【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年4月18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、3.24%（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26年4月19日から平成26年10月20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

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 （　　） 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	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

（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

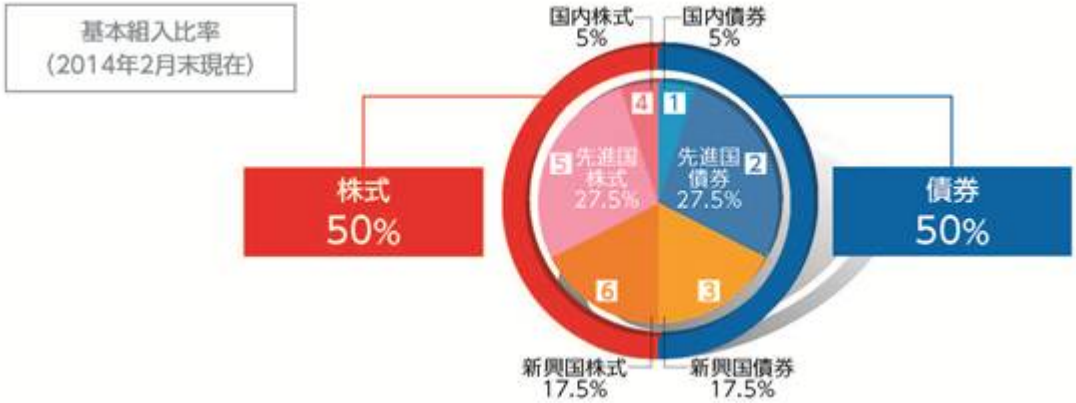
1.世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

・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「世界経済見通し2013年10月データ」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のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※上記のファンドの地域別構成比は、2014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、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

※3「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、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

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

※6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

3．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0.54%（税抜0.5%）です。
（注）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。

＜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 2012 Revision)」及びIMF「世界経済見通し2013年10月データ」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。
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

(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

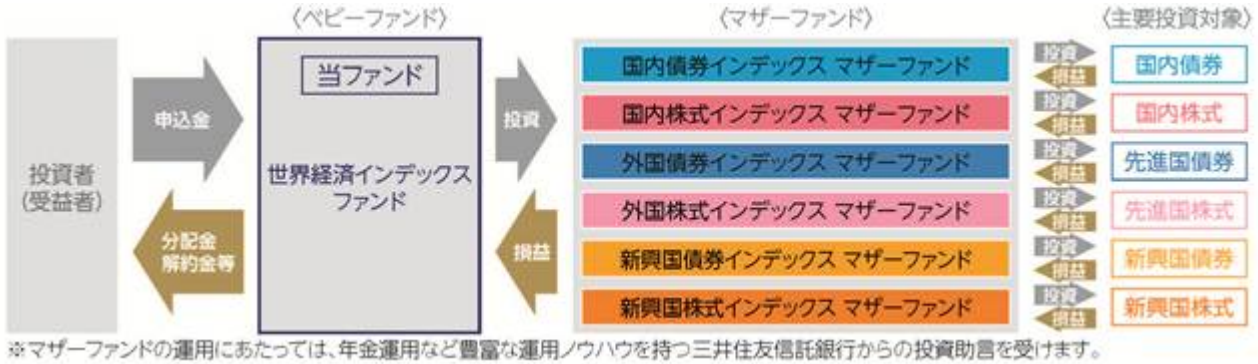
平成24年 4月 1日　当ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「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

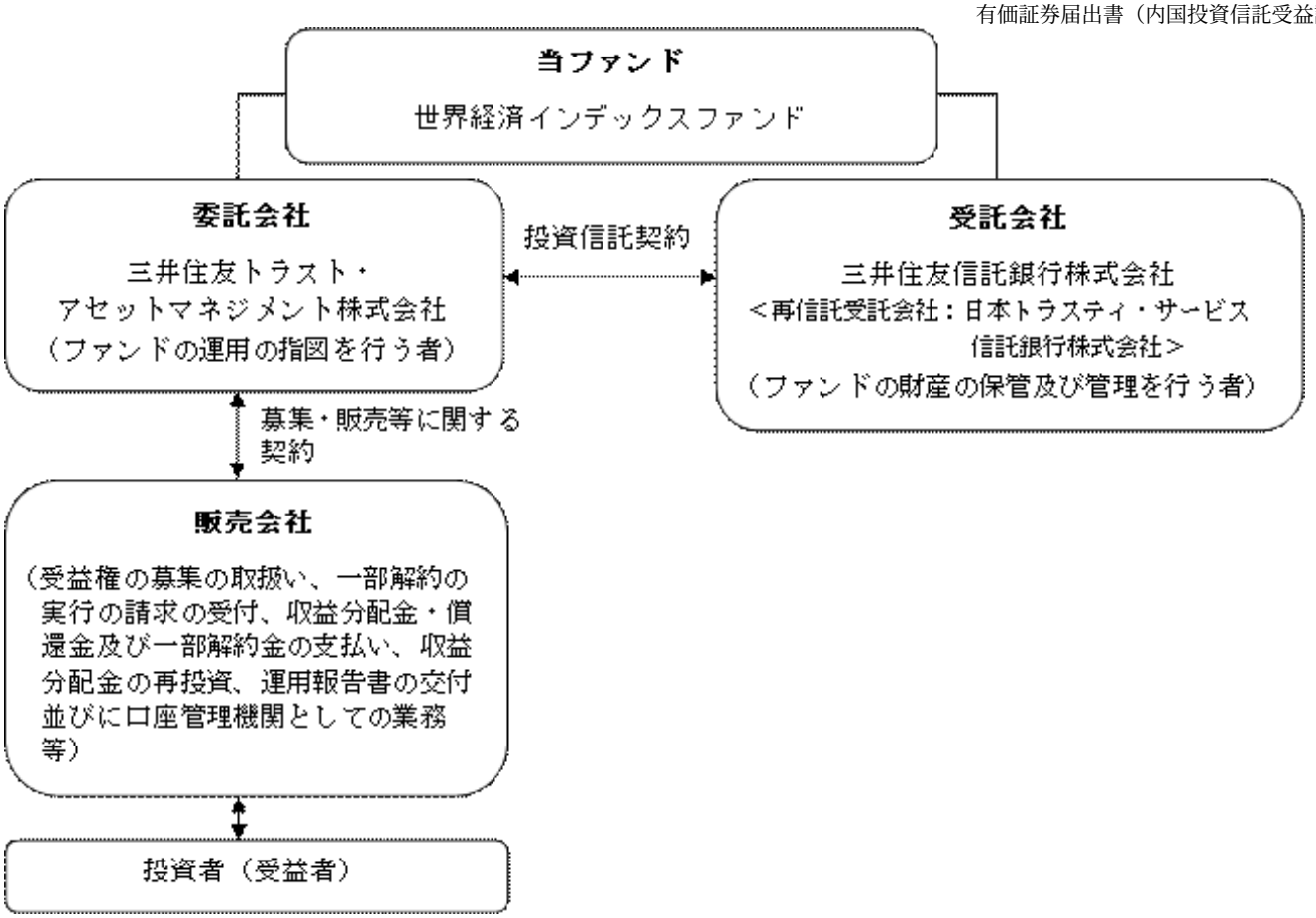
ファミリーファンド方式（※）で運用します。

※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26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26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

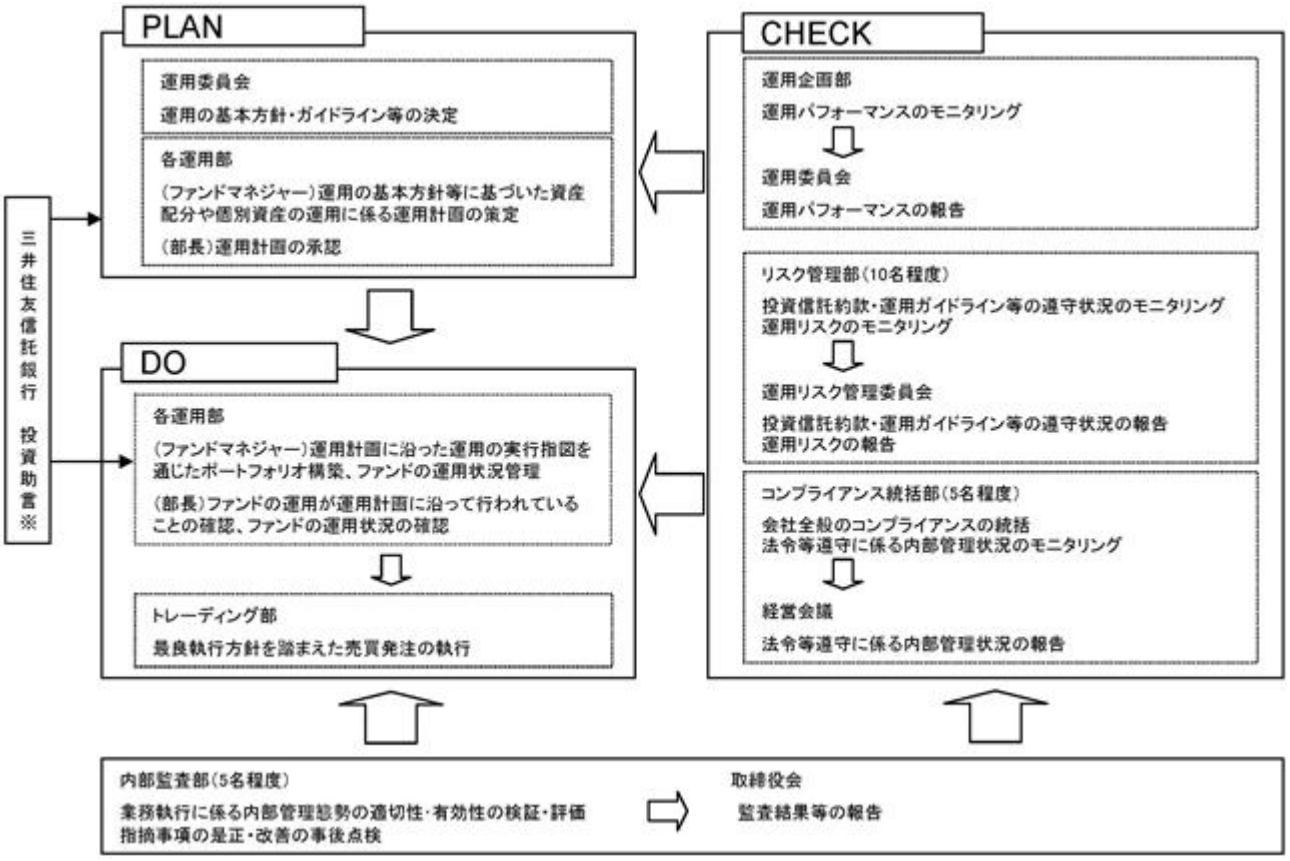
①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

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26年4月18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経営会議に報告します。

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、3.24%（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　0.54%（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　0.216%	（税抜　0.2%）
販売会社	年率　0.27%	（税抜　0.25%）
受託会社	年率　0.054%	（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26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

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

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。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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

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

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

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26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】

以下の記載は、平成26年2月28日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,901,062,067	97.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		105,579,462	2.11
合計(純資産総額)		5,006,641,529	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

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	893,169,673	1.6467	1,470,854,204	1.6423	1,466,852,553	29.30
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	558,090,937	2.4653	1,375,883,452	2.4690	1,377,926,523	27.52
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	381,125,531	2.1643	824,871,825	2.1215	808,557,814	16.15
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	500,556,945	1.6067	804,278,465	1.5804	791,080,195	15.80
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	276,234,193	1.0556	291,596,191	0.9929	274,272,930	5.48
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	141,560,236	1.2817	181,444,750	1.2883	182,372,052	3.64

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、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	97.89
合計	97.89

(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
第5期計算期間末 (平成26年 1月20日)	4,684,090,831	4,689,249,062	18,162	18,182

平成25年 2月末日	2,952,032,238	―	15,660	―
3月末日	3,173,336,078	―	15,976	―
4月末日	3,446,262,686	―	16,970	―
5月末日	3,660,926,771	―	17,288	―
6月末日	3,456,573,545	―	16,223	―
7月末日	3,638,257,207	―	16,526	―
8月末日	3,736,803,412	―	16,243	―
9月末日	3,996,431,883	―	16,862	―
10月末日	4,258,346,786	―	17,496	―
11月末日	4,469,503,491	―	18,000	―
12月末日	4,413,634,894	―	18,497	―
平成26年 1月末日	4,747,392,390	―	17,614	―
2月末日	5,006,641,529	―	17,943	―

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
第5期計算期間(平成25年 1月22日～平成26年 1月20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
第5期計算期間(平成25年 1月22日～平成26年 1月20日)	19.0

(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
第5期計算期間 (平成25年 1月22日～平成26年 1月20日)	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686

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

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	193,697,191,400	78.07
	ポーランド	200,438,000	0.08
	小計	193,897,629,400	78.15
地方債証券	日本	15,592,732,899	6.28
特殊債券	日本	21,588,249,393	8.70
	アメリカ	209,106,000	0.08
	韓国	201,072,000	0.08
	スウェーデン	101,100,000	0.04
	小計	22,099,527,393	8.91
社債券	日本	13,821,050,730	5.57
	オーストラリア	406,721,000	0.16
	オランダ	405,958,000	0.16
	アメリカ	207,325,000	0.08
	スウェーデン	102,762,000	0.04
	イギリス	101,256,000	0.04
	小計	15,045,072,730	6.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,459,725,014	0.59
合計(純資産総額)		248,094,687,436	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

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率	償還期限	投資比率
				単価	金額	単価	金額	(%)		(%)
日本	国債証券	第１１３回利付国債（５年）	3,880,000,000	100.37	3,894,591,100	100.64	3,904,832,000	0.3	2018/06/20	1.57
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	3,030,000,000	99.66	3,019,920,400	100.18	3,035,605,500	0.6	2023/12/20	1.22
日本	国債証券	第１０５回利付国債（５年）	2,810,000,000	99.96	2,809,054,800	100.29	2,818,289,500	0.2	2017/06/20	1.14
日本	国債証券	第１１６回利付国債（５年）	2,800,000,000	100.00	2,800,037,400	100.11	2,803,304,000	0.2	2018/12/20	1.13
日本	国債証券	第３２８回利付国債（１０年）	2,640,000,000	97.67	2,578,603,100	100.69	2,658,242,400	0.6	2023/03/20	1.07
日本	国債証券	第９７回利付国債（５年）	2,590,000,000	100.71	2,608,540,800	100.73	2,608,984,700	0.4	2016/06/20	1.05
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	2,430,000,000	105.16	2,555,462,700	105.19	2,556,262,800	1.5	2017/12/20	1.03
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	2,340,000,000	100.64	2,355,179,000	102.34	2,394,896,400	0.8	2023/06/20	0.97
日本	国債証券	第３２７回利付国債（１０年）	2,260,000,000	98.94	2,236,044,000	102.57	2,318,104,600	0.8	2022/12/20	0.93
日本	国債証券	第１０２回利付国債（５年）	2,280,000,000	100.18	2,284,289,000	100.58	2,293,338,000	0.3	2016/12/20	0.92
日本	国債証券	第３３０回利付国債（１０年）	2,240,000,000	101.59	2,275,648,700	102.22	2,289,750,400	0.8	2023/09/20	0.92
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,170,000,000	99.33	2,155,537,000	102.71	2,228,828,700	0.8	2022/09/20	0.90

日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	106.07	2,227,554,000	1.5	2018/09/20	0.90
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	105.60	2,207,040,000	1.7	2017/09/20	0.89
日本	国債証券	第１０３回利付国債（５年）	2,090,000,000	100.28	2,095,882,500	100.60	2,102,665,400	0.3	2017/03/20	0.85
日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	1,990,000,000	105.26	2,094,674,000	104.88	2,087,251,300	1.7	2017/03/20	0.84
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	1,960,000,000	105.25	2,062,980,300	106.30	2,083,538,800	1.3	2019/12/20	0.84
日本	国債証券	第２７０回利付国債（１０年）	2,000,000,000	102.26	2,045,245,400	101.59	2,031,840,000	1.3	2015/06/20	0.82
日本	国債証券	第１１５回利付国債（５年）	1,960,000,000	100.03	1,960,664,700	100.15	1,963,077,200	0.2	2018/09/20	0.79
日本	国債証券	第９９回利付国債（５年）	1,900,000,000	100.50	1,909,606,000	100.80	1,915,200,000	0.4	2016/09/20	0.77
日本	国債証券	第１０６回利付国債（５年）	1,880,000,000	99.27	1,866,276,000	100.28	1,885,301,600	0.2	2017/09/20	0.76
日本	国債証券	第２９８回利付国債（１０年）	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.37	1,749,258,200	1.3	2018/12/20	0.71
日本	国債証券	第３１０回利付国債（１０年）	1,610,000,000	102.61	1,652,092,000	104.69	1,685,605,600	1.0	2020/09/20	0.68
日本	国債証券	第３１８回利付国債（１０年）	1,610,000,000	101.29	1,630,916,700	104.51	1,682,611,000	1.0	2021/09/20	0.68
日本	国債証券	第３０３回利付国債（１０年）	1,530,000,000	106.37	1,627,497,500	106.64	1,631,622,600	1.4	2019/09/20	0.66
日本	国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	1,510,000,000	104.67	1,580,627,800	106.67	1,610,822,700	1.3	2021/03/20	0.65
日本	国債証券	第３２１回利付国債（１０年）	1,520,000,000	102.35	1,555,868,000	104.47	1,587,974,400	1.0	2022/03/20	0.64
日本	国債証券	第１１１回利付国債（５年）	1,570,000,000	100.21	1,573,297,000	101.04	1,586,406,500	0.4	2018/03/20	0.64
日本	国債証券	第１４７回利付国債（２０年）	1,520,000,000	101.68	1,545,536,900	102.54	1,558,653,600	1.6	2033/12/20	0.63
日本	国債証券	第９６回利付国債（５年）	1,470,000,000	100.87	1,482,790,800	100.86	1,482,744,900	0.5	2016/03/20	0.60

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	78.15
地方債証券	6.28
特殊債券	8.91
社債券	6.06
合計	99.41

(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	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	2	290,360,630	290,340,000	290,340,000	0.12

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

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	138,821,900,770	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,233,030,564	0.88
合計(純資産総額)		140,054,931,334	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

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	1,122,400	6,195.41	6,953,731,596	5,839.00	6,553,693,600	4.68
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,029,400	613.06	3,696,438,944	587.00	3,539,257,800	2.53
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	390,900	5,371.29	2,099,639,754	7,668.00	2,997,421,200	2.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	602,000	4,205.47	2,531,693,870	4,540.00	2,733,080,000	1.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	725,800	3,991.22	2,896,829,048	3,647.00	2,646,992,600	1.89
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,313,700	201.05	2,073,572,176	209.00	2,155,563,300	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	312,800	5,203.18	1,627,555,613	5,701.00	1,783,272,800	1.27
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	500,800	3,603.12	1,804,443,236	3,232.00	1,618,585,600	1.16
日本	株式	ファナック	電気機器	90,000	15,284.95	1,375,645,672	17,655.00	1,588,950,000	1.13
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,937,000	702.08	1,359,935,430	803.00	1,555,411,000	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	316,400	4,678.53	1,480,289,739	4,872.00	1,541,500,800	1.10
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	247,100	4,867.07	1,202,653,062	6,201.00	1,532,267,100	1.09
日本	株式	キヤノン	電気機器	467,600	3,644.46	1,704,149,883	3,162.00	1,478,551,200	1.06
日本	株式	三菱地所	不動産業	557,000	2,647.45	1,474,634,400	2,403.00	1,338,471,000	0.96
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	194,500	5,437.47	1,057,589,740	6,594.00	1,282,533,000	0.92
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	333,000	3,680.55	1,225,624,311	3,813.00	1,269,729,000	0.91
日本	株式	三菱商事	卸売業	621,100	1,849.69	1,148,847,720	1,947.00	1,209,281,700	0.86
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	148,400	7,705.43	1,143,486,517	7,942.00	1,178,592,800	0.84
日本	株式	パナソニック	電気機器	921,400	843.03	776,768,898	1,276.00	1,175,706,400	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	732,900	1,372.35	1,005,797,004	1,564.00	1,146,255,600	0.82
日本	株式	三井不動産	不動産業	375,000	2,984.42	1,119,160,120	3,027.00	1,135,125,000	0.81
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,628,300	836.51	1,362,102,156	687.00	1,118,642,100	0.80
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	655,800	1,521.45	997,769,161	1,701.00	1,115,515,800	0.80

日本	株式	デンソー	輸送用機器	199,200	4,485.12	893,436,832	5,440.00	1,083,648,000	0.77
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,570,000	275.00	981,752,000	297.00	1,060,290,000	0.76
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,132,000	1,117.15	1,264,615,615	911.00	1,031,252,000	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	807,000	1,047.49	845,325,240	1,205.00	972,435,000	0.69
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	264,700	3,471.39	918,878,036	3,667.00	970,654,900	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	308,300	3,147.21	970,287,468	3,012.00	928,599,600	0.66
日本	株式	三菱重工業	機械	1,436,000	663.05	952,151,600	625.00	897,500,000	0.64

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	99.12
合計	99.12

(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	0.07
		鉱業	0.47
		建設業	2.53
		食料品	3.85
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.30
		化学	5.34
		医薬品	4.66
		石油・石炭製品	0.60
		ゴム製品	0.92
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.63
		非鉄金属	1.02
		金属製品	0.71
		機械	5.21
		電気機器	12.57
		輸送用機器	11.62
		精密機器	1.41
		その他製品	1.43
		電気・ガス業	2.23
		陸運業	3.73
		海運業	0.38
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	7.31
		卸売業	4.64
		小売業	4.04
		銀行業	9.29
		証券、商品先物取引業	1.68
		保険業	2.15

		その他金融業	1.28
		不動産業	3.20
		サービス業	2.42
合計			99.12

(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	102	1,272,458,400	1,235,220,000	1,235,220,000	0.88

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	84,246,912,453	37.99
	イタリア	22,789,953,401	10.28
	フランス	22,397,100,553	10.10
	ドイツ	19,313,002,603	8.71
	イギリス	17,112,916,227	7.72
	スペイン	12,329,677,121	5.56
	ベルギー	6,182,143,592	2.79
	オランダ	5,953,708,836	2.68
	カナダ	5,079,202,792	2.29
	オーストリア	3,792,424,216	1.71
	オーストラリア	3,314,146,877	1.49
	メキシコ	2,182,620,797	0.98
	アイルランド	1,899,279,079	0.86
	ポーランド	1,886,290,267	0.85
	デンマーク	1,763,748,123	0.80
	フィンランド	1,448,435,342	0.65
	スウェーデン	1,231,597,537	0.56
	マレーシア	1,144,041,440	0.52
	南アフリカ	1,014,659,840	0.46
	スイス	828,006,767	0.37
	シンガポール	766,525,604	0.35
	ノルウェー	735,654,314	0.33
	小計	217,412,047,781	98.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,345,502,230	1.96
合計(純資産総額)		221,757,550,011	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

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 0.375% 06/30/15	34,400,000	10,198.07	3,508,138,694	10,223.06	3,516,735,667	0.375	2015/06/30	1.59
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,442.73	2,903,079,940	10,392.50	2,889,116,193	1.375	2015/11/30	1.30
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	10,202.96	2,060,998,743	10,223.06	2,065,059,897	0.375	2015/06/15	0.93
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	10,169.31	1,972,846,422	10,162.94	1,971,610,399	0.750	2017/06/30	0.89
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	10,127.30	1,822,914,173	10,170.50	1,830,691,078	0.250	2016/04/15	0.83
アメリカ	国債証券	T 0.25% 10/15/15	15,900,000	10,175.28	1,617,870,473	10,196.38	1,621,225,892	0.250	2015/10/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,508.77	1,576,316,941	10,422.17	1,563,325,554	1.750	2015/07/31	0.70
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	10,178.86	1,425,041,566	10,205.74	1,428,804,573	0.250	2015/07/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,525.90	1,378,893,195	10,426.94	1,365,930,292	1.875	2015/06/30	0.62
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	10,205.21	1,357,293,382	10,236.20	1,361,415,873	0.625	2016/07/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	11,072.83	1,384,104,290	10,799.46	1,349,933,479	4.250	2015/08/15	0.61
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000	14,870.51	1,308,605,584	14,565.16	1,281,734,454	3.250	2015/07/04	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/15/17	12,000,000	10,216.32	1,225,958,983	10,227.84	1,227,341,668	0.750	2017/01/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	12,500,000	10,050.50	1,256,312,657	9,770.90	1,221,363,642	2.000	2023/02/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	10,210.32	1,174,187,524	10,222.07	1,175,538,435	0.375	2015/04/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,685.46	1,145,176,036	11,394.38	1,116,649,568	4.500	2017/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,618.68	1,093,724,417	10,526.49	1,084,229,461	2.000	2016/01/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.25% 02/29/20	11,000,000	10,011.92	1,101,311,980	9,850.35	1,083,538,574	1.250	2020/02/29	0.49
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000	16,512.10	1,089,799,009	16,329.08	1,077,719,857	4.250	2019/04/25	0.49
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000	14,939.88	1,030,851,760	15,476.82	1,067,900,812	4.500	2018/08/01	0.48
アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	11,061.08	1,050,803,289	10,888.86	1,034,442,120	3.000	2017/02/28	0.47
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,000,000	14,865.20	1,040,564,525	14,511.15	1,015,780,561	3.500	2015/04/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	10,100,000	10,087.98	1,018,886,222	10,043.47	1,014,391,405	0.750	2018/02/28	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/31/17	10,000,000	10,107.58	1,010,758,994	10,075.93	1,007,593,278	0.750	2017/12/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	9,500,000	10,607.87	1,007,748,258	10,455.02	993,227,104	2.500	2015/03/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/31/19	10,000,000	9,941.51	994,151,093	9,816.90	981,690,160	1.125	2019/12/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	10,200,000	9,521.47	971,190,097	9,513.66	970,394,336	1.750	2023/05/15	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	5,400,000	17,027.77	919,499,798	17,899.24	966,559,493	6.500	2027/11/01	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/18	9,400,000	9,978.70	937,998,055	10,118.93	951,180,239	1.250	2018/11/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 3% 08/31/16	8,700,000	10,992.19	956,321,238	10,831.92	942,377,166	3.000	2016/08/31	0.42

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.04
合計	98.04

(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	20	2,392,986.34	2,399,531.20	244,608,210	0.11
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	11	1,366,434.64	1,372,250	139,887,165	0.06
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	789,742.75	798,750	81,424,575	0.04
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	14	1,548,786	1,548,610	216,418,247	0.10
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	13	1,649,312	1,652,950	230,999,762	0.10
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	19	2,741,006	2,756,330	385,197,117	0.17

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

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	88,715,580,069	53.27
	イギリス	15,001,272,579	9.01
	スイス	7,302,180,310	4.38
	カナダ	7,112,724,159	4.27
	フランス	6,798,339,623	4.08
	ドイツ	6,772,003,658	4.07
	オーストラリア	5,016,604,082	3.01
	オランダ	2,700,847,490	1.62
	スペイン	2,457,881,955	1.48
	スウェーデン	2,332,492,721	1.40
	香港	1,634,042,951	0.98
	イタリア	1,622,297,241	0.97
	アイルランド	1,476,871,011	0.89
	シンガポール	994,352,355	0.60
	デンマーク	993,207,779	0.60
	ジャージー	919,690,344	0.55
	ベルギー	870,655,815	0.52
	キュラソー	664,335,640	0.40
	フィンランド	655,834,532	0.39
	バミューダ	596,413,577	0.36
	ノルウェー	475,378,462	0.29
	イスラエル	356,297,313	0.21
	ルクセンブルク	279,323,000	0.17
	オーストリア	216,189,587	0.13
	ケイマン	214,321,661	0.13

	ポルトガル	130,517,763	0.08
	英ヴァージン諸島	106,281,861	0.06
	ニュージーランド	89,482,475	0.05
	パナマ	82,444,719	0.05
	ガーンジー	47,518,296	0.03
	リベリア	42,684,516	0.03
	マン島	34,175,186	0.02
	モーリシャス	20,214,298	0.01
	小計	156,732,457,028	94.11
投資信託受益証券	オーストラリア	76,252,465	0.05
	シンガポール	14,157,427	0.01
	香港	14,058,486	0.01
	小計	104,468,378	0.06
投資証券	アメリカ	2,145,107,456	1.29
	オーストラリア	368,086,979	0.22
	イギリス	221,913,558	0.13
	フランス	217,195,600	0.13
	香港	58,719,375	0.04
	シンガポール	54,927,356	0.03
	カナダ	33,316,937	0.02
	オランダ	16,056,989	0.01
	小計	3,115,324,250	1.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,585,657,339	3.95
合計(純資産総額)		166,537,906,995	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

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	48,051	45,000.39	2,162,313,912	53,790.67	2,584,695,955	1.55
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	233,280	9,418.46	2,197,138,647	9,769.92	2,279,129,177	1.37
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,798	90,569.57	1,340,248,538	124,286.26	1,839,188,184	1.10
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	424,135	3,572.39	1,515,177,775	3,859.44	1,636,927,147	0.98
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	540,418	2,406.57	1,300,558,160	2,599.46	1,404,800,378	0.84
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	150,704	8,935.37	1,346,596,204	9,313.23	1,403,542,279	0.84
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	172,191	7,518.35	1,294,593,699	7,631.53	1,314,082,504	0.79
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	266,387	4,130.60	1,100,340,486	4,694.33	1,250,510,350	0.75
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	102,737	12,880.29	1,323,283,185	11,793.43	1,211,622,501	0.73
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	37,516	29,012.63	1,088,438,197	31,295.05	1,174,065,170	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	200,821	5,568.44	1,118,261,453	5,778.97	1,160,540,261	0.70

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	145,214	8,241.71	1,196,812,963	7,970.68	1,157,455,574	0.70
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	346,244	2,952.18	1,022,175,442	3,285.52	1,137,593,733	0.68
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,021,027	1,260.05	1,286,551,297	1,081.92	1,104,669,796	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	219,643	4,944.20	1,085,959,496	4,842.14	1,063,544,352	0.64
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	54,998	21,181.09	1,164,917,763	18,886.42	1,038,715,536	0.62
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	122,835	8,198.31	1,007,040,208	8,423.38	1,034,686,373	0.62
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	567,156	1,360.89	771,842,033	1,680.99	953,383,904	0.57
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	285,444	3,685.29	1,051,945,048	3,285.52	937,833,740	0.56
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	156,135	4,863.45	759,356,181	5,775.92	901,823,331	0.54
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	991,994	820.07	813,509,281	856.31	849,458,964	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	212,394	4,333.47	920,403,620	3,880.85	824,270,486	0.49
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	162,091	5,276.15	855,216,509	4,963.45	804,531,967	0.48
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	195,122	3,542.71	691,262,310	3,970.56	774,744,193	0.47
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	206,698	3,832.90	792,252,813	3,712.45	767,356,982	0.46
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	114,673	5,614.29	643,807,547	6,476.01	742,624,068	0.45
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	258,635	3,031.89	784,154,111	2,866.00	741,250,055	0.45
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア	89,546	6,798.37	608,767,610	8,204.13	734,647,132	0.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	19,586	27,387.35	536,408,713	36,711.65	719,034,419	0.43
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	85,421	9,517.11	812,961,770	8,234.71	703,417,436	0.42

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	94.11
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.87
合計	96.05

(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	9.65
		素材	5.53
		資本財	7.39
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	1.77

		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.69
		メディア	2.91
		小売	3.04
		食品・生活必需品小売り	2.13
		食品・飲料・タバコ	5.76
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	2.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.10
		銀行	7.63
		各種金融	5.65
		保険	4.08
		不動産	0.62
		ソフトウェア・サービス	6.77
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.69
		電気通信サービス	3.28
		公益事業	3.09
		半導体・半導体製造装置	1.46
合計			94.11

(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	73	32,877,778.50	33,833,675	3,449,004,829	2.07
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	21	3,295,676.50	3,424,680	313,769,181	0.19
	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	33	2,688,891	2,784,540	319,553,810	0.19
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	146	4,427,577	4,584,400	640,669,900	0.38
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	28	3,609,121	3,777,200	345,236,080	0.21
	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	57	3,733,688.75	3,870,585	658,541,331	0.40

(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

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	ブラジル	2,890,228,293	10.11
	南アフリカ	2,863,264,608	10.01
	マレーシア	2,852,809,689	9.98
	ポーランド	2,835,739,815	9.92

	メキシコ	2,830,679,358	9.90
	ロシア	2,821,688,036	9.87
	トルコ	2,638,724,203	9.23
	タイ	2,389,120,312	8.35
	インドネシア	2,239,317,437	7.83
	ハンガリー	1,545,981,292	5.41
	コロンビア	916,254,509	3.20
	ナイジェリア	537,593,857	1.88
	ペルー	495,579,360	1.73
	フィリピン	144,626,430	0.51
	チリ	36,440,298	0.13
	小計	28,038,047,497	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		559,037,493	1.95
合計(純資産総額)		28,597,084,990	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

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	(%)		(%)
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	270,000,000	292.71	790,327,732	283.15	764,527,896	7.850	2018/03/10	2.67
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	267,000,000	288.88	771,330,208	276.18	737,411,133	7.600	2021/04/14	2.58
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	248,100,000	286.77	711,485,810	285.73	708,901,997	7.000	2015/06/03	2.48
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	217,500,000	291.65	634,360,178	280.84	610,847,010	8.150	2027/02/03	2.14
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	51,200,000	1,112.21	569,453,241	1,093.97	560,113,541	10.500	2026/12/21	1.96
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	9,490,000,000	5.61	532,825,516	5.53	524,818,485	12.000	2015/10/22	1.84
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000	3,455.70	483,799,348	3,467.58	485,461,847	0.000	2016/01/01	1.70
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	148,500,000	313.87	466,098,623	317.84	471,997,983	3.250	2017/06/16	1.65
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000	4,068.05	496,302,638	3,775.32	460,589,506	7.100	2023/03/08	1.61
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	4,634.63	440,290,553	4,585.31	435,604,902	12.500	2016/01/05	1.52
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,164.83	395,659,353	4,200.79	399,075,613	10.000	2017/01/01	1.40
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,788.55	388,326,450	3,798.36	389,332,414	0.000	2015/04/01	1.36
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	37,900,000	937.75	355,408,922	908.66	344,384,019	7.250	2020/01/15	1.20
タイ	国債証券	THAIGB 3.875% 06/13/19	104,500,000	317.22	331,505,015	322.35	336,866,158	3.875	2019/06/13	1.18
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	33,600,000	984.34	330,740,041	950.92	319,512,144	8.000	2018/12/21	1.12
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 06/16/23	102,500,000	304.24	311,848,846	310.96	318,741,462	3.625	2023/06/16	1.11
インドネシア	国債証券	INDOGB 6.625% 05/15/33	45,500,000,000	0.69	315,830,020	0.69	314,063,750	6.625	2033/05/15	1.10
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	9,000,000	3,492.43	314,319,577	3,464.06	311,765,855	5.500	2015/04/25	1.09
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,510.21	310,653,726	3,492.76	309,109,968	4.750	2016/10/25	1.08
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	47.82	322,786,498	45.71	308,559,597	7.000	2019/10/23	1.08

トルコ	国債証券	TURKGB 8.3% 06/20/18	7,000,000	4,302.16	301,151,363	4,268.80	298,816,404	8.300	2018/06/20	1.04
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	9,550,000	3,114.00	297,387,606	3,105.72	296,596,914	3.172	2016/07/15	1.04
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	3,092.76	296,905,875	3,086.46	296,301,097	3.314	2017/10/31	1.04
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	30,000,000	992.76	297,828,636	966.35	289,906,848	8.250	2017/09/15	1.01
トルコ	国債証券	TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000	4,992.83	309,555,463	4,639.55	287,652,211	10.500	2020/01/15	1.01
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,717.14	280,644,701	3,699.15	279,285,840	5.750	2022/09/23	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 6.25% 06/16/16	33,200,000	807.20	267,991,307	805.25	267,343,610	6.250	2016/06/16	0.93
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	28,900,000	905.02	261,553,321	901.52	260,539,337	8.750	2048/02/28	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000	1,072.16	257,319,888	1,038.98	249,356,217	13.500	2015/09/15	0.87
ポーランド	国債証券	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000	3,392.50	247,653,184	3,383.41	246,989,504	3.750	2018/04/25	0.86

(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	98.05
合計	98.05

(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

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	韓国	3,457,175,976	15.66
	台湾	2,509,458,904	11.36
	ブラジル	2,165,974,101	9.81
	中国	2,151,793,892	9.74
	南アフリカ	1,591,267,374	7.21
	インド	1,359,621,050	6.16
	ロシア	1,172,934,358	5.31
	メキシコ	1,035,934,532	4.69
	ケイマン	1,019,434,208	4.62
	香港	888,163,369	4.02
	マレーシア	831,125,895	3.76
	インドネシア	547,729,423	2.48
	タイ	472,910,852	2.14
	ポーランド	391,054,394	1.77
	チリ	337,579,449	1.53
	トルコ	289,705,703	1.31

	フィリピン	213,001,155	0.96
	バミューダ	209,130,817	0.95
	コロンビア	187,392,960	0.85
	ギリシャ	103,982,095	0.47
	チェコ	64,666,018	0.29
	ハンガリー	49,943,026	0.23
	エジプト	48,026,406	0.22
	ペルー	21,624,827	0.10
	アメリカ	20,091,762	0.09
	ルクセンブルク	3,530,155	0.02
	小計	21,143,252,701	95.75
投資信託受益証券	ブラジル	41,158,019	0.19
	南アフリカ	14,371,926	0.07
	メキシコ	9,618,124	0.04
	小計	65,148,069	0.30
投資証券	メキシコ	23,373,250	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		849,349,160	3.85
合計(純資産総額)		22,081,123,180	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

