.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	18,600	470.00	8,742,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	27,200	97.25	2,645,200.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	68.00	3,814,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	202,700	46.25	9,374,875.00	
	SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	5,600	438.00	2,452,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	168,800	34.50	5,823,600.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	17,700	121.00	2,141,700.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	64,700	206.00	13,328,200.00	
	BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	94,900	33.25	3,155,425.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	80,300	194.50	15,618,350.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	11,600	194.00	2,250,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	199,750	20.70	4,134,825.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	92,600	175.00	16,205,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	39,700	83.25	3,305,025.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	55,500	206.00	11,433,000.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	35,600	78.25	2,785,700.00	
タイバーツ小計		2,043,284		146,665,486.00 (444,396,422)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	81,000	57.00	4,617,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	179,600	17.70	3,178,920.00	
	DMCI HOLDINGS INC	21,700	53.00	1,150,100.00	
	SAN MIGUEL CORP	23,500	106.00	2,491,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	9,520	967.00	9,205,840.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	39,080	76.00	2,970,080.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	108.00	2,748,600.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	44,760	86.00	3,849,360.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	47,476	98.80	4,690,628.80	
	BDO UNIBANK INC	67,381	76.20	5,134,432.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	4,515	105.30	475,429.50	
	AYALA CORPORATION	9,900	529.00	5,237,100.00	
	AYALA LAND INC	342,400	27.75	9,501,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	309,750	16.60	5,141,850.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,187.00	2,124,730.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	1,730	2,800.00	4,844,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	38.10	3,409,950.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	6.98	4,231,974.00	
フィリピンペソ小計		1,905,352		75,002,594.50 (165,755,733)	

インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	1,690.00	1,352,845,000.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	17,000	42,000.00	714,000,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	37,500	16,400.00	615,000,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	82,000	22,050.00	1,808,100,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	156,000	15,850.00	2,472,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	75,500	21,000.00	1,585,500,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,600.00	691,600,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,017,500	7,750.00	7,885,625,000.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	322,000	2,375.00	764,750,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	224,000	2,400.00	537,600,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	19,250.00	385,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	328,000	3,775.00	1,238,200,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	22,500	52,850.00	1,189,125,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	234,500	5,950.00	1,395,275,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	79,000	22,450.00	1,773,550,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,021,000	1,040.00	1,061,840,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	595,000	9,500.00	5,652,500,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	5,850.00	1,149,525,000.00	
	BANK MANDIRI	447,698	8,700.00	3,894,972,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	375,000	3,850.00	1,443,750,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	524,500	8,000.00	4,196,000,000.00	
	INDOSAT TBK PT	39,500	6,850.00	270,575,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	489,500	9,800.00	4,797,100,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	5,450.00	940,125,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	578,000	4,600.00	2,658,800,000.00	
インドネシアルピア小計		7,978,698		50,473,957,600.00 (474,455,201)	
メキシコペソ	ALPEK SA DE CV	21,600	32.84	709,344.00	
	CEMEX SAB-SPONS	516,003	13.15	6,785,439.45	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	183,992	48.93	9,002,728.56	
	INDUSTRIAS CH S.A.B.-SER B	8,600	103.08	886,488.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,500	644.03	4,186,195.00	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	51,190	74.64	3,820,821.60	
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	31,700	54.39	1,724,163.00	
	ALFA S.A.B.-A	136,800	32.18	4,402,224.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	31,700	61.83	1,960,011.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	8,700	153.30	1,333,710.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	77.87	1,361,167.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	125,890	70.85	8,919,306.50	

	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	8,800	136.45	1,200,760.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	264,380	41.38	10,940,044.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	13,275	96.00	1,274,400.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	20,600	199.94	4,118,764.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	96,840	135.11	13,084,052.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	82,900	32.91	2,728,239.00	
	GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	31,500	113.45	3,573,675.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	75,900	34.51	2,619,309.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	73,900	40.74	3,010,686.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	92,700	89.40	8,287,380.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	95,900	36.70	3,519,530.00	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	59,900	19.68	1,178,832.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,910,540	15.56	29,728,002.40	
メキシコペソ小計		3,967,290		130,355,272.91 (925,522,437)	
ブラジルレアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	6,600	42.85	282,810.00	
	OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	64,264	4.95	318,106.80	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	143,800	19.90	2,861,620.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	205,740	19.58	4,028,389.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	15,400	45.50	700,700.00	
	BRADESPAR SA -PREF	11,000	31.22	343,420.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	13.86	123,354.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	35,200	12.00	422,400.00	
	DURATEX SA	11,200	14.00	156,800.00	
	FIBRIA CELULOSE SA	14,600	25.78	376,388.00	
	GERDAU SA-PREF	41,100	17.90	735,690.00	
	KLABIN SA-PREF	20,000	13.11	262,200.00	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	12,300	22.63	278,349.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,779	12.30	218,681.70	
	VALE SA	62,900	40.61	2,554,369.00	
	VALE SA-PREF A	98,315	39.20	3,853,948.00	
	EMBRAER SA	28,700	14.20	407,540.00	
	MARCOPOLO SA-PREF	6,900	13.00	89,700.00	
	WEG SA	12,400	27.00	334,800.00	
	MULTIPLUS SA	1,700	45.30	77,010.00	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	24,700	8.94	220,818.00	
	ARTERIS SA	3,400	19.20	65,280.00	
	CCR SA	44,000	19.99	879,560.00	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,900	17.39	137,381.00	