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	6,265	134,751.76	844,219,835	128,736.00	806,531,040	3.65
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,393,389	357.33	497,909,647	363.95	507,137,860	2.30
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	57,800	5,373.04	310,562,230	8,100.81	468,226,818	2.12
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	340,000	1,054.91	358,671,242	971.70	330,379,020	1.50
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	4,024,620	77.26	310,981,463	70.43	283,455,596	1.28
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	22,262	8,898.81	198,105,316	12,471.19	277,633,854	1.26
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	334,857	915.09	306,424,856	791.56	265,060,779	1.20
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,119,515	68.36	281,617,640	61.49	253,330,398	1.15
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,858	23,763.09	210,493,536	23,376.00	207,064,608	0.94
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,994,940	106.07	211,610,275	100.83	201,166,557	0.91
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	142,590	1,408.98	200,906,892	1,381.03	196,921,666	0.89
ブラジル	株式	AMBEV SA	食品・飲料・タバコ	264,200	761.54	201,199,578	742.14	196,075,131	0.89

中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,222,200	46.39	195,875,910	43.23	182,528,239	0.83
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	95,780	1,893.02	181,313,886	1,884.95	180,541,468	0.82
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	628,352	250.99	157,713,040	283.07	177,873,884	0.81
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	29,984	6,411.07	192,229,626	5,641.35	169,150,526	0.77
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	1,004,000	198.77	199,568,979	167.66	168,337,065	0.76
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	26,279	5,619.76	147,681,820	6,320.44	166,095,105	0.75
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	160,100	1,265.97	202,682,540	1,032.65	165,327,617	0.75
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	31,091	4,842.51	150,558,600	5,185.73	161,229,668	0.73
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	122,300	1,340.89	163,991,974	1,205.27	147,405,034	0.67
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	237,540	848.51	201,556,911	616.91	146,542,606	0.66
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	107,615	1,436.14	154,550,530	1,287.88	138,595,356	0.63
中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,435,400	82.62	118,598,913	91.84	131,839,480	0.60
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,182,000	112.77	133,298,505	107.09	126,581,562	0.57
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	422,000	271.23	114,459,543	297.62	125,596,062	0.57
韓国	株式	NAVER CORP	ソフトウェア・サービス	1,593	54,535.16	86,874,521	76,032.00	121,118,976	0.55
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	78,804	1,437.82	113,306,315	1,499.64	118,178,418	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	半導体・半導体製造装置	1,147	94,368.53	108,240,708	99,264.00	113,855,808	0.52
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	30,000	3,118.60	93,558,195	3,792.00	113,760,000	0.52

(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	95.75
投資信託受益証券	0.30
投資証券	0.11
合計	96.15

(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	10.36
		素材	9.08
		資本財	4.77
		商業・専門サービス	0.14
		運輸	1.53
		自動車・自動車部品	3.71
		耐久消費財・アパレル	0.94
		消費者サービス	0.78
		メディア	1.93
		小売	1.62

		食品・生活必需品小売り	1.90
		食品・飲料・タバコ	5.00
		家庭用品・パーソナル用品	0.96
		ヘルスケア機器・サービス	0.57
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.13
		銀行	17.44
		各種金融	2.37
		保険	3.28
		不動産	1.78
		ソフトウェア・サービス	4.75
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.31
		電気通信サービス	6.74
		公益事業	3.26
		半導体・半導体製造装置	8.40
合計			95.75

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

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

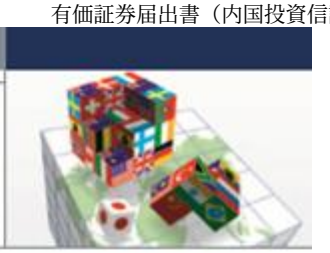
資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	187	8,813,924	9,022,750	919,779,135	4.17

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

(参考情報)交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2009年1月16日
作成基準日：2014年2月28日



基準価額・純資産の推移

基準価額	17,943円
純資産総額	50.07億円

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

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:40円

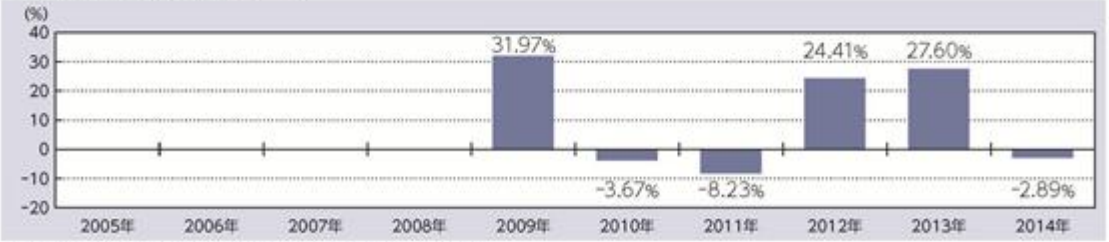
決算期	2010年1月	2011年1月	2012年1月	2013年1月	2014年1月
分配金	0円	0円	0円	20円	20円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	29.3%	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	27.5%	T 0.375% 06/30/15	アメリカ	国債証券	－	0.375%	2015/06/30	0.4%
		T 1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	－	1.375%	2015/11/30	0.4%
新興国株式インデックスマザーファンド	16.1%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.6%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	15.8%	RUSSIA 7.85% 03/10/18	ロシア	国債証券	－	7.850%	2018/03/10	0.4%
		RFLB 7.6% 04/14/21	ロシア	国債証券	－	7.600%	2021/04/14	0.4%
国内株式インデックスマザーファンド	5.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	－	－	0.3%
		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	3.6%	第113回利付国債(5年)	日本	国債証券	－	0.3%	2018/06/20	0.1%
		第332回利付国債(10年)	日本	国債証券	－	0.6%	2023/12/20	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、2014年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(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、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
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。

(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．からへ．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上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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5期計算期間(平成25年1月22日から平成26年1月20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】

項目	第4期 (平成25年 1月21日現在) 金額(円)	第5期 (平成26年 1月20日現在) 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,736,624	131,787,302
親投資信託受益証券	2,730,719,183	4,595,479,904
未収入金	17,110,000	―
未収利息	63	177
流動資産合計	2,789,565,870	4,727,267,383
資産合計	2,789,565,870	4,727,267,383
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,600,852	5,158,231
未払解約金	28,181,609	26,982,362
未払受託者報酬	617,640	1,084,172
未払委託者報酬	5,558,748	9,757,491
その他未払費用	112,731	194,296
流動負債合計	38,071,580	43,176,552
負債合計	38,071,580	43,176,552
純資産の部		
元本等		
元本	1,800,426,112	2,579,115,686
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	951,068,178	2,104,975,145
(分配準備積立金)	(450,050,332)	(727,369,230)
元本等合計	2,751,494,290	4,684,090,831
純資産合計	2,751,494,290	4,684,090,831
負債純資産合計	2,789,565,870	4,727,267,383

(2)【損益及び剰余金計算書】

項目	第4期 自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日 金額(円)	第5期 自 平成25年 1月22日 至 平成26年 1月20日 金額(円)
営業収益		
受取利息	11,575	39,218
有価証券売買等損益	583,219,760	639,700,721
営業収益合計	583,231,335	639,739,939
営業費用		
受託者報酬	1,128,523	1,944,134
委託者報酬	10,653,858	17,497,079
その他費用	112,731	194,296
営業費用合計	11,895,112	19,635,509
営業利益又は営業損失（△）	571,336,223	620,104,430
経常利益又は経常損失（△）	571,336,223	620,104,430
当期純利益又は当期純損失（△）	571,336,223	620,104,430
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（△）	57,738,692	157,556,492
期首剰余金又は期首欠損金（△）	289,507,546	951,068,178
剰余金増加額又は欠損金減少額	272,687,317	1,355,040,298
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	272,687,317	1,355,040,298
剰余金減少額又は欠損金増加額	121,123,364	658,523,038
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	121,123,364	658,523,038
分配金	3,600,852	5,158,231
期末剰余金又は期末欠損金（△）	951,068,178	2,104,975,145

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.　その他	ファンドの計算期間 第5期(自　平成25年 1月22日　至　平成26年 1月20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、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成25年 1月22日から平成26年 1月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (平成25年 1月21日現在)	第5期 (平成26年 1月20日現在)
1.　期首元本額	1,447,503,755円	1,800,426,112円
期中追加設定元本額	907,508,119円	1,918,803,387円
期中一部解約元本額	554,585,762円	1,140,113,813円
2.　当該計算期間の末日における受益権総数	1,800,426,112口	2,579,115,686口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5282円 (15,282円)	1.8162円 (18,162円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第4期 自 平成24年 1月21日 至 平成25年 1月21日	第5期 自 平成25年 1月22日 至 平成26年 1月20日
費用控除後の配当等収益額	A	68,203,789円 (69,772,109円)	110,826,942円 (115,494,954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	335,457,974円	351,720,996円
収益調整金額	C	501,017,846円	1,377,605,915円
分配準備積立金額	D	49,989,421円	269,979,523円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	954,669,030円	2,110,133,376円
当ファンドの期末残存口数	F	1,800,426,112口	2,579,115,686口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,302.46円	8,181.61円
1万口当たり分配金額	H	20円	20円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	3,600,852円	5,158,231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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	第4期 (平成25年 1月21日現在)	第5期 (平成26年 1月20日現在)
	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)	計算期間(自　平成25年 1月22日　至　平成26年 1月20日)の損益に含まれた評価差額(円)

親投資信託受益証券	562,406,451	585,399,412
合計	562,406,451	585,399,412

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

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	130,923,762	167,778,801	
	国内株式インデックス マザーファンド	259,152,041	274,649,333	
	外国債券インデックス マザーファンド	519,799,960	1,282,034,621	
	外国株式インデックス マザーファンド	834,174,449	1,377,055,180	
	新興国債券インデックス マザーファンド	452,270,975	728,653,767	
	新興国株式インデックス マザーファンド	352,368,066	765,308,202	
親投資信託受益証券 小計		2,548,689,253	4,595,479,904	
合計		2,548,689,253	4,595,479,904	

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26年1月20日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	959,973,594
国債証券	189,597,437,650
地方債証券	15,327,380,850
特殊債券	21,856,590,275
社債券	15,020,181,100
派生商品評価勘定	1,979,055
未収入金	8,273,476,590
未収利息	676,826,537
前払費用	29,636,114
流動資産合計	251,743,481,765
資産合計	251,743,481,765
負債の部	
流動負債	
前受金	1,680,000
未払解約金	8,459,923,078
流動負債合計	8,461,603,078
負債合計	8,461,603,078
純資産の部	
元本等	
元本	189,844,804,670
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	53,437,074,017
元本等合計	243,281,878,687
純資産合計	243,281,878,687
負債純資産合計	251,743,481,765

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20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発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又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.　収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 1月20日現在
1.　計算期間の期首元本額	180,543,384,070円
計算期間中の追加設定元本額	85,256,391,202円
計算期間中の一部解約元本額	75,954,970,602円
計算日の元本額	189,844,804,670円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	3,779,674円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	972,643,096円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,291,255円
SMT 国内債券インデックス・オープン	3,582,946,606円
世界経済インデックスファンド	130,923,762円
マイセレクション25	152,894,045円
マイセレクション50	94,860,649円
マイセレクション75	29,700,429円
DCマイセレクション25	11,161,729,050円
DCマイセレクション50	14,139,881,137円
DCマイセレクション75	3,959,620,763円
DC日本債券インデックス・オープン	388,222,833円
DC日本債券インデックス・オープンS	45,366,879,300円
DC日本債券インデックス・オープンP	15,210,287,772円
DCマイセレクションS25	3,997,799,604円
DCマイセレクションS50	4,714,265,984円
DCマイセレクションS75	917,714,113円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	37,747,158円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	849,875,797円

DCターゲット・イヤー ファンド2035	427,031,129円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	98,141,172円
DC世界経済インデックスファンド	107,024,833円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	851,852,908円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	48,768,268円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	325,268,356円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	47,037,635円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,464,232円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,680,567,840円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,480,392,863円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5,855,006,429円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	667,361,606円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	17,021,481,855円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,913,461,881円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,889,061,215円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,120,248,307円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,743,589,272円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,514,106,947円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,445,854,698円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,782,096,185円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,730,678,030円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	281,993,352円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,118,054,259円
日本債券ファンド・シリーズ1	5,354,808,411円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,130,502,580円
コア投資戦略ファンド(成長型)	793,576,975円
分散投資コア戦略ファンドA	78,368,976円
分散投資コア戦略ファンドS	63,668,240円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	13,512,898,054円
コア投資戦略ファンド(切替型)	20,328,110円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	5,234,195円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,734,990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 105,591,000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	189,844,804,670口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2815円 (12,815円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,599,868,700
地方債証券	215,495,287
特殊債券	293,036,351
社債券	92,083,730
合計	3,200,484,068

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成26年1月20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26年 1月20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	430,920,945	―	432,900,000	1,979,055
合計		430,920,945	―	432,900,000	1,979,055

(注)1. 時価の算定方法
債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。
2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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３２６回利付国債（２年）	730,000,000	730,160,600	
	第３２７回利付国債（２年）	1,210,000,000	1,210,290,400	
	第３２８回利付国債（２年）	1,270,000,000	1,270,330,200	
	第３２９回利付国債（２年）	770,000,000	771,232,000	
	第３３０回利付国債（２年）	670,000,000	671,132,300	
	第３３１回利付国債（２年）	790,000,000	790,181,700	
	第３３２回利付国債（２年）	1,920,000,000	1,920,460,800	
	第３３３回利付国債（２年）	1,420,000,000	1,420,355,000	
	第３３４回利付国債（２年）	910,000,000	910,245,700	
	第３３５回利付国債（２年）	1,390,000,000	1,390,389,200	
	第８８回利付国債（５年）	2,570,000,000	2,582,310,300	
	第８９回利付国債（５年）	1,610,000,000	1,617,132,300	
	第９０回利付国債（５年）	220,000,000	220,664,400	
	第９１回利付国債（５年）	200,000,000	201,044,000	
	第９２回利付国債（５年）	1,260,000,000	1,264,485,600	
	第９３回利付国債（５年）	1,110,000,000	1,118,780,100	
	第９４回利付国債（５年）	1,110,000,000	1,120,889,100	
	第９５回利付国債（５年）	620,000,000	626,733,200	
	第９６回利付国債（５年）	1,470,000,000	1,482,803,700	
	第９７回利付国債（５年）	2,590,000,000	2,608,648,000	
	第９９回利付国債（５年）	1,900,000,000	1,914,858,000	
	第１００回利付国債（５年）	390,000,000	392,016,300	
	第１０１回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,028,425,200	
	第１０２回利付国債（５年）	1,980,000,000	1,990,612,800	
	第１０３回利付国債（５年）	2,090,000,000	2,101,495,000	
	第１０４回利付国債（５年）	410,000,000	410,963,500	
	第１０５回利付国債（５年）	2,460,000,000	2,465,412,000	
	第１０６回利付国債（５年）	1,880,000,000	1,883,760,000	
	第１０７回利付国債（５年）	620,000,000	621,078,800	
	第１０８回利付国債（５年）	790,000,000	788,309,400	
	第１０９回利付国債（５年）	390,000,000	388,950,900	
	第１１０回利付国債（５年）	900,000,000	905,013,000	
	第１１１回利付国債（５年）	1,570,000,000	1,585,229,000	
	第１１２回利付国債（５年）	870,000,000	878,369,400	
	第１１３回利付国債（５年）	3,880,000,000	3,900,331,200	
	第１１４回利付国債（５年）	1,110,000,000	1,115,638,800	
	第１１５回利付国債（５年）	1,960,000,000	1,960,901,600	
	第１１６回利付国債（５年）	790,000,000	790,000,000	
	第１回利付国債（４０年）	150,000,000	177,090,000	
	第２回利付国債（４０年）	300,000,000	338,973,000	
	第３回利付国債（４０年）	340,000,000	384,084,400	
	第４回利付国債（４０年）	530,000,000	598,523,700	

第５回利付国債（４０年）	490,000,000	526,456,000	
第６回利付国債（４０年）	520,000,000	543,805,600	
第２６８回利付国債（１０年）	760,000,000	772,464,000	
第２６９回利付国債（１０年）	1,030,000,000	1,044,512,700	
第２７０回利付国債（１０年）	2,000,000,000	2,034,160,000	
第２７１回利付国債（１０年）	680,000,000	690,662,400	
第２７２回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,093,326,000	
第２７３回利付国債（１０年）	1,260,000,000	1,289,547,000	
第２７４回利付国債（１０年）	730,000,000	749,688,100	
第２７５回利付国債（１０年）	280,000,000	287,019,600	
第２７６回利付国債（１０年）	480,000,000	493,862,400	
第２７７回利付国債（１０年）	410,000,000	423,275,800	
第２７８回利付国債（１０年）	720,000,000	746,409,600	
第２７９回利付国債（１０年）	440,000,000	458,035,600	
第２８０回利付国債（１０年）	600,000,000	625,944,000	
第２８１回利付国債（１０年）	700,000,000	731,948,000	
第２８２回利付国債（１０年）	1,260,000,000	1,313,310,600	
第２８３回利付国債（１０年）	280,000,000	292,588,800	
第２８４回利付国債（１０年）	1,210,000,000	1,265,611,600	
第２８５回利付国債（１０年）	1,990,000,000	2,088,843,300	
第２８６回利付国債（１０年）	870,000,000	919,294,200	
第２８７回利付国債（１０年）	540,000,000	572,427,000	
第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	2,208,712,000	
第２８９回利付国債（１０年）	2,430,000,000	2,557,502,100	
第２９０回利付国債（１０年）	270,000,000	283,821,300	
第２９１回利付国債（１０年）	840,000,000	879,530,400	
第２９２回利付国債（１０年）	860,000,000	914,678,800	
第２９３回利付国債（１０年）	370,000,000	396,384,700	
第２９４回利付国債（１０年）	180,000,000	192,049,200	
第２９５回利付国債（１０年）	100,000,000	105,796,000	
第２９６回利付国債（１０年）	2,100,000,000	2,228,100,000	
第２９７回利付国債（１０年）	560,000,000	592,810,400	
第２９８回利付国債（１０年）	1,660,000,000	1,749,191,800	
第２９９回利付国債（１０年）	1,310,000,000	1,383,530,300	
第３００回利付国債（１０年）	830,000,000	885,062,200	
第３０１回利付国債（１０年）	1,240,000,000	1,324,828,400	
第３０２回利付国債（１０年）	200,000,000	212,612,000	
第３０３回利付国債（１０年）	1,830,000,000	1,949,078,100	
第３０４回利付国債（１０年）	300,000,000	317,847,000	
第３０５回利付国債（１０年）	1,900,000,000	2,014,988,000	
第３０６回利付国債（１０年）	740,000,000	790,157,200	
第３０７回利付国債（１０年）	600,000,000	637,032,000	
第３０８回利付国債（１０年）	600,000,000	637,518,000	

第３０９回利付国債（１０年）	1,360,000,000	1,427,496,800	
第３１０回利付国債（１０年）	1,710,000,000	1,783,495,800	
第３１１回利付国債（１０年）	160,000,000	164,792,000	
第３１２回利付国債（１０年）	1,470,000,000	1,552,187,700	(注)
第３１３回利付国債（１０年）	1,510,000,000	1,603,982,400	
第３１４回利付国債（１０年）	680,000,000	712,864,400	
第３１５回利付国債（１０年）	990,000,000	1,044,351,000	
第３１６回利付国債（１０年）	620,000,000	649,586,400	
第３１７回利付国債（１０年）	280,000,000	293,148,800	
第３１８回利付国債（１０年）	1,610,000,000	1,673,707,700	
第３１９回利付国債（１０年）	1,150,000,000	1,203,866,000	
第３２０回利付国債（１０年）	1,180,000,000	1,225,819,400	
第３２１回利付国債（１０年）	1,120,000,000	1,162,963,200	
第３２２回利付国債（１０年）	1,030,000,000	1,061,445,900	
第３２３回利付国債（１０年）	1,350,000,000	1,389,636,000	
第３２４回利付国債（１０年）	1,420,000,000	1,450,274,400	
第３２５回利付国債（１０年）	2,170,000,000	2,213,920,800	
第３２６回利付国債（１０年）	300,000,000	303,048,000	
第３２７回利付国債（１０年）	2,260,000,000	2,303,075,600	
第３２８回利付国債（１０年）	2,640,000,000	2,640,000,000	
第３２９回利付国債（１０年）	2,340,000,000	2,378,493,000	
第３３０回利付国債（１０年）	2,240,000,000	2,273,622,400	
第３３１回利付国債（１０年）	750,000,000	747,270,000	
第３３２回利付国債（１０年）	860,000,000	855,192,600	
第１回利付国債（３０年）	40,000,000	49,580,800	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	188,675,200	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	139,636,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	137,625,400	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	57,007,000	
第６回利付国債（３０年）	190,000,000	221,530,500	
第７回利付国債（３０年）	180,000,000	206,179,200	
第８回利付国債（３０年）	50,000,000	52,980,500	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	237,864,000	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	149,918,400	
第１１回利付国債（３０年）	90,000,000	93,054,600	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	208,734,000	
第１３回利付国債（３０年）	290,000,000	313,188,400	
第１４回利付国債（３０年）	300,000,000	344,184,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	395,906,200	
第１６回利付国債（３０年）	270,000,000	314,320,500	
第１７回利付国債（３０年）	280,000,000	321,132,000	
第１８回利付国債（３０年）	370,000,000	417,870,600	
第１９回利付国債（３０年）	130,000,000	146,851,900	

第２０回利付国債（３０年）	230,000,000	268,258,200	
第２１回利付国債（３０年）	280,000,000	316,674,400	
第２２回利付国債（３０年）	300,000,000	350,469,000	
第２３回利付国債（３０年）	340,000,000	397,354,600	
第２４回利付国債（３０年）	270,000,000	315,659,700	
第２５回利付国債（３０年）	320,000,000	362,102,400	
第２６回利付国債（３０年）	540,000,000	621,388,800	
第２７回利付国債（３０年）	580,000,000	679,499,000	
第２８回利付国債（３０年）	510,000,000	598,306,500	
第２９回利付国債（３０年）	690,000,000	797,481,300	
第３０回利付国債（３０年）	540,000,000	613,299,600	
第３１回利付国債（３０年）	580,000,000	647,425,000	
第３２回利付国債（３０年）	780,000,000	887,218,800	
第３３回利付国債（３０年）	800,000,000	859,000,000	
第３４回利付国債（３０年）	960,000,000	1,072,080,000	
第３５回利付国債（３０年）	920,000,000	986,773,600	
第３６回利付国債（３０年）	1,040,000,000	1,115,337,600	
第３７回利付国債（３０年）	860,000,000	902,707,600	
第３８回利付国債（３０年）	540,000,000	554,304,600	
第３９回利付国債（３０年）	250,000,000	262,375,000	
第４０回利付国債（３０年）	720,000,000	738,561,600	
第４１回利付国債（３０年）	170,000,000	170,336,600	
第２８回利付国債（２０年）	20,000,000	21,136,600	
第２９回利付国債（２０年）	60,000,000	64,099,800	
第３０回利付国債（２０年）	80,000,000	84,802,400	
第３１回利付国債（２０年）	80,000,000	85,887,200	
第３２回利付国債（２０年）	50,000,000	53,895,000	
第３３回利付国債（２０年）	140,000,000	153,742,400	
第３４回利付国債（２０年）	50,000,000	55,313,500	
第３５回利付国債（２０年）	10,000,000	10,998,100	
第３６回利付国債（２０年）	70,000,000	77,275,800	
第３７回利付国債（２０年）	70,000,000	77,531,300	
第３８回利付国債（２０年）	20,000,000	22,101,800	
第３９回利付国債（２０年）	500,000,000	550,480,000	
第４０回利付国債（２０年）	100,000,000	109,797,000	
第４１回利付国債（２０年）	330,000,000	351,892,200	
第４２回利付国債（２０年）	80,000,000	89,821,600	
第４３回利付国債（２０年）	140,000,000	160,930,000	
第４４回利付国債（２０年）	170,000,000	193,014,600	
第４５回利付国債（２０年）	290,000,000	327,502,800	
第４６回利付国債（２０年）	170,000,000	190,323,500	
第４７回利付国債（２０年）	90,000,000	100,971,900	
第４８回利付国債（２０年）	130,000,000	148,812,300	

第４９回利付国債（２０年）	140,000,000	156,678,200	
第５０回利付国債（２０年）	220,000,000	243,144,000	
第５１回利付国債（２０年）	100,000,000	111,315,000	
第５２回利付国債（２０年）	110,000,000	123,444,200	
第５３回利付国債（２０年）	80,000,000	90,012,800	
第５４回利付国債（２０年）	200,000,000	226,558,000	
第５５回利付国債（２０年）	140,000,000	156,584,400	
第５６回利付国債（２０年）	150,000,000	168,019,500	
第５７回利付国債（２０年）	240,000,000	266,894,400	
第５８回利付国債（２０年）	300,000,000	333,891,000	
第５９回利付国債（２０年）	200,000,000	219,440,000	
第６０回利付国債（２０年）	350,000,000	374,948,000	
第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	248,546,400	
第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	325,264,000	
第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	221,570,000	
第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	357,657,600	
第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	246,173,400	
第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	365,841,300	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	145,550,600	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	218,368,900	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	444,299,700	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	468,240,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	230,108,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	719,630,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	408,052,800	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	228,842,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	148,909,800	
第７６回利付国債（２０年）	170,000,000	191,108,900	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	329,010,800	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	191,248,300	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	306,593,100	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	252,271,800	
第８１回利付国債（２０年）	240,000,000	272,750,400	
第８２回利付国債（２０年）	510,000,000	585,077,100	
第８３回利付国債（２０年）	200,000,000	229,644,000	
第８４回利付国債（２０年）	570,000,000	648,249,600	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	333,241,900	
第８６回利付国債（２０年）	300,000,000	351,801,000	
第８７回利付国債（２０年）	290,000,000	336,658,100	
第８８回利付国債（２０年）	550,000,000	645,304,000	
第８９回利付国債（２０年）	410,000,000	476,133,000	
第９０回利付国債（２０年）	590,000,000	685,739,300	
第９１回利付国債（２０年）	300,000,000	352,338,000	

第９２回利付国債（２０年）	700,000,000	805,063,000	
第９３回利付国債（２０年）	370,000,000	420,845,400	
第９４回利付国債（２０年）	490,000,000	563,475,500	
第９５回利付国債（２０年）	620,000,000	728,642,600	
第９６回利付国債（２０年）	300,000,000	344,928,000	
第９７回利付国債（２０年）	490,000,000	569,218,300	
第９８回利付国債（２０年）	320,000,000	367,830,400	
第９９回利付国債（２０年）	850,000,000	976,089,000	
第１００回利付国債（２０年）	550,000,000	638,170,500	
第１０１回利付国債（２０年）	255,000,000	302,646,750	
第１０２回利付国債（２０年）	400,000,000	474,408,000	
第１０３回利付国債（２０年）	270,000,000	316,593,900	
第１０４回利付国債（２０年）	360,000,000	412,466,400	
第１０５回利付国債（２０年）	600,000,000	687,018,000	
第１０６回利付国債（２０年）	330,000,000	382,341,300	
第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	297,299,600	
第１０８回利付国債（２０年）	600,000,000	669,630,000	
第１０９回利付国債（２０年）	200,000,000	222,810,000	
第１１０回利付国債（２０年）	850,000,000	970,496,000	
第１１１回利付国債（２０年）	300,000,000	346,212,000	
第１１２回利付国債（２０年）	600,000,000	684,006,000	
第１１３回利付国債（２０年）	970,000,000	1,104,005,500	
第１１４回利付国債（２０年）	440,000,000	500,249,200	
第１１５回利付国債（２０年）	560,000,000	644,711,200	
第１１６回利付国債（２０年）	490,000,000	563,166,800	
第１１７回利付国債（２０年）	770,000,000	873,826,800	
第１１８回利付国債（２０年）	650,000,000	726,765,000	
第１１９回利付国債（２０年）	380,000,000	413,523,600	
第１２０回利付国債（２０年）	200,000,000	211,692,000	
第１２１回利付国債（２０年）	840,000,000	924,201,600	
第１２２回利付国債（２０年）	280,000,000	303,956,800	
第１２３回利付国債（２０年）	580,000,000	654,298,000	
第１２４回利付国債（２０年）	400,000,000	445,292,000	
第１２５回利付国債（２０年）	280,000,000	319,379,200	
第１２６回利付国債（２０年）	390,000,000	432,845,400	
第１２７回利付国債（２０年）	460,000,000	503,658,600	
第１２８回利付国債（２０年）	500,000,000	546,075,000	
第１２９回利付国債（２０年）	440,000,000	473,919,600	
第１３０回利付国債（２０年）	470,000,000	504,474,500	
第１３１回利付国債（２０年）	480,000,000	507,576,000	
第１３２回利付国債（２０年）	330,000,000	347,912,400	
第１３３回利付国債（２０年）	660,000,000	706,398,000	
第１３４回利付国債（２０年）	370,000,000	394,852,900	

	第１３５回利付国債（２０年）	380,000,000	399,391,400	
	第１３６回利付国債（２０年）	530,000,000	548,518,200	
	第１３７回利付国債（２０年）	290,000,000	303,621,300	
	第１３８回利付国債（２０年）	520,000,000	527,607,600	
	第１３９回利付国債（２０年）	470,000,000	484,466,600	
	第１４０回利付国債（２０年）	1,170,000,000	1,221,023,700	
	第１４１回利付国債（２０年）	260,000,000	270,446,800	
	第１４２回利付国債（２０年）	480,000,000	507,187,200	
	第１４３回利付国債（２０年）	920,000,000	938,574,800	
	第１４４回利付国債（２０年）	250,000,000	250,932,500	
	第１４５回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,053,833,400	
	第１４６回利付国債（２０年）	1,240,000,000	1,277,646,400	
	第１４７回利付国債（２０年）	560,000,000	565,980,800	
	第１４回ポーランド共和国円貨債券	200,000,000	199,932,000	
	国債証券 小計	179,935,000,000	189,597,437,650	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,687,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	112,637,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	111,216,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	107,708,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,121,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,353,000	
	第２３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	111,999,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	204,998,000	
	第６２２回東京都公募公債	100,000,000	101,626,000	
	第６３３回東京都公募公債	129,000,000	134,103,240	
	第６３９回東京都公募公債	50,000,000	52,244,000	
	第６４９回東京都公募公債	102,000,000	107,756,880	
	第６５０回東京都公募公債	140,000,000	148,513,400	
	第６７４回東京都公募公債	100,000,000	106,133,000	
	第６９５回東京都公募公債	100,000,000	105,164,000	
	第６９６回東京都公募公債	100,000,000	105,041,000	
	第７１６回東京都公募公債	100,000,000	101,137,000	
	平成１８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	103,624,000	
	平成１８年度第１０回北海道公募公債	100,000,000	104,933,000	
	平成１９年度第９回北海道公募公債	110,000,000	116,120,400	
	平成２０年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	107,287,000	
	平成２２年度第１１回北海道公募公債	100,000,000	105,871,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	100,000,000	115,770,000	
	第１６回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	111,223,000	
	第１４４回神奈川県公募公債	100,000,000	104,860,000	
	第１５０回神奈川県公募公債	100,000,000	105,731,000	
	第１６７回神奈川県公募公債	140,000,000	149,637,600	
	第１７２回神奈川県公募公債	200,000,000	212,196,000	

第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	211,574,000	
第７２回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	100,958,000	
第２８４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,621,000	
第２９０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,257,000	
第２９１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,405,000	
第３０７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,006,000	
第３１１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,829,000	
第３４５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	105,229,000	
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,020,000	
平成１８年度第１回京都府公募公債	100,000,000	104,492,000	
平成２２年度第２回京都府公募公債	100,000,000	104,975,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	97,130,000	
平成１７年度第１３回兵庫県公募公債	200,000,000	206,614,000	
平成１９年度第９回兵庫県公募公債	100,000,000	105,993,000	
平成２２年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	106,577,000	
平成１９年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	105,993,000	
平成２０年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	106,515,000	
平成２１年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	106,454,000	
平成２３年度第３回静岡県公募公債	103,290,000	108,474,125	
平成２３年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	103,649,000	
平成２０年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	107,105,000	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	115,249,000	
平成２１年度第８回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,159,000	
平成２２年度第３回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	212,596,000	
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	106,394,000	
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	105,157,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	116,395,000	
平成２２年度第１回広島県公募公債	100,000,000	106,267,000	
平成２４年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,466,000	
平成１７年度第３回埼玉県公募公債	100,000,000	101,772,000	
平成１８年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	104,368,000	
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	100,000,000	105,584,000	
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	193,000,000	204,016,440	
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	103,706,000	
平成２１年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	107,000,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	109,611,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債	200,000,000	209,822,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	105,757,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	102,949,000	
平成２１年度第１２回千葉県公募公債	100,000,000	106,666,000	
平成２１年度第２回千葉県公募公債	100,000,000	106,898,000	
平成２１年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	105,731,000	
平成２２年度第８回千葉県公募公債	120,000,000	124,630,800	

平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,262,000	
平成１７年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	102,685,000	
平成２２年度第１回長野県公募公債	100,000,000	100,635,000	
第２９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,042,000	
第３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,819,000	
第３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,066,000	
第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,342,000	
第４０回共同発行市場公募地方債	120,000,000	125,881,200	
第４６回共同発行市場公募地方債	136,500,000	143,213,070	
第５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,998,000	
第５５回共同発行市場公募地方債	158,400,000	168,220,800	
第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,818,000	
第６２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,584,000	
第６７回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,651,942	
第７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,355,000	
第７７回共同発行市場公募地方債	110,000,000	117,625,200	
第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,145,000	
第８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,738,000	
第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,841,000	
第８９回共同発行市場公募地方債	150,300,000	156,629,133	
第９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,221,000	
第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,516,000	
第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,442,000	
第９５回共同発行市場公募地方債	250,000,000	264,270,000	
第９７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,766,000	
第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,927,000	
第１０２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,526,000	
第１０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,397,000	
第１１０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,386,000	
第１１２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,918,000	
第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,631,000	
第１１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,196,000	
第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,663,000	
平成１７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,680,000	
平成２２年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	103,843,000	
平成１７年度第１０回大阪市公募公債	100,000,000	102,673,000	
平成１９年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	105,779,000	
平成２２年度第２回大阪市公募公債（５年）	100,000,000	100,434,000	
平成２２年度第５回大阪市公募公債	100,000,000	104,982,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	113,417,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	112,719,000	
第１２回す号名古屋市公募公債	100,000,000	103,356,000	
平成２２年度第１回京都市公募公債	100,000,000	100,385,000	

	平成２２年度第２回京都市公募公債	102,000,000	106,621,620	
	平成２４年度第４回京都市公募公債	100,000,000	101,377,000	
	平成１７年度第１３回神戸市公募公債	100,000,000	103,004,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	114,445,000	
	平成２１年度第１回横浜市公募公債	200,000,000	213,902,000	
	平成２１年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	107,218,000	
	平成２３年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	103,462,000	
	平成１７年度第６回札幌市公募公債	100,000,000	102,615,000	
	平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,262,000	
	第８１回川崎市公募公債	100,000,000	106,755,000	
	第８２回川崎市公募公債	100,000,000	106,854,000	
	平成２３年度第１回北九州市公募公債（５年）	100,000,000	100,508,000	
	平成２２年度第６回広島市公募公債	100,000,000	105,001,000	
	平成２３年度第２回千葉市公募公債	100,000,000	103,757,000	
	平成１８年度第１回鹿児島県公募公債（１０年）	100,000,000	104,797,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	116,369,000	
	地方債証券 小計	14,530,190,000	15,327,380,850	
特殊債券	第４２回韓国産業銀行円貨債券	100,000,000	100,087,000	
	第１１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,162,000	
	第１３回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	111,110,260	
	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,736,000	
	第１６回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,745,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,791,000	
	第１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,666,000	
	第５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,113,000	
	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	110,089,000	
	第８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,218,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,992,000	
	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	220,236,000	
	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	104,865,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	117,197,000	
	第２３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,547,000	
	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	104,911,000	
	第３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,248,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,017,000	
	第３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	315,000,000	333,607,050	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,710,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,277,000	
	第４０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,102,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	113,735,000	
	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	105,827,000	
	第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,341,000	
	第４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,775,000	

第４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,137,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,666,000	
第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,005,000	
第５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,574,000	
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	31,501,500	
第５６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,633,250	
第６０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,039,000	
第６２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	193,177,680	
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,938,000	
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,173,000	
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,478,000	
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,008,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,574,000	
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	317,763,000	
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	146,328,300	
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	110,102,000	
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	106,049,000	
第１１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,031,000	
第１１７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,024,000	
第１２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,538,000	
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	210,584,000	
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,960,000	
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	105,285,000	
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	105,911,000	
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	104,386,000	
第１４０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,678,000	
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	102,692,000	
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,200,000	
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,499,000	
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,680,000	
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,433,000	
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,738,000	
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,500,000	
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,193,000	
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,473,000	
第３４７回政府保証道路債券	181,000,000	184,578,370	
第１回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	215,168,380	
第１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,684,000	
第１回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,955,000	
第２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,208,000	
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	300,000,000	337,011,000	
第３回公営企業債券（２０年）	10,000,000	10,270,300	
第５回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,390,000	

第６回地方公共団体金融機構債券（５年）	100,000,000	100,639,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	113,377,000	
第７回公営企業債券（３０年）	100,000,000	115,693,000	
第７回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	112,642,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	45,560,800	
第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,378,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,303,000	
第１１回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,022,000	
第１５回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,312,000	
第１７回公営企業債券	100,000,000	102,350,000	
第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	104,319,870	
第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,299,000	
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,011,520	
第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	106,977,180	
第２３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,251,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	101,995,000	
第２８回公営企業債券	100,000,000	106,210,000	
第３０回公営企業債券	100,000,000	107,462,000	
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,726,000	
第４２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,883,000	
第８５５回政府保証公営企業債券	140,000,000	142,749,600	
第８５９回政府保証公営企業債券	131,000,000	134,644,420	
第８６２回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,752,000	
第８６７回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,427,000	
第８７１回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,965,000	
第８７２回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,164,000	
第８７４回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,986,000	
第８７５回政府保証公営企業債券	212,000,000	222,826,840	
第８７６回政府保証公営企業債券	122,000,000	129,184,580	
第３回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	108,036,700	
第５回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	83,994,400	
第２００回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,978,000	
第５回政府保証日本政策金融公庫債券	101,000,000	106,824,670	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,135,000	
第４３回都市再生債券	100,000,000	105,125,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	113,730,000	
第３２２回東京交通債券	10,000,000	10,494,000	
第３４４回東京交通債券	100,000,000	108,362,000	
第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,705,000	
第１９０回政府保証預金保険機構債	100,000,000	99,891,000	
第１９１回政府保証預金保険機構債	100,000,000	99,873,000	
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,707,000	45,711,864	
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	31,700,000	33,929,778	

第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	32,726,000	35,341,461	
第３回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,039,000	
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,202,000	46,574,348	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	35,020,000	37,374,044	
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	27,731,000	29,304,734	
第５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,269,000	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	57,690,000	62,298,277	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	34,998,000	37,113,279	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	30,323,000	32,614,205	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	38,942,000	41,367,697	
第８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,376,000	
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	29,953,000	32,247,100	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	44,412,000	47,197,964	
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	48,141,000	50,601,967	
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	48,568,000	50,980,372	
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,074,000	60,437,678	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,783,000	61,459,647	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,164,000	60,590,284	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,329,000	67,377,622	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,891,000	70,073,760	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,900,000	71,893,199	
第３３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,977,000	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,970,000	148,037,870	
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,706,000	45,255,121	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,908,000	81,187,930	
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,720,000	45,164,865	
第４１回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,416,000	
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,139,000	44,579,043	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,218,000	90,151,270	
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,174,000	40,154,611	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,122,000	90,419,142	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,718,000	91,239,096	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,157,000	45,539,256	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,606,000	182,159,567	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,068,000	92,268,843	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,439,000	45,440,710	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,923,000	93,867,086	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,600,000	93,580,740	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,176,000	94,306,072	
第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,680,000	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,754,000	189,840,277	
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,542,000	
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,729,000	

第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,020,000	191,885,996	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,417,000	96,069,652	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,038,000	97,946,275	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,198,000	98,252,789	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,610,000	98,622,386	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,008,000	97,606,539	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,328,000	99,645,379	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,506,000	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,845,000	100,237,390	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,330,000	
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,778,000	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,512,000	
第１２回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	114,819,000	
第２回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	151,536,420	
い第７１８号商工債	100,000,000	100,571,000	
い第７２１号商工債	150,000,000	150,822,000	
い第７２２号商工債	100,000,000	100,498,000	
い第７２６号商工債	100,000,000	100,517,000	
い第７２９号商工債	100,000,000	101,099,000	
い第７３１号商工債	100,000,000	101,184,000	
い第７３６号商工債	100,000,000	100,707,000	
い第７３８号商工債	100,000,000	100,736,000	
い第７４１号商工債	100,000,000	100,755,000	
い第７２１号農林債	100,000,000	100,591,000	
い第７２２号農林債	100,000,000	100,543,000	
い第７２３号農林債	200,000,000	201,148,000	
い第７４０号農林債	100,000,000	100,839,000	
い第７４３号農林債	100,000,000	100,680,000	
い第７４６号農林債	100,000,000	100,348,000	
い第７４８号農林債	100,000,000	100,346,000	
い第７５２号農林債	100,000,000	100,127,000	
第２４７回信金中金債（５年）	100,000,000	100,555,000	
第２５８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,888,000	
第２５９回信金中金債（５年）	100,000,000	100,908,000	
第２６５回信金中金債（５年）	100,000,000	100,904,000	
第２６７回信金中金債（５年）	200,000,000	201,542,000	
第５回ＳＢＡＢ銀行ＡＢ（ｐｕｂｌ）円貨債券	100,000,000	101,097,000	
第１０回韓国輸出入銀行円貨債券	100,000,000	100,928,000	
第１回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	102,727,000	
第１９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,135,000	
第２８回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,960,000	
第３３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,275,000	
第４３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,279,000	

	第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	201,844,000	
特殊債券 小計		20,804,116,000	21,856,590,275	
社債券	第２回ノルデアバンク・アクツィエボラーグ・プブリクト円貨社債	100,000,000	102,556,000	
	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	102,862,000	
	第９回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	104,608,000	
	第４回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,372,000	
	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	101,298,000	
	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	102,749,000	
	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	101,420,000	
	第１６回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	204,868,000	
	第１７回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,016,000	
	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	101,260,000	
	第１３回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,608,000	
	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	100,055,000	
	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	105,708,000	
	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	107,035,000	
	第３回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	107,145,000	
	第８回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	106,223,000	
	第４８回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,942,000	
	第８回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,735,000	
	第１４回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,959,000	
	第２回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,107,000	
	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	102,397,000	
	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	100,188,000	
	第５回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	99,970,000	
	第１３回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,057,000	
	第５５回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,157,000	
	第６７回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
	第１５回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,426,000	
	第２８回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,817,000	
	第１６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,612,000	
	第９回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	100,092,000	
	第５０回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,203,000	
	第５９回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,006,000	
	第３０回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,175,000	
	第１１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	102,703,000	

第２７回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,431,000	
第３回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	101,947,000	
第２４回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,189,000	
第３７回川崎重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,917,000	
第１回日本生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,239,000	
第１回Ｂ号明治安田生命２０１２基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,004,000	
第５２回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	102,942,000	
第１２回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,261,000	
第５回株式会社ドン・キホーテ無担保社債	100,000,000	102,135,000	
第５３回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,815,000	
第７５回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,981,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,479,000	
第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,117,000	
第７４回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,892,000	
第７７回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,923,000	
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	100,367,000	
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	101,187,000	
第２６回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	302,319,000	
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	100,637,000	
第３０回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,237,000	
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	121,349,000	
第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,748,000	
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	106,795,000	
第６回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,914,000	
第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	108,107,000	
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	109,415,000	
第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,444,000	
第５３回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,167,000	
第５６回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,842,000	
第１０回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	213,372,000	
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	100,673,000	
第１７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,642,000	
第２７回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,977,000	
第４７回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,828,000	
第４０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,658,000	
第１３３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,783,000	
第１３８回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,677,000	
第１６７回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,336,000	
第１９回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,564,000	

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	100,839,000	
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	100,925,000	
第３９回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,622,000	
第４０回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,664,000	
第２４回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,750,000	
第３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	110,524,000	
第１０３回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,685,000	
第３回株式会社サンケイビル無担保社債	100,000,000	101,081,000	
第８４回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,000	
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,351,000	
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	101,194,000	
第３６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,643,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,779,000	
第３０回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,025,000	
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,413,000	
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,677,000	
第８１回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,742,000	
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	19,000,000	21,495,270	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,044,000	
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,512,000	
第１６回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,591,000	
第２１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,254,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,494,000	
第９回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,326,000	
第３９回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,927,000	
第９回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	103,042,000	
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	101,033,000	
第５１回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,455,000	
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	99,822,000	
第７回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	102,146,000	
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,837,000	
第４２５回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,048,000	
第４５５回東京電力株式会社社債	120,000,000	112,638,000	
第４５９回東京電力株式会社社債	10,000,000	9,612,100	
第５１８回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,390,000	
第５２１回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,026,000	
第５２８回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,891,000	
第５３６回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,509,000	
第５４２回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,844,000	
第５４４回東京電力株式会社社債	100,000,000	94,088,000	
第５５４回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,515,000	
第４０５回中部電力株式会社社債	50,000,000	52,434,500	

	第４０８回中部電力株式会社社債	50,000,000	53,280,500	
	第４９９回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,468,000	
	第４５１回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,687,000	
	第４７３回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,552,000	
	第４７４回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,685,000	
	第４８９回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,821,000	
	第４９１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,149,000	
	第３５８回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,009,000	
	第３６２回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,244,000	
	第３７１回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,777,000	
	第２８６回北陸電力株式会社社債	100,000,000	108,100,000	
	第３７６回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,108,000	
	第３８０回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,865,000	
	第３８２回東北電力株式会社社債	20,000,000	21,729,400	
	第４６６回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,330,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,022,000	
	第２７６回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,751,000	
	第２７９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,674,000	
	第３８７回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,804,000	
	第４０８回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,800,000	
	第４１７回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,639,000	
	第４２０回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,251,000	
	第２６１回北海道電力株式会社社債	31,000,000	33,710,330	
	第２８５回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,085,000	
	第１７回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,316,000	
	第３０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,873,000	
	第９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	110,620,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,456,000	
	第４２回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	101,218,000	
	社債券 小計	14,620,000,000	15,020,181,100	
合計		229,889,306,000	241,801,589,875	

（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。

「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,112,259,020
株式	144,828,205,240
派生商品評価勘定	48,049,500
未収入金	736,850
未収配当金	119,203,574
未収利息	2,837
差入委託証拠金	64,815,000
流動資産合計	147,173,272,021
資産合計	147,173,272,021
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	525
前受金	51,105,000
未払金	4,495,400
未払解約金	311,819,266
流動負債合計	367,420,191
負債合計	367,420,191
純資産の部	
元本等	
元本	138,521,834,689
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,284,017,141
元本等合計	146,805,851,830
純資産合計	146,805,851,830
負債純資産合計	147,173,272,021

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20日現在
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.　デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.　収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成26年 1月20日現在
1.　計算期間の期首元本額	182,835,918,854円
計算期間中の追加設定元本額	25,333,390,457円
計算期間中の一部解約元本額	69,647,474,622円
計算日の元本額	138,521,834,689円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,973,751,827円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,627,334,999円
SBI資産設計オープン(分配型)	21,478,962円
SMT TOPIXインデックス・オープン	5,822,822,186円
世界経済インデックスファンド	259,152,041円
マイセレクション25	64,769,666円
マイセレクション50	105,643,647円
マイセレクション75	115,787,189円
日本株式インデックス・オープン	14,319,804,001円
DCマイセレクション25	4,765,557,703円
DCマイセレクション50	15,646,355,597円
DCマイセレクション75	14,875,866,914円
DC日本株式インデックス・オープン	3,938,311,133円
DCマイセレクションS25	1,707,504,597円

DCマイセレクションS50	5,346,871,753円
DCマイセレクションS75	3,421,825,935円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,297,617,986円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	17,360,960円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	450,865,578円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	448,047,292円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	209,750,109円
DC世界経済インデックスファンド	195,457,454円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	338,345,674円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	184,796,004円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	361,935,240円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	172,207,999円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	1,905,254,351円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24,391,395円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	971,635,430円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,570,279,009円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	7,374,224,093円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,881,611,298円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,180,832,017円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,779,764,593円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	9,802,310,382円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,144,138,449円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2,607,204,396円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,119,296,730円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,281,277,254円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,152,645,668円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,535,569,936円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	128,954,495円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,687,526,976円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,154,808,167円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,688,644円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	20,133,738円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,962,794円
2. 計算日における受益権総数	138,521,834,689口
3. 1口当たり純資産額	1.0598円
(1万口当たり純資産額)	(10,598円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20日現在

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	13,123,742,671
合計	13,123,742,671

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成26年1月20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26年 1月20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	1,898,201,025	－	1,946,250,000	48,048,975
合計		1,898,201,025	－	1,946,250,000	48,048,975

(注)1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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	35,000	270.00	9,450,000	
日本水産	109,100	233.00	25,420,300	

マルハニチロホールディングス	171,000	180.00	30,780,000	
サカタのタネ	13,100	1,362.00	17,842,200	
ホクト	9,800	1,967.00	19,276,600	
住石ホールディングス	24,600	152.00	3,739,200	
日鉄鉱業	23,000	501.00	11,523,000	
三井松島産業	58,000	174.00	10,092,000	
国際石油開発帝石	431,400	1,307.00	563,839,800	
日本海洋掘削	2,200	5,960.00	13,112,000	
石油資源開発	12,600	4,220.00	53,172,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,500	1,572.00	7,074,000	
ショーボンドホールディングス	7,900	4,865.00	38,433,500	
ミライト・ホールディングス	25,200	979.00	24,670,800	
タマホーム	4,000	1,047.00	4,188,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,000	1,990.00	1,990,000	
安藤・間	56,900	390.00	22,191,000	
東急建設	36,400	498.00	18,127,200	
コムシスホールディングス	43,100	1,521.00	65,555,100	
ミサワホーム	10,600	1,613.00	17,097,800	
高松コンストラクショングループ	6,700	1,874.00	12,555,800	
東建コーポレーション	3,330	5,080.00	16,916,400	
ヤマウラ	4,900	297.00	1,455,300	
大成建設	449,000	466.00	209,234,000	
大林組	266,000	596.00	158,536,000	
清水建設	272,000	544.00	147,968,000	
長谷工コーポレーション	118,300	853.00	100,909,900	
松井建設	12,000	435.00	5,220,000	
鹿島建設	392,000	399.00	156,408,000	
不動テトラ	62,700	185.00	11,599,500	
鉄建建設	54,000	307.00	16,578,000	
日鉄住金テックスエンジ	15,000	427.00	6,405,000	
西松建設	124,000	378.00	46,872,000	
三井住友建設	238,500	125.00	29,812,500	
前田建設工業	57,000	718.00	40,926,000	
佐田建設	31,000	140.00	4,340,000	
ナカノフドー建設	13,100	249.00	3,261,900	
奥村組	79,000	485.00	38,315,000	
大和小田急建設	5,000	269.00	1,345,000	
東鉄工業	10,700	2,063.00	22,074,100	
イチケン	18,000	186.00	3,348,000	
戸田建設	103,000	382.00	39,346,000	
熊谷組	84,000	293.00	24,612,000	
青木あすなろ建設	5,400	598.00	3,229,200	
北野建設	20,000	278.00	5,560,000	

植木組	22,000	218.00	4,796,000	
三井ホーム	11,000	510.00	5,610,000	
矢作建設工業	13,400	1,082.00	14,498,800	
ピーエス三菱	6,700	483.00	3,236,100	
大東建託	33,700	10,055.00	338,853,500	
新日本建設	17,400	338.00	5,881,200	
ＮＩＰＰＯ	21,000	1,696.00	35,616,000	
東亜道路工業	18,000	505.00	9,090,000	
前田道路	28,000	1,774.00	49,672,000	
日本道路	24,000	560.00	13,440,000	
東亜建設工業	81,000	248.00	20,088,000	
若築建設	48,000	136.00	6,528,000	
東洋建設	30,400	365.00	11,096,000	
五洋建設	106,000	405.00	42,930,000	
大林道路	12,000	601.00	7,212,000	
福田組	17,000	461.00	7,837,000	
住友林業	61,200	1,221.00	74,725,200	
日本基礎技術	12,000	366.00	4,392,000	
日成ビルド工業	33,000	269.00	8,877,000	
巴コーポレーション	11,000	491.00	5,401,000	
パナホーム	33,000	782.00	25,806,000	
大和ハウス工業	244,000	2,044.00	498,736,000	
ライト工業	18,500	770.00	14,245,000	
積水ハウス	233,100	1,538.00	358,507,800	
日特建設	12,800	409.00	5,235,200	
北陸電気工事	6,000	421.00	2,526,000	
ユアテック	14,000	341.00	4,774,000	
西部電気工業	7,000	489.00	3,423,000	
四電工	8,000	372.00	2,976,000	
中電工	12,800	1,851.00	23,692,800	
関電工	40,000	586.00	23,440,000	
きんでん	59,000	1,042.00	61,478,000	
東京エネシス	9,000	521.00	4,689,000	
トーエネック	13,000	647.00	8,411,000	
住友電設	6,200	1,575.00	9,765,000	
日本電設工業	14,000	1,380.00	19,320,000	
協和エクシオ	34,800	1,362.00	47,397,600	
新日本空調	7,500	665.00	4,987,500	
ＮＤＳ	14,000	298.00	4,172,000	
九電工	17,000	813.00	13,821,000	
三機工業	19,000	672.00	12,768,000	
日揮	89,000	4,143.00	368,727,000	
中外炉工業	26,000	261.00	6,786,000	

ヤマト	8,000	352.00	2,816,000	
太平電業	13,000	642.00	8,346,000	
高砂熱学工業	25,400	989.00	25,120,600	
三晃金属工業	13,000	273.00	3,549,000	
朝日工業社	10,000	388.00	3,880,000	
明星工業	13,000	513.00	6,669,000	
大氣社	11,800	2,277.00	26,868,600	
ダイダン	12,000	579.00	6,948,000	
日比谷総合設備	10,900	1,323.00	14,420,700	
東芝プラントシステム	14,000	1,656.00	23,184,000	
東洋エンジニアリング	48,000	472.00	22,656,000	
千代田化工建設	71,000	1,596.00	113,316,000	
新興プランテック	18,300	808.00	14,786,400	
日本製粉	55,000	531.00	29,205,000	
日清製粉グループ本社	88,500	1,064.00	94,164,000	
日東富士製粉	7,000	324.00	2,268,000	
昭和産業	37,000	335.00	12,395,000	
鳥越製粉	7,100	667.00	4,735,700	
協同飼料	31,000	115.00	3,565,000	
中部飼料	8,600	583.00	5,013,800	
日本配合飼料	28,000	126.00	3,528,000	
東洋精糖	14,000	109.00	1,526,000	
日本甜菜製糖	46,000	196.00	9,016,000	
三井製糖	35,000	449.00	15,715,000	
森永製菓	87,000	229.00	19,923,000	
中村屋	21,000	405.00	8,505,000	
江崎グリコ	32,000	1,300.00	41,600,000	
名糖産業	4,000	1,061.00	4,244,000	
不二家	51,000	197.00	10,047,000	
山崎製パン	65,000	1,096.00	71,240,000	
モロゾフ	14,000	320.00	4,480,000	
亀田製菓	5,000	3,075.00	15,375,000	
カルビー	32,500	2,443.00	79,397,500	
森永乳業	75,000	319.00	23,925,000	
六甲バター	4,000	827.00	3,308,000	
ヤクルト本社	51,900	5,220.00	270,918,000	
明治ホールディングス	26,300	6,720.00	176,736,000	
雪印メグミルク	19,200	1,323.00	25,401,600	
プリマハム	44,000	197.00	8,668,000	
日本ハム	62,000	1,805.00	111,910,000	
伊藤ハム	49,000	471.00	23,079,000	
丸大食品	43,000	314.00	13,502,000	
米久	2,900	892.00	2,586,800	

Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,500	1,148.00	6,314,000	
サッポロホールディングス	145,000	417.00	60,465,000	
アサヒグループホールディングス	178,400	2,838.00	506,299,200	
キリンホールディングス	380,000	1,446.00	549,480,000	
宝ホールディングス	70,000	898.00	62,860,000	
オエノンホールディングス	21,000	238.00	4,998,000	
養命酒製造	7,000	825.00	5,775,000	
コカ・コーラウエスト	27,300	2,085.00	56,920,500	
コカ・コーライーストジャパン	18,400	2,122.00	39,044,800	
サントリー食品インターナショナル	45,600	3,350.00	152,760,000	
ダイドードリンコ	4,100	4,310.00	17,671,000	
伊藤園	24,200	2,207.00	53,409,400	
キーコーヒー	8,400	1,594.00	13,389,600	
ユニカフェ	2,500	699.00	1,747,500	
ジャパンフーズ	1,200	1,289.00	1,546,800	
日清オイリオグループ	39,000	348.00	13,572,000	
不二製油	21,600	1,570.00	33,912,000	
かどや製油	900	2,714.00	2,442,600	
Ｊ－オイルミルズ	37,000	299.00	11,063,000	
キッコーマン	72,000	1,906.00	137,232,000	
味の素	211,000	1,553.00	327,683,000	
キユーピー	45,200	1,491.00	67,393,200	
ハウス食品グループ本社	31,200	1,588.00	49,545,600	
カゴメ	34,300	1,730.00	59,339,000	
焼津水産化学工業	4,200	918.00	3,855,600	
アリアケジャパン	8,100	2,640.00	21,384,000	
ニチレイ	95,000	498.00	47,310,000	
東洋水産	44,000	3,315.00	145,860,000	
日清食品ホールディングス	34,700	4,460.00	154,762,000	
永谷園	9,000	948.00	8,532,000	
フジッコ	9,000	1,223.00	11,007,000	
ロック・フィールド	4,600	1,847.00	8,496,200	
日本たばこ産業	491,800	3,200.00	1,573,760,000	
ケンコーマヨネーズ	3,000	945.00	2,835,000	
わらべや日洋	5,200	2,066.00	10,743,200	
なとり	4,100	1,068.00	4,378,800	
ミヨシ油脂	31,000	174.00	5,394,000	
片倉工業	9,600	1,189.00	11,414,400	
グンゼ	67,000	271.00	18,157,000	
東洋紡	351,000	191.00	67,041,000	
ユニチカ	227,000	72.00	16,344,000	
富士紡ホールディングス	44,000	246.00	10,824,000	
日清紡ホールディングス	53,000	941.00	49,873,000	

倉敷紡績	85,000	198.00	16,830,000	
シキボウ	48,000	142.00	6,816,000	
日本毛織	26,000	791.00	20,566,000	
トーア紡コーポレーション	35,000	85.00	2,975,000	
ダイドーリミテッド	9,400	700.00	6,580,000	
帝国繊維	8,700	1,358.00	11,814,600	
帝人	339,000	247.00	83,733,000	
東レ	602,000	696.00	418,992,000	
サカイオーベックス	22,000	214.00	4,708,000	
住江織物	27,000	306.00	8,262,000	
日本フエルト	4,800	477.00	2,289,600	
イチカワ	6,000	343.00	2,058,000	
日本バイリーン	10,000	695.00	6,950,000	
芦森工業	25,000	147.00	3,675,000	
アツギ	70,000	127.00	8,890,000	
ダイニック	16,000	197.00	3,152,000	
セーレン	22,300	865.00	19,289,500	
東海染工	12,000	129.00	1,548,000	
小松精練	15,000	552.00	8,280,000	
ワコールホールディングス	49,000	1,110.00	54,390,000	
ホギメディカル	5,200	5,580.00	29,016,000	
レナウン	19,900	138.00	2,746,200	
クラウディア	1,900	1,188.00	2,257,200	
ＴＳＩホールディングス	40,600	660.00	26,796,000	
三陽商会	45,000	291.00	13,095,000	
オンワードホールディングス	55,000	790.00	43,450,000	
ルック	18,000	294.00	5,292,000	
ゴールドウイン	21,000	494.00	10,374,000	
デサント	19,000	718.00	13,642,000	
キング	4,800	441.00	2,116,800	
ヤマトインターナショナル	5,100	457.00	2,330,700	
特種東海製紙	48,000	217.00	10,416,000	
王子ホールディングス	366,000	510.00	186,660,000	
日本製紙	42,900	1,787.00	76,662,300	
三菱製紙	118,000	96.00	11,328,000	
北越紀州製紙	56,500	473.00	26,724,500	
中越パルプ工業	32,000	251.00	8,032,000	
巴川製紙所	13,000	206.00	2,678,000	
大王製紙	29,000	963.00	27,927,000	
レンゴー	67,000	596.00	39,932,000	
トーモク	26,000	367.00	9,542,000	
ザ・パック	5,900	1,875.00	11,062,500	
クラレ	131,800	1,244.00	163,959,200	

旭化成	517,000	835.00	431,695,000	
共和レザー	5,500	538.00	2,959,000	
コープケミカル	12,000	148.00	1,776,000	
昭和電工	552,000	159.00	87,768,000	
住友化学	611,000	439.00	268,229,000	
日本化成	16,000	159.00	2,544,000	
住友精化	17,000	927.00	15,759,000	
日産化学工業	56,800	1,563.00	88,778,400	
ラサ工業	31,000	204.00	6,324,000	
クレハ	58,000	506.00	29,348,000	
多木化学	5,000	764.00	3,820,000	
テイカ	14,000	319.00	4,466,000	
石原産業	149,000	134.00	19,966,000	
片倉チッカリン	5,000	278.00	1,390,000	
日本曹達	53,000	625.00	33,125,000	
東ソー	222,000	478.00	106,116,000	
トクヤマ	129,000	464.00	59,856,000	
セントラル硝子	79,000	340.00	26,860,000	
東亜合成	97,000	465.00	45,105,000	
ダイソー	33,000	392.00	12,936,000	
関東電化工業	20,000	272.00	5,440,000	
電気化学工業	166,000	419.00	69,554,000	
信越化学工業	148,700	5,825.00	866,177,500	
日本カーバイド工業	24,000	309.00	7,416,000	
堺化学工業	34,000	336.00	11,424,000	
エア・ウォーター	68,000	1,565.00	106,420,000	
大陽日酸	106,000	782.00	82,892,000	
日本化学工業	31,000	149.00	4,619,000	
日本パーカライジング	20,000	2,325.00	46,500,000	
高圧ガス工業	12,000	602.00	7,224,000	
チタン工業	10,000	273.00	2,730,000	
四国化成工業	12,000	815.00	9,780,000	
戸田工業	15,000	294.00	4,410,000	
ステラ　ケミファ	4,200	1,623.00	6,816,600	
保土谷化学工業	25,000	222.00	5,550,000	
日本触媒	70,000	1,214.00	84,980,000	
大日精化工業	32,000	509.00	16,288,000	
カネカ	103,000	690.00	71,070,000	
三菱瓦斯化学	131,000	786.00	102,966,000	
三井化学	377,000	254.00	95,758,000	
ＪＳＲ	76,100	2,056.00	156,461,600	
東京応化工業	16,000	2,247.00	35,952,000	
大阪有機化学工業	5,600	471.00	2,637,600	

三菱ケミカルホールディングス	518,500	471.00	244,213,500	
日本合成化学工業	17,000	978.00	16,626,000	
ダイセル	108,000	861.00	92,988,000	
住友ベークライト	65,000	397.00	25,805,000	
積水化学工業	170,000	1,253.00	213,010,000	
日本ゼオン	65,000	1,059.00	68,835,000	
アイカ工業	23,300	2,144.00	49,955,200	
宇部興産	418,000	232.00	96,976,000	
積水樹脂	11,600	1,453.00	16,854,800	
タキロン	19,000	468.00	8,892,000	
旭有機材工業	29,000	228.00	6,612,000	
日立化成	35,900	1,644.00	59,019,600	
ニチバン	8,000	378.00	3,024,000	
リケンテクノス	13,000	663.00	8,619,000	
大倉工業	20,000	360.00	7,200,000	
積水化成品工業	24,000	285.00	6,840,000	
群栄化学工業	22,000	485.00	10,670,000	
タイガースポリマー	4,200	510.00	2,142,000	
ミライアル	2,100	1,685.00	3,538,500	
日本化薬	58,000	1,404.00	81,432,000	
カーリットホールディングス	6,700	499.00	3,343,300	
日本精化	6,900	664.00	4,581,600	
ＡＤＥＫＡ	35,700	1,203.00	42,947,100	
日油	69,000	772.00	53,268,000	
ハリマ化成グループ	7,200	485.00	3,492,000	
花王	215,700	3,384.00	729,928,800	
第一工業製薬	15,000	264.00	3,960,000	
三洋化成工業	26,000	735.00	19,110,000	
大日本塗料	47,000	180.00	8,460,000	
日本ペイント	72,000	1,881.00	135,432,000	
関西ペイント	101,000	1,511.00	152,611,000	
神東塗料	5,000	237.00	1,185,000	
中国塗料	24,000	592.00	14,208,000	
日本特殊塗料	6,400	717.00	4,588,800	
藤倉化成	10,500	651.00	6,835,500	
太陽ホールディングス	6,800	3,520.00	23,936,000	
ＤＩＣ	294,000	319.00	93,786,000	
サカタインクス	16,900	1,024.00	17,305,600	
東洋インキＳＣホールディングス	75,000	501.00	37,575,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	3,000	2,377.00	7,131,000	
富士フイルムホールディングス	189,800	3,023.00	573,765,400	
資生堂	147,600	1,647.00	243,097,200	
ライオン	96,000	584.00	56,064,000	

高砂香料工業	30,000	616.00	18,480,000	
マンダム	8,300	3,375.00	28,012,500	
ミルボン	5,300	4,130.00	21,889,000	
ファンケル	19,300	1,150.00	22,195,000	
コーセー	13,400	3,310.00	44,354,000	
ドクターシーラボ	56	340,000.00	19,040,000	
シーボン	700	2,309.00	1,616,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,500	3,675.00	31,237,500	
ノエビアホールディングス	5,600	1,931.00	10,813,600	
エステー	5,100	993.00	5,064,300	
コニシ	6,000	2,027.00	12,162,000	
長谷川香料	10,500	1,481.00	15,550,500	
星光ＰＭＣ	3,500	638.00	2,233,000	
小林製薬	13,600	5,770.00	78,472,000	
荒川化学工業	6,900	970.00	6,693,000	
メック	6,500	654.00	4,251,000	
日本高純度化学	24	220,000.00	5,280,000	
ＪＣＵ	1,200	6,060.00	7,272,000	
新田ゼラチン	5,000	1,051.00	5,255,000	
アース製薬	6,000	3,575.00	21,450,000	
イハラケミカル工業	13,000	776.00	10,088,000	
北興化学工業	8,000	302.00	2,416,000	
大成ラミック	2,200	2,674.00	5,882,800	
クミアイ化学工業	17,000	672.00	11,424,000	
日本農薬	19,000	1,516.00	28,804,000	
アキレス	66,000	159.00	10,494,000	
有沢製作所	13,800	638.00	8,804,400	
日東電工	68,400	4,267.00	291,862,800	
レック	2,600	1,216.00	3,161,600	
きもと	6,100	1,011.00	6,167,100	
藤森工業	7,100	2,667.00	18,935,700	
前澤化成工業	5,800	1,061.00	6,153,800	
ＪＳＰ	5,400	1,633.00	8,818,200	
エフピコ	4,100	7,190.00	29,479,000	
天馬	6,600	1,470.00	9,702,000	
信越ポリマー	16,300	407.00	6,634,100	
東リ	22,000	218.00	4,796,000	
ニフコ	18,500	2,778.00	51,393,000	
日本バルカー工業	34,000	297.00	10,098,000	
ユニ・チャーム	50,900	5,526.00	281,273,400	
協和発酵キリン	99,000	1,081.00	107,019,000	
武田薬品工業	310,700	4,845.00	1,505,341,500	
アステラス製薬	191,000	6,106.00	1,166,246,000	

大日本住友製薬	58,700	1,795.00	105,366,500	
塩野義製薬	129,500	2,202.00	285,159,000	
田辺三菱製薬	69,000	1,530.00	105,570,000	
わかもと製薬	9,000	284.00	2,556,000	
あすか製薬	10,000	849.00	8,490,000	
日本新薬	19,000	2,061.00	39,159,000	
ビオフェルミン製薬	1,300	2,521.00	3,277,300	
中外製薬	82,600	2,255.00	186,263,000	
科研製薬	30,000	1,679.00	50,370,000	
エーザイ	102,100	3,962.00	404,520,200	
ロート製薬	35,000	1,720.00	60,200,000	
小野薬品工業	37,700	9,770.00	368,329,000	
久光製薬	25,700	4,970.00	127,729,000	
有機合成薬品工業	5,000	293.00	1,465,000	
持田製薬	6,100	6,440.00	39,284,000	
参天製薬	30,400	4,840.00	147,136,000	
扶桑薬品工業	28,000	395.00	11,060,000	
日本ケミファ	12,000	500.00	6,000,000	
ツムラ	24,400	2,762.00	67,392,800	
日医工	19,950	1,598.00	31,880,100	
キッセイ薬品工業	15,400	2,577.00	39,685,800	
生化学工業	17,300	1,591.00	27,524,300	
栄研化学	6,400	1,990.00	12,736,000	
日水製薬	3,300	1,144.00	3,775,200	
鳥居薬品	5,700	3,905.00	22,258,500	
ＪＣＲファーマ	4,800	2,130.00	10,224,000	
東和薬品	4,200	4,110.00	17,262,000	
富士製薬工業	2,300	1,933.00	4,445,900	
沢井製薬	12,800	6,560.00	83,968,000	
ゼリア新薬工業	13,100	2,958.00	38,749,800	
第一三共	261,500	1,920.00	502,080,000	
キョーリン製薬ホールディングス	22,100	2,426.00	53,614,600	
大幸薬品	3,900	2,621.00	10,221,900	
ダイト	2,700	1,646.00	4,444,200	
大塚ホールディングス	164,600	3,228.00	531,328,800	
大正製薬ホールディングス	19,900	7,420.00	147,658,000	
日本コークス工業	66,900	158.00	10,570,200	
昭和シェル石油	74,100	1,040.00	77,064,000	
コスモ石油	229,000	205.00	46,945,000	
ニチレキ	10,000	1,000.00	10,000,000	
東燃ゼネラル石油	125,000	935.00	116,875,000	
ユシロ化学工業	4,500	1,057.00	4,756,500	
ビーピー・カストロール	3,400	472.00	1,604,800	

富士石油	21,100	332.00	7,005,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,000	1,751.00	3,502,000	
出光興産	39,300	2,433.00	95,616,900	
ＪＸホールディングス	920,300	543.00	499,722,900	
横浜ゴム	93,000	982.00	91,326,000	
東洋ゴム工業	69,000	618.00	42,642,000	
ブリヂストン	259,900	3,885.00	1,009,711,500	
住友ゴム工業	64,700	1,503.00	97,244,100	
藤倉ゴム工業	5,200	1,121.00	5,829,200	
オカモト	29,000	346.00	10,034,000	
フコク	3,500	1,106.00	3,871,000	
ニッタ	8,200	2,378.00	19,499,600	
東海ゴム工業	15,300	1,129.00	17,273,700	
三ツ星ベルト	21,000	622.00	13,062,000	
バンドー化学	30,000	448.00	13,440,000	
日東紡績	61,000	491.00	29,951,000	
旭硝子	409,000	633.00	258,897,000	
日本板硝子	400,000	146.00	58,400,000	
石塚硝子	11,000	349.00	3,839,000	
日本山村硝子	33,000	191.00	6,303,000	
日本電気硝子	171,000	525.00	89,775,000	
オハラ	3,200	634.00	2,028,800	
住友大阪セメント	158,000	398.00	62,884,000	
太平洋セメント	487,000	404.00	196,748,000	
デイ・シイ	9,300	679.00	6,314,700	
日本ヒューム	8,000	946.00	7,568,000	
日本コンクリート工業	15,000	534.00	8,010,000	
三谷セキサン	4,200	1,380.00	5,796,000	
ジャパンパイル	7,300	1,011.00	7,380,300	
東海カーボン	78,000	349.00	27,222,000	
日本カーボン	44,000	211.00	9,284,000	
東洋炭素	4,600	2,261.00	10,400,600	
ノリタケカンパニーリミテド	47,000	270.00	12,690,000	
ＴＯＴＯ	122,000	1,696.00	206,912,000	
日本碍子	105,000	1,864.00	195,720,000	
日本特殊陶業	71,000	2,550.00	181,050,000	
ＭＡＲＵＷＡ	2,100	3,805.00	7,990,500	
品川リフラクトリーズ	21,000	239.00	5,019,000	
黒崎播磨	20,000	257.00	5,140,000	
ヨータイ	5,000	319.00	1,595,000	
イソライト工業	5,100	201.00	1,025,100	
東京窯業	11,000	240.00	2,640,000	
ニッカトー	3,000	422.00	1,266,000	

フジミインコーポレーテッド	7,600	1,317.00	10,009,200	
ニチアス	40,000	754.00	30,160,000	
ニチハ	10,100	1,557.00	15,725,700	
新日鐵住金	3,505,000	337.00	1,181,185,000	
神戸製鋼所	1,149,000	184.00	211,416,000	
合同製鐵	42,000	185.00	7,770,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	211,500	2,378.00	502,947,000	
日新製鋼ホールディングス	35,800	1,254.00	44,893,200	
東京製鐵	46,600	571.00	26,608,600	
共英製鋼	7,700	2,008.00	15,461,600	
大和工業	17,200	3,280.00	56,416,000	
東京鐵鋼	17,000	400.00	6,800,000	
大阪製鐵	4,200	1,792.00	7,526,400	
淀川製鋼所	59,000	456.00	26,904,000	
東洋鋼鈑	20,000	483.00	9,660,000	
丸一鋼管	27,700	2,686.00	74,402,200	
モリ工業	13,000	446.00	5,798,000	
大同特殊鋼	139,000	513.00	71,307,000	
日本高周波鋼業	38,000	122.00	4,636,000	
日本冶金工業	68,000	335.00	22,780,000	
山陽特殊製鋼	45,000	531.00	23,895,000	
愛知製鋼	44,000	442.00	19,448,000	
日立金属	74,000	1,576.00	116,624,000	
日本金属	21,000	153.00	3,213,000	
大平洋金属	58,000	400.00	23,200,000	
日本電工	35,000	329.00	11,515,000	
栗本鐵工所	43,000	259.00	11,137,000	
虹技	10,000	214.00	2,140,000	
日本鋳鉄管	9,000	243.00	2,187,000	
三菱製鋼	51,000	268.00	13,668,000	
日亜鋼業	11,000	393.00	4,323,000	
日本精線	6,000	474.00	2,844,000	
シンニッタン	7,900	420.00	3,318,000	
新家工業	18,000	174.00	3,132,000	
大紀アルミニウム工業所	14,000	289.00	4,046,000	
日本軽金属ホールディングス	187,700	150.00	28,155,000	
三井金属鉱業	211,000	309.00	65,199,000	
東邦亜鉛	47,000	362.00	17,014,000	
三菱マテリアル	517,000	381.00	196,977,000	
住友金属鉱山	215,000	1,457.00	313,255,000	
ＤＯＷＡホールディングス	91,000	983.00	89,453,000	
古河機械金属	139,000	222.00	30,858,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,100	1,748.00	15,906,800	