LOCALIZA RENT A CAR	5,800	35.45	205,610.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	13,400	18.44	247,096.00	
MRV ENGENHARIA	15,300	11.12	170,136.00	
PDG REALTY SA	63,900	3.14	200,646.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	6,700	33.50	224,450.00	
KROTON EDUCATIONAL SA	4,400	43.70	192,280.00	
CIA HERING	6,400	38.20	244,480.00	
LOJAS AMERICANAS SA	7,200	17.42	125,424.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	21,858	17.95	392,351.10	
LOJAS RENNER S.A.	6,300	78.54	494,802.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	5,000	90.14	450,700.00	
RAIA DROGASIL SA	9,000	23.20	208,800.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	31,900	45.61	1,454,959.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	37,200	91.87	3,417,564.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	6,600	89.70	592,020.00	
JBS SA	28,000	7.10	198,800.00	
SOUZA CRUZ SA	18,700	32.35	604,945.00	
HYPERMARCAS SA	19,800	16.17	320,166.00	
NATURA COSMETICOS SA	8,600	55.60	478,160.00	
AMIL PARTICIPACOES SA	6,000	31.15	186,900.00	
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	11,800	13.80	162,840.00	
ODONTOPREV S.A.	12,400	10.20	126,480.00	
QUALICORP SA	8,000	22.30	178,400.00	
BANCO BRADESCO S.A.	28,000	37.00	1,036,000.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	93,100	38.25	3,561,075.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	26,900	26.20	704,780.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	7,700	17.30	133,210.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	110,900	36.06	3,999,054.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	121,740	10.55	1,284,357.00	
BM&FBOVESPA SA	86,800	13.92	1,208,256.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,500	24.70	284,050.00	
PORTO SEGURO SA	5,900	22.90	135,110.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	20,200	26.80	541,360.00	
BR PROPERTIES SA	9,000	27.00	243,000.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,900	58.10	226,590.00	
CIELO SA	14,800	54.52	806,896.00	
TOTVS SA	5,800	43.35	251,430.00	
OI SA	7,286	9.82	71,548.52	

	OI SA-PREFERENCE	45,431	9.17	416,602.27	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	15,200	51.75	786,600.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	39,200	8.47	332,024.00	
	AES TIETE SA-PREF	6,100	22.00	134,200.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	7.32	119,316.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	9,000	12.23	110,070.00	
	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	6,800	20.36	138,448.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	24,025	23.35	560,983.75	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	31.85	175,175.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,700	90.60	516,420.00	
	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	3,400	46.33	157,522.00	
	CPFL ENERGIA SA	12,768	21.50	274,512.00	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	12,900	12.15	156,735.00	
	ELETROPAULO METROPOLI-PREF	4,200	14.61	61,362.00	
	LIGHT SA	4,400	21.40	94,160.00	
	MPX ENERGIA SA	5,100	10.69	54,519.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	7,200	35.40	254,880.00	
ブラジルレアル小計		2,029,806		49,437,569.34 (2,176,736,178)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	21,825	7,246.90	158,163,592.50	
	CAP SA	3,824	17,749.00	67,872,176.00	
	EMPRESAS CMPC SA	55,751	1,897.90	105,809,822.90	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,701	27,587.00	129,686,487.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	13,037	11,863.00	154,657,931.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	22,381	5,179.30	115,917,913.30	
	CENCOSUD SA	52,180	2,895.20	151,071,536.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,096	7,582.00	46,219,872.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	9,036	3,033.70	27,412,513.20	
	VINA CONCHA Y TORO SA	17,318	944.37	16,354,599.66	
	BANCO DE CHILE	963,059	78.02	75,137,863.18	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,588	35,065.00	55,683,220.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	3,113,843	35.68	111,101,918.24	
	CORPBANCA	4,390,624	6.80	29,882,586.94	
	CORPBANCA SA-RIGHT	703,438	0.59	421,359.36	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	10,447.00	63,664,018.00	
	AES GENER SA	104,798	324.57	34,014,286.86	
	AGUAS ANDINAS SA-A	107,808	349.19	37,645,475.52	
	COLBUN SA	410,079	145.78	59,781,316.62	
	E.CL SA	22,835	1,121.70	25,614,019.50	