東邦チタニウム	14,000	697.00	9,758,000	
ＵＡＣＪ	105,000	408.00	42,840,000	
古河電気工業	261,000	279.00	72,819,000	
住友電気工業	312,300	1,693.00	528,723,900	
フジクラ	133,000	518.00	68,894,000	
昭和電線ホールディングス	106,000	125.00	13,250,000	
東京特殊電線	12,000	181.00	2,172,000	
タツタ電線	12,700	685.00	8,699,500	
沖電線	11,000	217.00	2,387,000	
カナレ電気	1,300	1,501.00	1,951,300	
平河ヒューテック	1,800	873.00	1,571,400	
リョービ	51,000	444.00	22,644,000	
アサヒホールディングス	12,500	1,962.00	24,525,000	
稲葉製作所	3,500	1,300.00	4,550,000	
宮地エンジニアリンググループ	27,000	297.00	8,019,000	
トーカロ	5,100	1,672.00	8,527,200	
アルファＣｏ	3,500	1,076.00	3,766,000	
ＳＵＭＣＯ	51,800	914.00	47,345,200	
川田テクノロジーズ	2,100	2,760.00	5,796,000	
東洋製罐グループホールディングス	58,900	1,986.00	116,975,400	
ホッカンホールディングス	23,000	360.00	8,280,000	
コロナ	4,300	1,133.00	4,871,900	
横河ブリッジホールディングス	16,000	1,512.00	24,192,000	
日本橋梁	18,100	201.00	3,638,100	
駒井ハルテック	19,000	357.00	6,783,000	
高田機工	11,000	228.00	2,508,000	
三和ホールディングス	70,000	753.00	52,710,000	
文化シヤッター	21,000	682.00	14,322,000	
三協立山	11,300	2,599.00	29,368,700	
東洋シヤッター	3,800	638.00	2,424,400	
ＬＩＸＩＬグループ	115,500	2,930.00	338,415,000	
日本フイルコン	7,300	470.00	3,431,000	
ノーリツ	16,200	2,280.00	36,936,000	
長府製作所	8,900	2,407.00	21,422,300	
リンナイ	12,800	8,270.00	105,856,000	
ダイニチ工業	4,200	798.00	3,351,600	
日東精工	14,000	361.00	5,054,000	
三洋工業	14,000	198.00	2,772,000	
岡部	16,500	1,319.00	21,763,500	
東プレ	16,000	1,612.00	25,792,000	
高周波熱錬	12,100	854.00	10,333,400	
サンコール	6,000	705.00	4,230,000	
モリテック　スチール	5,900	322.00	1,899,800	

パイオラックス	3,900	4,075.00	15,892,500	
日本発條	66,000	1,188.00	78,408,000	
中央発條	11,000	316.00	3,476,000	
三益半導体工業	7,000	942.00	6,594,000	
アタカ大機	6,000	553.00	3,318,000	
日本製鋼所	119,000	553.00	65,807,000	
三浦工業	12,300	2,740.00	33,702,000	
タクマ	26,000	1,050.00	27,300,000	
ツガミ	26,000	657.00	17,082,000	
オークマ	54,000	1,099.00	59,346,000	
東芝機械	45,000	657.00	29,565,000	
アマダ	127,000	912.00	115,824,000	
アイダエンジニアリング	19,500	1,200.00	23,400,000	
滝澤鉄工所	24,000	167.00	4,008,000	
富士機械製造	25,300	890.00	22,517,000	
牧野フライス製作所	42,000	893.00	37,506,000	
オーエスジー	34,100	2,012.00	68,609,200	
ダイジェット工業	13,000	165.00	2,145,000	
旭ダイヤモンド工業	21,300	1,151.00	24,516,300	
ＤＭＧ森精機	43,700	1,938.00	84,690,600	
ディスコ	9,200	7,350.00	67,620,000	
日東工器	4,900	1,896.00	9,290,400	
豊和工業	4,700	892.00	4,192,400	
大阪機工	32,000	160.00	5,120,000	
東洋機械金属	7,500	449.00	3,367,500	
津田駒工業	21,000	194.00	4,074,000	
島精機製作所	10,800	1,782.00	19,245,600	
日阪製作所	11,000	1,072.00	11,792,000	
やまびこ	3,300	3,635.00	11,995,500	
ペガサスミシン製造	9,500	416.00	3,952,000	
ナブテスコ	37,900	2,437.00	92,362,300	
三井海洋開発	6,900	2,968.00	20,479,200	
レオン自動機	8,000	673.00	5,384,000	
ＳＭＣ	23,700	27,910.00	661,467,000	
新川	7,300	659.00	4,810,700	
ホソカワミクロン	14,000	718.00	10,052,000	
ユニオンツール	3,600	2,686.00	9,669,600	
オイレス工業	7,900	2,213.00	17,482,700	
日精エー・エス・ビー機械	2,400	2,602.00	6,244,800	
サトーホールディングス	8,800	2,594.00	22,827,200	
日本エアーテック	3,300	528.00	1,742,400	
日精樹脂工業	6,100	676.00	4,123,600	
ワイエイシイ	4,700	583.00	2,740,100	

小松製作所	386,800	2,087.00	807,251,600	
住友重機械工業	227,000	489.00	111,003,000	
日立建機	42,300	2,119.00	89,633,700	
日工	12,000	648.00	7,776,000	
巴工業	3,000	1,706.00	5,118,000	
井関農機	85,000	317.00	26,945,000	
ＴＯＷＡ	7,600	540.00	4,104,000	
丸山製作所	19,000	279.00	5,301,000	
北川鉄工所	42,000	212.00	8,904,000	
クボタ	432,000	1,807.00	780,624,000	
荏原実業	2,200	1,381.00	3,038,200	
三菱化工機	28,000	197.00	5,516,000	
月島機械	13,000	1,158.00	15,054,000	
帝国電機製作所	2,900	2,808.00	8,143,200	
新東工業	19,500	826.00	16,107,000	
澁谷工業	5,500	2,509.00	13,799,500	
アイチ　コーポレーション	11,800	494.00	5,829,200	
小森コーポレーション	20,200	1,723.00	34,804,600	
鶴見製作所	6,000	1,426.00	8,556,000	
住友精密工業	14,000	487.00	6,818,000	
酒井重工業	16,000	400.00	6,400,000	
荏原製作所	183,000	714.00	130,662,000	
石井鐵工所	15,000	313.00	4,695,000	
西島製作所	8,800	1,235.00	10,868,000	
ダイキン工業	108,100	6,302.00	681,246,200	
オルガノ	13,000	499.00	6,487,000	
トーヨーカネツ	44,000	327.00	14,388,000	
栗田工業	49,800	2,328.00	115,934,400	
椿本チエイン	42,000	837.00	35,154,000	
大同工業	19,000	349.00	6,631,000	
日本コンベヤ	26,000	160.00	4,160,000	
木村化工機	9,100	485.00	4,413,500	
アネスト岩田	14,000	725.00	10,150,000	
ダイフク	33,500	1,331.00	44,588,500	
加藤製作所	19,000	665.00	12,635,000	
油研工業	18,000	265.00	4,770,000	
タダノ	35,000	1,488.00	52,080,000	
フジテック	23,000	1,419.00	32,637,000	
ＣＫＤ	22,400	1,157.00	25,916,800	
キトー	4,800	2,297.00	11,025,600	
平和	17,600	1,840.00	32,384,000	
理想科学工業	6,100	2,178.00	13,285,800	
ＳＡＮＫＹＯ	24,000	4,990.00	119,760,000	

日本金銭機械	7,500	2,057.00	15,427,500	
マースエンジニアリング	4,500	2,067.00	9,301,500	
福島工業	4,300	1,651.00	7,099,300	
オーイズミ	3,100	1,192.00	3,695,200	
ダイコク電機	3,300	2,445.00	8,068,500	
アマノ	22,600	1,123.00	25,379,800	
サンデン	46,000	528.00	24,288,000	
マックス	13,000	1,201.00	15,613,000	
グローリー	23,700	2,684.00	63,610,800	
新晃工業	5,700	837.00	4,770,900	
大和冷機工業	13,000	749.00	9,737,000	
セガサミーホールディングス	85,100	2,566.00	218,366,600	
日本ピストンリング	31,000	230.00	7,130,000	
リケン	32,000	500.00	16,000,000	
ＴＰＲ	9,100	1,910.00	17,381,000	
ホシザキ電機	17,300	3,665.00	63,404,500	
大豊工業	5,800	1,157.00	6,710,600	
日本精工	176,000	1,321.00	232,496,000	
ＮＴＮ	185,000	515.00	95,275,000	
ジェイテクト	84,300	1,676.00	141,286,800	
不二越	74,000	732.00	54,168,000	
日本トムソン	26,000	586.00	15,236,000	
ＴＨＫ	49,400	2,471.00	122,067,400	
ユーシン精機	3,500	2,390.00	8,365,000	
前澤給装工業	3,100	1,366.00	4,234,600	
イーグル工業	10,000	1,796.00	17,960,000	
前澤工業	7,100	363.00	2,577,300	
日本ピラー工業	9,000	732.00	6,588,000	
キッツ	36,500	531.00	19,381,500	
日立工機	21,200	772.00	16,366,400	
マキタ	51,600	5,790.00	298,764,000	
日立造船	58,800	850.00	49,980,000	
三菱重工業	1,410,000	724.00	1,020,840,000	
ＩＨＩ	541,000	507.00	274,287,000	
イビデン	48,200	2,078.00	100,159,600	
コニカミノルタ	209,000	1,122.00	234,498,000	
ブラザー工業	102,400	1,428.00	146,227,200	
ミネベア	108,000	784.00	84,672,000	
日立製作所	1,901,000	858.00	1,631,058,000	
東芝	1,563,000	501.00	783,063,000	
三菱電機	792,000	1,313.00	1,039,896,000	
富士電機	220,000	509.00	111,980,000	
東洋電機製造	16,000	368.00	5,888,000	

安川電機	87,000	1,571.00	136,677,000	
シンフォニアテクノロジー	48,000	180.00	8,640,000	
明電舎	73,000	421.00	30,733,000	
オリジン電気	12,000	345.00	4,140,000	
山洋電気	12,000	721.00	8,652,000	
デンヨー	7,800	1,542.00	12,027,600	
東芝テック	50,000	736.00	36,800,000	
芝浦メカトロニクス	16,000	271.00	4,336,000	
マブチモーター	11,200	6,160.00	68,992,000	
日本電産	42,800	10,865.00	465,022,000	
東光高岳ホールディングス	4,400	2,175.00	9,570,000	
ダイヘン	47,000	516.00	24,252,000	
ヤーマン	1,000	1,482.00	1,482,000	
ＪＶＣケンウッド	56,600	213.00	12,055,800	
第一精工	3,300	1,256.00	4,144,800	
日新電機	16,000	670.00	10,720,000	
大崎電気工業	12,000	666.00	7,992,000	
オムロン	89,400	4,330.00	387,102,000	
日東工業	11,700	1,899.00	22,218,300	
ＩＤＥＣ	10,400	964.00	10,025,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	153,000	579.00	88,587,000	
サクサホールディングス	20,000	168.00	3,360,000	
メルコホールディングス	3,800	1,581.00	6,007,800	
テクノメディカ	1,800	2,194.00	3,949,200	
日本電気	1,089,000	272.00	296,208,000	
富士通	764,000	530.00	404,920,000	
沖電気工業	306,000	264.00	80,784,000	
岩崎通信機	37,000	112.00	4,144,000	
電気興業	23,000	751.00	17,273,000	
サンケン電気	43,000	750.00	32,250,000	
ナカヨ通信機	8,000	371.00	2,968,000	
アイホン	4,600	1,797.00	8,266,200	
ルネサスエレクトロニクス	41,000	612.00	25,092,000	
セイコーエプソン	54,100	2,904.00	157,106,400	
ワコム	62,400	682.00	42,556,800	
アルバック	13,300	1,538.00	20,455,400	
アクセル	4,000	1,849.00	7,396,000	
ＥＩＺＯ	7,300	2,853.00	20,826,900	
日本信号	20,000	974.00	19,480,000	
京三製作所	19,000	356.00	6,764,000	
能美防災	10,000	1,163.00	11,630,000	
ホーチキ	6,000	612.00	3,672,000	
エレコム	2,900	1,392.00	4,036,800	

日本無線	20,000	375.00	7,500,000	
パナソニック	904,700	1,316.00	1,190,585,200	
シャープ	571,000	366.00	208,986,000	
アンリツ	46,100	1,148.00	52,922,800	
富士通ゼネラル	19,000	1,088.00	20,672,000	
日立国際電気	16,000	1,449.00	23,184,000	
ソニー	434,200	1,767.00	767,231,400	
ＴＤＫ	47,800	4,835.00	231,113,000	
帝国通信工業	19,000	192.00	3,648,000	
ミツミ電機	30,100	781.00	23,508,100	
タムラ製作所	31,000	331.00	10,261,000	
アルプス電気	58,200	1,201.00	69,898,200	
パイオニア	110,000	233.00	25,630,000	
日本電波工業	7,600	970.00	7,372,000	
日本トリム	1,800	7,790.00	14,022,000	
ローランド　ディー．ジー．	3,500	3,610.00	12,635,000	
フォスター電機	8,100	1,878.00	15,211,800	
クラリオン	49,000	168.00	8,232,000	
ＳＭＫ	23,000	690.00	15,870,000	
ヨコオ	6,700	565.00	3,785,500	
東光	37,000	349.00	12,913,000	
ホシデン	23,300	560.00	13,048,000	
ヒロセ電機	13,800	14,740.00	203,412,000	
日本航空電子工業	20,000	1,474.00	29,480,000	
ＴＯＡ	8,500	1,082.00	9,197,000	
古野電気	7,700	762.00	5,867,400	
ユニデン	25,000	352.00	8,800,000	
アルパイン	17,200	1,480.00	25,456,000	
スミダコーポレーション	7,200	579.00	4,168,800	
アイコム	4,400	2,450.00	10,780,000	
リオン	2,500	1,593.00	3,982,500	
船井電機	8,000	1,404.00	11,232,000	
横河電機	85,900	1,692.00	145,342,800	
新電元工業	25,000	652.00	16,300,000	
アズビル	24,000	2,545.00	61,080,000	
東亜ディーケーケー	3,000	560.00	1,680,000	
日本光電工業	16,900	4,100.00	69,290,000	
チノー	14,000	237.00	3,318,000	
共和電業	9,000	442.00	3,978,000	
日本電子材料	3,500	585.00	2,047,500	
堀場製作所	14,700	3,800.00	55,860,000	
アドバンテスト	54,000	1,237.00	66,798,000	
小野測器	8,000	461.00	3,688,000	

エスペック	8,200	893.00	7,322,600	
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	7,000	533.00	3,731,000	
キーエンス	17,900	42,985.00	769,431,500	
日置電機	4,200	1,403.00	5,892,600	
シスメックス	33,100	6,090.00	201,579,000	
メガチップス	7,100	1,520.00	10,792,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,100	3,280.00	16,728,000	
日本電産コパル電子	8,200	885.00	7,257,000	
澤藤電機	5,000	244.00	1,220,000	
コーセル	11,500	1,214.00	13,961,000	
日立メディコ	2,000	1,805.00	3,610,000	
新日本無線	6,000	436.00	2,616,000	
オプテックス	5,000	1,671.00	8,355,000	
千代田インテグレ	3,500	2,239.00	7,836,500	
レーザーテック	5,700	1,164.00	6,634,800	
スタンレー電気	57,000	2,581.00	147,117,000	
岩崎電気	31,000	223.00	6,913,000	
ウシオ電機	48,100	1,351.00	64,983,100	
岡谷電機産業	4,300	405.00	1,741,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	6,900	401.00	2,766,900	
日本セラミック	4,500	1,671.00	7,519,500	
遠藤照明	3,300	2,060.00	6,798,000	
日本デジタル研究所	5,900	1,604.00	9,463,600	
古河電池	6,000	833.00	4,998,000	
双信電機	3,900	426.00	1,661,400	
図研	5,200	910.00	4,732,000	
日本電子	28,000	530.00	14,840,000	
カシオ計算機	82,400	1,195.00	98,468,000	
ファナック	88,300	17,520.00	1,547,016,000	
日本シイエムケイ	18,700	291.00	5,441,700	
エンプラス	3,000	7,580.00	22,740,000	
大真空	11,000	454.00	4,994,000	
ローム	41,800	5,220.00	218,196,000	
浜松ホトニクス	30,900	4,495.00	138,895,500	
三井ハイテック	10,500	799.00	8,389,500	
新光電気工業	26,600	964.00	25,642,400	
京セラ	141,100	5,000.00	705,500,000	
太陽誘電	38,500	1,370.00	52,745,000	
村田製作所	83,100	10,070.00	836,817,000	
ユーシン	11,500	699.00	8,038,500	
双葉電子工業	14,700	1,419.00	20,859,300	
北陸電気工業	32,000	175.00	5,600,000	
ニチコン	25,000	1,011.00	25,275,000	

日本ケミコン	51,000	437.00	22,287,000	
ＫＯＡ	10,000	1,200.00	12,000,000	
市光工業	22,000	169.00	3,718,000	
小糸製作所	43,000	2,102.00	90,386,000	
ミツバ	14,900	1,924.00	28,667,600	
スター精密	15,100	1,374.00	20,747,400	
大日本スクリーン製造	75,000	561.00	42,075,000	
キヤノン電子	7,300	2,008.00	14,658,400	
キヤノン	459,100	3,216.00	1,476,465,600	
リコー	238,000	1,213.00	288,694,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	11,000	541.00	5,951,000	
東京エレクトロン	71,100	5,680.00	403,848,000	
トヨタ紡織	27,700	1,273.00	35,262,100	
鬼怒川ゴム工業	15,000	539.00	8,085,000	
ユニプレス	12,800	2,031.00	25,996,800	
豊田自動織機	72,100	5,040.00	363,384,000	
モリタホールディングス	14,000	912.00	12,768,000	
三櫻工業	10,000	754.00	7,540,000	
デンソー	195,600	5,657.00	1,106,509,200	
東海理化電機製作所	20,900	2,009.00	41,988,100	
三井造船	306,000	230.00	70,380,000	
佐世保重工業	56,000	143.00	8,008,000	
川崎重工業	617,000	492.00	303,564,000	
名村造船所	11,600	1,508.00	17,492,800	
サノヤスホールディングス	7,200	231.00	1,663,200	
日本車輌製造	29,000	545.00	15,805,000	
ニチユ三菱フォークリフト	9,000	706.00	6,354,000	
近畿車輛	14,000	349.00	4,886,000	
日産自動車	1,111,500	962.00	1,069,263,000	
いすゞ自動車	459,000	655.00	300,645,000	
トヨタ自動車	1,102,100	6,206.00	6,839,632,600	
日野自動車	99,000	1,593.00	157,707,000	
三菱自動車工業	183,800	1,232.00	226,441,600	
エフテック	2,700	1,528.00	4,125,600	
ＧＭＢ	800	1,446.00	1,156,800	
武蔵精密工業	8,400	2,249.00	18,891,600	
日産車体	39,000	1,497.00	58,383,000	
新明和工業	32,000	953.00	30,496,000	
極東開発工業	13,700	1,477.00	20,234,900	
日信工業	16,100	2,319.00	37,335,900	
トピー工業	65,000	193.00	12,545,000	
ティラド	31,000	287.00	8,897,000	
曙ブレーキ工業	36,800	468.00	17,222,400	

タチエス	11,600	1,458.00	16,912,800	
ＮＯＫ	38,300	1,792.00	68,633,600	
フタバ産業	24,100	401.00	9,664,100	
カヤバ工業	75,000	533.00	39,975,000	
シロキ工業	18,000	256.00	4,608,000	
大同メタル工業	11,000	1,181.00	12,991,000	
プレス工業	31,000	456.00	14,136,000	
カルソニックカンセイ	54,000	530.00	28,620,000	
太平洋工業	16,100	712.00	11,463,200	
ケーヒン	18,200	1,719.00	31,285,800	
河西工業	11,000	779.00	8,569,000	
アイシン精機	72,500	4,145.00	300,512,500	
富士機工	9,000	395.00	3,555,000	
マツダ	1,180,000	554.00	653,720,000	
ダイハツ工業	84,000	1,798.00	151,032,000	
今仙電機製作所	5,800	1,584.00	9,187,200	
本田技研工業	712,600	4,156.00	2,961,565,600	
スズキ	165,500	2,924.00	483,922,000	
富士重工業	269,500	3,045.00	820,627,500	
ヤマハ発動機	120,400	1,524.00	183,489,600	
ショーワ	18,700	1,662.00	31,079,400	
ＴＢＫ	9,000	631.00	5,679,000	
エクセディ	9,600	3,385.00	32,496,000	
豊田合成	25,600	2,262.00	57,907,200	
愛三工業	9,600	1,017.00	9,763,200	
ヨロズ	5,800	2,002.00	11,611,600	
エフ・シー・シー	12,900	2,207.00	28,470,300	
シマノ	34,200	9,460.00	323,532,000	
タカタ	14,300	3,185.00	45,545,500	
テイ・エス　テック	16,700	4,040.00	67,468,000	
テルモ	60,700	4,800.00	291,360,000	
クリエートメディック	2,600	977.00	2,540,200	
日機装	26,000	1,341.00	34,866,000	
島津製作所	102,000	953.00	97,206,000	
ＪＭＳ	15,000	306.00	4,590,000	
ショットモリテックス	1,700	343.00	583,100	
長野計器	5,100	701.00	3,575,100	
ブイ・テクノロジー	16	272,200.00	4,355,200	
東京計器	27,000	317.00	8,559,000	
愛知時計電機	11,000	310.00	3,410,000	
東京精密	14,200	2,112.00	29,990,400	
マニー	2,400	3,975.00	9,540,000	
ニコン	147,900	1,912.00	282,784,800	

トプコン	21,300	1,502.00	31,992,600	
オリンパス	118,000	3,095.00	365,210,000	
理研計器	7,000	909.00	6,363,000	
タムロン	6,100	2,781.00	16,964,100	
ＨＯＹＡ	192,500	2,944.00	566,720,000	
ノーリツ鋼機	7,200	686.00	4,939,200	
エー・アンド・デイ	7,200	681.00	4,903,200	
シチズンホールディングス	97,500	869.00	84,727,500	
リズム時計工業	36,000	150.00	5,400,000	
大研医器	2,800	1,815.00	5,082,000	
松風	3,900	892.00	3,478,800	
セイコーホールディングス	51,000	575.00	29,325,000	
ニプロ	42,200	945.00	39,879,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,600	3,530.00	26,828,000	
ＳＨＯ－ＢＩ	2,400	412.00	988,800	
前田工繊	6,400	1,240.00	7,936,000	
永大産業	11,000	627.00	6,897,000	
ダンロップスポーツ	4,300	1,322.00	5,684,600	
バンダイナムコホールディングス	87,400	2,157.00	188,521,800	
共立印刷	14,500	291.00	4,219,500	
フランスベッドホールディングス	50,000	207.00	10,350,000	
パイロットコーポレーション	6,900	3,495.00	24,115,500	
トッパン・フォームズ	14,200	974.00	13,830,800	
フジシールインターナショナル	9,700	3,395.00	32,931,500	
タカラトミー	26,100	479.00	12,501,900	
廣済堂	7,400	620.00	4,588,000	
タカノ	3,600	559.00	2,012,400	
プロネクサス	8,600	687.00	5,908,200	
ホクシン	7,000	155.00	1,085,000	
ウッドワン	13,000	335.00	4,355,000	
大建工業	32,000	286.00	9,152,000	
凸版印刷	224,000	806.00	180,544,000	
大日本印刷	241,000	1,079.00	260,039,000	
図書印刷	15,000	393.00	5,895,000	
共同印刷	25,000	299.00	7,475,000	
日本写真印刷	13,600	1,594.00	21,678,400	
光村印刷	8,000	283.00	2,264,000	
宝印刷	4,700	724.00	3,402,800	
アシックス	78,700	1,853.00	145,831,100	
ツツミ	4,000	2,392.00	9,568,000	
ローランド	8,100	1,449.00	11,736,900	
小松ウオール工業	2,900	2,293.00	6,649,700	
ヤマハ	58,200	1,612.00	93,818,400	

河合楽器製作所	28,000	195.00	5,460,000	
クリナップ	8,100	984.00	7,970,400	
ピジョン	13,000	5,150.00	66,950,000	
兼松日産農林	12,000	174.00	2,088,000	
キングジム	6,700	687.00	4,602,900	
リンテック	18,800	1,978.00	37,186,400	
イトーキ	17,800	645.00	11,481,000	
任天堂	48,800	13,745.00	670,756,000	
三菱鉛筆	6,500	2,511.00	16,321,500	
タカラスタンダード	33,000	795.00	26,235,000	
コクヨ	41,200	758.00	31,229,600	
ナカバヤシ	17,000	210.00	3,570,000	
グローブライド	41,000	162.00	6,642,000	
岡村製作所	31,000	908.00	28,148,000	
美津濃	39,000	527.00	20,553,000	
アデランス	9,900	1,116.00	11,048,400	
東京電力	671,700	490.00	329,133,000	
中部電力	260,900	1,309.00	341,518,100	
関西電力	323,100	1,170.00	378,027,000	
中国電力	109,500	1,473.00	161,293,500	
北陸電力	77,600	1,374.00	106,622,400	
東北電力	197,800	1,102.00	217,975,600	
四国電力	71,300	1,569.00	111,869,700	
九州電力	174,900	1,277.00	223,347,300	
北海道電力	74,100	1,167.00	86,474,700	
沖縄電力	5,200	3,420.00	17,784,000	
電源開発	49,100	3,070.00	150,737,000	
東京瓦斯	928,000	516.00	478,848,000	
大阪瓦斯	820,000	431.00	353,420,000	
東邦瓦斯	201,000	523.00	105,123,000	
北海道瓦斯	15,000	286.00	4,290,000	
西部瓦斯	89,000	246.00	21,894,000	
静岡瓦斯	20,600	620.00	12,772,000	
東武鉄道	450,000	492.00	221,400,000	
相鉄ホールディングス	136,000	368.00	50,048,000	
東京急行電鉄	466,000	685.00	319,210,000	
京浜急行電鉄	203,000	873.00	177,219,000	
小田急電鉄	254,000	913.00	231,902,000	
京王電鉄	221,000	680.00	150,280,000	
京成電鉄	119,000	938.00	111,622,000	
富士急行	22,000	896.00	19,712,000	
新京成電鉄	10,000	372.00	3,720,000	
東日本旅客鉄道	145,700	8,149.00	1,187,309,300	

西日本旅客鉄道	71,400	4,478.00	319,729,200	
東海旅客鉄道	70,900	12,220.00	866,398,000	
鴻池運輸	4,200	1,572.00	6,602,400	
西日本鉄道	102,000	396.00	40,392,000	
ハマキョウレックス	2,300	2,899.00	6,667,700	
サカイ引越センター	1,300	3,295.00	4,283,500	
近畿日本鉄道	797,000	361.00	287,717,000	
阪急阪神ホールディングス	531,000	557.00	295,767,000	
南海電気鉄道	165,000	369.00	60,885,000	
京阪電気鉄道	167,000	396.00	66,132,000	
神戸電鉄	19,000	339.00	6,441,000	
名糖運輸	3,200	693.00	2,217,600	
名古屋鉄道	276,000	314.00	86,664,000	
山陽電気鉄道	29,000	417.00	12,093,000	
日本通運	313,000	499.00	156,187,000	
ヤマトホールディングス	147,500	1,983.00	292,492,500	
山九	96,000	409.00	39,264,000	
丸運	5,000	249.00	1,245,000	
丸全昭和運輸	27,000	360.00	9,720,000	
センコー	32,000	533.00	17,056,000	
トナミホールディングス	16,000	215.00	3,440,000	
日本梱包運輸倉庫	24,200	1,945.00	47,069,000	
日本石油輸送	9,000	239.00	2,151,000	
福山通運	48,000	569.00	27,312,000	
セイノーホールディングス	56,000	1,047.00	58,632,000	
神奈川中央交通	9,000	511.00	4,599,000	
日立物流	16,500	1,593.00	26,284,500	
日本郵船	670,000	328.00	219,760,000	
商船三井	446,000	458.00	204,268,000	
川崎汽船	348,000	275.00	95,700,000	
ＮＳユナイテッド海運	34,000	299.00	10,166,000	
乾汽船	16,000	376.00	6,016,000	
飯野海運	38,900	622.00	24,195,800	
共栄タンカー	16,000	252.00	4,032,000	
日本航空	66,900	5,320.00	355,908,000	
ＡＮＡホールディングス	1,556,000	231.00	359,436,000	
スカイマーク	16,800	432.00	7,257,600	
パスコ	7,000	513.00	3,591,000	
トランコム	2,300	3,520.00	8,096,000	
日新	30,000	305.00	9,150,000	
三菱倉庫	52,000	1,504.00	78,208,000	
三井倉庫	40,000	496.00	19,840,000	
住友倉庫	53,000	597.00	31,641,000	

澁澤倉庫	19,000	413.00	7,847,000	
東陽倉庫	14,000	263.00	3,682,000	
日本トランスシティ	17,000	355.00	6,035,000	
ケイヒン	14,000	183.00	2,562,000	
中央倉庫	4,600	928.00	4,268,800	
安田倉庫	6,200	1,118.00	6,931,600	
東洋埠頭	23,000	269.00	6,187,000	
宇徳	6,400	397.00	2,540,800	
上組	94,000	982.00	92,308,000	
サンリツ	1,900	572.00	1,086,800	
キムラユニティー	1,800	992.00	1,785,600	
キユーソー流通システム	2,500	1,087.00	2,717,500	
郵船ロジスティクス	7,300	1,293.00	9,438,900	
近鉄エクスプレス	7,100	4,260.00	30,246,000	
東海運	4,300	292.00	1,255,600	
エーアイテイー	2,900	816.00	2,366,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	8,600	2,447.00	21,044,200	
システナ	7,600	801.00	6,087,600	
デジタルアーツ	2,100	947.00	1,988,700	
新日鉄住金ソリューションズ	6,500	2,550.00	16,575,000	
コア	2,900	766.00	2,221,400	
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	1,091.00	2,836,600	
ＩＴホールディングス	28,100	1,666.00	46,814,600	
ネオス	1,600	1,404.00	2,246,400	
電算システム	1,800	1,362.00	2,451,600	
グリー	40,600	1,082.00	43,929,200	
コーエーテクモホールディングス	15,500	1,217.00	18,863,500	
三菱総合研究所	3,000	2,288.00	6,864,000	
ボルテージ	1,100	1,292.00	1,421,200	
電算	500	2,090.00	1,045,000	
ヒト・コミュニケーションズ	800	1,961.00	1,568,800	
ブレインパッド	600	1,618.00	970,800	
ＫＬａｂ	5,200	856.00	4,451,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4,800	1,935.00	9,288,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,100	2,236.00	2,459,600	
ネクソン	64,800	924.00	59,875,200	
アイスタイル	2,200	610.00	1,342,000	
エムアップ	1,400	884.00	1,237,600	
エイチーム	700	6,750.00	4,725,000	
ブロードリーフ	7,700	1,886.00	14,522,200	
ハーツユナイテッドグループ	1,800	2,732.00	4,917,600	
ドワンゴ	7,000	2,713.00	18,991,000	

ベリサーブ	500	1,771.00	885,500	
マクロミル	12,700	782.00	9,931,400	
ティーガイア	7,800	1,258.00	9,812,400	
豆蔵ホールディングス	4,600	475.00	2,185,000	
テクマトリックス	2,500	652.00	1,630,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,000	4,580.00	13,740,000	
ザッパラス	4,400	798.00	3,511,200	
インターネットイニシアティブ	11,500	2,786.00	32,039,000	
ビットアイル	5,900	827.00	4,879,300	
ＳＲＡホールディングス	3,800	1,377.00	5,232,600	
朝日ネット	7,200	575.00	4,140,000	
コムチュア	700	2,212.00	1,548,400	
パナソニック　インフォメーションシステムズ	1,600	3,265.00	5,224,000	
フェイス	2,400	1,137.00	2,728,800	
野村総合研究所	44,300	3,550.00	157,265,000	
サイバネットシステム	6,400	364.00	2,329,600	
インテージホールディングス	4,200	1,365.00	5,733,000	
ソースネクスト	3,900	896.00	3,494,400	
クレスコ	1,800	1,002.00	1,803,600	
フジ・メディア・ホールディングス	75,600	2,050.00	154,980,000	
オービック	26,900	3,025.00	81,372,500	
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	1,700	848.00	1,441,600	
ヤフー	565,700	613.00	346,774,100	
トレンドマイクロ	34,500	3,340.00	115,230,000	
日本オラクル	15,600	3,870.00	60,372,000	
アルファシステムズ	2,600	1,414.00	3,676,400	
フューチャーアーキテクト	9,400	631.00	5,931,400	
シーエーシー	4,800	944.00	4,531,200	
ソフトバンク・テクノロジー	1,800	1,611.00	2,899,800	
トーセ	1,900	780.00	1,482,000	
オービックビジネスコンサルタント	4,000	3,535.00	14,140,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,900	4,350.00	38,715,000	
アイティフォー	8,700	496.00	4,315,200	
東計電算	1,400	1,617.00	2,263,800	
エックスネット	700	1,397.00	977,900	
大塚商会	7,000	11,940.00	83,580,000	
サイボウズ	11,700	462.00	5,405,400	
ソフトブレーン	10,800	149.00	1,609,200	
アグレックス	1,800	1,093.00	1,967,400	
電通国際情報サービス	4,800	1,153.00	5,534,400	
ＥＭシステムズ	1,100	2,107.00	2,317,700	
ウェザーニューズ	2,000	2,724.00	5,448,000	

ＣＩＪ	7,300	450.00	3,285,000	
WOWOW	2,400	3,580.00	8,592,000	
ネットワンシステムズ	30,700	678.00	20,814,600	
アルゴグラフィックス	2,900	1,891.00	5,483,900	
マーベラスＡＱＬ	11,900	757.00	9,008,300	
エイベックス・グループ・ホールディングス	14,400	2,498.00	35,971,200	
日本ユニシス	18,900	1,001.00	18,918,900	
兼松エレクトロニクス	4,900	1,393.00	6,825,700	
東京放送ホールディングス	42,200	1,307.00	55,155,400	
日本テレビホールディングス	77,800	1,980.00	154,044,000	
テレビ朝日	19,800	2,261.00	44,767,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	59,300	553.00	32,792,900	
テレビ東京ホールディングス	6,400	1,723.00	11,027,200	
コネクシオ	6,900	883.00	6,092,700	
日本電信電話	307,100	5,851.00	1,796,842,100	
ＫＤＤＩ	242,600	6,219.00	1,508,729,400	
光通信	7,300	8,650.00	63,145,000	
ＮＴＴドコモ	643,900	1,733.00	1,115,878,700	
GMOインターネット	26,100	1,335.00	34,843,500	
学研ホールディングス	26,000	329.00	8,554,000	
ゼンリン	10,400	1,015.00	10,556,000	
昭文社	4,700	747.00	3,510,900	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	7,500	3,345.00	25,087,500	
インプレスホールディングス	5,700	170.00	969,000	
アイネット	3,300	875.00	2,887,500	
松竹	51,000	947.00	48,297,000	
東宝	55,800	2,294.00	128,005,200	
東映	33,000	599.00	19,767,000	
ＡＯＩ　Ｐｒｏ．	3,600	695.00	2,502,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	55,200	3,625.00	200,100,000	
ＤＴＳ	7,500	2,018.00	15,135,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	28,400	1,722.00	48,904,800	
シーイーシー	4,700	718.00	3,374,600	
カプコン	20,000	1,861.00	37,220,000	
ジャステック	5,000	831.00	4,155,000	
ＳＣＳＫ	18,600	2,847.00	52,954,200	
日本システムウエア	3,000	515.00	1,545,000	
アイネス	10,700	737.00	7,885,900	
ＴＫＣ	6,600	1,895.00	12,507,000	
富士ソフト	10,000	2,491.00	24,910,000	
ＮＳＤ	16,600	1,377.00	22,858,200	
コナミ	35,300	2,411.00	85,108,300	
福井コンピュータホールディングス	1,100	955.00	1,050,500	

ＪＢＣＣホールディングス	6,600	832.00	5,491,200	
ミロク情報サービス	5,000	431.00	2,155,000	
ソフトバンク	383,800	8,838.00	3,392,024,400	
ホウスイ	7,000	142.00	994,000	
高千穂交易	3,300	1,041.00	3,435,300	
伊藤忠食品	1,900	3,485.00	6,621,500	
エレマテック	3,700	1,749.00	6,471,300	
ＪＡＬＵＸ	2,200	1,202.00	2,644,400	
あらた	18,000	348.00	6,264,000	
トーメンデバイス	1,200	1,771.00	2,125,200	
東京エレクトロン　デバイス	1,600	1,643.00	2,628,800	
双日	523,100	200.00	104,620,000	
アルフレッサ　ホールディングス	23,100	5,820.00	134,442,000	
横浜冷凍	19,400	810.00	15,714,000	
山下医科器械	700	1,728.00	1,209,600	
ラサ商事	3,500	501.00	1,753,500	
アルコニックス	2,400	2,391.00	5,738,400	
神戸物産	800	2,410.00	1,928,000	
あい　ホールディングス	13,900	1,421.00	19,751,900	
ダイワボウホールディングス	71,000	220.00	15,620,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,700	722.00	10,613,400	
八洲電機	6,100	456.00	2,781,600	
ＵＫＣホールディングス	5,000	1,765.00	8,825,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	38,300	350.00	13,405,000	
三洋貿易	2,700	972.00	2,624,400	
ミタチ産業	1,900	561.00	1,065,900	
シップヘルスケアホールディングス	11,200	4,085.00	45,752,000	
富士興産	2,900	740.00	2,146,000	
協栄産業	10,000	200.00	2,000,000	
小野建	6,800	1,398.00	9,506,400	
佐鳥電機	5,800	701.00	4,065,800	
エコートレーディング	2,000	735.00	1,470,000	
伯東	4,800	1,091.00	5,236,800	
コンドーテック	6,400	739.00	4,729,600	
中山福	4,500	859.00	3,865,500	
ナガイレーベン	10,400	1,595.00	16,588,000	
三菱食品	8,600	2,559.00	22,007,400	
松田産業	5,700	1,409.00	8,031,300	
メディパルホールディングス	78,200	1,558.00	121,835,600	
アドヴァン	4,000	1,214.00	4,856,000	
ＳＰＫ	1,800	1,928.00	3,470,400	
アズワン	5,100	2,433.00	12,408,300	
スズデン	2,900	555.00	1,609,500	

尾家産業	2,600	832.00	2,163,200	
シモジマ	5,400	1,005.00	5,427,000	
ドウシシャ	8,300	1,506.00	12,499,800	
高速	4,700	944.00	4,436,800	
黒田電気	11,300	1,625.00	18,362,500	
丸文	7,000	653.00	4,571,000	
ハピネット	4,800	911.00	4,372,800	
トーメンエレクトロニクス	4,000	1,285.00	5,140,000	
エクセル	3,600	1,374.00	4,946,400	
マルカキカイ	2,600	1,339.00	3,481,400	
ガリバーインターナショナル	26,400	768.00	20,275,200	
日本エム・ディ・エム	6,700	339.00	2,271,300	
進和	4,600	1,325.00	6,095,000	
エスケイジャパン	2,000	300.00	600,000	
ダイトエレクトロン	3,700	393.00	1,454,100	
シークス	5,000	1,577.00	7,885,000	
田中商事	2,500	630.00	1,575,000	
オーハシテクニカ	4,000	1,031.00	4,124,000	
マクニカ	4,000	2,822.00	11,288,000	
白銅	2,600	1,006.00	2,615,600	
伊藤忠商事	623,500	1,366.00	851,701,000	
丸紅	684,000	770.00	526,680,000	
高島	15,000	268.00	4,020,000	
長瀬産業	44,300	1,285.00	56,925,500	
蝶理	5,000	1,224.00	6,120,000	
豊田通商	87,100	2,564.00	223,324,400	
三共生興	13,400	393.00	5,266,200	
兼松	166,000	193.00	32,038,000	
ツカモトコーポレーション	14,000	167.00	2,338,000	
三井物産	719,600	1,494.00	1,075,082,400	
日本紙パルプ商事	41,000	344.00	14,104,000	
日立ハイテクノロジーズ	23,700	2,616.00	61,999,200	
カメイ	10,200	826.00	8,425,200	
東都水産	14,000	218.00	3,052,000	
ＯＵＧホールディングス	12,000	196.00	2,352,000	
スターゼン	28,000	283.00	7,924,000	
山善	30,100	654.00	19,685,400	
椿本興業	9,000	315.00	2,835,000	
住友商事	461,200	1,327.00	612,012,400	
内田洋行	18,000	288.00	5,184,000	
三菱商事	609,800	2,020.00	1,231,796,000	
第一実業	18,000	490.00	8,820,000	
キヤノンマーケティングジャパン	22,300	1,462.00	32,602,600	

西華産業	27,000	256.00	6,912,000	
佐藤商事	7,000	734.00	5,138,000	
菱洋エレクトロ	9,200	1,143.00	10,515,600	
東京産業	7,900	412.00	3,254,800	
ユアサ商事	80,000	235.00	18,800,000	
神鋼商事	20,000	237.00	4,740,000	
小林産業	5,300	341.00	1,807,300	
阪和興業	78,000	572.00	44,616,000	
カナデン	8,000	719.00	5,752,000	
菱電商事	11,000	752.00	8,272,000	
フルサト工業	4,300	1,327.00	5,706,100	
岩谷産業	87,000	662.00	57,594,000	
すてきナイスグループ	33,000	243.00	8,019,000	
昭光通商	25,000	168.00	4,200,000	
ニチモウ	12,000	205.00	2,460,000	
極東貿易	9,000	244.00	2,196,000	
イワキ	12,000	220.00	2,640,000	
三愛石油	18,000	529.00	9,522,000	
稲畑産業	19,300	1,216.00	23,468,800	
ＧＳＩクレオス	21,000	173.00	3,633,000	
明和産業	7,300	390.00	2,847,000	
ワキタ	12,000	1,175.00	14,100,000	
東邦ホールディングス	25,000	1,880.00	47,000,000	
サンゲツ	13,900	2,656.00	36,918,400	
ミツウロコグループホールディングス	12,600	607.00	7,648,200	
シナネン	17,000	429.00	7,293,000	
伊藤忠エネクス	17,300	630.00	10,899,000	
サンリオ	19,700	4,330.00	85,301,000	
サンワテクノス	4,100	905.00	3,710,500	
リョーサン	11,600	2,281.00	26,459,600	
新光商事	8,600	942.00	8,101,200	
トーホー	16,000	385.00	6,160,000	
三信電気	9,700	801.00	7,769,700	
東陽テクニカ	10,800	1,083.00	11,696,400	
モスフードサービス	10,300	2,233.00	22,999,900	
加賀電子	7,100	1,348.00	9,570,800	
ソーダニッカ	8,000	455.00	3,640,000	
立花エレテック	4,800	1,399.00	6,715,200	
Ｐａｌｔａｃ	11,000	1,410.00	15,510,000	
ヤマタネ	39,000	189.00	7,371,000	
丸紅建材リース	7,000	223.00	1,561,000	
日鉄住金物産	51,000	400.00	20,400,000	
トラスコ中山	8,900	2,547.00	22,668,300	

オートバックスセブン	27,500	1,739.00	47,822,500	
加藤産業	11,300	1,976.00	22,328,800	
イノテック	7,300	522.00	3,810,600	
イエローハット	6,800	1,955.00	13,294,000	
富士エレクトロニクス	4,000	1,433.00	5,732,000	
ＪＫホールディングス	6,700	583.00	3,906,100	
日伝	3,500	2,248.00	7,868,000	
北沢産業	6,500	208.00	1,352,000	
杉本商事	4,300	993.00	4,269,900	
因幡電機産業	10,700	3,410.00	36,487,000	
バイテック	2,700	923.00	2,492,100	
ミスミグループ本社	31,300	3,325.00	104,072,500	
江守商事	2,500	2,282.00	5,705,000	
アルテック	3,800	260.00	988,000	
タキヒヨー	13,000	426.00	5,538,000	
スズケン	32,400	3,595.00	116,478,000	
ジェコス	5,400	887.00	4,789,800	
ローソン	32,100	7,940.00	254,874,000	
サンエー	5,900	3,100.00	18,290,000	
キリン堂	2,800	731.00	2,046,800	
ダイユーエイト	1,600	739.00	1,182,400	
カワチ薬品	5,400	1,997.00	10,783,800	
エービーシー・マート	11,100	4,780.00	53,058,000	
ハードオフコーポレーション	3,800	916.00	3,480,800	
アスクル	6,700	3,485.00	23,349,500	
ゲオホールディングス	13,400	1,023.00	13,708,200	
アダストリアホールディングス	6,000	3,685.00	22,110,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	10,000	261.00	2,610,000	
くらコーポレーション	4,600	1,807.00	8,312,200	
キャンドゥ	3,700	1,556.00	5,757,200	
パル	4,600	2,314.00	10,644,400	
エディオン	35,800	604.00	21,623,200	
サーラコーポレーション	6,700	513.00	3,437,100	
あみやき亭	1,300	3,610.00	4,693,000	
ひらまつ	8,100	754.00	6,107,400	
ゲンキー	700	2,193.00	1,535,100	
大黒天物産	1,600	2,924.00	4,678,400	
ハニーズ	6,180	953.00	5,889,540	
アルペン	6,000	1,957.00	11,742,000	
クオール	5,700	605.00	3,448,500	
ジェイアイエヌ	4,000	4,195.00	16,780,000	
ビックカメラ	297	60,800.00	18,057,600	
ＤＣＭホールディングス	38,600	747.00	28,834,200	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	12,100	2,322.00	28,096,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	185,000	735.00	135,975,000	
ドトール・日レスホールディングス	13,700	1,809.00	24,783,300	
マツモトキヨシホールディングス	16,100	3,820.00	61,502,000	
ブロンコビリー	1,200	1,905.00	2,286,000	
スタートトゥデイ	24,300	2,441.00	59,316,300	
物語コーポレーション	1,100	3,235.00	3,558,500	
ココカラファイン	8,100	2,689.00	21,780,900	
三越伊勢丹ホールディングス	155,300	1,430.00	222,079,000	
ウエルシアホールディングス	2,900	6,150.00	17,835,000	
クリエイトＳＤホールディングス	3,300	3,750.00	12,375,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	6,800	326.00	2,216,800	
エー・ピーカンパニー	700	2,071.00	1,449,700	
ブックオフコーポレーション	4,300	718.00	3,087,400	
あさひ	4,500	1,486.00	6,687,000	
日本調剤	990	2,928.00	2,898,720	
コスモス薬品	3,900	12,590.00	49,101,000	
一六堂	1,100	490.00	539,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	326,900	4,229.00	1,382,460,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,000	3,030.00	3,030,000	
ツルハホールディングス	7,700	9,950.00	76,615,000	
サンマルクホールディングス	2,500	5,100.00	12,750,000	
フェリシモ	2,200	1,076.00	2,367,200	
トリドール	6,800	942.00	6,405,600	
クスリのアオキ	1,200	5,880.00	7,056,000	
メディカルシステムネットワーク	6,400	534.00	3,417,600	
総合メディカル	1,900	4,235.00	8,046,500	
はるやま商事	3,300	783.00	2,583,900	
カッパ・クリエイトホールディングス	5,750	2,033.00	11,689,750	
ライトオン	5,800	745.00	4,321,000	
良品計画	8,300	10,390.00	86,237,000	
三城ホールディングス	9,700	479.00	4,646,300	
コナカ	10,000	918.00	9,180,000	
ハウス　オブ　ローゼ	900	1,396.00	1,256,400	
Ｇ－７ホールディングス	2,300	826.00	1,899,800	
イオン北海道	6,400	708.00	4,531,200	
コジマ	11,500	291.00	3,346,500	
ヒマラヤ	1,800	1,290.00	2,322,000	
コーナン商事	10,200	1,109.00	11,311,800	
エコス	2,700	666.00	1,798,200	
ワタミ	9,200	1,448.00	13,321,600	
マルシェ	1,900	836.00	1,588,400	

ドンキホーテホールディングス	23,100	6,580.00	151,998,000	
西松屋チェーン	15,400	866.00	13,336,400	
ゼンショーホールディングス	29,800	1,171.00	34,895,800	
幸楽苑	4,800	1,353.00	6,494,400	
ハークスレイ	2,200	795.00	1,749,000	
サイゼリヤ	11,600	1,261.00	14,627,600	
ポプラ	3,300	538.00	1,775,400	
ユナイテッドアローズ	10,200	3,645.00	37,179,000	
ハイデイ日高	4,100	2,557.00	10,483,700	
京都きもの友禅	5,200	1,127.00	5,860,400	
コロワイド	26,000	1,092.00	28,392,000	
壱番屋	3,100	3,920.00	12,152,000	
トップカルチャー	2,800	474.00	1,327,200	
ＰＬＡＮＴ	1,500	1,023.00	1,534,500	
スギホールディングス	14,000	4,325.00	60,550,000	
スクロール	10,200	349.00	3,559,800	
ヨンドシーホールディングス	6,000	1,632.00	9,792,000	
ファミリーマート	26,400	4,785.00	126,324,000	
木曽路	9,600	1,906.00	18,297,600	
サトレストランシステムズ	7,300	758.00	5,533,400	
千趣会	14,100	894.00	12,605,400	
タカキュー	6,000	320.00	1,920,000	
ケーヨー	13,300	476.00	6,330,800	
上新電機	17,000	847.00	14,399,000	
日本瓦斯	11,600	1,172.00	13,595,200	
ベスト電器	25,200	167.00	4,208,400	
マルエツ	17,000	368.00	6,256,000	
ロイヤルホールディングス	13,000	1,569.00	20,397,000	
東天紅	6,000	201.00	1,206,000	
いなげや	8,700	1,000.00	8,700,000	
島忠	17,700	2,563.00	45,365,100	
チヨダ	9,200	2,121.00	19,513,200	
ライフコーポレーション	6,300	1,610.00	10,143,000	
カスミ	16,100	704.00	11,334,400	
リンガーハット	7,600	1,549.00	11,772,400	
ＭｒＭａｘ	7,800	336.00	2,620,800	
テンアライド	5,900	322.00	1,899,800	
ＡＯＫＩホールディングス	13,500	1,882.00	25,407,000	
オークワ	12,000	907.00	10,884,000	
コメリ	12,000	2,741.00	32,892,000	
青山商事	19,600	2,852.00	55,899,200	
しまむら	9,100	9,850.00	89,635,000	
ＣＦＳコーポレーション	5,200	459.00	2,386,800	

はせがわ	2,700	878.00	2,370,600	
高島屋	106,000	1,059.00	112,254,000	
松屋	16,600	1,197.00	19,870,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	46,000	890.00	40,940,000	
近鉄百貨店	30,000	364.00	10,920,000	
ニッセンホールディングス	15,600	406.00	6,333,600	
パルコ	7,500	983.00	7,372,500	
丸井グループ	102,200	1,039.00	106,185,800	
アクシアル　リテイリング	4,300	1,576.00	6,776,800	
ダイエー	48,250	318.00	15,343,500	
イズミヤ	31,000	470.00	14,570,000	
イオン	312,200	1,361.00	424,904,200	
ユニーグループ・ホールディングス	75,900	639.00	48,500,100	
イズミ	17,600	3,245.00	57,112,000	
東武ストア	10,000	262.00	2,620,000	
平和堂	16,000	1,496.00	23,936,000	
フジ	8,700	1,784.00	15,520,800	
ヤオコー	4,000	4,555.00	18,220,000	
ゼビオ	9,400	2,211.00	20,783,400	
ケーズホールディングス	16,500	2,952.00	48,708,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	4,600	796.00	3,661,600	
日産東京販売ホールディングス	11,000	457.00	5,027,000	
アインファーマシーズ	4,700	5,370.00	25,239,000	
元気寿司	2,400	1,605.00	3,852,000	
ヤマダ電機	308,900	382.00	117,999,800	
アークランドサカモト	5,100	1,910.00	9,741,000	
ニトリホールディングス	15,500	9,840.00	152,520,000	
グルメ杵屋	6,000	742.00	4,452,000	
愛眼	6,200	298.00	1,847,600	
ケーユーホールディングス	1,600	1,530.00	2,448,000	
吉野家ホールディングス	21,200	1,466.00	31,079,200	
松屋フーズ	3,800	1,898.00	7,212,400	
サガミチェーン	10,000	982.00	9,820,000	
関西スーパーマーケット	5,800	868.00	5,034,400	
王将フードサービス	3,900	3,455.00	13,474,500	
プレナス	8,700	2,285.00	19,879,500	
ミニストップ	5,800	1,682.00	9,755,600	
アークス	13,300	1,980.00	26,334,000	
バロー	16,800	1,474.00	24,763,200	
藤久	600	1,637.00	982,200	
ベルク	3,900	1,940.00	7,566,000	
大庄	3,700	1,321.00	4,887,700	
ファーストリテイリング	18,300	38,005.00	695,491,500	

サンドラッグ	16,500	4,760.00	78,540,000	
東京デリカ	3,900	1,566.00	6,107,400	
ヤマザワ	1,800	1,574.00	2,833,200	
やまや	1,600	2,842.00	4,547,200	
ベルーナ	19,500	532.00	10,374,000	
島根銀行	1,600	1,363.00	2,180,800	
じもとホールディングス	56,100	219.00	12,285,900	
新生銀行	676,000	240.00	162,240,000	
あおぞら銀行	406,000	305.00	123,830,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,920,100	676.00	4,001,987,600	
りそなホールディングス	742,900	569.00	422,710,100	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,535,000	537.00	824,295,000	
三井住友フィナンシャルグループ	591,000	5,359.00	3,167,169,000	
第四銀行	100,000	384.00	38,400,000	
北越銀行	85,000	217.00	18,445,000	
西日本シティ銀行	274,000	288.00	78,912,000	
千葉銀行	301,000	689.00	207,389,000	
横浜銀行	515,000	567.00	292,005,000	
常陽銀行	291,000	527.00	153,357,000	
群馬銀行	175,000	602.00	105,350,000	
武蔵野銀行	12,500	3,555.00	44,437,500	
千葉興業銀行	16,200	790.00	12,798,000	
筑波銀行	32,500	396.00	12,870,000	
東京都民銀行	13,800	1,103.00	15,221,400	
七十七銀行	123,000	515.00	63,345,000	
青森銀行	57,000	282.00	16,074,000	
秋田銀行	54,000	295.00	15,930,000	
山形銀行	48,000	445.00	21,360,000	
岩手銀行	5,100	5,200.00	26,520,000	
東邦銀行	70,000	346.00	24,220,000	
東北銀行	40,000	160.00	6,400,000	
みちのく銀行	42,000	205.00	8,610,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	317,000	450.00	142,650,000	
静岡銀行	229,000	1,082.00	247,778,000	
十六銀行	98,000	392.00	38,416,000	
スルガ銀行	76,000	1,836.00	139,536,000	
八十二銀行	144,000	621.00	89,424,000	
山梨中央銀行	50,000	482.00	24,100,000	
大垣共立銀行	98,000	305.00	29,890,000	
福井銀行	67,000	253.00	16,951,000	
北國銀行	88,000	370.00	32,560,000	
清水銀行	2,700	2,794.00	7,543,800	
滋賀銀行	73,000	538.00	39,274,000	

南都銀行	76,000	390.00	29,640,000	
百五銀行	70,000	452.00	31,640,000	
京都銀行	149,000	883.00	131,567,000	
紀陽銀行	30,700	1,460.00	44,822,000	
三重銀行	32,000	233.00	7,456,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	532,000	215.00	114,380,000	
広島銀行	231,000	425.00	98,175,000	
山陰合同銀行	48,000	776.00	37,248,000	
中国銀行	58,200	1,326.00	77,173,200	
鳥取銀行	25,000	193.00	4,825,000	
伊予銀行	83,600	1,042.00	87,111,200	
百十四銀行	86,000	365.00	31,390,000	
四国銀行	56,000	244.00	13,664,000	
阿波銀行	64,000	521.00	33,344,000	
鹿児島銀行	54,000	667.00	36,018,000	
大分銀行	49,000	414.00	20,286,000	
宮崎銀行	52,000	306.00	15,912,000	
肥後銀行	64,000	581.00	37,184,000	
佐賀銀行	47,000	239.00	11,233,000	
十八銀行	49,000	241.00	11,809,000	
沖縄銀行	5,800	4,055.00	23,519,000	
琉球銀行	15,100	1,416.00	21,381,600	
八千代銀行	3,700	2,904.00	10,744,800	
セブン銀行	292,800	410.00	120,048,000	
みずほフィナンシャルグループ	10,117,700	234.00	2,367,541,800	
高知銀行	30,000	168.00	5,040,000	
山口フィナンシャルグループ	78,000	1,018.00	79,404,000	
長野銀行	26,000	187.00	4,862,000	
名古屋銀行	71,000	369.00	26,199,000	
北洋銀行	117,700	445.00	52,376,500	
愛知銀行	2,800	5,300.00	14,840,000	
第三銀行	44,000	187.00	8,228,000	
中京銀行	32,000	183.00	5,856,000	
東日本銀行	34,000	283.00	9,622,000	
大光銀行	28,000	226.00	6,328,000	
愛媛銀行	46,000	222.00	10,212,000	
トマト銀行	30,000	180.00	5,400,000	
みなと銀行	71,000	180.00	12,780,000	
京葉銀行	64,000	493.00	31,552,000	
関西アーバン銀行	109,000	129.00	14,061,000	
栃木銀行	39,000	437.00	17,043,000	
北日本銀行	2,400	2,662.00	6,388,800	
東和銀行	92,000	116.00	10,672,000	

福島銀行	96,000	100.00	9,600,000	
大東銀行	50,000	127.00	6,350,000	
トモニホールディングス	60,000	427.00	25,620,000	
フィデアホールディングス	45,000	225.00	10,125,000	
池田泉州ホールディングス	58,600	488.00	28,596,800	
ＦＰＧ	6,700	1,062.00	7,115,400	
ＳＢＩホールディングス	94,800	1,475.00	139,830,000	
ジャフコ	10,900	5,440.00	59,296,000	
大和証券グループ本社	775,000	1,005.00	778,875,000	
野村ホールディングス	1,598,400	794.00	1,269,129,600	
岡三証券グループ	62,000	1,050.00	65,100,000	
丸三証券	23,800	1,000.00	23,800,000	
東洋証券	32,000	388.00	12,416,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,800	1,021.00	84,538,800	
水戸証券	25,000	497.00	12,425,000	
いちよし証券	15,700	1,671.00	26,234,700	
松井証券	39,700	1,237.00	49,108,900	
だいこう証券ビジネス	4,900	940.00	4,606,000	
マネックスグループ	85,400	450.00	38,430,000	
カブドットコム証券	30,600	600.00	18,360,000	
極東証券	9,800	2,189.00	21,452,200	
岩井コスモホールディングス	8,200	1,495.00	12,259,000	
マネーパートナーズグループ	7,700	280.00	2,156,000	
ＮＫＳＪホールディングス	173,600	2,957.00	513,335,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	233,600	2,686.00	627,449,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	74,900	1,835.00	137,441,500	
第一生命保険	393,400	1,728.00	679,795,200	
東京海上ホールディングス	302,700	3,291.00	996,185,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	268,100	1,453.00	389,549,300	
全国保証	10,200	4,410.00	44,982,000	
クレディセゾン	64,800	2,691.00	174,376,800	
芙蓉総合リース	8,800	3,950.00	34,760,000	
興銀リース	14,700	3,070.00	45,129,000	
東京センチュリーリース	19,300	3,250.00	62,725,000	
日本証券金融	39,300	781.00	30,693,300	
ポケットカード	11,700	853.00	9,980,100	
リコーリース	5,700	3,080.00	17,556,000	
イオンフィナンシャルサービス	45,700	2,568.00	117,357,600	
アコム	168,400	328.00	55,235,200	
ジャックス	54,000	528.00	28,512,000	
オリエントコーポレーション	188,200	253.00	47,614,600	
日立キャピタル	16,400	2,791.00	45,772,400	

アプラスフィナンシャル	55,000	145.00	7,975,000	
オリックス	481,600	1,748.00	841,836,800	
三菱ＵＦＪリース	201,200	607.00	122,128,400	
日本取引所グループ	116,400	2,680.00	311,952,000	
イー・ギャランティ	4,000	2,523.00	10,092,000	
アサックス	1,400	1,451.00	2,031,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,800	2,741.00	10,415,800	
日本駐車場開発	853	9,540.00	8,137,620	
ヒューリック	131,800	1,356.00	178,720,800	
東京建物不動産販売	4,000	464.00	1,856,000	
三栄建築設計	2,400	907.00	2,176,800	
野村不動産ホールディングス	51,600	2,388.00	123,220,800	
プレサンスコーポレーション	1,400	3,020.00	4,228,000	
常和ホールディングス	2,800	3,805.00	10,654,000	
フージャースホールディングス	11,700	781.00	9,137,700	
オープンハウス	3,100	2,152.00	6,671,200	
東急不動産ホールディングス	173,400	917.00	159,007,800	
飯田グループホールディングス	34,200	1,926.00	65,869,200	
パーク２４	40,800	2,244.00	91,555,200	
パラカ	2,000	850.00	1,700,000	
三井不動産	368,000	3,581.00	1,317,808,000	
三菱地所	547,000	2,902.00	1,587,394,000	
平和不動産	15,800	1,740.00	27,492,000	
東京建物	160,000	1,133.00	181,280,000	
ダイビル	23,000	1,294.00	29,762,000	
京阪神ビルディング	13,000	566.00	7,358,000	
住友不動産	187,000	4,890.00	914,430,000	
大京	132,000	287.00	37,884,000	
テーオーシー	27,000	829.00	22,383,000	
東京楽天地	13,000	503.00	6,539,000	
レオパレス２１	89,800	624.00	56,035,200	
フジ住宅	10,000	745.00	7,450,000	
空港施設	9,500	862.00	8,189,000	
明和地所	3,800	535.00	2,033,000	
住友不動産販売	5,600	3,295.00	18,452,000	
ゴールドクレスト	6,200	3,005.00	18,631,000	
日本エスリード	3,100	1,190.00	3,689,000	
日神不動産	10,500	429.00	4,504,500	
タカラレーベン	26,100	370.00	9,657,000	
サンヨーハウジング名古屋	4,100	1,184.00	4,854,400	
イオンモール	50,400	3,105.00	156,492,000	
ファースト住建	2,200	1,486.00	3,269,200	
トーセイ	10,700	819.00	8,763,300	

穴吹興産	5,000	334.00	1,670,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	48,600	1,131.00	54,966,600	
サンフロンティア不動産	7,400	1,530.00	11,322,000	
エフ・ジェー・ネクスト	3,200	564.00	1,804,800	
ランドビジネス	5,300	495.00	2,623,500	
グランディハウス	4,700	373.00	1,753,100	
日本空港ビルデング	27,000	2,188.00	59,076,000	
日本工営	28,000	462.00	12,936,000	
ネクスト	7,500	1,046.00	7,845,000	
日本M＆Aセンター	4,300	7,610.00	32,723,000	
ノバレーゼ	2,100	776.00	1,629,600	
アコーディア・ゴルフ	33,900	1,411.00	47,832,900	
タケエイ	5,800	1,359.00	7,882,200	
パソナグループ	8,500	723.00	6,145,500	
ＣＤＳ	1,300	1,015.00	1,319,500	
リンクアンドモチベーション	109	24,690.00	2,691,210	
ＧＣＡサヴィアン	4,900	1,037.00	5,081,300	
エス・エム・エス	4,900	2,345.00	11,490,500	
テンプホールディングス	18,100	2,927.00	52,978,700	
リニカル	2,200	1,171.00	2,576,200	
クックパッド	4,900	3,270.00	16,023,000	
エスクリ	3,700	1,043.00	3,859,100	
アイ・ケイ・ケイ	1,900	836.00	1,588,400	
学情	3,300	933.00	3,078,900	
スタジオアリス	3,400	1,392.00	4,732,800	
シミックホールディングス	3,100	1,331.00	4,126,100	
ＮＥＣフィールディング	6,700	1,216.00	8,147,200	
綜合警備保障	30,100	2,019.00	60,771,900	
カカクコム	50,200	2,125.00	106,675,000	
ルネサンス	3,700	889.00	3,289,300	
オプト	3,300	964.00	3,181,200	
ツクイ	9,400	985.00	9,259,000	
綜合臨床ホールディングス	2,400	569.00	1,365,600	
キャリアデザインセンター	21	102,600.00	2,154,600	
エムスリー	274	272,800.00	74,747,200	
ベストブライダル	4,800	651.00	3,124,800	
アウトソーシング	3,600	1,222.00	4,399,200	
ディー・エヌ・エー	44,500	2,228.00	99,146,000	
博報堂ＤＹホールディングス	114,700	853.00	97,839,100	
ぐるなび	5,800	3,045.00	17,661,000	
一休	59	150,000.00	8,850,000	
ジャパンベストレスキューシステム	65	63,700.00	4,140,500	
ジェイコムホールディングス	1,500	789.00	1,183,500	

ＰＧＭホールディングス	11,800	980.00	11,564,000	
バリューコマース	5,600	1,433.00	8,024,800	
ＪＰホールディングス	15,000	483.00	7,245,000	
イーピーエス	89	132,100.00	11,756,900	
アミューズ	2,300	2,152.00	4,949,600	
ドリームインキュベータ	25	178,500.00	4,462,500	
ケネディクス	99,600	504.00	50,198,400	
電通	78,000	4,065.00	317,070,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	2,450.00	9,555,000	
ぴあ	2,400	1,904.00	4,569,600	
イオンファンタジー	2,700	1,572.00	4,244,400	
ネクシィーズ	3,700	1,139.00	4,214,300	
みらかホールディングス	21,700	5,000.00	108,500,000	
アルプス技研	3,300	1,021.00	3,369,300	
サニックス	12,000	1,006.00	12,072,000	
ダイオーズ	1,500	938.00	1,407,000	
日本空調サービス	2,000	1,338.00	2,676,000	
オリエンタルランド	22,400	15,635.00	350,224,000	
ダスキン	22,400	2,047.00	45,852,800	
明光ネットワークジャパン	8,200	1,140.00	9,348,000	
ファルコＳＤホールディングス	4,200	1,285.00	5,397,000	
秀英予備校	3,100	341.00	1,057,100	
田谷	1,300	765.00	994,500	
ラウンドワン	24,700	965.00	23,835,500	
リゾートトラスト	28,200	1,829.00	51,577,800	
ビー・エム・エル	5,400	3,555.00	19,197,000	
ワタベウェディング	2,700	702.00	1,895,400	
もしもしホットライン	15,400	1,153.00	17,756,200	
リソー教育	9,300	585.00	5,440,500	
早稲田アカデミー	1,200	798.00	957,600	
ユー・エス・エス	100,100	1,441.00	144,244,100	
東京個別指導学院	4,000	312.00	1,248,000	
テー・オー・ダブリュー	2,700	707.00	1,908,900	
セントラルスポーツ	2,500	1,610.00	4,025,000	
フルキャストホールディングス	7,800	286.00	2,230,800	
リゾートソリューション	9,000	255.00	2,295,000	
リブセンス	4,100	2,441.00	10,008,100	
ジャパンマテリアル	700	2,186.00	1,530,200	
ＥＲＩホールディングス	1,600	1,206.00	1,929,600	
リロ・ホールディング	3,100	5,550.00	17,205,000	
エイチ・アイ・エス	6,700	5,430.00	36,381,000	
共立メンテナンス	4,200	3,770.00	15,834,000	
イチネンホールディングス	9,800	842.00	8,251,600	

建設技術研究所	4,900	1,143.00	5,600,700	
スペース	4,000	916.00	3,664,000	
燦ホールディングス	1,700	1,447.00	2,459,900	
スバル興業	6,000	396.00	2,376,000	
東京テアトル	32,000	166.00	5,312,000	
よみうりランド	18,000	704.00	12,672,000	
東京都競馬	64,000	403.00	25,792,000	
カナモト	11,000	2,734.00	30,074,000	
東京ドーム	63,000	664.00	41,832,000	
西尾レントオール	4,500	2,806.00	12,627,000	
トランス・コスモス	10,800	2,273.00	24,548,400	
乃村工藝社	16,200	887.00	14,369,400	
藤田観光	21,000	391.00	8,211,000	
日本管財	3,500	2,085.00	7,297,500	
トーカイ	3,700	3,250.00	12,025,000	
白洋舎	11,000	241.00	2,651,000	
セコム	86,000	5,881.00	505,766,000	
セントラル警備保障	3,700	997.00	3,688,900	
丹青社	8,000	749.00	5,992,000	
メイテック	11,400	2,807.00	31,999,800	
アサツー　ディ・ケイ	14,500	2,460.00	35,670,000	
応用地質	7,900	1,698.00	13,414,200	
船井総合研究所	8,500	831.00	7,063,500	
進学会	3,500	441.00	1,543,500	
ベネッセホールディングス	27,700	4,200.00	116,340,000	
イオンディライト	8,000	2,160.00	17,280,000	
ナック	4,100	1,847.00	7,572,700	
ニチイ学館	18,000	882.00	15,876,000	
ダイセキ	12,200	2,069.00	25,241,800	
ステップ	2,500	834.00	2,085,000	
合計	125,964,138	－	144,828,205,240	

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。

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	144,477,601
コール・ローン	2,665,441,974
国債証券	217,810,165,744
派生商品評価勘定	6,940,903
未収利息	2,313,514,590
前払費用	134,280,656
差入委託証拠金	41,646,677
流動資産合計	223,116,468,145
資産合計	223,116,468,145
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,510,172
前受収益	68,568
未払金	2,077,880
未払解約金	767,413,090
流動負債合計	792,069,710
負債合計	792,069,710
純資産の部	
元本等	
元本	90,141,679,369
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	132,182,719,066
元本等合計	222,324,398,435
純資産合計	222,324,398,435
負債純資産合計	223,116,468,145

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20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発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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
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26年 1月20日現在
1. 計算期間の期首元本額	108,288,582,697円
計算期間中の追加設定元本額	24,410,378,762円
計算期間中の一部解約元本額	42,557,282,090円
計算日の元本額	90,141,679,369円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,444,553,911円
外国債券オープン(3ケ月決算型)	221,505,192円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,868,387,432円

財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,292,978,176円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	601,405,797円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,660,691円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,412,649,253円
世界経済インデックスファンド	519,799,960円
マイセレクション25	13,101,996円
マイセレクション50	6,466,823円
マイセレクション75	4,639,380円
DCマイセレクション25	1,010,575,268円
DCマイセレクション50	926,939,540円
DCマイセレクション75	597,195,115円
DC外国債券インデックス・オープン	1,179,031,963円
DCマイセレクションS25	359,921,907円
DCマイセレクションS50	310,564,064円
DCマイセレクションS75	136,891,648円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,752,151円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	41,561,879円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	28,370,468円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	10,142,000円
DC世界経済インデックスファンド	414,630,514円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	10,244,284,631円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	234,340,480円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	22,112,907円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	7,212,196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)	286,046,335円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	970,231,498円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,516,798,336円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	15,041,327,523円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,959,335,492円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,783,928,739円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,228,637,104円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,195,025,561円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,339,958,895円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,877,486,034円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,302,501,881円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,171,731,005円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	488,149,569円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	650,273,505円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,078,499,136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)	892,051,507円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	586,531,677円
外国債券ファンド・シリーズ1	340,034,654円
コア投資戦略ファンド(安定型)	837,853,877円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,004,707,151円
分散投資コア戦略ファンドA	31,244,014円

分散投資コア戦略ファンドS	79,741,866円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
コア投資戦略ファンド(切替型)	18,668,688円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	15,022,015円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	13,787,477円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	2,988,145円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	8,509,205,544円
2. 計算日における受益権総数	90,141,679,369口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4664円 (24,664円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△3,898,362,537
合計	△3,898,362,537

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成26年1月20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26年 1月20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	1,287,117,854	－	1,293,218,063	6,100,209
合計		1,287,117,854	－	1,293,218,063	6,100,209

(注)1. 時価の算定方法
債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 1月20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	884,820,936	－	878,013,200	△6,807,736
	カナダドル	71,334,980	－	70,255,600	△1,079,380
	イギリスポンド	167,379,190	－	165,452,900	△1,926,290
	ユーロ	807,312,472	－	795,456,400	△11,856,072
	計	1,930,847,578	－	1,909,178,100	△21,669,478
合計		1,930,847,578	－	1,909,178,100	△21,669,478

(注)時価の算定方法

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

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

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

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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% 01/15/15	2,000,000.00	2,002,187.50	
		T 0.25% 02/15/15	8,000,000.00	8,007,968.71	
		T 0.25% 04/15/16	18,000,000.00	17,907,539.04	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	14,002,734.34	
		T 0.25% 10/15/15	15,900,000.00	15,882,609.37	
		T 0.375% 02/15/16	3,000,000.00	2,997,656.25	

		T 0.375% 03/15/16	4,800,000.00	4,792,781.23	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,526,953.12	
		T 0.375% 06/15/15	20,200,000.00	20,246,949.24	
		T 0.375% 06/30/15	34,400,000.00	34,479,281.33	
		T 0.625% 07/15/16	13,300,000.00	13,312,728.49	
		T 0.625% 09/30/17	1,000,000.00	981,445.31	
		T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,889,257.80	
		T 0.625% 12/15/16	6,400,000.00	6,376,875.00	
		T 0.75% 02/28/18	10,100,000.00	9,870,185.50	
		T 0.75% 03/31/18	7,500,000.00	7,315,869.15	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,224,566.38	
		T 0.75% 12/31/17	10,000,000.00	9,808,593.80	
		T 0.875% 01/31/18	5,500,000.00	5,411,591.78	
		T 0.875% 09/15/16	5,200,000.00	5,231,078.11	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,404,156.25	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,620,664.04	
		T 1% 09/30/16	7,900,000.00	7,969,279.28	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,807,265.64	
		T 1% 11/30/19	6,300,000.00	5,967,773.46	
		T 1.125% 04/30/20	2,000,000.00	1,887,265.62	
		T 1.125% 12/31/19	10,000,000.00	9,525,781.29	
		T 1.25% 01/31/19	900,000.00	882,685.54	
		T 1.25% 02/29/20	11,000,000.00	10,505,429.66	
		T 1.25% 10/31/19	5,500,000.00	5,302,236.33	
		T 1.25% 11/30/18	9,400,000.00	9,245,781.25	
		T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,335,804.70	
		T 1.375% 05/31/20	3,800,000.00	3,634,863.28	
		T 1.375% 06/30/18	2,200,000.00	2,192,523.43	
		T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	3,869,683.58	
		T 1.375% 11/30/15	27,800,000.00	28,324,507.88	
		T 1.375% 12/31/18	500,000.00	494,306.64	
		T 1.5% 03/31/19	4,400,000.00	4,354,453.13	
		T 1.5% 07/31/16	4,300,000.00	4,397,169.93	
		T 1.5% 08/31/18	5,800,000.00	5,796,375.00	
		T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,149,228.51	
		T 1.625% 11/15/22	8,500,000.00	7,789,287.12	
		T 1.75% 05/15/22	6,000,000.00	5,623,476.54	
		T 1.75% 05/15/23	10,200,000.00	9,346,945.33	
		T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,343,945.35	
		T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,411,380.84	
		T 1.875% 06/30/20	5,200,000.00	5,123,421.88	
		T 1.875% 08/31/17	7,900,000.00	8,119,101.60	