	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	167,149	798.78	133,515,278.22	
	ENERSIS SA	627,902	185.64	116,563,727.28	
チリペソ小計		10,825,366		1,716,191,513.28 (326,934,483)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,786	67,900.00	189,169,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,849	164,000.00	467,236,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,270	97,400.00	221,098,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	2,213	90,600.00	200,497,800.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	3,756	19,400.00	72,866,400.00	
	HANWHA CORPORATION	1,835	33,400.00	61,289,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	66,900.00	94,262,100.00	
	HYUNDAI HYSCO	1,460	43,450.00	63,437,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,908	83,000.00	241,364,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	381	405,000.00	154,305,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	580	125,000.00	72,500,000.00	
	LG CHEM LTD	2,263	317,500.00	718,502,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	163	98,100.00	15,990,300.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	906	256,000.00	231,936,000.00	
	OCI COMPANY LTD	780	179,500.00	140,010,000.00	
	POSCO	3,144	357,000.00	1,122,408,000.00	
	CJ CORP	898	131,500.00	118,087,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,470	91,500.00	134,505,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,210	9,480.00	39,910,800.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,992	37,900.00	113,396,800.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,110	28,000.00	115,080,000.00	
	DOOSAN CORP	304	129,000.00	39,216,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	2,311	47,000.00	108,617,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	4,280	16,950.00	72,546,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,822	56,100.00	102,214,200.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,000	23,000.00	69,000,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	3,428	72,000.00	246,816,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,975	229,000.00	452,275,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	430	127,000.00	54,610,000.00	
	KCC CORP	260	291,000.00	75,660,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,510	24,500.00	36,995,000.00	
	LG CORP	4,420	64,900.00	286,858,000.00	
	LS CORP	1,095	89,900.00	98,440,500.00	
	LS INDUSTRIAL SYSTEMS	617	66,900.00	41,277,300.00	
	SAMSUNG C&T CORP	5,864	62,700.00	367,672,800.00	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,603	156,500.00	250,869,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	7,540	37,400.00	281,996,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	1,635	55,800.00	91,233,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,234	170,000.00	209,780,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,700	8,270.00	38,869,000.00	
S1 CORPORATION	1,294	70,500.00	91,227,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	594	206,500.00	122,661,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	2,198	22,000.00	48,356,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,006	45,600.00	91,473,600.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	3,361	46,550.00	156,454,550.00	
HYUNDAI MOBIS	3,266	260,500.00	850,793,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	7,550	213,500.00	1,611,925,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,719	75,000.00	128,925,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	830	68,800.00	57,104,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	699	155,000.00	108,345,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	12,477	54,200.00	676,253,400.00	
MANDO CORP	560	122,000.00	68,320,000.00	
COWAY CO.,LTD.	2,430	45,800.00	111,294,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,431	74,800.00	406,238,800.00	
KANGWON LAND INC	5,180	30,350.00	157,213,000.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	4,110	21,050.00	86,515,500.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	832	169,000.00	140,608,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	501	385,500.00	193,135,500.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	226,000.00	94,242,000.00	
EMART	1,007	236,500.00	238,155,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	404	375,500.00	151,702,000.00	
KT&G CORP	5,333	76,600.00	408,507,800.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	1,652,000.00	74,340,000.00	
ORION CORP	159	1,077,000.00	171,243,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	180	1,150,000.00	207,000,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	446	669,000.00	298,374,000.00	
PACIFIC CORP	121	448,000.00	54,208,000.00	
CELLTRION INC	6,129	26,000.00	159,354,000.00	
YUHAN CORPORATION	366	187,000.00	68,442,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	7,870	13,650.00	107,425,500.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	6,090	14,150.00	86,173,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	11,840	38,400.00	454,656,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7,770	11,850.00	92,074,500.00	

	KB FINANCIAL GROUP INC	17,518	39,400.00	690,209,200.00	
	KOREA EXCHANGE BANK	14,630	7,260.00	106,213,800.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	20,495	40,200.00	823,899,000.00	
	WOORI FINANCE HOLDINGS CO	16,320	12,400.00	202,368,000.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	7,448	12,050.00	89,748,400.00	
	HYUNDAI SECURITIES CO	4,190	8,830.00	36,997,700.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,840	44,500.00	81,880,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,508	38,300.00	57,756,400.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,896	37,000.00	70,152,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,246	56,500.00	183,399,000.00	
	WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,202	12,150.00	99,654,300.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	2,150	46,650.00	100,297,500.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE	7,630	7,900.00	60,277,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,170	33,750.00	106,987,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,722	212,500.00	365,925,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	2,905	106,500.00	309,382,500.00	
	NCSOFT CORPORATION	708	142,000.00	100,536,000.00	
	NHN CORP	1,989	237,000.00	471,393,000.00	
	SK C&C CO LTD	1,235	108,500.00	133,997,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	11,080	28,800.00	319,104,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	392	76,100.00	29,831,200.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,844	94,200.00	267,904,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,745	146,000.00	254,770,000.00	
	KT CORP	2,340	37,150.00	86,931,000.00	
	LG UPLUS CORP	14,670	8,230.00	120,734,100.00	
	SK TELECOM	945	164,000.00	154,980,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	13,180	34,250.00	451,415,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,083	79,100.00	85,665,300.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,399	1,480,000.00	7,990,520,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	987	841,000.00	830,067,000.00	
	SK HYNIX INC	25,050	25,600.00	641,280,000.00	
	韓国ウォン小計	393,143		30,609,812,750.00 (2,601,834,083)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	50,240	85.10	4,275,424.00	
	ASIA CEMENT CORP	95,311	36.55	3,483,617.05	
	CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	82,720	18.70	1,546,864.00	
	CHINA STEEL	555,280	28.00	15,547,840.00	
	ETERNAL CHEMICAL CO LTD	27,562	25.50	702,831.00	
	FENG HSIN IRON & STEEL CO	25,000	52.30	1,307,500.00	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	145,050	79.00	11,458,950.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	198,870	80.20	15,949,374.00	
LCY CHEMICAL CORP	21,796	38.15	831,517.40	
NAN YA PLASTICS CORP	221,250	59.40	13,142,250.00	
TAIWAN CEMENT	144,929	38.75	5,615,998.75	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	72.80	2,475,200.00	
TSRC CORP	27,830	58.00	1,614,140.00	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	40,000	29.75	1,190,000.00	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	172.00	860,000.00	
CTCI CORP	33,000	57.20	1,887,600.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	156,611	32.95	5,160,332.45	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	7,570	211.00	1,597,270.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	65,486	29.50	1,931,837.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	83,000	23.00	1,909,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	199,000	9.87	1,964,130.00	
CHINA AIRLINES LTD	133,203	13.15	1,751,619.45	
EVA AIRWAYS CORP	95,000	18.20	1,729,000.00	
EVERGREEN MARINE	106,499	19.35	2,060,755.65	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	18,000	48.35	870,300.00	
WAN HAI LINES LIMITED	28,350	16.75	474,862.50	
YANG MING MARINE TRANSPORT	42,900	14.45	619,905.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	88,749	73.80	6,549,676.20	
CHINA MOTOR CORP	51,000	26.20	1,336,200.00	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	43,309	34.65	1,500,656.85	
YULON MOTOR COMPANY	56,000	54.30	3,040,800.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	27.25	1,090,000.00	
GIANT MANUFACTURING	11,464	160.50	1,839,972.00	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	15,000	126.50	1,897,500.00	
POU CHEN	117,780	30.55	3,598,179.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	21,777	74.40	1,620,208.80	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,662	360.00	958,320.00	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	48,187	28.80	1,387,785.60	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,000	227.00	2,724,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	27,544	161.00	4,434,584.00	
STANDARD FOODS CORP	11,160	80.50	898,380.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	195,835	52.30	10,242,170.50	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	27,000	67.30	1,817,100.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	235,688	15.95	3,759,223.60	

CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	636,780	7.72	4,915,941.60	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	555,578	16.65	9,250,373.70	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	170,584	16.15	2,754,931.60	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	319,131	17.55	5,600,749.05	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	271,625	16.85	4,576,881.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	390,876	23.20	9,068,323.20	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	261,559	12.60	3,295,643.40	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	273,063	11.60	3,167,530.80	
TAIWAN BUSINESS BANK	171,003	8.74	1,494,566.22	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	232,744	16.35	3,805,364.40	
CAPITAL SECURITIES CORP	139,948	11.00	1,539,428.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	29,000	68.10	1,974,900.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	265,082	36.30	9,622,476.60	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	366,944	15.05	5,522,507.20	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	334,673	31.90	10,676,068.70	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	113,759	27.65	3,145,436.35	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	324,826	8.12	2,637,587.12	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	53.10	531,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	21,600	58.50	1,263,600.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	37,993	62.60	2,378,361.80	
ACER INC	146,375	24.35	3,564,231.25	
ADVANTECH CO LTD	15,600	119.50	1,864,200.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	32,092	330.00	10,590,360.00	
AU OPTRONICS CORP	388,090	11.50	4,463,035.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	25,700	129.00	3,315,300.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	17,340	58.10	1,007,454.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	27,807	78.70	2,188,410.90	
CLEVO COMPANY	21,008	36.75	772,044.00	
COMPAL ELECTRONICS	224,760	20.80	4,675,008.00	
DELTA ELECTRONICS INC	85,520	107.00	9,150,640.00	
E INK HOLDINGS INC	36,000	21.50	774,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	40,426	86.30	3,488,763.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	488,048	85.40	41,679,299.20	
HTC CORPORATION	35,430	288.00	10,203,840.00	
INVENTEC CO LTD	164,511	11.75	1,933,004.25	
LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	725.00	3,654,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	103,058	39.45	4,065,638.10	
PEGATRON CORP	71,474	39.00	2,787,486.00	

	QUANTA COMPUTER INC	124,270	64.60	8,027,842.00	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	13,354	130.50	1,742,697.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	69,381	59.60	4,135,107.60	
	TPK HOLDING CO LTD	10,969	481.00	5,276,089.00	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	19,100	58.60	1,119,260.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	59,000	29.00	1,711,000.00	
	WINTEK CORP	72,196	13.45	971,036.20	
	WISTRON CORP	99,171	33.70	3,342,062.70	
	WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	39.30	3,190,649.10	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	9,450	66.90	632,205.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	184,315	94.70	17,454,630.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	72.90	5,904,900.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	78,200	106.50	8,328,300.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	276,739	24.80	6,863,127.20	
	EPISTAR CORP	34,000	53.00	1,802,000.00	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	540.00	1,620,000.00	
	KINSUS INTERCONNECT TECH	12,000	92.00	1,104,000.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	225,809	8.81	1,989,377.29	
	MEDIATEK INC	55,064	309.00	17,014,776.00	
	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	11,008	203.00	2,234,624.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	26,045	112.00	2,917,040.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	6,599	199.00	1,313,201.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,770	44.95	1,697,761.50	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	19,570	109.50	2,142,915.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	23,707	61.90	1,467,463.30	
	RICHTEK TECHNOLOGY CORP	9,410	175.50	1,651,455.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	161,000	30.65	4,934,650.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,197,389	101.50	121,534,983.50	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	81.50	769,767.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	634,000	11.50	7,291,000.00	
新台湾ドル小計		14,147,807		588,235,180.68 (1,823,529,060)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,660	434.95	2,461,817.00	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	336.90	7,462,335.00	
	COAL INDIA LTD	21,324	354.80	7,565,755.20	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	33,375	337.70	11,270,737.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	63,053	900.20	56,760,310.60	
	ACC LTD	3,062	1,345.15	4,118,849.30	