		T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,081,855.48
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,566,552.72
		T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,631,933.56
		T 2% 02/15/22	5,500,000.00	5,286,445.34
		T 2% 02/15/23	12,500,000.00	11,777,587.87
		T 2% 07/31/20	5,200,000.00	5,156,632.83
		T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,319,937.51
		T 2% 11/30/20	5,500,000.00	5,412,880.88
		T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	5,980,263.64
		T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,516,332.03
		T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	5,948,330.09
		T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,079,257.82
		T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	19,668,000.00
		T 2.375% 03/31/16	5,200,000.00	5,417,343.77
		T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,164,531.24
		T 2.375% 06/30/18	550,000.00	572,418.94
		T 2.5% 03/31/15	9,500,000.00	9,761,992.23
		T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,046,171.88
		T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,346,134.77
		T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,262,011.70
		T 2.625% 08/15/20	5,500,000.00	5,666,396.50
		T 2.625% 11/15/20	8,000,000.00	8,212,656.24
		T 2.75% 02/15/19	600,000.00	631,910.15
		T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,021,765.64
		T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,472,187.52
		T 2.75% 08/15/42	7,000,000.00	5,757,089.87
		T 2.75% 11/15/23	5,200,000.00	5,169,531.27
		T 2.75% 11/15/42	9,000,000.00	7,384,921.92
		T 2.75% 11/30/16	200,000.00	211,332.03
		T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,145,349.62
		T 2.875% 05/15/43	9,100,000.00	7,645,599.59
		T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,122,138.66
		T 3% 05/15/42	5,500,000.00	4,782,959.00
		T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,235,763.66
		T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,740,214.83
		T 3.125% 02/15/43	1,000,000.00	887,402.34
		T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	6,956,904.30
		T 3.125% 05/15/19	10,000,000.00	10,709,765.60
		T 3.125% 05/15/21	5,300,000.00	5,584,046.87
		T 3.125% 10/31/16	6,500,000.00	6,931,005.83
		T 3.125% 11/15/41	2,800,000.00	2,506,000.00
		T 3.25% 06/30/16	5,400,000.00	5,752,687.50

		T 3.25% 07/31/16	2,500,000.00	2,667,675.77	
		T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,752,246.08	
		T 3.375% 11/15/19	5,600,000.00	6,064,953.10	
		T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,199,863.26	
		T 3.5% 02/15/39	3,400,000.00	3,308,226.55	
		T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	5,644,681.65	
		T 3.625% 02/15/21	7,000,000.00	7,628,359.41	
		T 3.625% 08/15/19	2,700,000.00	2,960,560.55	
		T 3.75% 08/15/41	6,100,000.00	6,150,634.75	
		T 3.75% 11/15/18	5,000,000.00	5,508,691.40	
		T 3.875% 08/15/40	4,200,000.00	4,341,339.82	
		T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,494,609.38	
		T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,671,121.10	
		T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,045,207.04	
		T 4.25% 05/15/39	600,000.00	660,199.21	
		T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,278,564.50	
		T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,127,472.66	
		T 4.25% 11/15/40	5,000,000.00	5,495,312.50	
		T 4.375% 02/15/38	1,400,000.00	1,570,214.84	
		T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	5,494,316.39	
		T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,240,976.56	
		T 4.375% 11/15/39	4,000,000.00	4,485,703.12	
		T 4.5% 02/15/36	2,500,000.00	2,859,960.95	
		T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	10,932,359.42	
		T 4.5% 05/15/38	1,500,000.00	1,713,896.49	
		T 4.5% 08/15/39	2,900,000.00	3,315,968.75	
		T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,333,953.12	
		T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,572,460.95	
		T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,339,884.76	
		T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,468,923.83	
		T 5.0% 05/15/37	500,000.00	612,031.25	
		T 5.125% 05/15/16	4,800,000.00	5,309,437.48	
		T 5.25% 02/15/29	1,400,000.00	1,723,011.71	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,599,355.47	
		T 5.375% 02/15/31	2,400,000.00	3,012,750.00	
		T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,510,757.80	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,208,074.22	
		T 6.125% 11/15/27	1,650,000.00	2,190,020.51	
		T 6.25% 05/15/30	1,100,000.00	1,502,251.94	
		T 6.25% 08/15/23	2,700,000.00	3,513,849.60	
		T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,336,606.42	
		T 7.5% 11/15/16	3,000,000.00	3,567,480.48	

	T 8.0% 11/15/21	1,700,000.00	2,382,855.47	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	2,809,447.26	
アメリカドル小計		813,000,000.00	827,824,155.31 (86,126,825,118)	
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	200,108.00	
	CAN 1% 11/01/15	1,000,000.00	999,955.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	1,800,000.00	1,778,328.00	
	CAN 1.25% 09/01/18	850,000.00	833,331.50	
	CAN 1.5% 06/01/23	2,100,000.00	1,925,847.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	1,650,000.00	1,655,577.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,800,000.00	1,839,663.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,062,340.00	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,100,000.00	1,088,719.50	
	CAN 2.75% 06/01/22	1,800,000.00	1,853,613.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	2,200,000.00	2,291,586.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,700,000.00	1,762,186.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	1,600,000.00	1,723,496.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	1,900,000.00	2,073,707.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	2,150,000.00	2,338,318.50	
	CAN 3.75% 06/01/19	2,700,000.00	2,967,664.50	
	CAN 4% 06/01/16	2,150,000.00	2,297,500.75	
	CAN 4% 06/01/17	3,100,000.00	3,379,418.50	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,581,381.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	1,948,100.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	6,800,000.00	7,124,598.00	
	CAN 5% 06/01/37	1,950,000.00	2,597,283.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,400,000.00	1,907,542.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,950,000.00	2,747,745.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	650,000.00	1,033,087.25	
カナダドル小計		49,500,000.00	54,011,096.00 (5,132,134,341)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	1,700,000.00	1,505,911.00	
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,000,000.00	913,935.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	850,000.00	730,779.00	
	ACGB 3.25% 10/21/18	200,000.00	199,530.00	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,400,000.00	1,459,129.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	2,750,000.00	2,887,967.50	
	ACGB 4.5% 04/21/33	850,000.00	828,078.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,550,000.00	1,608,334.25	
	ACGB 4.75% 06/15/16	2,900,000.00	3,038,895.50	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,050,000.00	2,127,223.50	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,400,000.00	2,613,132.00	

	ACGB 5.5% 01/21/18	3,000,000.00	3,268,590.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,950,000.00	3,283,232.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,600,000.00	2,927,717.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,300,000.00	2,598,068.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,494,512.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,050,000.00	2,144,628.00	
オーストラリアドル小計		33,750,000.00	35,629,662.75 (3,248,000,056)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,800,000.00	5,726,543.00	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,000,000.00	2,940,450.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	600,000.00	611,931.00	
	UKT 1.75% 07/22/19	1,000,000.00	984,850.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,350,000.00	3,112,099.75	
	UKT 2% 01/22/16	3,100,000.00	3,181,313.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,900,000.00	2,758,770.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	2,950,000.00	3,017,923.75	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,950,000.00	2,772,041.25	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,250,000.00	1,241,306.25	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,850,000.00	1,933,000.25	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,600,000.00	3,928,824.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	2,650,000.00	2,893,707.25	
	UKT 3.75% 09/07/21	2,250,000.00	2,452,252.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,900,000.00	2,114,814.00	
	UKT 4% 03/07/22	2,100,000.00	2,325,939.00	
	UKT 4% 09/07/16	2,900,000.00	3,137,698.50	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,800,000.00	3,126,676.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,000,000.00	3,350,115.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,900,000.00	2,130,318.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	2,011,167.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,470,017.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,300,000.00	2,616,284.50	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,900,000.00	2,181,836.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,100,000.00	2,443,413.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	1,950,000.00	2,198,907.75	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,650,000.00	3,057,106.25	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,800,000.00	3,288,992.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	2,750,000.00	3,162,197.50	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,800,000.00	2,991,632.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,300,000.00	2,716,909.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	2,350,000.00	2,835,545.25	
	UKT 5% 03/07/18	3,300,000.00	3,759,063.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,400,000.00	2,862,912.00	

	UKT 6.0% 12/07/28	1,500,000.00	1,990,935.00	
	UKT 8% 06/07/21	2,300,000.00	3,169,756.50	
	UKT 8% 12/07/15	2,195,000.00	2,502,398.77	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	1,891,102.50	
イギリスポンド小計		92,945,000.00	101,890,748.52 (17,386,637,327)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	110,972.50	
	SWISS 3% 01/08/18	3,100,000.00	3,456,686.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	800,000.00	843,480.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,800,000.00	2,276,325.00	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	398,386.50	
スイスフラン小計		6,100,000.00	7,085,850.00 (807,645,183)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	150,000.00	149,877.75	
	SIGB 0.5% 04/01/18	400,000.00	390,872.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	350,000.00	355,577.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	500,000.00	503,220.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	550,000.00	579,144.50	
	SIGB 2.5% 06/01/19	850,000.00	889,554.75	
	SIGB 2.75% 04/01/42	450,000.00	420,156.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,295,731.25	
	SIGB 2.875% 09/01/30	400,000.00	391,046.00	
	SIGB 3% 09/01/24	400,000.00	412,354.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	953,059.50	
	SIGB 3.25% 09/01/20	450,000.00	485,210.25	
	SIGB 3.375% 09/01/33	200,000.00	207,862.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	800,000.00	852,384.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	800,000.00	868,152.00	
	SIGB 4% 09/01/18	650,000.00	729,657.50	
シンガポールドル小計		9,100,000.00	9,483,858.75 (773,029,326)	
マレーシア リンギット	MGS 3.172% 07/15/16	700,000.00	699,562.50	
	MGS 3.197% 10/15/15	500,000.00	501,015.00	
	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,526,246.75	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,250,000.00	1,188,868.75	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,450,000.00	1,377,159.25	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,550,000.00	1,509,731.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,900,000.00	1,723,775.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,400,000.00	2,386,056.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	3,550,000.00	3,577,068.75	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	2,017,530.00	
	MGS 3.889% 07/31/20	800,000.00	798,852.00	

	MGS 3.892% 03/15/27	350,000.00	329,812.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	664,321.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,300,000.00	2,317,871.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,703,225.25	
	MGS 4.262% 09/15/16	4,300,000.00	4,412,187.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,750,000.00	3,841,706.25	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,100,000.00	1,100,104.50	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,334,963.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,000,000.00	1,083,340.00	
マレーシアリンギット小計		36,100,000.00	36,093,395.50 (1,133,332,618)	
スウェーデンクローナ	SGB 1.5% 11/13/23	13,000,000.00	12,033,320.00	
	SGB 3% 07/12/16	7,600,000.00	7,960,620.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,950,000.00	6,424,125.75	
	SGB 3.5% 06/01/22	8,400,000.00	9,233,784.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	8,600,000.00	9,320,766.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,000,000.00	12,386,825.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	9,350,000.00	9,886,035.50	
	SGB 5% 12/01/20	8,000,000.00	9,534,480.00	
スウェーデンクローナ小計		71,900,000.00	76,779,956.25 (1,231,550,498)	
ノルウェークローネ	NGB 2% 05/24/23	5,400,000.00	5,017,761.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	8,300,000.00	8,927,231.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,500,000.00	9,185,950.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,550,000.00	8,406,170.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,750,000.00	11,256,916.25	
ノルウェークローネ小計		40,500,000.00	42,794,028.25 (721,507,316)	
デンマーククローネ	DGB 1.5% 11/15/23	7,450,000.00	7,227,803.75	
	DGB 2.5% 11/15/16	3,950,000.00	4,193,932.25	
	DGB 3% 11/15/21	13,950,000.00	15,509,819.25	
	DGB 4% 11/15/15	12,600,000.00	13,491,891.00	
	DGB 4% 11/15/17	7,650,000.00	8,664,772.50	
	DGB 4% 11/15/19	12,150,000.00	14,187,737.25	
	DGB 4.5% 11/15/39	16,600,000.00	22,442,370.00	
	DGB 7% 11/10/24	3,500,000.00	5,274,377.50	
デンマーククローネ小計		77,850,000.00	90,992,703.50 (1,714,302,533)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,500,000.00	10,845,830.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	12,000,000.00	11,777,700.00	
	MBONO 5% 06/15/17	16,400,000.00	16,529,888.00	
	MBONO 6% 06/18/15	50,200,000.00	51,760,467.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	18,400,000.00	18,934,336.00	

	MBONO 7.25% 12/15/16	24,400,000.00	26,282,094.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	3,400,000.00	3,648,319.00	
	MBONO 8% 06/11/20	18,700,000.00	20,935,304.50	
	MBONO 8% 12/07/23	27,100,000.00	30,413,517.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	44,300,000.00	50,560,919.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	29,500,000.00	32,761,225.00	
メキシコペソ小計		252,900,000.00	274,449,599.50 (2,151,684,860)	
ポーランドズロチ	POLGB 2.5% 07/25/18	1,600,000.00	1,531,048.00	
	POLGB 3.75% 04/25/18	5,000,000.00	5,060,050.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,900,000.00	2,824,208.50	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,199,498.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	4,350,000.00	4,544,184.00	
	POLGB 5% 04/25/16	2,300,000.00	2,402,120.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	5,600,000.00	5,977,216.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,436,864.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	2,150,000.00	2,224,497.50	
	POLGB 5.5% 10/25/19	3,700,000.00	4,020,198.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,550,000.00	1,732,551.25	
	POLGB 5.75% 09/23/22	4,150,000.00	4,583,571.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,086,902.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	10,500,000.00	11,120,497.50	
ポーランドズロチ小計		51,900,000.00	54,743,406.00 (1,848,684,820)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	19,600,000.00	22,948,856.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	12,650,000.00	9,273,651.75	
	SAGB 6.5% 02/28/41	10,850,000.00	7,992,164.25	
	SAGB 6.75% 03/31/21	14,000,000.00	13,217,260.00	
	SAGB 7% 02/28/31	10,600,000.00	8,854,074.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	12,000,000.00	11,789,100.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	5,300,000.00	5,207,780.00	
	SAGB 8% 12/21/18	12,000,000.00	12,319,920.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	11,600,000.00	12,042,598.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	4,350,000.00	4,135,392.75	
南アフリカランド小計		112,950,000.00	107,780,796.75 (1,029,306,608)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	1,100,000.00	1,110,433.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	700,000.00	694,466.50	
	BGB 3% 09/28/19	1,050,000.00	1,140,567.75	
	BGB 3.25% 09/28/16	2,900,000.00	3,116,224.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,038,655.00	
	BGB 3.75% 06/22/45	650,000.00	690,010.75	

		BGB 3.75% 09/28/15	2,000,000.00	2,117,580.00
		BGB 3.75% 09/28/20	2,650,000.00	3,003,019.75
		BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,589,765.50
		BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,555,390.00
		BGB 4% 03/28/32	1,100,000.00	1,234,062.50
		BGB 4.0% 03/28/17	2,500,000.00	2,766,262.50
		BGB 4.0% 03/28/19	1,700,000.00	1,936,878.00
		BGB 4.25% 03/28/41	1,650,000.00	1,924,056.75
		BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,400,358.00
		BGB 4.25% 09/28/22	3,100,000.00	3,608,632.50
		BGB 4.5% 03/28/26	950,000.00	1,125,441.25
		BGB 5% 03/28/35	2,550,000.00	3,250,089.75
		BGB 5.5% 03/28/28	2,450,000.00	3,198,242.25
		BGB 5.5% 09/28/17	1,900,000.00	2,226,999.50
		BGB 8.0% 03/28/15	900,000.00	982,426.50
		BTNS 1% 07/25/17	3,000,000.00	3,033,855.00
		BTNS 1.75% 02/25/17	1,600,000.00	1,659,192.00
		BTNS 2% 07/12/15	1,700,000.00	1,744,242.50
		BTNS 2.25% 02/25/16	3,200,000.00	3,329,792.00
		BTNS 2.5% 01/15/15	800,000.00	818,136.00
		BTNS 2.5% 07/25/16	4,000,000.00	4,210,820.00
		BTPS 2.75% 12/01/15	2,300,000.00	2,371,277.00
		BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,899,712.00
		BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	5,043,055.50
		BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,897,678.00
		BTPS 3.5% 11/01/17	800,000.00	843,124.00
		BTPS 3.5% 12/01/18	1,900,000.00	1,996,111.50
		BTPS 3.75% 03/01/21	2,600,000.00	2,711,150.00
		BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,320,791.00
		BTPS 3.75% 08/01/15	5,500,000.00	5,730,642.50
		BTPS 3.75% 08/01/16	6,300,000.00	6,666,975.00
		BTPS 3.75% 08/01/21	4,800,000.00	4,990,512.00
		BTPS 4% 02/01/17	5,500,000.00	5,875,705.00
		BTPS 4% 02/01/37	3,600,000.00	3,421,782.00
		BTPS 4% 09/01/20	2,900,000.00	3,093,459.00
		BTPS 4.25% 02/01/15	2,500,000.00	2,589,600.00
		BTPS 4.25% 02/01/19	3,800,000.00	4,126,021.00
		BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,187,917.50
		BTPS 4.25% 09/01/19	2,650,000.00	2,875,091.00
		BTPS 4.5% 02/01/18	2,800,000.00	3,055,934.00
		BTPS 4.5% 02/01/20	3,750,000.00	4,102,387.50
		BTPS 4.5% 03/01/19	4,350,000.00	4,778,105.25

		BTPS 4.5% 03/01/24	2,150,000.00	2,279,139.75
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,700,000.00	2,853,373.50
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,150,000.00	3,358,341.00
		BTPS 4.5% 08/01/18	6,900,000.00	7,564,332.00
		BTPS 4.75% 06/01/17	3,800,000.00	4,153,001.00
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,700,000.00	4,027,487.00
		BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,405,540.00
		BTPS 4.75% 09/01/44	900,000.00	924,871.50
		BTPS 4.75% 09/15/16	2,400,000.00	2,603,844.00
		BTPS 5% 03/01/22	2,350,000.00	2,613,634.75
		BTPS 5% 03/01/25	3,000,000.00	3,288,540.00
		BTPS 5% 08/01/34	3,100,000.00	3,336,003.00
		BTPS 5% 09/01/40	3,100,000.00	3,305,840.00
		BTPS 5.0% 08/01/39	2,800,000.00	2,996,042.00
		BTPS 5.25% 08/01/17	3,050,000.00	3,394,299.25
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,800,000.00	4,230,122.00
		BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,403,072.00
		BTPS 5.5% 11/01/22	4,100,000.00	4,696,755.00
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,300,000.00	2,702,477.00
		BTPS 6% 05/01/31	4,300,000.00	5,163,805.50
		BTPS 6.5% 11/01/27	5,400,000.00	6,730,587.00
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,502,556.50
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,145,492.00
		DBR 1.5% 02/15/23	3,600,000.00	3,549,312.00
		DBR 1.5% 05/15/23	3,950,000.00	3,877,023.75
		DBR 1.5% 09/04/22	2,900,000.00	2,880,671.50
		DBR 1.75% 07/04/22	3,100,000.00	3,152,855.00
		DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,710,734.00
		DBR 2.25% 09/04/20	2,100,000.00	2,250,517.50
		DBR 2.25% 09/04/21	2,800,000.00	2,982,798.00
		DBR 2.5% 01/04/21	2,700,000.00	2,931,727.50
		DBR 2.5% 07/04/44	2,300,000.00	2,229,056.50
		DBR 3% 07/04/20	2,800,000.00	3,133,732.00
		DBR 3.25% 01/04/20	3,600,000.00	4,071,042.00
		DBR 3.25% 07/04/15	8,800,000.00	9,196,396.00
		DBR 3.25% 07/04/21	2,300,000.00	2,617,480.50
		DBR 3.25% 07/04/42	1,950,000.00	2,184,828.75
		DBR 3.5% 01/04/16	5,800,000.00	6,177,522.00
		DBR 3.5% 07/04/19	3,500,000.00	3,989,020.00
		DBR 3.75% 01/04/17	2,600,000.00	2,864,056.00
		DBR 3.75% 01/04/19	3,150,000.00	3,607,632.00
		DBR 4% 07/04/16	3,600,000.00	3,932,568.00

DBR 4.0% 01/04/18	3,300,000.00	3,751,440.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,500,000.00	4,321,467.50	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,622,448.00	
DBR 4.25% 07/04/18	4,150,000.00	4,807,961.75	
DBR 4.25% 07/04/39	2,000,000.00	2,592,790.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,000,000.00	2,597,560.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,600,000.00	3,493,425.00	
DBR 4.75% 07/04/40	2,250,000.00	3,147,142.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,450,000.00	3,470,976.25	
DBR 5.625% 01/04/28	1,600,000.00	2,242,456.00	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	637,856.80	
DBR 6.25% 01/04/24	1,600,000.00	2,252,656.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,883,425.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,450,000.00	2,178,980.25	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,300,000.00	2,299,091.50	
FRTR 1% 05/25/18	2,500,000.00	2,507,487.50	
FRTR 1% 11/25/18	2,500,000.00	2,489,600.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	3,600,000.00	3,465,666.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	500,000.00	492,725.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	4,200,000.00	4,263,441.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,200,000.00	5,508,906.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	2,350,000.00	2,336,182.00	
FRTR 3% 04/25/22	3,800,000.00	4,108,674.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,242,625.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	4,400,000.00	4,687,782.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	850,000.00	833,803.25	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,580,355.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,224,690.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	4,900,000.00	5,501,916.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,800,000.00	5,227,536.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	5,300,000.00	5,840,414.50	
FRTR 3.75% 04/25/21	5,800,000.00	6,612,435.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	2,300,000.00	2,610,201.00	
FRTR 4% 04/25/18	3,800,000.00	4,294,589.00	
FRTR 4% 04/25/55	1,950,000.00	2,208,180.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,350,000.00	1,530,447.75	
FRTR 4% 10/25/38	3,350,000.00	3,794,277.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,600,000.00	7,630,953.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,000,000.00	4,521,800.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	4,800,000.00	5,517,864.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,100,000.00	5,980,744.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,650,000.00	4,463,931.75	

		FRTR 4.75% 04/25/35	2,900,000.00	3,626,116.50
		FRTR 5% 10/25/16	5,000,000.00	5,626,325.00
		FRTR 5.5% 04/25/29	3,700,000.00	4,892,380.50
		FRTR 5.75% 10/25/32	3,550,000.00	4,936,257.25
		FRTR 6.0% 10/25/25	2,400,000.00	3,240,060.00
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,535,985.00
		FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,567,944.00
		IRISH 3.9% 03/20/23	800,000.00	846,304.00
		IRISH 4.4% 06/18/19	1,100,000.00	1,228,689.00
		IRISH 4.5% 02/18/15	700,000.00	731,545.50
		IRISH 4.5% 04/18/20	3,100,000.00	3,463,397.50
		IRISH 4.5% 10/18/18	800,000.00	898,168.00
		IRISH 4.6% 04/18/16	1,800,000.00	1,951,371.00
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,950,000.00	2,259,552.75
		IRISH 5.5% 10/18/17	500,000.00	572,065.00
		IRISH 5.9% 10/18/19	700,000.00	836,430.00
		NETHER 0.75% 04/15/15	1,600,000.00	1,611,184.00
		NETHER 1.25% 01/15/18	1,750,000.00	1,784,265.00
		NETHER 1.25% 01/15/19	600,000.00	606,390.00
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,650,000.00	1,605,928.50
		NETHER 2.25% 07/15/22	2,400,000.00	2,473,632.00
		NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,225,317.50
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,400,000.00	1,353,646.00
		NETHER 2.75% 01/15/15	1,100,000.00	1,127,802.50
		NETHER 3.25% 07/15/15	3,550,000.00	3,709,483.75
		NETHER 3.25% 07/15/21	2,300,000.00	2,559,842.50
		NETHER 3.5% 07/15/20	2,250,000.00	2,543,208.75
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,700,000.00	1,954,371.00
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,000,000.00	2,373,080.00
		NETHER 4% 01/15/37	1,800,000.00	2,177,190.00
		NETHER 4% 07/15/16	3,800,000.00	4,142,361.00
		NETHER 4% 07/15/19	2,400,000.00	2,762,340.00
		NETHER 4.0% 07/15/18	2,550,000.00	2,898,087.75
		NETHER 4.5% 07/15/17	2,100,000.00	2,380,371.00
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,800,000.00	2,438,703.00
		NETHER 7.5% 01/15/23	550,000.00	802,928.50
		OBL 0.5% 02/23/18	4,000,000.00	3,987,300.00
		OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,410,920.00
		OBL 0.5% 10/13/17	450,000.00	450,645.75
		OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,038,700.00
		OBL 1% 10/12/18	2,000,000.00	2,023,950.00
		OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	513,507.50

		OBL 1.75% 10/09/15	3,800,000.00	3,904,500.00
		OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,590,072.50
		OBL 2.5% 02/27/15	5,200,000.00	5,336,162.00
		OBL 2.75% 04/08/16	4,100,000.00	4,331,834.50
		RAGB 1.75% 10/20/23	900,000.00	873,175.50
		RAGB 2.4% 05/23/34	350,000.00	329,775.25
		RAGB 3.15% 06/20/44	600,000.00	631,413.00
		RAGB 3.2% 02/20/17	1,050,000.00	1,137,459.75
		RAGB 3.4% 11/22/22	1,150,000.00	1,285,498.75
		RAGB 3.5% 07/15/15	1,400,000.00	1,468,047.00
		RAGB 3.5% 09/15/21	2,200,000.00	2,480,027.00
		RAGB 3.65% 04/20/22	1,100,000.00	1,252,823.00
		RAGB 3.8% 01/26/62	450,000.00	552,147.75
		RAGB 3.9% 07/15/20	2,200,000.00	2,532,904.00
		RAGB 4% 09/15/16	2,050,000.00	2,245,703.25
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,700,000.00	2,071,985.50
		RAGB 4.3% 09/15/17	950,000.00	1,074,792.00
		RAGB 4.35% 03/15/19	2,050,000.00	2,385,154.50
		RAGB 4.65% 01/15/18	2,800,000.00	3,228,036.00
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,050,000.00	1,323,231.00
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,100,000.00	1,573,121.00
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	625,488.50
		RFGB 1.625% 09/15/22	750,000.00	736,275.00
		RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	619,617.00
		RFGB 2.625% 07/04/42	450,000.00	436,857.75
		RFGB 2.75% 07/04/28	650,000.00	667,579.25
		RFGB 3.375% 04/15/20	750,000.00	841,053.75
		RFGB 3.5% 04/15/21	700,000.00	791,679.00
		RFGB 3.875% 09/15/17	2,100,000.00	2,344,849.50
		RFGB 4% 07/04/25	850,000.00	998,452.50
		RFGB 4.25% 07/04/15	1,000,000.00	1,058,940.00
		RFGB 4.375% 07/04/19	900,000.00	1,054,134.00
		SPGB 3% 04/30/15	1,800,000.00	1,849,221.00
		SPGB 3.15% 01/31/16	5,600,000.00	5,829,600.00
		SPGB 3.25% 04/30/16	1,600,000.00	1,671,080.00
		SPGB 3.3% 07/30/16	1,800,000.00	1,884,960.00
		SPGB 3.75% 10/31/15	1,400,000.00	1,467,578.00
		SPGB 3.75% 10/31/18	550,000.00	587,072.75
		SPGB 3.8% 01/31/17	3,700,000.00	3,951,322.50
		SPGB 4% 04/30/20	2,350,000.00	2,514,605.75
		SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,762,325.75
		SPGB 4.1% 07/30/18	5,900,000.00	6,401,264.00

		SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,011,695.00	
		SPGB 4.25% 10/31/16	4,000,000.00	4,304,560.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	2,700,000.00	2,951,478.00	
		SPGB 4.4% 01/31/15	2,850,000.00	2,956,376.25	
		SPGB 4.5% 01/31/18	2,100,000.00	2,303,122.50	
		SPGB 4.6% 07/30/19	2,600,000.00	2,882,919.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,400,000.00	2,569,248.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,550,000.00	1,582,534.50	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,500,000.00	1,629,892.50	
		SPGB 4.85% 10/31/20	2,950,000.00	3,291,949.25	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,000,000.00	2,104,770.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	950,000.00	1,052,215.25	
		SPGB 5.15% 10/31/44	650,000.00	702,919.75	
		SPGB 5.4% 01/31/23	5,050,000.00	5,738,087.75	
		SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,920,064.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	2,350,000.00	2,651,951.50	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,670,603.75	
		SPGB 5.85% 01/31/22	2,500,000.00	2,930,862.50	
		SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,547,253.50	
		SPGB 6.0% 01/31/29	2,250,000.00	2,704,680.00	
	ユーロ小計		607,930,000.00	672,254,411.30 (94,505,525,140)	
国債証券合計				217,810,165,744 (217,810,165,744)	
合計				217,810,165,744 (217,810,165,744)	

(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	134銘柄	100.0%	39.5%
カナダドル	国債証券	25銘柄	100.0%	2.4%
オーストラリアドル	国債証券	17銘柄	100.0%	1.5%
イギリスポンド	国債証券	38銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.8%

メキシコペソ	国債証券	11銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	10銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券	236銘柄	100.0%	43.4%

(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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,119,670,544
コール・ローン	341,751,672
株式	156,832,227,940
投資信託受益証券	102,181,275
投資証券	3,012,976,841
派生商品評価勘定	139,329,554
未収入金	1,170,770
未収配当金	144,252,793
未収利息	459
差入委託証拠金	1,131,366,143
流動資産合計	165,824,927,991
資産合計	165,824,927,991

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,064,335
未払解約金	418,087,326
流動負債合計	419,151,661
負債合計	419,151,661
純資産の部	
元本等	
元本	100,196,822,690
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	65,208,953,640
元本等合計	165,405,776,330
純資産合計	165,405,776,330
負債純資産合計	165,824,927,991

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
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26年 1月20日現在
1.　計算期間の期首元本額	130,579,100,449円
計算期間中の追加設定元本額	16,262,425,368円
計算期間中の一部解約元本額	46,644,703,127円
計算日の元本額	100,196,822,690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)	1,045,221,766円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,953,492円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,434,849,749円
世界経済インデックスファンド	834,174,449円
マイセレクション25	11,009,276円
マイセレクション50	28,845,261円
マイセレクション75	37,639,091円
外国株式インデックス・オープン	1,030,189,390円
DCマイセレクション25	818,884,568円
DCマイセレクション50	4,509,196,016円
DCマイセレクション75	4,861,371,837円
DC外国株式インデックス・オープン	5,458,625,132円
DCマイセレクションS25	299,610,863円
DCマイセレクションS50	1,544,732,777円
DCマイセレクションS75	1,122,689,268円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	5,676,079円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	148,375,041円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	147,443,686円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	69,055,221円

DC世界経済インデックスファンド	668,560,015円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	11,619,314,037円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	99,902,484円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	55,339,344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)	311,451,447円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	620,330,445円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,275,144,832円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,700,916,967円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,836,985,646円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,106,220,446円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	992,578,376円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,258,520,088円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	10,063,482,420円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,007,948,096円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,034,622,960円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,102,916,363円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	339,517,849円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,790,658,755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)	5,027,041,706円
外国株式ファンド・シリーズ1	691,388,560円
コア投資戦略ファンド(安定型)	750,267,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,198,216,994円
分散投資コア戦略ファンドA	27,946,649円
分散投資コア戦略ファンドS	94,889,419円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	22,520,964円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	71,240,909円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	6,963,536円
2.　計算日における受益権総数	100,196,822,690口
3.　1口当たり純資産額	1.6508円
(1万口当たり純資産額)	(16,508円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	13,981,490,818
投資信託受益証券	△1,625,955
投資証券	△290,808,950
合計	13,689,055,913

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年5月30日から平成26年1月20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26年 1月20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	5,389,636,540	－	5,527,147,039	137,510,499
合計		5,389,636,540	－	5,527,147,039	137,510,499

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 1月20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	103,195,510	－	102,989,700	△205,810
	カナダドル	10,451,320	－	10,451,100	△220
	イギリスポンド	10,238,040	－	10,237,800	△240
	ユーロ	25,590,960	－	25,302,600	△288,360
	計	149,475,830	－	148,981,200	△494,630
	売　建				
	アメリカドル	105,915,670	－	105,070,300	845,370
	カナダドル	16,262,880	－	16,151,700	111,180
	イギリスポンド	54,894,400	－	54,601,600	292,800
	計	177,072,950	－	175,823,600	1,249,350
合計		326,548,780	－	324,804,800	754,720

(注)時価の算定方法

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

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

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

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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	26,439	80.06	2,116,706.34	
	APACHE CORP	20,455	84.31	1,724,561.05	
	BAKER HUGHES	23,207	54.14	1,256,426.98	
	CABOT OIL & GAS CORP	21,935	37.48	822,123.80	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	12,793	58.69	750,821.17	
	CHENIERE ENERGY INC	10,879	45.93	499,672.47	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	27,697	25.45	704,888.65	
	CHEVRON CORP	102,035	119.29	12,171,755.15	
	CIMAREX ENERGY CO	4,865	101.38	493,213.70	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	14,569	16.52	240,679.88	
	CONCHO RESOURCES INC	5,666	99.60	564,333.60	
	CONOCOPHILLIPS	61,254	67.51	4,135,257.54	
	CONSOL ENERGY INC	12,855	38.21	491,189.55	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,577	108.46	279,501.42	
	CORE LABORATORIES N.V.	2,348	191.01	448,491.48	
	DENBURY RESOURCES INC	18,996	16.26	308,874.96	
	DEVON ENERGY CORPORATION	20,190	59.01	1,191,411.90	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	3,474	54.10	187,943.40	
	ENERGEN CORP	3,649	68.53	250,065.97	
	ENSCO PLC-CL A	12,142	54.60	662,953.20	
	EOG RESOURCES INC	14,328	168.96	2,420,858.88	
	EQT CORPORATION	7,819	87.62	685,100.78	
	EXXON MOBIL	232,557	99.16	23,060,352.12	

FMC TECHNOLOGIES INC	12,792	51.00	652,392.00	
HALLIBURTON CO	44,467	50.66	2,252,698.22	
HELMERICH & PAYNE	5,975	85.65	511,758.75	
HESS CORP	16,190	77.13	1,248,734.70	
HOLLYFRONTIER CORP	9,792	48.00	470,016.00	
KINDER MORGAN INC	35,252	35.57	1,253,913.64	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,825	76.05	442,991.25	
MARATHON OIL CORP	37,186	33.96	1,262,836.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	16,413	85.28	1,399,700.64	
MURPHY OIL CORP	9,795	62.77	614,832.15	
NABORS INDUSTRIES LTD	16,302	17.28	281,698.56	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	22,453	76.97	1,728,207.41	
NOBLE CORP PLC	14,269	35.39	504,979.91	
NOBLE ENERGY INC	18,804	63.90	1,201,575.60	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	42,469	90.57	3,846,417.33	
OCEANEERING INTL INC	6,088	74.67	454,590.96	
PEABODY ENERGY CORP	14,207	17.97	255,299.79	
PHILLIPS 66	30,518	76.02	2,319,978.36	
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,257	174.70	1,267,797.90	
QEP RESOURCES INC	9,981	29.98	299,230.38	
RANGE RESOURCES CORP	8,831	82.64	729,793.84	
ROWAN COMPANIES PLC	7,231	32.75	236,815.25	
SCHLUMBERGER	69,811	90.21	6,297,650.31	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	19,018	39.33	747,977.94	
SPECTRA ENERGY CORP	35,024	35.09	1,228,992.16	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	9,499	26.11	248,018.89	
TESORO CORP	7,212	52.58	379,206.96	
VALERO ENERGY CORP	28,403	51.42	1,460,482.26	
WEATHERFORD INTL LTD	39,815	14.68	584,484.20	
WHITING PETROLEUM CORP	6,704	59.57	399,357.28	
WILLIAMS COS	35,775	39.22	1,403,095.50	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	10,997	112.01	1,231,773.97	
AIRGAS INC	3,393	112.15	380,524.95	
ALBEMARLE CORP	4,304	66.00	284,064.00	
ALCOA	57,641	11.36	654,801.76	
ASHLAND INC	3,915	98.90	387,193.50	
AVERY DENNISON CORP	4,954	51.15	253,397.10	
BALL CORP	7,358	50.53	371,799.74	
CELANESE CORP-SERIES A	8,241	55.10	454,079.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,105	245.81	763,240.05	
CROWN HOLDINGS INC	7,486	42.48	318,005.28	
DOW CHEMICAL CO	63,825	43.07	2,748,942.75	

DU PONT (E.I) DE NEMOURS	48,735	64.02	3,120,014.70	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,354	79.88	667,317.52	
ECOLAB INC	14,258	104.15	1,484,970.70	
FMC CORP	7,358	75.52	555,676.16	
FREEPORT-MCMOR-B	54,643	36.19	1,977,530.17	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,194	87.02	364,961.88	
INT'L PAPER CO	23,118	48.34	1,117,524.12	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,384	81.40	1,822,057.60	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,327	108.15	251,665.05	
MEADWESTVACO CORP	10,334	37.32	385,664.88	
MONSANTO CO	28,142	113.11	3,183,141.62	
MOSAIC CO/THE	15,495	48.54	752,127.30	
NEWMONT MINING CORP	27,014	24.55	663,193.70	
NUCOR CORP	16,622	51.38	854,038.36	
OWENS-ILLINOIS INC	8,238	33.85	278,856.30	
PPG INDUSTRIES INC	7,507	189.48	1,422,426.36	
PRAXAIR INC	15,527	132.44	2,056,395.88	
ROCK-TENN COMPANY -CL A	3,687	99.82	368,036.34	
SEALED AIR CORP	9,873	33.06	326,401.38	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,752	194.12	922,458.24	
SIGMA-ALDRICH	6,492	92.51	600,574.92	
VULCAN MATERIALS CO	6,674	59.65	398,104.10	
3 M COMPANY	34,230	137.31	4,700,121.30	
AGCO CORP	5,665	55.41	313,897.65	
AMETEK INC	13,197	52.02	686,507.94	
B/E AEROSPACE INC	5,493	83.70	459,764.10	
BOEING CO	37,799	140.46	5,309,247.54	
CATERPILLAR	34,093	91.44	3,117,463.92	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV	5,158	82.86	427,391.88	
CUMMINS INC	9,312	137.74	1,282,634.88	
DANAHER CORP	31,094	77.87	2,421,289.78	
DEERE&CO	19,083	89.35	1,705,066.05	
DOVER CORP	9,268	95.11	881,479.48	
EATON CORP	24,885	76.85	1,912,412.25	
EMERSON ELECTRIC CO	37,593	69.12	2,598,428.16	
FASTENAL CO	14,654	47.61	697,676.94	
FLOWSERVE CORP	7,263	77.12	560,122.56	
FLUOR CORP	8,820	82.05	723,681.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,589	95.47	1,488,281.83	
GENERAL ELECTRIC CO	537,900	26.58	14,297,382.00	
GRAINGER (WW) INC	3,076	264.10	812,371.60	
HONEYWELL INTL INC	39,279	89.95	3,533,146.05	