AMBUJA CEMENTS LTD	32,735	198.70	6,504,444.50	
ASIAN PAINTS LTD	1,215	4,311.05	5,237,925.75	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	49,471	122.75	6,072,565.25	
JINDAL STEEL & POWER LTD	19,814	422.85	8,378,349.90	
JSW STEEL LTD	3,763	869.80	3,273,057.40	
SESA GOA LTD	18,682	187.15	3,496,336.30	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	59,174	113.60	6,722,166.40	
TATA STEEL LTD	14,409	415.00	5,979,735.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,438	1,909.30	2,745,573.40	
ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	267.00	2,015,049.00	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,306	1,143.80	2,637,602.80	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	32,256	226.45	7,304,371.20	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	37,334	89.90	3,356,326.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	10,658	1,537.20	16,383,477.60	
SIEMENS INDIA LTD	1,983	656.65	1,302,136.95	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	11,935	132.25	1,578,403.75	
BAJAJ AUTO LTD	3,464	2,059.25	7,133,242.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,195	1,764.10	3,872,199.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	14,072	886.00	12,467,792.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,820	1,547.45	4,363,809.00	
TATA MOTORS LTD	34,257	328.55	11,255,137.35	
TITAN INDUSTRIES LTD	7,394	274.25	2,027,804.50	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	26,571	224.10	5,954,561.10	
ITC LTD	106,863	287.45	30,717,769.35	
UNITED BREWERIES LTD	4,195	684.45	2,871,267.75	
UNITED SPIRITS LTD	4,068	1,801.55	7,328,705.40	
DABUR INDIA LTD	19,484	128.95	2,512,461.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,666	723.65	4,823,850.90	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	42,612	490.40	20,896,924.80	
CIPLA LTD	15,010	409.80	6,151,098.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,694	1,051.00	2,831,394.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,073	1,891.15	11,484,953.95	
LUPIN LTD	6,867	588.35	4,040,199.45	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	573.75	2,028,206.25	
RANBAXY LABORATORIES LTD	6,355	482.15	3,064,063.25	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	17,704	712.05	12,606,133.20	
AXIS BANK LTD	10,693	1,388.05	14,842,418.65	
BANK OF BARODA	2,287	884.65	2,023,194.55	

	BANK OF INDIA	4,754	385.50	1,832,667.00	
	CANARA BANK	3,635	521.15	1,894,380.25	
	HDFC BANK LTD	75,362	662.85	49,953,701.70	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	71,903	822.70	59,154,598.10	
	ICICI BANK LTD	20,594	1,176.20	24,222,662.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	19,565	281.45	5,506,569.25	
	STATE BANK OF INDIA	6,493	2,492.05	16,180,880.65	
	IDFC LTD	47,718	176.05	8,400,753.90	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,709	629.75	8,633,242.75	
	POWER FINANCE CORPORATION	9,522	207.25	1,973,434.50	
	RELIANCE CAPITAL LTD	4,769	481.00	2,293,889.00	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	13,706	250.85	3,438,150.10	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,385	761.35	5,622,569.75	
	DLF LTD	24,294	262.70	6,382,033.80	
	UNITECH LTD	52,722	38.80	2,045,613.60	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	9,433	705.65	6,656,396.45	
	INFOSYS LTD	21,032	2,788.05	58,638,267.60	
	SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	46,405	116.80	5,420,104.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	23,447	1,351.00	31,676,897.00	
	WIPRO LTD	25,858	397.35	10,274,676.30	
	BHARTI AIRTEL LTD	25,397	348.85	8,859,743.45	
	IDEA CELLULAR LTD	29,763	117.30	3,491,199.90	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	32,379	83.30	2,697,170.70	
	GAIL INDIA LTD	16,026	383.65	6,148,374.90	
	NTPC LTD	25,870	164.50	4,255,615.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	56,375	114.95	6,480,306.25	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	527.30	3,914,147.90	
	RELIANCE POWER LTD	26,910	93.35	2,512,048.50	
	TATA POWER CO LTD	54,425	108.15	5,886,063.75	
インドルピー小計		1,576,097		702,370,672.00 (1,187,006,435)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	943	3,980.00	3,753,140.00	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	6,181	330.00	2,039,730.00	
	CEZ AS	8,088	652.90	5,280,655.20	
チェココルナ小計		15,212		11,073,525.20 (51,713,362)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	1,773	18,900.00	33,509,700.00	
	OTP BANK NYRT	11,567	4,670.00	54,017,890.00	
	MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	28,589	407.00	11,635,723.00	

ハンガリーフォリント小計		41,929		99,163,313.00 (40,458,631)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	2,227	40.00	89,080.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	15,313	50.40	771,775.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	92,344	5.66	522,667.04	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,244	92.75	208,131.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,215	188.00	1,356,420.00	
	SYNTHOS SA	33,750	5.18	174,825.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	17.90	212,652.00	
	EUROCASH SA	2,543	47.00	119,521.00	
	KERNEL HOLDING SA	3,178	62.90	199,896.20	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	97.15	195,271.50	
	BANK MILLENNIUM SA	22,475	5.13	115,296.75	
	BANK PEKAO SA	6,079	170.00	1,033,430.00	
	BRE BANK SA	761	320.50	243,900.50	
	PKO BANK POLSKI SA	32,265	36.28	1,170,574.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,976	403.00	1,199,328.00	
	ASSECO POLAND SA	2,746	45.98	126,261.08	
	TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	36,440	12.76	464,974.40	
	ENEA SA	4,648	15.69	72,927.12	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	36,786	18.98	698,198.28	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	40,920	4.90	200,508.00	
ポーランドズロチ小計		358,800		9,175,637.27 (264,074,840)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,847	169.25	820,354.75	
	SASOL LTD	26,349	369.63	9,739,380.87	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	4,318	195.37	843,607.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	2,584	445.12	1,150,190.08	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	17,110	259.52	4,440,387.20	
	ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	9,721	37.51	364,634.71	
	ASSORE LTD	1,860	431.99	803,501.40	
	GOLD FIELDS LTD	33,782	107.96	3,647,104.72	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	20,054	66.94	1,342,414.76	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	26,620	169.60	4,514,752.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,653	580.00	2,118,740.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	13,846	37.00	512,302.00	
	PPC LIMITED	30,677	33.00	1,012,341.00	
	SAPPI LIMITED	26,526	32.15	852,810.90	
	AVENG LTD	20,796	29.59	615,353.64	

	BARLOWORLD LTD	13,028	87.04	1,133,957.12	
	BIDVEST GROUP LTD	13,894	218.00	3,028,892.00	
	REUNERT LTD	7,306	76.00	555,256.00	
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	54,397	27.28	1,483,950.16	
	NASPERS LTD-N SHS	19,012	549.07	10,438,918.84	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	8,743	202.00	1,766,086.00	
	MR PRICE GROUP LTD	11,589	120.00	1,390,680.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	10,233	122.33	1,251,802.89	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	21,406	102.85	2,201,607.10	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	40,114	64.18	2,574,516.52	
	MASSMART HOLDINGS LTD	5,649	183.46	1,036,365.54	
	PICK N PAY STORES LTD	10,581	45.00	476,145.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	21,783	183.00	3,986,289.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,016	120.14	1,203,322.24	
	TIGER BRANDS LTD	8,354	300.50	2,510,377.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	49,296	32.70	1,611,979.20	
	NETCARE LTD	36,951	19.65	726,087.15	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	14,257	164.84	2,350,123.88	
	ABSA GROUP LTD	13,812	161.75	2,234,091.00	
	NEDBANK GROUP LTD	9,558	192.42	1,839,150.36	
	STANDARD BANK GROUP LTD	58,855	117.12	6,893,097.60	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	41,558	30.25	1,257,129.50	
	FIRSTRAND LTD	153,209	33.00	5,055,897.00	
	INVESTEC LTD	15,904	64.00	1,017,856.00	
	REMGRO LTD	21,482	166.80	3,583,197.60	
	RMB HOLDINGS LTD	34,090	44.00	1,499,960.00	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	18,014	64.54	1,162,623.56	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	116.60	725,951.60	
	MMI HOLDINGS LTD	49,547	23.00	1,139,581.00	
	RMI HOLDINGS	40,408	23.05	931,404.40	
	SANLAM LTD	87,946	47.10	4,142,256.60	
	MTN GROUP LTD	82,740	176.57	14,609,401.80	
	VODACOM GROUP	17,139	127.00	2,176,653.00	
	南アフリカランド小計	1,249,840		120,772,482.35 (1,221,009,796)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,478	52.25	338,475.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	45,766	2.64	120,822.24	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	1,677	44.60	74,794.20	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	22,162	5.88	130,312.56	

	KOC HOLDING AS	31,393	10.45	328,056.85	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	28,780	3.24	93,247.20	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	12,762	10.00	127,620.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	33,158	6.78	224,811.24	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	21.70	70,698.60	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	9,987	10.95	109,357.65	
	ARCELIK AS	15,358	12.60	193,510.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,322	92.50	492,285.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	9,571	26.90	257,459.90	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,991	41.00	122,631.00	
	AKBANK T.A.S.	90,842	9.86	895,702.12	
	ASYA KATILIM BANKASI AS	20,503	2.51	51,462.53	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	108,046	9.86	1,065,333.56	
	TURKIYE HALK BANKASI	28,740	19.80	569,052.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	68,092	6.96	473,920.32	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	35,938	5.72	205,565.36	
	YAPI VE KREDI BANKASI	41,263	5.84	240,975.92	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	41,483	10.80	448,016.40	
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	21,819	3.10	67,638.90	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	26,540	7.46	197,988.40	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	37,927	12.25	464,605.75	
トルコリラ小計		749,856		7,364,344.00 (375,949,761)	
ユーロ	MAROC TELECOM	12,056	9.81	118,269.36	
ユーロ小計		12,056		118,269.36 (14,141,467)	
合計		80,648,063		17,363,281,657 (17,363,281,657)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	CONTROLADORA COML MEXIC-UB	18,600.00	855,042.00	
	メキシコペソ小計		18,600.00	855,042.00 (6,070,798)	
	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER SA	35,600.00	552,868.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	7,155.00	121,205.70	
	ブラジルレアル小計		42,755.00	674,073.70 (29,679,465)	

	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	83,438.00	2,167,719.24	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	166,445.00	1,607,858.70	
	南アフリカランド小計		249,883.00	3,775,577.94 (38,171,092)	
投資信託受益証券合計				73,921,355 (73,921,355)	
合計				73,921,355 (73,921,355)	