ILLINOIS TOOL WORKS	22,341	82.66	1,846,707.06	
INGERSOLL-RAND PLC	15,849	62.32	987,709.68	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,748	65.73	443,546.04	
JOY GLOBAL INC	6,186	56.23	347,838.78	
KBR INC	8,182	32.86	268,860.52	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	4,812	107.57	517,626.84	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,335	153.82	2,205,009.70	
MASCO CORP	19,054	22.10	421,093.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,452	118.24	1,354,084.48	
PACCAR INC	19,281	59.53	1,147,797.93	
PALL CORP	5,994	83.50	500,499.00	
PARKER HANNIFIN CORP	7,784	127.43	991,915.12	
PENTAIR LTD	10,793	77.60	837,536.80	
PRECISION CASTPARTS CORP	7,647	270.62	2,069,431.14	
QUANTA SERVICES INC	12,193	31.64	385,786.52	
RAYTHEON COMPANY	16,911	90.07	1,523,173.77	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,527	119.23	897,444.21	
ROCKWELL COLLIN	6,615	77.58	513,191.70	
ROPER INDUSTRIES INC	5,151	140.04	721,346.04	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	38.63	270,410.00	
SPX CORP	1,919	104.37	200,286.03	
STANLEY BLACK&DECKER	8,226	81.17	667,704.42	
TEXTRON	14,466	36.10	522,222.60	
TRANSDIGM GROUP INC	2,832	173.21	490,530.72	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	45,969	114.21	5,250,119.49	
XYLEM INC	10,787	36.57	394,480.59	
ADT CORPORATION	10,721	39.66	425,194.86	
CINTAS CORP	6,063	59.13	358,505.19	
DUN & BRADSTREET CORP	2,027	118.97	241,152.19	
EQUIFAX INC	6,491	70.73	459,108.43	
IHS INC-CLASS A	3,148	117.11	368,662.28	
IRON MOUNTAIN INC	8,702	27.51	239,392.02	
MANPOWER GROUP	4,455	85.57	381,214.35	
NIELSEN HOLDINGS NV	12,159	44.42	540,102.78	
REPUBLIC SERVICES INC	15,596	32.25	502,971.00	
ROBERT HALF INTL INC	7,318	42.13	308,307.34	
STERICYCLE INC	4,626	120.13	555,721.38	
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,488	128.84	449,393.92	
TYCO INTERNATIONAL LTD	25,136	41.38	1,040,127.68	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,126	63.45	515,594.70	
WASTE MANAGEMENT INC	23,275	43.12	1,003,618.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,571	59.13	506,803.23	

CSX CORP	53,420	27.23	1,454,626.60	
DELTA AIR LINES INC	12,452	31.07	386,883.64	
EXPEDITORS INTL WASH INC	11,078	43.77	484,884.06	
FEDEX CORP	15,790	140.51	2,218,652.90	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	21,579	27.08	584,359.32	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,793	77.59	371,888.87	
KANSAS CITY SOUTHERN	5,728	116.31	666,223.68	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,355	88.99	1,455,431.45	
SOUTHWEST AIRLINES CO	10,842	21.22	230,067.24	
UNION PACIFIC CORP	24,447	167.84	4,103,184.48	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	47.07	253,754.37	
UNITED PARCEL SERVICE B	38,026	99.91	3,799,177.66	
AUTOLIV INC	4,931	91.01	448,770.31	
BORGWARNER INC	12,370	55.81	690,369.70	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	16,018	62.70	1,004,328.60	
FORD MOTOR COMPANY	193,589	16.52	3,198,090.28	
GENERAL MOTORS CO	50,912	38.60	1,965,203.20	
HARLEY-DAVIDSON	11,611	67.58	784,671.38	
JOHNSON CONTROLS INC	35,927	51.06	1,834,432.62	
TESLA MOTORS INC	4,397	170.01	747,533.97	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	6,284	75.74	475,950.16	
COACH INC	14,691	52.56	772,158.96	
DR HORTON INC	16,578	21.59	357,919.02	
FOSSIL GROUP INC	2,953	115.09	339,860.77	
GARMIN LTD	6,856	46.66	319,900.96	
HASBRO INC	5,948	52.00	309,296.00	
LEGGETT & PLATT INC	7,102	29.75	211,284.50	
LENNAR CORP-CL A	9,411	37.48	352,724.28	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,197	47.49	246,805.53	
MATTEL INC	17,952	44.00	789,888.00	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	10,472	77.03	806,658.16	
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,306	146.76	485,188.56	
NEWELL RUBBERMAID	14,823	31.77	470,926.71	
NIKE B	37,508	73.39	2,752,712.12	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,368	136.89	461,045.52	
PULTE GROUP INC	17,827	19.36	345,130.72	
PVH CORP	4,194	123.80	519,217.20	
RALPH LAUREN CORPORATION	3,265	162.49	530,529.85	
TOLL BROTHERS INC	8,144	35.96	292,858.24	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,123	81.99	338,044.77	
VF CORP	19,156	58.79	1,126,181.24	
WHIRLPOOL CORP	4,283	156.84	671,745.72	

BLOCK H & R INC	14,023	29.03	407,087.69	
CARNIVAL CORPORATION	19,994	41.36	826,951.84	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,609	527.61	848,924.49	
DARDEN RESTAURANTS INC	6,661	50.96	339,444.56	
INT'L GAME TECHNOLOGY	13,093	17.77	232,662.61	
LAS VEGAS SANDS CORP	21,614	81.93	1,770,835.02	
MARRIOTT INTL A	12,563	50.62	635,939.06	
MCDONALD'S CORP	52,720	94.93	5,004,709.60	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	20,081	26.41	530,339.21	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,853	49.56	389,194.68	
STARBUCKS CORP	39,573	74.90	2,964,017.70	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,144	78.87	800,057.28	
WYMDHAM WORLDWIDE CORP	7,142	74.37	531,150.54	
WYNN RESORTS LTD	4,379	215.70	944,550.30	
YUM BRANDS INC	23,434	72.10	1,689,591.40	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	10,601	16.36	173,432.36	
CBS CORP-CL B	29,691	60.49	1,796,008.59	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,255	134.29	437,113.95	
COMCAST CORP-CL A	112,545	53.54	6,025,659.30	
COMCAST CORP-SPECIAL A	25,221	51.65	1,302,664.65	
DIRECTV	27,391	71.65	1,962,565.15	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	7,963	80.91	644,286.33	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	4,757	74.53	354,539.21	
DISH NETWORK CORPORATION-A	11,313	54.85	620,518.05	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	21,619	17.46	377,467.74	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,072	87.80	972,121.60	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	8,926	82.98	740,679.48	
LIBERTY MEDIA CORP	4,893	137.32	671,906.76	
NEWS CORP-CLASS A	20,142	17.08	344,025.36	
OMNICOM GROUP	14,198	74.20	1,053,491.60	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	4,261	74.17	316,038.37	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	167,674	3.71	622,908.91	
THE WALT DISNEY CO	89,546	73.98	6,624,613.08	
TIME WARNER CABLE-A	15,020	135.71	2,038,364.20	
TIME WARNER INC	48,452	64.40	3,120,308.80	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS A	79,784	32.04	2,556,279.36	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	22,853	31.46	718,955.38	
VIACOM INC-CLASS B	22,359	83.08	1,857,585.72	
ADVANCE AUTO PARTS	3,734	118.44	442,254.96	
AMAZON.COM	19,291	399.61	7,708,876.51	
AUTOZONE INC	1,930	505.86	976,309.80	
BED BATH & BEYOND INC	11,835	66.05	781,701.75	

BEST BUY COMPANY INC	14,689	24.43	358,852.27	
CARMAX INC	12,059	45.19	544,946.21	
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,316	53.60	284,937.60	
DOLLAR GENERAL CORP	16,923	60.10	1,017,072.30	
DOLLAR TREE INC	12,075	54.32	655,914.00	
EXPEDIA INC	6,277	70.69	443,721.13	
FAMILY DOLLAR STORES	5,520	65.56	361,891.20	
GAMESTOP CORP-CLASS A	6,944	37.65	261,441.60	
GAP	16,448	37.30	613,510.40	
GENUINE PARTS CO	8,040	84.14	676,485.60	
HOME DEPOT	75,573	81.00	6,121,413.00	
KOHLS CORP	11,356	52.93	601,073.08	
L BRANDS INC	12,820	55.17	707,279.40	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	26,628	28.10	748,246.80	
LKQ CORP	15,504	27.93	433,026.72	
LOWES COMPANIES	55,345	47.61	2,634,975.45	
MACY'S INC	20,572	56.23	1,156,763.56	
NETFLIX INC	2,872	330.04	947,874.88	
NORDSTROM INC	8,421	59.93	504,670.53	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,879	135.48	796,486.92	
PETSMART INC	5,053	64.43	325,564.79	
PRICELINE.COM INC	2,712	1,178.04	3,194,844.48	
ROSS STORES INC	11,893	71.39	849,041.27	
STAPLES INC	34,140	13.61	464,645.40	
TARGET (DAYTON HUDSON)	31,504	60.24	1,897,800.96	
TIFFANY & CO	6,895	86.71	597,865.45	
TJX COMPANIES INC	37,618	61.86	2,327,049.48	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,518	74.17	557,610.06	
TRIPADVISOR INC	6,310	83.90	529,409.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	3,108	83.56	259,704.48	
URBAN OUTFITTERS INC	6,170	37.02	228,413.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	22,988	116.29	2,673,274.52	
CVS CAREMARK CORPORATION	64,756	67.97	4,401,465.32	
KROGER CO	26,823	36.79	986,818.17	
SAFEWAY INC	13,559	31.82	431,447.38	
SYSCO CORP	32,327	36.51	1,180,258.77	
WALGREEN CO	47,255	59.16	2,795,605.80	
WAL-MART STORES	86,460	76.19	6,587,387.40	
WHOLE FOODS MKT INC	19,278	52.33	1,008,817.74	
ALTRIA GROUP INC	105,635	37.03	3,911,664.05	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,553	41.01	1,417,018.53	
BEAM INC	8,162	83.34	680,221.08	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,903	79.20	546,717.60	
BUNGE LIMITED	7,957	81.30	646,904.10	
CAMPBELL SOUP CO (US)	10,449	41.79	436,663.71	
COCA-COLA CO	210,617	39.28	8,273,035.76	
COCA-COLA ENTERPRISES	13,141	44.28	581,883.48	
CONAGRA	22,867	33.42	764,215.14	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,907	79.54	708,462.78	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	10,510	48.49	509,629.90	
GENERAL MILLS INC	33,688	48.28	1,626,456.64	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	6,597	78.96	520,899.12	
HERSHEY FOODS CORPORATION	8,039	98.58	792,484.62	
HORMEL FOODS CORP	8,128	45.85	372,668.80	
JM SMUCKER CO	5,676	97.20	551,707.20	
KELLOGG CO	13,776	60.47	833,034.72	
KRAFT FOODS GROUP INC	31,257	54.76	1,711,633.32	
LORILLARD INC	20,365	49.22	1,002,365.30	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,714	68.95	462,930.30	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,557	82.28	868,629.96	
MOLSON COORS BREWING CO -B	7,769	55.58	431,801.02	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	89,066	35.25	3,139,576.50	
MONSTER BEVERAGE CORP	7,320	69.12	505,958.40	
PEPSICO INC	81,383	82.20	6,689,682.60	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	85,421	83.33	7,118,131.93	
REYNOLDS AMERICAN INC	17,745	48.32	857,438.40	
TYSON FOODS INC	14,542	35.04	509,551.68	
AVON PRODUCTS INC	24,395	16.31	397,882.45	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,773	65.53	509,364.69	
CLOROX COMPANY	7,049	89.97	634,198.53	
COLGATE-PALMOLIVE CO	48,856	64.70	3,160,983.20	
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,469	105.93	367,471.17	
ESTEE LAUDER CO-CL A	12,444	72.57	903,061.08	
HERBALIFE LTD	4,464	70.20	313,372.80	
KIMBERLY-CLARK CORP	20,137	105.46	2,123,648.02	
PROCTER & GAMBLE CO	144,615	79.88	11,551,846.20	
ABBOTT LABORATORIES	81,842	39.40	3,224,574.80	
AETNA INC	19,495	70.16	1,367,769.20	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,037	70.53	848,969.61	
BARD C R INC	4,050	135.21	547,600.50	
BAXTER INTERNATIONAL	28,517	69.93	1,994,193.81	
BECTON DICKINSON & CO	10,156	111.31	1,130,464.36	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,956	13.51	945,105.56	
CARDINAL HEALTH	17,759	67.68	1,201,929.12	

CAREFUSION CORP	11,482	40.75	467,891.50	
CERNER CORP	16,116	55.74	898,305.84	
CIGNA CORP	14,814	89.46	1,325,260.44	
COVIDIEN PLC	24,139	68.20	1,646,279.80	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,737	64.83	631,249.71	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,997	47.90	383,056.30	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,351	68.54	435,297.54	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	42,862	73.62	3,155,500.44	
HCA HOLDINGS INC	15,911	51.41	817,984.51	
HENRY SCHEIN INC	4,467	116.16	518,886.72	
HOLOGIC INC	14,997	22.58	338,632.26	
HUMANA INC	8,157	96.57	787,721.49	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,067	430.14	889,099.38	
LABORATORY CRP OF AMER	4,843	91.80	444,587.40	
MCKESSON CORP	12,013	168.12	2,019,625.56	
MEDTRONIC	53,051	59.51	3,157,065.01	
OMNICARE INC	5,836	63.57	370,994.52	
PATTERSON COMPANIES INC	4,632	40.98	189,819.36	
QUEST DIAGNOSTICS	8,163	54.68	446,352.84	
RESMED INC	7,971	45.63	363,716.73	
ST JUDE MEDICAL INC	14,978	65.90	987,050.20	
STRYKER CORP	15,830	78.20	1,237,906.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,584	72.52	3,885,911.68	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,000	85.28	426,400.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,539	82.40	456,413.60	
WELLPOINT INC	15,676	85.49	1,340,141.24	
ZIMMER HOLDINGS INC	8,831	95.93	847,157.83	
ABBVIE INC	83,563	50.06	4,183,163.78	
ACTAVIS PLC	9,091	183.28	1,666,198.48	
AGILENT TECHNOLOGIES	17,993	60.71	1,092,355.03	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,241	139.71	1,430,770.11	
ALLERGAN INC	15,568	120.15	1,870,495.20	
AMGEN	39,720	119.15	4,732,638.00	
BIOGEN IDEC INC	12,523	297.48	3,725,342.04	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,235	73.45	531,410.75	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,797	54.36	4,718,284.92	
CELGENE CORP	21,668	167.04	3,619,422.72	
FOREST LABORATORIES INC	13,065	68.74	898,088.10	
GILEAD SCIENCES INC	80,753	78.40	6,331,035.20	
HOSPIRA INC	9,252	42.75	395,523.00	
ILLUMINA INC	6,492	136.34	885,119.28	
JOHNSON & JOHNSON	148,846	95.06	14,149,300.76	

LIFE TECHNOLOGIES CORP	9,346	75.96	709,922.16	
LILLY (ELI) & CO	53,363	55.16	2,943,503.08	
MERCK & CO	154,459	51.95	8,024,145.05	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,700	254.29	432,293.00	
MYLAN INC	19,913	45.75	911,019.75	
PERRIGO CO PLC	7,240	156.03	1,129,657.20	
PFIZER	349,595	31.09	10,868,908.55	
PHARMACYCLICS INC	3,500	140.64	492,240.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,049	292.00	1,182,308.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,939	115.89	2,194,840.71	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,134	82.09	996,080.06	
WATERS CORP	4,818	104.40	502,999.20	
ZOETIS INC	26,046	31.73	826,439.58	
BB&T CORP	36,863	38.78	1,429,547.14	
CIT GROUP INC	9,861	49.90	492,063.90	
COMERICA INC	9,514	47.65	453,342.10	
FIFTH THIRD BANCORP	46,284	21.55	997,420.20	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,082	51.22	260,300.04	
HUDSON CITY BANCORP INC	27,687	9.08	251,397.96	
KEY CORP	47,236	13.54	639,575.44	
M & T BANK CORP	6,337	111.99	709,680.63	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	24,669	17.02	419,866.38	
OCWEN FINANCIAL CORP	6,111	49.96	305,305.56	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,290	14.85	271,606.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,943	82.26	2,298,591.18	
REGIONS FINL CORP	72,555	10.57	766,906.35	
SUNTRUST BANKS	29,267	39.34	1,151,363.78	
US BANCORP	96,924	41.45	4,017,499.80	
WELLS FARGO & CO	266,387	46.39	12,357,692.93	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,734	211.97	579,525.98	
AMERICAN EXPRESS	51,188	90.97	4,656,572.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,348	113.37	1,173,152.76	
BANK NEW YORK CO	60,461	32.70	1,977,074.70	
BANK OF AMERICA CORP	567,156	17.01	9,647,323.56	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,301	115.07	6,708,696.07	
BLACKROCK INC	7,062	316.72	2,236,676.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,777	72.39	2,227,947.03	
CITIGROUP	160,531	52.27	8,390,955.37	
CME GROUP INC	16,641	75.49	1,256,229.09	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,348	53.41	1,353,836.68	
EATON VANCE CORP	6,650	40.90	271,985.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,610	58.51	1,264,401.10	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,483	176.28	3,963,303.24	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,988	206.87	1,238,737.56	
INVESCO LTD	24,023	35.01	841,045.23	
JPMORGAN CHASE & CO	198,778	58.11	11,550,989.58	
LEGG MASON INC	6,202	43.91	272,329.82	
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,616	27.94	464,251.04	
MCGRAW-HILL FINANCIAL	14,232	76.75	1,092,306.00	
MOODY'S CORP	10,759	75.75	814,994.25	
MORGAN STANLEY	77,269	33.40	2,580,784.60	
NASDAQ OMX GROUP	6,376	39.72	253,254.72	
NORTHERN TRUST CORP	11,855	60.71	719,717.05	
PRICE T ROWE GROUP INC	14,176	82.28	1,166,401.28	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,405	54.05	346,190.25	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,648	26.77	1,623,546.96	
SEI INVESTMENTS COMPANY	8,731	35.08	306,283.48	
SLM CORP	22,604	24.47	553,119.88	
STATE STREET CORP	23,411	73.50	1,720,708.50	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,812	32.41	415,236.92	
ACE LTD	17,862	97.10	1,734,400.20	
AFLAC	24,405	64.71	1,579,247.55	
ALLEGHANY CORP	856	391.09	334,773.04	
ALLSTATE CORP	24,277	52.90	1,284,253.30	
AMERICAN INT'L GROUP	73,901	50.89	3,760,821.89	
AON PLC	15,294	84.15	1,286,990.10	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,848	54.64	374,174.72	
ASSURANT INC	4,482	67.65	303,207.30	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,941	45.56	270,671.96	
CHUBB CORPORATION	13,382	89.77	1,201,302.14	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,700	50.52	439,524.00	
EVEREST RE GROUP LTD	2,493	146.36	364,875.48	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	12,973	31.55	409,298.15	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	22,516	35.26	793,914.16	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,750	51.59	709,362.50	
LOEWS CORP	17,876	47.33	846,071.08	
MARSH & MCLENNAN COS	28,802	48.50	1,396,897.00	
METLIFE INC	49,069	52.96	2,598,694.24	
PARTNERRE LTD	2,555	99.44	254,069.20	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,321	47.44	726,828.24	
PROGRESSIVE CORP	29,765	25.73	765,853.45	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,342	90.23	2,196,378.66	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,591	91.00	235,781.00	
TORCHMARK CORP	4,876	77.71	378,913.96	

TRAVELERS COS INC/THE	19,608	86.47	1,695,503.76	
UNUM GROUP	14,141	34.35	485,743.35	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,583	44.36	380,741.88	
WR BERKLEY CORP	6,732	41.52	279,512.64	
XL GROUP PLC	14,744	29.94	441,435.36	
CBRE GROUP INC-A	14,402	26.50	381,653.00	
REALOGY HOLDINGS CORP	7,466	46.70	348,662.20	
WEYERHAEUSER CO	31,657	30.97	980,417.29	
ACCENTURE PLC-CL A	33,965	84.43	2,867,664.95	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,101	16.96	425,712.96	
ADOBE SYSTEMS INC	25,036	61.37	1,536,459.32	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	9,990	48.58	485,314.20	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,637	256.89	677,418.93	
ANSYS INC	5,240	84.64	443,513.60	
AUTODESK INC	11,509	53.24	612,739.16	
AUTOMATIC DATA PROCESS	25,397	79.97	2,030,998.09	
CA INC	16,511	34.43	568,473.73	
CITRIX SYSTEMS INC	10,112	60.44	611,169.28	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,818	99.34	1,571,360.12	
COMPUTER SCIENCES CORP	7,907	55.45	438,443.15	
EBAY	61,416	53.20	3,267,331.20	
ELECTRONIC ARTS INC	17,619	24.10	424,617.90	
EQUINIX INC	2,777	175.87	488,390.99	
FACEBOOK INC-A	91,109	56.30	5,129,436.70	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,219	52.74	802,650.06	
FISERV INC	14,118	57.25	808,255.50	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,722	107.71	400,896.62	
GOOGLE INC-CL A	14,484	1,150.53	16,664,276.52	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	54,998	190.09	10,454,569.82	
INTUIT INC	15,386	76.99	1,184,568.14	
LEIDOS HOLDINGS	3,963	46.49	184,239.87	
LINKEDIN CORP - A	5,331	219.93	1,172,446.83	
MASTERCARD INC-CLASS A	5,508	818.42	4,507,857.36	
MICROSOFT CORP	418,426	36.38	15,222,337.88	
NETSUITE INC	1,707	110.65	188,879.55	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,487	15.02	232,614.74	
ORACLE CORP	183,436	38.21	7,009,089.56	
PAYCHEX INC	17,132	44.10	755,521.20	
RACKSPACE HOSTING INC	6,900	38.22	263,718.00	
RED HAT INC	9,757	58.59	571,662.63	
SALESFORCE.COM INC	29,727	59.86	1,779,458.22	

SERVICENOW INC	6,543	62.05	405,993.15	
SYMANTEC CORP	38,039	23.26	884,787.14	
SYNOPSYS INC	8,164	41.09	335,458.76	
TERADATA CORP	8,368	47.24	395,304.32	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,333	32.20	300,522.60	
VANTIV INC - CL A	6,378	32.60	207,922.80	
VERISIGN INC	7,689	61.89	475,872.21	
VISA INC-CLASS A SHARES	27,171	232.18	6,308,562.78	
VMWARE INC-CLASS A	4,666	98.20	458,201.20	
WESTERN UNION CO	28,486	16.45	468,594.70	
WORKDAY INC-CLASS A	3,472	92.48	321,090.56	
YAHOO	50,966	40.01	2,039,149.66	
AMPHENOL CORPORATION	8,628	92.08	794,466.24	
APPLE INC	48,051	540.60	25,976,370.60	
ARROW ELECTRONICS INC	5,800	54.12	313,896.00	
AVNET INC	7,613	44.02	335,124.26	
CISCO SYSTEMS	282,225	22.74	6,417,796.50	
CORNING	76,573	18.77	1,437,275.21	
EMC CORP	109,601	26.33	2,885,794.33	
F5 NETWORKS INC	4,405	96.92	426,932.60	
FLEXTRONICS INTL LTD	36,425	7.72	281,201.00	
FLIR SYSTEMS INC	8,635	33.44	288,754.40	
HARRIS CORP	6,127	70.54	432,198.58	
HEWLETT-PACKARD CO	101,609	29.80	3,027,948.20	
JUNIPER NETWORKS INC	27,303	26.00	709,878.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,003	66.10	859,498.30	
NETAPP INC	18,444	44.49	820,573.56	
QUALCOMM	90,608	74.73	6,771,135.84	
SANDISK CORP	13,074	73.69	963,423.06	
SEAGATE TECHNOLOGY	16,751	61.20	1,025,161.20	
TE CONNECTIVITY LTD	21,655	55.94	1,211,380.70	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,353	34.08	489,150.24	
WESTERN DIGITAL CORP	11,127	88.82	988,300.14	
XEROX CORP	63,433	12.20	773,882.60	
AT&T INC	283,421	33.70	9,551,287.70	
CENTURYLINK INC	33,052	30.00	991,560.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	17,401	74.22	1,291,502.22	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	53,046	4.83	256,212.18	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,688	90.01	601,986.88	
SPRINT CORP	55,972	8.97	502,068.84	
T-MOBILE US INC	12,775	32.51	415,315.25	
VERIZON COMMUNICATIONS	152,673	48.35	7,381,739.55	

WINDSTREAM HOLDINGS INC	33,150	7.90	261,885.00	
AES CORP	33,880	14.30	484,484.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	6,173	51.29	316,613.17	
AMEREN CORPORATION	13,296	36.15	480,650.40	
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,475	46.77	1,191,465.75	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,509	41.53	394,908.77	
CALPINE CORP	20,101	19.23	386,542.23	
CENTERPOINT ENERGY INC	22,554	23.42	528,214.68	
CMS ENERGY CORP	14,951	26.43	395,154.93	
CONSOLIDATED EDISON INC	15,264	53.96	823,645.44	
DOMINION RESOURCES	30,422	66.29	2,016,674.38	
DTE ENERGY COMPANY	9,457	65.85	622,743.45	
DUKE ENERGY CORP	37,144	67.57	2,509,820.08	
EDISON INTL	16,102	46.90	755,183.80	
ENTERGY CORP	9,623	61.61	592,873.03	
EXELON CORP	44,834	27.20	1,219,484.80	
FIRSTENERGY CORP	21,740	32.61	708,941.40	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	3,984	53.64	213,701.76	
MDU RESOURCES GROUP INC	10,444	30.61	319,690.84	
NEXTERA ENERGY INC	22,306	87.66	1,955,343.96	
NISOURCE INC	16,828	33.89	570,300.92	
NORTHEAST UTILITIES	16,346	42.59	696,176.14	
NRG ENERGY INC	17,935	28.07	503,435.45	
OGE ENERGY CORP	11,103	34.11	378,723.33	
ONEOK INC	10,691	67.13	717,686.83	
PEPCO HOLDINGS INC	14,374	18.66	268,218.84	
PG&E CORP	23,235	40.67	944,967.45	
PINNACLE WEST CAPITAL	6,136	52.39	321,465.04	
PPL CORPORATION	32,999	29.59	976,440.41	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,374	31.78	838,165.72	
SCANA CORP	6,775	46.34	313,953.50	
SEMPRA ENERGY	12,647	91.95	1,162,891.65	
SOUTHERN CO	45,903	41.16	1,889,367.48	
WISCONSIN ENERGY CORP	12,243	41.14	503,677.02	
XCEL ENERGY INC	26,973	28.20	760,638.60	
ALTERA CORPORATION	17,227	32.40	558,154.80	
ANALOG DEVICES	16,883	49.38	833,682.54	
APPLIED MATERIALS	65,596	17.55	1,151,209.80	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	12,798	56.14	718,479.72	
BROADCOM CORP-CL A	28,699	29.00	832,271.00	
CREE INC	6,609	62.50	413,062.50	
INTEL CORP	263,114	25.85	6,801,496.90	

	KLA-TENCOR CORP	8,938	62.74	560,770.12	
	LAM RESEARCH CORP	8,750	54.23	474,512.50	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,056	46.00	554,576.00	
	LSI CORP	31,994	11.00	351,934.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	23,144	14.68	339,753.92	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,649	28.55	418,228.95	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,067	46.20	511,295.40	
	MICRON TECHNOLOGY	54,386	22.38	1,217,158.68	
	NVIDIA CORP	29,853	15.99	477,349.47	
	TEXAS INSTRUMENTS	57,988	43.45	2,519,578.60	
	XILINX INC	13,820	47.22	652,580.40	
アメリカドル小計		16,001,214		894,807,466.93 (93,095,768,859)	
カナダドル	ALTAGAS INCOME LTD	6,922	41.40	286,570.80	
	ARC RESOURCES LTD	16,744	28.16	471,511.04	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	20,054	6.99	140,177.46	
	BAYTEX ENERGY CORP	6,001	41.32	247,961.32	
	CAMECO CORP	21,148	24.10	509,666.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	56,813	35.72	2,029,360.36	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	26,085	20.28	529,003.80	
	CENOVUS ENERGY INC	39,203	29.53	1,157,664.59	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	21,074	39.42	830,737.08	
	ENBRIDGE	40,930	46.84	1,917,161.20	
	ENCANA CORP	39,999	19.42	776,780.58	
	ENERPLUS CORP	10,454	20.02	209,289.08	
	HUSKY ENERGY INC	18,542	33.27	616,892.34	
	IMPERIAL OIL	15,870	45.99	729,861.30	
	KEYERA CORP	4,636	67.13	311,214.68	
	MEG ENERGY CORP	8,375	30.49	255,353.75	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,856	17.93	320,158.08	
	PEMBINA PIPELINE CORP	15,718	38.11	599,012.98	
	PENGROWTH ENERGY CORP	31,475	7.17	225,675.75	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	23,074	9.16	211,357.84	
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,413	34.05	286,462.65	
	SUNCOR ENERGY	78,714	37.38	2,942,329.32	
	TALISMAN ENERGY INC	55,994	12.56	703,284.64	
	TOURMALINE OIL CORP	8,740	47.94	418,995.60	
	TRANSCANADA CORP	36,879	48.61	1,792,688.19	
	VERMILION ENERGY INC	5,094	63.34	322,653.96	
	AGNICO EAGLE MINES	10,066	32.21	324,225.86	
	AGRIUM INC	7,581	103.13	781,828.53	
	BARRICK GOLD CORP	63,624	20.61	1,311,290.64	

ELDORADO GOLD CORP	43,374	7.32	317,497.68	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	30,311	20.21	612,585.31	
FRANCO-NEVADA CORP	8,570	49.36	423,015.20	
GOLDCORP INC	44,335	25.43	1,127,439.05	
KINROSS GOLD CORP	55,654	5.23	291,070.42	
METHANEX CORP	5,075	66.11	335,508.25	
NEW GOLD INC	29,614	6.38	188,937.32	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	45,238	37.49	1,695,972.62	
SILVER WHEATON CORP	17,681	24.49	433,007.69	
TECK RESOURCES LTD-CL B	29,114	28.66	834,407.24	
YAMANA GOLD INC	37,317	10.54	393,321.18	
BOMBARDIER B	71,394	4.11	293,429.34	
CAE INC	16,121	14.10	227,306.10	
FINNING INTERNATIONAL INC	8,970	27.09	242,997.30	
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,077	47.96	387,372.92	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,150	58.58	2,703,467.00	
CP RAILWAY LIMITED	9,117	163.94	1,494,640.98	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,784	96.46	1,136,684.64	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,652	59.70	337,424.40	
TIM HORTONS INC	8,110	60.29	488,951.90	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	20,777	24.78	514,854.06	
THOMSON REUTERS CORP	20,240	41.22	834,292.80	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,119	98.25	404,691.75	
DOLLARAMA INC	3,609	82.74	298,608.66	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	7,017	79.22	555,886.74	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,863	72.05	206,279.15	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,916	44.45	262,966.20	
METRO INC	4,535	66.00	299,310.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	10,732	59.42	637,695.44	
WESTON (GEORGE) LTD	2,658	79.55	211,443.90	
SAPUTO INC	6,225	52.55	327,123.75	
CATAMARAN CORPORATION	11,095	54.24	601,792.80	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	16,549	151.50	2,507,173.50	
BANK MONTREAL	33,827	72.65	2,457,531.55	
BANK NOVA SCOTIA	63,250	63.86	4,039,145.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	20,888	88.93	1,857,569.84	
NATIONAL BANK OF CANADA	8,812	88.76	782,153.12	
ROYAL BANK OF CANADA	75,800	71.86	5,446,988.00	
TORONTO-DOMINION BANK	48,482	98.11	4,756,569.02	
CI FINANCIAL CORP	8,227	35.58	292,716.66	
IGM FINANCIAL INC	5,864	56.15	329,263.60	
ONEX CORP	5,304	56.76	301,055.04	

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	544	423.39	230,324.16	
	GREAT-WEST LIFECO INC	15,149	32.20	487,797.80	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	5,185	46.10	239,028.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,059	69.23	488,694.57	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	96,029	21.91	2,103,995.39	
	POWER CORP OF CANADA	18,862	31.60	596,039.20	
	POWER FINANCIAL CORP	13,355	35.64	475,972.20	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	31,406	38.42	1,206,618.52	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	28,687	41.56	1,192,231.72	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	16,031	20.62	330,559.22	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	5,534	17.40	96,291.60	
	CGI GROUP INC - CL A	10,363	35.42	367,057.46	
	OPEN TEXT CORP	3,113	99.14	308,622.82	
	BCE INC	13,980	46.56	650,908.80	
	BELL ALIANT INC	5,225	26.60	138,985.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,886	47.40	942,596.40	
	TELUS CORP	16,454	37.37	614,885.98	
	ATCO LTD -CLASS I	4,000	46.48	185,920.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,764	36.25	208,945.00	
	FORTIS INC	11,903	30.23	359,827.69	
	TRANSALTA CORP	15,621	14.19	221,661.99	
カナダドル小計		1,978,675		74,596,281.36 (7,088,138,654)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	8,489	19.40	164,686.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	56,076	13.83	775,531.08	
	SANTOS	52,200	14.51	757,422.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,101	39.12	1,334,031.12	
	WORLEYPARSONS LTD	10,573	17.28	182,701.44	
	ALUMINA LIMITED	163,150	1.25	203,937.50	
	AMCOR	65,010	10.45	679,354.50	
	BHP BILLITON LTD	169,036	37.89	6,404,774.04	
	BORAL LIMITED	35,177	4.80	168,849.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	77,368	5.68	439,450.24	
	ILUKA RESOURCES LTD	21,335	8.90	189,881.50	
	INCITEC PIVOT LTD	83,630	2.91	243,363.30	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,623	13.17	297,944.91	
	NEWCREST MINING LIMITED	36,982	9.19	339,864.58	
	ORICA LTD	19,603	24.78	485,762.34	
	RIO TINTO LTD	22,618	66.32	1,500,025.76	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,493	15.85	150,464.05	
	ALS LTD	21,808	8.79	191,692.32	

	BRAMBLES LTD	79,421	8.86	703,670.06	
	SEEK LTD	19,117	12.94	247,373.98	
	ASCIANO GROUP	51,076	5.72	292,154.72	
	AURIZON HOLDINGS LTD	101,448	4.95	502,167.60	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.10	84,863.90	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	41,707	5.80	241,900.60	
	TRANSURBAN GROUP	75,466	6.80	513,168.80	
	CROWN RESORTS LTD	21,269	17.60	374,334.40	
	ECHO ENTERTAIMENT GROUP LIMITED	47,591	2.43	115,646.13	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,263	45.76	149,314.88	
	TABCORP HOLDINGS	45,765	3.53	161,550.45	
	TATTS GROUP LTD	65,227	3.01	196,333.27	
	REA GROUP LTD	2,513	40.94	102,882.22	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	30,812	3.26	100,447.12	
	METCASH LTD	55,380	3.12	172,785.60	
	WESFARMERS LIMITED	51,915	43.70	2,268,685.50	
	WOOLWORTHS LTD	65,273	34.19	2,231,683.87	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	28,004	12.33	345,289.32	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,552	4.65	179,266.80	
	COCHLEAR LIMITED	3,583	58.80	210,680.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,612	44.45	338,353.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	21,648	16.84	364,552.32	
	CSL LIMITED	25,343	70.02	1,774,516.86	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	144,174	31.03	4,473,719.22	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	16,301	11.87	193,492.87	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,308	11.60	223,972.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	84,855	75.47	6,404,006.85	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	123,370	33.74	4,162,503.80	
	WESTPAC BANKING	163,231	31.60	5,158,099.60	
	ASX LTD	10,432	36.19	377,534.08	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	14,778	53.96	797,420.88	
	AMP LTD	158,697	4.49	712,549.53	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	111,841	5.72	639,730.52	
	QBE INSURANCE GROUP	66,852	11.60	775,483.20	
	SUNCORP GROUP LIMITED	65,908	13.03	858,781.24	
	COMPUTERSHARE LIMITED	22,437	11.54	258,922.98	
	TELSTRA CORP	236,799	5.24	1,240,826.76	
	AGL ENERGY LTD	29,447	15.24	448,772.28	
	SP AUSNET	87,439	1.25	109,735.94	
	オーストラリアドル小計	3,224,275		53,016,911.63 (4,833,021,664)	

イギリス ポンド	AMEC PLC	15,243	10.45	159,289.35	
	BG GROUP	179,545	13.44	2,413,982.52	
	BP PLC	991,994	4.91	4,871,186.53	
	PETROFAC LTD	15,103	12.63	190,750.89	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	201,188	21.74	4,374,833.06	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	132,050	22.79	3,010,079.75	
	TULLOW OIL PLC	47,460	9.06	430,224.90	
	ANGLO AMERICAN PLC	73,284	13.91	1,019,380.44	
	ANTOFAGASTA PLC	22,958	8.46	194,339.47	
	BHP BILLTTON PLC	111,357	18.90	2,104,647.30	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,905	24.12	190,668.60	
	FRESNILLO PLC	11,483	7.32	84,055.56	
	GLENCORE XSTRATA PLC	559,165	3.38	1,890,816.44	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,991	33.93	372,924.63	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	4,501	39.55	178,014.55	
	REXAM	40,774	5.05	206,112.57	
	RIO TINTO PLC REG	67,043	33.83	2,268,064.69	
	BAE SYSTEMS PLC	169,479	4.44	753,164.67	
	BUNZL PLC	17,199	14.18	243,881.82	
	COBHAM PLC	56,036	2.94	165,250.16	
	IMI PLC	16,802	15.55	261,271.10	
	INVENSYS PLC	37,986	5.09	193,538.67	
	MEGGITT PLC	40,649	5.45	221,537.05	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	66,776	3.08	205,803.63	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	96,881	12.50	1,211,012.50	
	SMITHS GROUP PLC	21,067	15.23	320,850.41	
	TRAVIS PERKINS PLC	12,089	18.55	224,250.95	
	WEIR GROUP PLC/THE	11,331	21.37	242,143.47	
	WOLSELEY LTD	14,633	34.67	507,326.11	
	AGGREKO PLC	12,998	17.22	223,825.56	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	18,079	13.97	252,563.63	
	CAPITA GROUP PLC	35,312	10.57	373,247.84	
	EXPERIAN PLC	51,666	11.26	581,759.16	
	G4S PLC	88,705	2.59	229,834.65	
	INTERTEK GROUP PLC	8,601	29.09	250,203.09	
	SERCO GROUP PLC	29,062	5.10	148,216.20	
	EASYJET PLC	9,444	16.80	158,659.20	
	NEW GKN	87,889	4.07	357,884.00	
	BURBERRY GROUP PLC	23,806	15.15	360,660.90	
	PERSIMMON PLC	15,599	13.40	209,026.60	
	CARNIVAL PLC	9,460	25.81	244,162.60	
	COMPASS GROUP PLC	95,010	9.64	916,371.45	