(注)有価証券明細表注記
(1)通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数		組入時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカドル	株式	30銘柄	100.0%	8.2%
香港ドル	株式	135銘柄	100.0%	18.6%
マレーシアリンギット	株式	42銘柄	100.0%	3.4%
タイバーツ	株式	23銘柄	100.0%	2.5%
フィリピンペソ	株式	18銘柄	100.0%	1.0%
インドネシアルピア	株式	25銘柄	100.0%	2.7%
メキシコペソ	株式	25銘柄	99.3%	5.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.7%	0.0%
ブラジルレアル	株式	79銘柄	98.7%	12.5%
	投資信託受益証券	2銘柄	1.3%	0.2%
チリペソ	株式	22銘柄	100.0%	1.9%
韓国ウォン	株式	104銘柄	100.0%	14.9%
新台湾ドル	株式	112銘柄	100.0%	10.5%
インドルピー	株式	73銘柄	100.0%	6.8%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	0.3%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	株式	20銘柄	100.0%	1.5%
南アフリカランド	株式	48銘柄	97.0%	7.0%
	投資信託受益証券	2銘柄	3.0%	0.2%
トルコリラ	株式	25銘柄	100.0%	2.2%
ユーロ	株式	1銘柄	100.0%	0.1%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成25年2月28日現在)

Ⅰ 資産総額	2,992,913,594	円
Ⅱ 負債総額	40,881,356	円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	2,952,032,238	円
Ⅳ 発行済口数	1,885,074,428	口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.5660	円
1万口当たり純資産額	15,660	円

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	243,270,745,819	円
Ⅱ 負債総額	6,816,517,977	円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	236,454,227,842	円
Ⅳ 発行済口数	186,999,191,663	口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.2645	円
1万口当たり純資産額	12,645	円

国内株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	139,606,119,434	円
Ⅱ 負債総額	403,345,505	円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	139,202,773,929	円
Ⅳ 発行済口数	177,511,624,683	口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.7842	円
1万口当たり純資産額	7,842	円

外国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	229,043,646,797	円
Ⅱ 負債総額	96,515,915	円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	228,947,130,882	円
Ⅳ 発行済口数	106,522,009,310	口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	2.1493	円
1万口当たり純資産額	21,493	円

外国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	148,551,166,156	円
Ⅱ 負債総額	190,713,690	円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	148,360,452,466	円

Ⅳ 発行済口数	121,855,409,861 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.2175 円
1万口当たり純資産額	12,175 円

新興国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	19,344,728,702 円
Ⅱ 負債総額	208,791,281 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	19,135,937,421 円
Ⅳ 発行済口数	11,843,124,124 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.6158 円
1万口当たり純資産額	16,158 円

新興国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	19,145,802,098 円
Ⅱ 負債総額	711,264,557 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	18,434,537,541 円
Ⅳ 発行済口数	9,049,619,935 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	2.0371 円
1万口当たり純資産額	20,371 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。

①受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取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。

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

②受益権の譲渡

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ます。

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載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。

④受益権の再分割

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

⑤償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載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。

⑥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25年2月28日現在）

資本金の額	： 3億円
発行可能株式総数	： 12,000株
発行済株式総数	： 3,000株
最近5年間における資本金の額の増減	： 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①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、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

［DO（実行）］

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

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

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年4月9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25年2月28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	299	4,042,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	778
単位型公社債投資信託	0	0
合計	304	4,043,323

3【委託会社等の経理状況】

（イ） 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

（ロ） 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度の中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

(3)【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

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

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

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

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

２．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

３．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

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

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

１．耐用年数の変更

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

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

２．資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

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

※2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

※1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式（株）	6,000	－	－	6,000

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３.剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

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

２．自己株式の種類及び株式数

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

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

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

３.剰余金の配当に関する事項

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

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

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

(1)配当金の総額　　30,000千円

(2)配当金の原資　　利益剰余金

(3)１株当たり配当額　　10,000円

(4)基準日　　平成24年3月31日

(5)効力発生日　　平成24年6月29日

（リース取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①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。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日）　　（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

(1)現金及び預金	6,223,302	6,223,302	―
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	―
(3)投資有価証券 その他有価証券	39,590	39,590	―
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	―

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）　（単位:千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）　（単位:千円）

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

当事業年度（平成24年3月31日）　（単位:千円）

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

未収委託者報酬	944,716	－	－	－

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）　（単位:千円）

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）　（単位:千円）

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

２．売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

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

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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項　（単位：千円）

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

(注) 1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

(注) 2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項　（単位：千円）

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

(注) 1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

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

3． 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

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

関連情報

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	－	－

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

①投資有価証券の譲渡

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

③ 投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（１株当たり情報）

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

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

２．1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

前事業年度（自　平成22年4月1日　至　平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成23年4月1日　至　平成24年3月31日）

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

１．企業結合の概要

(1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称　　住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

２．実施した会計処理の概要

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

次へ

中間貸借対照表

（単位：千円）

		第27期中間会計期間末 （平成24年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		7,260,016
未収委託者報酬		1,814,969
未収運用受託報酬		28,372
繰延税金資産		101,482
その他	※2	93,819
流動資産合計		9,298,659
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	86,364
器具備品	※1	125,490
有形固定資産合計		211,855
無形固定資産		185,002
投資その他の資産		
投資有価証券		74,123
長期貸付金		33,338
会員権		25,000
その他		1,550
貸倒引当金		△ 33,338
投資その他の資産合計		100,673
固定資産合計		497,530
資産合計		9,796,190
負債の部		
流動負債		
未払金		962,627
未払費用		281,477
未払法人税等		5,190
賞与引当金		95,026
その他		19,459
流動負債合計		1,363,781
固定負債		
退職給付引当金		247,039
繰延税金負債		300,749
資産除去債務		12,177
固定負債合計		559,966
負債合計		1,923,747

（単位：千円）

	第27期中間会計期間末

	（平成24年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	5,076,855
利益剰余金合計	7,236,355
株主資本合計	7,886,355
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△ 13,912
評価・換算差額等合計	△ 13,912
純資産合計	7,872,442
負債純資産合計	9,796,190

中間損益計算書

（単位：千円）

		第27期中間会計期間 （自　平成24年4月1日 至　平成24年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		9,035,190
運用受託報酬		44,467
営業収益合計		9,079,657
営業費用		6,960,854
一般管理費	※1	1,564,871
営業利益		553,930
営業外収益	※2	8,237
営業外費用		542
経常利益		561,626
特別損失	※1 ※3	484,725
税引前中間純利益		76,900
法人税、住民税及び事業税		1,327
法人税等調整額		24,285
法人税等合計		25,612
中間純利益		51,287

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	－
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	－
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	－
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	56,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	－
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	2,516,273
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 33,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,560,582
当中間期末残高	5,076,855
利益剰余金合計	
当期首残高	4,672,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,563,582
当中間期末残高	7,236,355
株主資本合計	
当期首残高	4,972,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
当中間期変動額合計	2,913,582
当中間期末残高	7,886,355

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	△ 9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 4,053
当中間期変動額合計	△ 4,053
当中間期末残高	△ 13,912
評価・換算差額等合計	
当期首残高	△ 9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 4,053
当中間期変動額合計	△ 4,053
当中間期末残高	△ 13,912
純資産合計	
当期首残高	4,962,913
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 4,053
当中間期変動額合計	2,909,528
当中間期末残高	7,872,442

重要な会計方針

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

に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）貸倒引当金

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

（2）賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

（3）退職給付引当金

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

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間末
（平成24年9月30日）

※1　有形固定資産の減価償却累計額

建　　物	16,512千円
器具備品	213,925千円
計	230,438千円

※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間
（自　平成24年4月1日
至　平成24年9月30日）

※1　減価償却実施額

有形固定資産	33,259千円
無形固定資産	34,512千円

※2　営業外収益の主要項目

受取利息	2,688千円

※3　特別損失の主要項目

統合関連損失	484,725千円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

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

（リース取引関係）
第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）
該当事項はありません。

（金融商品関係）
第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）
平成24年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

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

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

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

投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

その他有価証券

（単位:千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

１．企業結合の概要

(1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称　　当社

事業の内容　投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

２．実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

関連情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報
第27期中間会計期間（自　平成24年4月1日　至　平成24年9月30日）
　該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第27期中間会計期間（自　平成24年4月1日　至　平成24年9月30日）
　該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第27期中間会計期間（自　平成24年4月1日　至　平成24年9月30日）
　該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
該当事項はありません。
次へ

＜参考＞中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２４年６月１１日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　木 村 充 男　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

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

次へ

（１）貸借対照表

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

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

（２）損益計算書

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

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

（３）株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

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

追加情報

第26期 (平成23年４月１日から 平成24年３月31日まで)
１．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月４日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月４日）を適用しております。 ２．役員賞与引当金 役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第４号 平成17年11月29日）を適用し、当事業年度より役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

１．貸借対照表関係

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

２．損益計算書関係

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

３．株主資本等変動計算書関係

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

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

４．リース取引関係

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

５．金融商品関係

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

６．有価証券関係

第25期（平成23年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949
計	58,149	56,200	1,949

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	986	1,000	△13
計	986	1,000	△13

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344
計	128,650	67,194	344

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

第26期（平成24年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	52,728	50,200	2,528
計	52,728	50,200	2,528

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	7,151	153	2
計	7,151	153	2

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

７．デリバティブ関係

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

８．退職給付関係

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

９．税効果会計関係

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

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

10. 資産除去債務関係

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

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

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)

（セグメント情報）

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

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

第26期
(平成23年４月１日から
平成24年３月31日まで)

（セグメント情報）

第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

12. 関連当事者との取引関係

Ⅰ 第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

Ⅱ 第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. １株当たり情報

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

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14. 重要な後発事象

第26期 (平成23年４月１日から 平成24年３月31日まで)
（企業結合） 当社は、平成24年１月31日開催の取締役会における決議に基づき、住信アセットマネジメント株式会社と平成24年４月１日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年１月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び住信アセットマネジメント株式会社は、平成24年４月１日付で合併いたしました。 (1) 企業結合の概要 ①結合当事企業の名称及び当該事業の内容 結合企業 名称　　住信アセットマネジメント株式会社 事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業 被結合企業 名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社 事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業 ②企業結合日 平成24年４月１日 ③企業結合の法的形式 住信アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、当社を吸収合併消滅会社とする吸収合併 合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。 ④結合後の企業の名称 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 ⑤その他取引の概要に関する事項 旧中央三井トラスト・グループと旧住友信託銀行グループは、平成23年４月１日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年４月１日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び住信アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足するものです。 (2) 実施した会計処理の概要 「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたします。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、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25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年4月9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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（平成24年9月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年9月末日現在）	事業の内容
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
楽天証券株式会社	7,495	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。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196	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。
マネックス証券株式会社	7,425	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

①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

②設立年月日　：平成12年6月20日

③資本金の額　：51,000百万円（平成24年9月末日現在）

④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成２５年３月２１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」に掲げられている世界経済インデックスファンドの平成２４年１月２１日から平成２５年１月２１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、世界経済インデックスファンドの平成２５年１月２１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成２４年１月２０日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成２４年３月２日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以 上

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

２．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれておりません。

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成24年６月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

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

委託会社の監査報告書（当期中間）へ

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月６日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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