INTERCONTINENTAL HOTELS	13,993	19.96	279,300.28	
TUI TRAVEL PLC	20,444	4.28	87,602.54	
WHITBREAD PLC	9,667	39.51	381,943.17	
WILLIAM HILL	44,403	3.60	159,895.20	
BRITISH SKY BROADCASTING	55,902	8.40	469,576.80	
ITV PLC	200,934	2.03	408,297.88	
PEARSON	44,692	12.80	572,057.60	
REED ELSEVIER PLC	61,631	9.25	570,394.90	
WPP PLC	70,175	13.53	949,467.75	
KINGFISHER PLC	123,985	3.88	481,433.75	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	87,223	4.86	424,339.89	
NEXT PLC	8,404	61.45	516,425.80	
MORRISON SUPERMARKETS	118,741	2.52	299,702.28	
SAINSBURY (J) PLC	63,963	3.68	235,767.61	
TESCO	425,642	3.31	1,409,300.66	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,242	26.48	509,528.16	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	100,425	30.75	3,088,068.75	
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,262	17.09	192,467.58	
DIAGEO	132,459	19.31	2,558,445.58	
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	51,011	22.10	1,127,343.10	
SABMILLER PLC	50,682	30.51	1,546,307.82	
TATE & LYLE	23,966	7.82	187,533.95	
UNILEVER PLC	67,627	24.24	1,639,278.48	
RECKITT BENCKISER PLC	34,078	46.77	1,593,828.06	
SMITH & NEPHEW PLC	48,397	8.78	425,167.64	
ASTRAZENECA	66,061	38.75	2,559,863.75	
GLAXOSMITHKLINE	258,635	16.45	4,254,545.75	
SHIRE PLC	29,047	30.19	876,928.93	
BARCLAYS	816,527	2.88	2,356,496.92	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	999,301	6.77	6,772,262.87	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,668,987	0.83	2,229,137.94	
ROYAL BANK OF SCOTLAND	116,151	3.63	422,441.18	
STANDARD CHARTERED PLC	129,440	13.30	1,721,552.00	
3I GROUP PLC	57,274	3.96	227,091.41	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	50,274	4.39	220,702.86	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,852	14.53	186,739.56	
ICAP PLC	32,393	4.52	146,513.53	
INVESTEC PLC	34,476	4.37	150,935.92	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	9,458	18.37	173,743.46	
SCHRODERS PLC	6,124	25.63	156,958.12	
ADMIRAL GROUP PLC	11,529	14.07	162,213.03	
AVIVA PIC	156,581	4.76	745,951.88	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	49,676	2.66	132,436.21	
	LEGAL & GENERAL GROUP	314,312	2.30	723,860.53	
	OLD MUTUAL PLC	259,537	1.91	498,051.50	
	PRUDENTIAL	136,666	13.64	1,864,124.24	
	RESOLUTION LTD	74,378	3.59	267,686.42	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	190,688	1.03	196,408.64	
	STANDARD LIFE PLC	125,741	3.84	483,096.92	
	SAGE GROUP PLC	58,315	4.10	239,558.02	
	BT GROUP PLC	411,447	3.83	1,577,487.79	
	INMARSAT PLC	23,362	7.44	173,930.09	
	VODAFONE GROUP PLC	2,546,388	2.40	6,111,331.20	
	CENTRICA PLC	270,458	3.21	869,252.01	
	NATIONAL GRID PLC	196,481	7.88	1,548,270.28	
	SEVERN TRENT PLC	12,322	16.45	202,696.90	
	SSE PLC	50,573	13.20	667,563.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	36,246	6.88	249,372.48	
	ARM HOLDINGS PLC	73,437	9.89	726,291.93	
イギリスポンド小計		15,712,688		92,824,789.77 (15,839,622,126)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	18,824	42.72	804,161.28	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	477	311.00	148,347.00	
	GIVAUDAN-REG	452	1,266.00	572,232.00	
	HOLCIM LTD	12,338	70.70	872,296.60	
	SIKA AG-BR	110	3,092.00	340,120.00	
	SYNGENTA AG	4,893	351.70	1,720,868.10	
	ABB LTD	114,872	24.75	2,843,082.00	
	GEBERIT AG-REG	2,055	278.80	572,934.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,042	132.80	138,377.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,485	130.50	324,292.50	
	SULZER AG-REG	1,193	139.60	166,542.80	
	ADECCO	7,193	75.25	541,273.25	
	SGS SA	296	2,007.00	594,072.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,767	125.10	346,151.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	27,288	87.45	2,386,335.60	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,613	548.00	883,924.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,319	95.00	220,305.00	
	ARYZTA AG	4,457	73.50	327,589.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	1,098.00	144,936.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	49	4,182.00	204,918.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	50,300.00	301,800.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	170,048	67.65	11,503,747.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,677	121.50	325,255.50	

	ACTELION LTD-REG	5,535	87.65	485,142.75	
	LONZA GROUP AG-REG	2,757	93.35	257,365.95	
	NOVARTIS	121,456	74.15	9,005,962.40	
	ROCHE HOLDING GENUSS	37,099	250.30	9,285,879.70	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	80,742	29.75	2,402,074.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,321	44.85	552,596.85	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,299	73.40	95,346.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	936	222.70	208,447.20	
	UBS AG-REG	194,761	19.10	3,719,935.10	
	BALOISE HOLDING AG	2,556	112.80	288,316.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,662	199.00	330,738.00	
	SWISS RE LTD	18,733	80.00	1,498,640.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,933	273.10	2,166,502.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,934	70.50	206,847.00	
	SWISSCOM	1,269	492.00	624,348.00	
スイスフラン小計		869,579		57,411,704.78 (6,543,786,110)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	35,500	26.60	944,300.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	109,000	106.50	11,608,500.00	
	NWS HOLDINGS LTD	49,000	11.86	581,140.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	57,000	16.98	967,860.00	
	MTR CORP	84,500	28.05	2,370,225.00	
	LI & FUNG	314,800	11.04	3,475,392.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	46,500	23.85	1,109,025.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	114,000	83.20	9,484,800.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	38,000	35.15	1,335,700.00	
	SANDS CHINA LTD	131,200	64.95	8,521,440.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	98,000	14.70	1,440,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	89,000	25.70	2,287,300.00	
	WYNN MACAU LTD	82,800	36.05	2,984,940.00	
	BANK EAST ASIA	65,960	32.15	2,120,614.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	200,500	24.40	4,892,200.00	
	HANG SENG BANK	41,400	124.30	5,146,020.00	
	FIRST PACIFIC CO	128,000	8.19	1,048,320.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59,700	128.20	7,653,540.00	
	AIA GROUP LTD	628,200	38.75	24,342,750.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	71,000	121.50	8,626,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	120,000	24.60	2,952,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	56,000	44.95	2,517,200.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	40,000	33.60	1,344,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	38,500	26.15	1,006,775.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	200,500	10.32	2,069,160.00	

	SINO LAND CO	125,400	10.86	1,361,844.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	87,000	98.50	8,569,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	36,500	88.25	3,221,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,600	20.85	950,760.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	58.15	4,884,600.00	
	WHEELOCK & CO LTD	53,000	34.90	1,849,700.00	
	PCCW LTD	232,000	3.55	823,600.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	31,000	46.65	1,446,150.00	
	CLP HOLDINGS	94,500	61.35	5,797,575.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	284,967	17.20	4,901,432.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	75,000	60.35	4,526,250.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	70.30	970,140.00	
香港ドル小計		4,061,827		150,132,977.40 (2,013,283,226)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	74,300	11.01	818,043.00	
	NOBLE GROUP LTD	227,363	1.02	233,047.07	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	44,000	5.34	234,960.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	41,000	4.20	172,200.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	76,000	3.85	292,600.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	133,000	1.21	160,930.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	99,000	1.94	192,555.00	
	SINGAPORE AIRLINES	24,533	10.09	247,537.97	
	GENTING SINGAPORE PLC	313,000	1.47	460,110.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	93,000	4.01	372,930.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	39.40	236,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	87,000	1.52	132,240.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	444,000	0.53	235,320.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	111,000	3.27	362,970.00	
	DBS GROUP	91,000	17.40	1,583,400.00	
	OCBC BANK	135,000	9.71	1,310,850.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	67,000	20.49	1,372,830.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,000	7.08	297,360.00	
	CAPITALAND LTD	130,500	2.92	381,060.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	79,000	1.88	148,520.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,000	9.55	229,200.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	158,000	2.94	464,520.00	
	KEPPEL LAND LTD	40,000	3.24	129,600.00	
	UOL GROUP LIMITED	22,300	5.98	133,354.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	425,243	3.52	1,496,855.36	
	STARHUB LTD	38,000	4.19	159,220.00	
シンガポールドル小計		3,025,239		11,858,612.40 (966,595,496)	

ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	35,168	8.97	315,456.96	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	53,092	3.58	190,334.82	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	15,000	8.35	125,250.00	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	108,032	2.36	254,955.52	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.12	130,575.36	
ニュージーランドドル小計		236,795		1,016,572.66 (87,211,768)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	11,307	120.70	1,364,754.90	
	BOLIDEN AB	13,292	105.00	1,395,660.00	
	ALFA LAVAL AB	16,494	164.80	2,718,211.20	
	ASSA ABLOY B	18,234	341.90	6,234,204.60	
	ATLAS COPCO A	34,888	182.20	6,356,593.60	
	ATLAS COPCO B	20,730	170.00	3,524,100.00	
	SANDVIK AB	55,142	92.25	5,086,849.50	
	SCANIA AB-B SHS	16,055	131.10	2,104,810.50	
	SKANSKA B	19,200	131.20	2,519,040.00	
	SKF AB-B	21,056	178.90	3,766,918.40	
	VOLVO B	82,072	90.50	7,427,516.00	
	SECURITAS B	19,690	71.90	1,415,711.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,627	162.00	2,207,574.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	25,855	40.50	1,047,127.50	
	HENNES & MAURITZ B	49,795	290.00	14,440,550.00	
	SWEDISH MATCH AB	10,523	194.90	2,050,932.70	
	SCA SV CELLULOSA B	31,937	195.70	6,250,070.90	
	ELEKTA AB-B SHS	21,103	99.40	2,097,638.20	
	GETINGE AB-B SHS	10,818	220.00	2,379,960.00	
	NORDEA BANK AB	161,374	91.00	14,685,034.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	79,981	86.10	6,886,364.10	
	SVENSKA HANDELSBK A	26,362	324.40	8,551,832.80	
	SWEDBANK AB-A	47,847	183.50	8,779,924.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,453	124.10	924,917.30	
	INVESTOR AB-B SHS	25,163	220.90	5,558,506.70	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	11,549	288.60	3,333,041.40	
	ERICSSON (LM) B	159,514	78.35	12,497,921.90	
	HEXAGON AB-B SHS	12,002	224.30	2,692,048.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,309	660.50	2,185,594.50	
	TELE2 AB-B SHS	15,978	75.70	1,209,534.60	
	TELIASONERA AB	128,887	52.50	6,766,567.50	
スウェーデンクローナ小計		1,171,237		148,459,510.90 (2,381,290,554)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	10,529	103.00	1,084,487.00	
	SEADRILL LTD	20,267	246.90	5,003,922.30	

	STATOIL ASA	58,513	152.70	8,934,935.10	
	SUBSEA 7 SA	13,385	119.30	1,596,830.50	
	NORSK HYDRO	69,507	29.63	2,059,492.41	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,529	265.90	2,533,761.10	
	ORKLA	38,985	49.10	1,914,163.50	
	DNB ASA	53,015	112.80	5,980,092.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,106	121.10	1,223,836.60	
	TELENOR ASA	35,621	145.70	5,189,979.70	
ノルウェークローネ小計		319,457		35,521,500.21 (598,892,493)	
デンマーク クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	31	62,950.00	1,951,450.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	68	65,600.00	4,460,800.00	
	DSV A/S	10,479	184.10	1,929,183.90	
	CARLSBERG AS-B	5,492	592.50	3,254,010.00	
	COLOPLAST-B	5,601	372.30	2,085,252.30	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,484	516.50	766,486.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	104,765	209.90	21,990,173.50	
	NOVOZYMES A/S	11,484	237.70	2,729,746.80	
	DANSKE BANK A/S	35,811	131.10	4,694,822.10	
	TRYG A/S	1,646	516.50	850,159.00	
	TDC A/S	41,126	50.90	2,093,313.40	
デンマーククローネ小計		217,987		46,805,397.00 (881,813,679)	
イスラエル シェケル	DELEK GROUP LTD	299	1,328.00	397,072.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	20,596	31.10	640,535.60	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	1,933.00	311,213.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	43,947	154.80	6,802,995.60	
	BANK HAPOALIM BM	58,582	18.95	1,110,128.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,820	13.86	981,565.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	43.45	356,290.00	
	NICE SYSTEMS LTD	3,358	146.40	491,611.20	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	111,633	5.50	613,981.50	
イスラエルシェケル小計		317,596		11,705,393.00 (348,937,765)	
ユーロ	CGG	7,644	12.26	93,715.44	
	ENI	133,517	17.23	2,300,497.91	
	FUGRO NV-CVA	3,638	42.30	153,887.40	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,031	12.00	252,372.00	
	NESTE OIL OYJ	6,385	14.17	90,475.45	
	OMV AG	8,150	35.27	287,491.25	
	REPSOL SA	46,543	19.00	884,549.71	
	SAIPEM	12,941	17.34	224,396.94	
	TECHNIP S.A.	5,427	66.93	363,229.11	

TENARIS SA	25,624	16.41	420,489.84	
TOTAL SA	112,822	44.10	4,976,014.31	
VOPAK	3,622	43.55	157,738.10	
AIR LIQUIDE	16,370	98.77	1,616,864.90	
AKZO NOBEL	12,441	57.95	720,955.95	
ARCELORMITTAL	51,938	13.02	676,232.76	
ARKEMA	3,184	80.43	256,089.12	
BASF SE	48,402	79.49	3,847,474.98	
CRH	40,755	20.01	815,507.55	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	2,114	73.24	154,829.36	
HEIDELBERGCEMENT AG	7,624	57.49	438,303.76	
IMERYS SA	1,975	63.42	125,254.50	
K+S AG	10,261	24.63	252,728.43	
KONINKLIJKE DSM NV	8,307	56.52	469,511.64	
LAFARGE (FRANCE)	10,122	57.25	579,484.50	
LANXESS	4,844	49.76	241,037.44	
LINDE AG	9,734	149.00	1,450,366.00	
SOLVAY SA	3,155	108.70	342,948.50	
STORA ENSO OYJ R	31,297	7.59	237,544.23	
THYSSEN KRUPP	20,902	19.15	400,377.81	
UMICORE	6,637	32.10	213,080.88	
UPM KYMMENE CORP	27,512	13.17	362,333.04	
VOESTALPINE AG	4,791	35.85	171,757.35	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	7,907	28.03	221,633.21	
AIRBUS GROUP NV	31,000	57.03	1,767,930.00	
ALSTOM RGPT	11,643	27.57	320,997.51	
ANDRITZ AG	2,986	43.00	128,398.00	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,427	37.45	165,813.28	
BOUYGUES ORD	9,712	31.09	301,946.08	
BRENNTAG AG	2,783	134.10	373,200.30	
CNH INDUSTRIAL NV	50,975	8.71	444,247.12	
FERROVIAL SA	22,078	15.00	331,170.00	
FINMECCANICA SPA	25,448	6.36	161,976.52	
GEA GROUP AG	9,866	35.05	345,803.30	
HOCHTIEF AG	1,793	64.90	116,365.70	
KONE OYJ-B	16,796	32.57	547,045.72	
KONINKLIJKE PHILIPS	51,079	28.06	1,433,276.74	
LEGRAND SA	14,256	41.15	586,634.40	
MAN SE	2,099	90.43	189,812.57	
METSO OYJ	6,575	24.86	163,454.50	
OCI NV	5,400	34.70	187,380.00	
OSRAM LICHT AG	4,722	46.72	220,611.84	

PRYSMIAN SPA	10,872	19.54	212,438.88	
REXEL SA	12,359	20.27	250,578.72	
SAFRAN SA	14,689	53.39	784,245.71	
SAINT-GOBAIN	21,627	41.02	887,139.54	
SCHNEIDER ELECTRIC	27,956	65.35	1,826,924.60	
SIEMENS	41,792	100.55	4,202,185.60	
THALES SA	5,301	48.95	259,483.95	
VALLOUREC	5,583	40.93	228,512.19	
VALMET CORP	6,575	6.70	44,052.50	
VINCI S.A.	25,090	48.74	1,223,012.05	
WARTSILA OYJ	9,358	40.60	379,934.80	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	13.95	142,303.95	
ZODIAC AEROSPACE	1,790	132.55	237,264.50	
BUREAU VERITAS SA	11,149	20.20	225,265.54	
EDENRED	11,350	23.18	263,149.75	
RANDSTAD HOLDING NV	6,762	48.30	326,604.60	
SOCIETE BIC SA	1,800	88.30	158,940.00	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	22,413	17.38	389,650.00	
ADP	1,728	83.70	144,633.60	
ATLANTIA SPA	19,265	17.32	333,669.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,159	18.25	221,962.54	
DEUTSCHE POST AG-REG	47,478	26.60	1,262,914.80	
FRAPORT AG	2,319	56.00	129,864.00	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	32,020	8.20	262,724.10	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	56,869	5.19	295,434.45	
TNT EXPRESS	22,191	7.14	158,532.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,362	86.21	1,496,778.02	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,666	63.75	169,957.50	
CONTINENTAL AG	5,738	164.85	945,909.30	
DAIMLER AG	50,687	66.09	3,349,903.83	
FIAT ORD	47,091	7.44	350,357.04	
MICHELIN	9,752	81.20	791,862.40	
NOKIAN RENKAAT OYJ	6,178	35.76	220,925.28	
PIRELLI & CO	11,059	12.63	139,675.17	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,935	78.41	622,183.35	
RENAULT SA	9,986	68.25	681,544.50	
VALEO SA	3,978	87.03	346,205.34	
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,584	203.35	1,542,206.40	
VOLKSWAGEN STAMM	1,589	197.35	313,589.15	
ADIDAS AG	10,925	90.79	991,880.75	
CHRISTIAN DIOR	2,802	130.10	364,540.20	
HUGO BOSS AG	1,699	96.00	163,104.00	

KERING	4,084	152.20	621,584.80	
LUXOTTICA GROUP SPA	9,028	37.41	337,737.48	
LVMH	13,340	126.70	1,690,178.00	
ACCOR	8,071	35.93	290,031.38	
SODEXO	5,007	76.23	381,683.61	
AXEL SPRINGER SE	2,489	48.12	119,770.68	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,458	22.30	188,613.40	
JC DECAUX SA	3,121	31.95	99,715.95	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,323	96.96	128,278.08	
LAGADERE S.C.A	6,639	27.13	180,116.07	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-RIGISTERED	10,036	34.70	348,249.20	
PUBLICIS GROUPE	9,914	67.55	669,690.70	
REED ELSEVIER NV	37,555	15.92	597,875.60	
RTL GROUP	2,054	93.62	192,311.91	
SES	15,539	24.27	377,131.53	
SKY DEUTSCHLAND AG	23,240	7.27	169,001.28	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,220	43.65	140,569.10	
WOLTERS KLUWER	15,329	22.01	337,467.93	
INDITEX	11,806	118.90	1,403,733.40	
AHOLD (KON.)	52,304	12.72	665,306.88	
CARREFOUR	32,139	27.33	878,519.56	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,282	83.11	272,767.02	
COLRUYT SA	4,415	39.99	176,577.92	
DELHAIZE GROUP	5,268	45.84	241,485.12	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	33,359	6.67	222,771.40	
JERONIMO MARTINS	15,262	13.23	201,916.26	
METRO STAMM	6,525	34.92	227,853.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV	42,408	75.16	3,187,385.28	
DANONE (GROUPE)	29,809	50.69	1,511,018.21	
HEINEKEN HOLDING NV	5,452	45.39	247,493.54	
HEINEKEN NV	11,920	48.00	572,219.60	
KERRY GROUP PLC-A	8,560	51.52	441,011.20	
PERNOD-RICARD	11,083	82.20	911,022.60	
REMY COINTREAU	1,575	56.20	88,515.00	
SUEDZUCKER AG	4,926	20.40	100,490.40	
UNILEVER NV-CVA	85,660	28.74	2,461,868.40	
BEIERSDORF AG	5,460	76.81	419,382.60	
HENKEL AG & CO KGAA	6,702	75.79	507,944.58	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,274	84.06	779,572.44	
LOREAL	12,693	125.15	1,588,528.95	
CELESIO AG	4,224	22.90	96,750.72	

ESSILOR INTERNATIONAL	11,102	79.38	881,276.76	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,168	53.29	595,142.72	
FRESENIUS SE&CO KGAA	6,499	116.75	758,758.25	
BAYER	43,593	101.30	4,415,970.90	
GRIFOLS SA	8,679	38.20	331,537.80	
MERCK KGAA	3,505	131.35	460,381.75	
ORION OYJ-CLASS B	5,839	20.39	119,057.21	
QIAGEN N.V.	13,772	18.02	248,171.44	
SANOFI	62,976	75.52	4,755,947.52	
UCB (GROUPE)	5,804	52.28	303,433.12	
BANCO BILBAO VIZCAYA	314,042	9.71	3,049,347.82	
BANCO DE SABADELL SA	186,109	2.10	392,131.66	
BANCO SANTANDER SA	616,405	6.71	4,137,310.36	
BANCO SANTANDER SA-RTS	616,405	0.15	96,159.18	
BNP PARIBAS	53,119	57.72	3,066,028.68	
CAIXABANK	67,785	4.40	298,254.00	
COMMERZBANK AG	53,360	13.54	722,761.20	
CREDIT AGRICOLE SA	54,249	10.34	560,934.66	
ERSTE GROUP BANK AG	14,327	29.10	416,915.70	
INTESA SANPAOLO	613,139	1.95	1,200,526.16	
KBC GROEP NV	12,490	46.00	574,540.00	
NATIXIS	46,847	4.65	218,213.32	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	31.00	105,400.00	
SOCIETE GENERALE	38,230	44.85	1,714,615.50	
UNICREDIT SPA	229,360	5.95	1,364,692.00	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	45,851	5.63	258,370.38	
DEUTSCHE BANK NAMEN	54,267	39.34	2,134,863.78	
DEUTSCHE BOERSE	10,126	60.33	610,901.58	
EURAZEO	1,975	54.80	108,230.00	
EXOR SPA	5,807	30.88	179,320.16	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,236	67.70	286,777.20	
ING GROEP	204,216	10.85	2,215,743.60	
MEDIOBANCA	30,462	7.02	213,995.55	
OKO BANK-A	6,702	14.98	100,395.96	
WENDEL	1,898	106.70	202,516.60	
AEGON	98,534	6.82	672,001.88	
AGEAS	11,969	32.84	393,121.80	
ALLIANZ SE-REG	24,328	133.90	3,257,519.20	
ASSICURAZIONI GENERALI	61,532	16.99	1,045,428.68	
AXA	95,511	20.14	1,923,591.54	
CNP ASSURANCES	8,550	15.60	133,380.00	
DELTA LLOYD NV	11,075	19.30	213,802.87	

HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,252	62.28	202,534.56	
MAPFRE SA	55,064	3.45	190,356.24	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	9,531	158.15	1,507,327.65	
SAMPO OYJ-A SHS	22,291	34.98	779,739.18	
SCOR SE	7,779	25.81	200,775.99	
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA	47,000	2.34	110,074.00	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,264	38.67	87,548.88	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,145	14.66	236,766.42	
IMMOFINANZ AG	55,175	3.59	198,133.42	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,889	30.01	626,878.89	
ATOS	3,458	66.75	230,821.50	
CAP GEMINI SA	7,599	51.77	393,400.23	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,198	87.16	278,737.68	
GEMALTO	4,231	86.05	364,077.55	
SAP AG	48,509	60.68	2,943,526.12	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,632	32.87	185,152.00	
ALCATEL-LUCENT	148,862	3.06	456,559.75	
NOKIA CORP	197,059	5.82	1,147,868.67	
BELGACOM	7,760	21.91	170,060.40	
DEUTSCHE TELEKOM	151,914	12.46	1,892,848.44	
ELISA A	7,061	19.49	137,618.89	
ILIAD SA	1,349	163.65	220,763.85	
KPN (KON.)	171,949	2.70	464,262.30	
ORANGE	96,826	9.67	936,404.24	
PORTUGAL TELECOM	41,591	3.55	147,648.05	
TELECOM ITALIA ORD	544,541	0.85	467,216.17	
TELECOM ITALIA RNC	319,440	0.66	213,545.64	
TELEFONICA	217,971	12.48	2,721,367.93	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16,719	6.20	103,774.83	
TELEKOM AUSTRIA AG	13,843	6.51	90,173.30	
VIVENDI	63,096	19.50	1,230,687.48	
ZIGGO NV	7,516	33.63	252,800.66	
E.ON SE	94,348	13.56	1,279,358.88	
ELECTRICITE DE FRANCE	12,365	25.24	312,154.42	
ENAGAS	10,414	20.77	216,350.85	
ENEL	342,713	3.36	1,153,571.95	
ENEL GREEN POWER SPA	92,686	1.95	181,108.44	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	114,604	2.86	328,684.27	
FORTUM OYJ	23,610	16.32	385,315.20	
GAS NATURAL SDG SA	19,183	19.22	368,793.17	
GDF SUEZ	69,490	17.34	1,205,304.05	

	IBERDROLA SA	257,911	4.69	1,211,150.05	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,917	54.06	319,873.02	
	RWE STAMM	25,441	26.82	682,327.62	
	SNAM SPA	110,056	4.07	447,927.92	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,532	13.95	202,794.06	
	TERNA SPA	83,672	3.59	300,717.16	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,757	12.19	240,837.83	
	ASML HOLDING NV	18,708	62.05	1,160,831.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES	58,579	7.69	450,882.56	
	STMICROELECTRONICS	37,108	5.73	212,703.05	
ユーロ小計		9,711,385		157,589,027.93 (22,153,865,546)	
合計		56,847,954		156,832,227,940 (156,832,227,940)	

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	224,000.00	152,320.00	
	アメリカドル小計		224,000.00	152,320.00 (15,847,372)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	40,986.00	253,703.34	
		LEND LEASE GROUP	28,820.00	320,478.40	
		SYDNEY AIRPORT	58,361.00	223,522.63	
	オーストラリアドル小計		128,167.00	797,704.37 (72,718,730)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	130,000.00	1,015,300.00	
	香港ドル小計		130,000.00	1,015,300.00 (13,615,173)	
投資信託受益証券合計				102,181,275 (102,181,275)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	20,342.00	411,925.50	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	20,727.00	1,723,450.05	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	50,991.00	520,108.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,397.00	779,666.36	
		BOSTON PROPERTIES	7,935.00	831,111.90	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,483.00	270,459.39	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENT	24,954.00	371,565.06	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,811.00	352,605.47	
		DUKE REALTY CORP	18,853.00	281,286.76	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,864.00	961,797.76	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,356.00	348,084.32	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	27,065.00	552,396.65	

	HCP INC	23,765.00	904,020.60	
	HEALTH CARE REIT INC	14,921.00	829,458.39	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,654.00	789,500.68	
	KIMCO REALTY CORP	22,989.00	477,251.64	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,318.00	290,880.46	
	MACERICH CO/THE	7,524.00	436,692.96	
	PLUM CREEK TIMBER COMMON	9,142.00	404,533.50	
	PROLOGIS INC	27,149.00	1,003,970.02	
	PUBLIC STORAGE	7,650.00	1,185,520.50	
	RAYONIER INC	7,016.00	294,040.56	
	REALTY INCOME CORP	10,053.00	386,135.73	
	REGENCY CENTERS CORP	5,612.00	270,891.24	
	SIMON PROPERTY GROUP	16,324.00	2,558,134.04	
	SL GREEN REALTY CORP	5,153.00	479,177.47	
	UDR INC	13,985.00	334,381.35	
	VENTAS INC	15,287.00	931,895.52	
	VORNADO REALTY TRUST	8,760.00	803,992.80	
アメリカドル小計		454,080.00	19,784,934.88 (2,058,424,624)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	7,535.00	158,611.75	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,604.00	188,046.92	
カナダドル小計		15,139.00	346,658.67 (32,939,506)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	126,802.00	250,433.95	
	DEXUS PROPERTY GROUP	242,301.00	254,416.05	
	FEDERATION CENTRES	89,917.00	212,204.12	
	GOODMAN GROUP	91,399.00	427,747.32	
	GPT GROUP	90,744.00	331,215.60	
	MIRVAC GROUP	215,406.00	375,883.47	
	STOCKLAND	131,200.00	498,560.00	
	WESTFIELD GROUP	111,987.00	1,142,267.40	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	165,924.00	511,045.92	
オーストラリアドル小計		1,265,680.00	4,003,773.83 (364,984,022)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,918.00	331,455.52	
	HAMMERSON PLC	38,982.00	201,926.76	
	INTU PROPERTIES PLC	40,230.00	126,523.35	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	42,914.00	442,014.20	
	SEGRO PLC	38,146.00	129,925.27	
イギリスポンド小計		210,190.00	1,231,845.10 (210,202,047)	
香港ドル	LINK REIT	125,000.00	4,487,500.00	

	香港ドル小計		125,000.00	4,487,500.00 (60,177,375)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	111,000.00	238,650.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	110,000.00	163,900.00	
		CAPITAMALL TRUST	149,000.00	279,375.00	
	シンガポールドル小計		370,000.00	681,925.00 (55,583,706)	
	ユーロ	CORIO NV	3,438.00	115,035.48	
		FONCIERE DES REGIONS	1,649.00	103,013.03	
		GECINA SA	1,389.00	132,135.57	
		ICADE	2,102.00	136,840.20	
		KLEPIERRE	5,171.00	177,985.82	
		UNIBAIL-RODAMCO SE	5,148.00	975,803.40	
	ユーロ小計		18,897.00	1,640,813.50 (230,665,561)	
投資証券合計				3,012,976,841 (3,012,976,841)	
合計				3,115,158,116 (3,115,158,116)	

(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	579銘柄	97.8%	58.2%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.0%	0.0%
	投資証券	29銘柄	2.2%	1.3%
カナダドル	株式	92銘柄	99.5%	4.4%
	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	91.7%	3.0%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.4%	0.0%
	投資証券	9銘柄	6.9%	0.2%
イギリスポンド	株式	101銘柄	98.7%	9.9%
	投資証券	5銘柄	1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	38銘柄	100.0%	4.1%
香港ドル	株式	37銘柄	96.5%	1.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.7%	0.0%
	投資証券	1銘柄	2.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	26銘柄	94.6%	0.6%
	投資証券	3銘柄	5.4%	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	31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	9銘柄	100.0%	0.2%
ユーロ	株式	227銘柄	99.0%	13.9%
	投資証券	6銘柄	1.0%	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。

「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26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	223,072,622
コール・ローン	405,154,823
国債証券	26,179,415,141
派生商品評価勘定	136,728
未収利息	400,469,306
前払費用	30,428,808
流動資産合計	27,238,677,428
資産合計	27,238,677,428
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	1,473,141
未払金	413,940,535
未払解約金	9,083,959
流動負債合計	424,497,635
負債合計	424,497,635
純資産の部	
元本等	
元本	16,642,891,635
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,171,288,158
元本等合計	26,814,179,793
純資産合計	26,814,179,793
負債純資産合計	27,238,677,428

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20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発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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	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26年 1月20日現在
1. 計算期間の期首元本額	11,568,259,032円

計算期間中の追加設定元本額	8,926,010,704円
計算期間中の一部解約元本額	3,851,378,101円
計算日の元本額	16,642,891,635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	2,562,005,682円
世界経済インデックスファンド	452,270,975円
DC新興国債券インデックス・オープン	1,831,238,978円
DC世界経済インデックスファンド	370,350,537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)	500,897,732円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,263,857,047円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,503,641,035円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	7,935,848,312円
分散投資コア戦略ファンドA	47,100,677円
分散投資コア戦略ファンドS	119,982,327円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	52,811円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	162,832円
コア投資戦略ファンド(切替型)	27,517,526円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	14,415,423円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	13,238,151円
新興国債券インデックス・オープン	311,590円
2. 計算日における受益権総数	16,642,891,635口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6111円 (16,111円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△266,500,182
合計	△266,500,182

(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25年11月12日から平成26年1月20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26年 1月20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	110,142,000	－	109,751,650	△390,350
	マレーシアリンギット	17,419,367	－	17,405,509	△13,858
	メキシコペソ	88,144,000	－	87,696,000	△448,000
	ハンガリーフォリント	15,942,796	－	15,737,900	△204,896
	南アフリカランド	99,632,000	－	99,216,000	△416,000
	ブラジルレアル	17,069,760	－	17,069,723	△37
	計	348,349,923	－	346,876,782	△1,473,141
	売　建				
	アメリカドル	17,069,760	－	16,933,032	136,728
	計	17,069,760	－	16,933,032	136,728
合計		365,419,683	－	363,809,814	△1,336,413

(注)時価の算定方法

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

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

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

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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 3.172% 07/15/16	9,050,000.00	9,044,343.75	
		MGS 3.197% 10/15/15	1,350,000.00	1,352,740.50	
		MGS 3.26% 03/01/18	4,400,000.00	4,343,416.00	

	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000.00	9,510,576.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	7,000,000.00	6,657,665.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	800,000.00	759,812.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	6,200,000.00	6,038,924.00	
	MGS 3.58% 09/28/18	5,000,000.00	4,970,950.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	7,700,000.00	7,758,712.50	
	MGS 3.835% 08/12/15	3,200,000.00	3,238,832.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,450,000.00	1,320,217.75	
	MGS 3.889% 07/31/20	3,850,000.00	3,844,475.25	
	MGS 3.892% 03/15/27	4,300,000.00	4,051,976.00	
	MGS 4.012% 09/15/17	1,500,000.00	1,521,810.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	3,250,000.00	3,084,347.50	
	MGS 4.16% 07/15/21	3,100,000.00	3,124,087.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	780,000.00	754,139.10	
	MGS 4.24% 02/07/18	3,900,000.00	3,978,331.50	
	MGS 4.262% 09/15/16	2,000,000.00	2,052,180.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,550,000.00	3,636,815.25	
	MGS 4.392% 04/15/26	3,200,000.00	3,200,304.00	
マレーシアリンギット小計		85,180,000.00	84,244,655.10 (2,645,282,170)	
タイバーツ	THAIGB 2.8% 10/10/17	30,500,000.00	30,312,730.00	
	THAIGB 3.125% 12/11/15	57,500,000.00	58,268,487.50	
	THAIGB 3.25% 06/16/17	115,000,000.00	116,634,725.00	
	THAIGB 3.45% 03/08/19	51,600,000.00	51,846,648.00	
	THAIGB 3.58% 12/17/27	78,500,000.00	73,770,767.50	
	THAIGB 3.625% 05/22/15	64,600,000.00	65,727,593.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	81,500,000.00	79,381,407.50	
	THAIGB 3.65% 12/17/21	58,200,000.00	57,959,052.00	
	THAIGB 3.875% 06/13/19	86,500,000.00	88,702,722.50	
	THAIGB 4.125% 11/18/16	15,700,000.00	16,292,047.00	
	THAIGB 4.75% 12/20/24	12,262,000.00	12,997,413.45	
	THAIGB 5.125% 03/13/18	27,000,000.00	29,064,690.00	
タイバーツ小計		678,862,000.00	680,958,283.45 (2,151,828,175)	
フィリピンペソ	RPGB 7.375% 03/03/21	17,000,000.00	19,962,709.00	
	RPGB 8% 07/19/31	30,500,000.00	40,347,870.50	
フィリピンペソ小計		47,500,000.00	60,310,579.50 (139,317,438)	
インドネシアルピア	INDOGB 10% 02/15/28	5,700,000,000.00	6,145,312,500.00	
	INDOGB 10% 07/15/17	3,600,000,000.00	3,838,500,000.00	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	4,600,000,000.00	5,189,375,000.00	
	INDOGB 10.75% 05/15/16	3,500,000,000.00	3,723,125,000.00	

	INDOGB 11% 09/15/25	5,850,000,000.00	6,782,343,750.00	
	INDOGB 11% 11/15/20	6,900,000,000.00	7,930,687,500.00	
	INDOGB 12.8% 06/15/21	3,000,000,000.00	3,742,500,000.00	
	INDOGB 5.25% 05/15/18	11,300,000,000.00	10,254,750,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	18,300,000,000.00	15,006,000,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	11,500,000,000.00	8,862,187,500.00	
	INDOGB 6.25% 04/15/17	12,300,000,000.00	11,784,937,500.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	43,500,000,000.00	34,310,625,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	12,100,000,000.00	11,109,312,500.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	26,200,000,000.00	22,286,375,000.00	
	INDOGB 7.375% 09/15/16	16,700,000,000.00	16,543,437,500.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	27,700,000,000.00	25,830,250,000.00	
	INDOGB 8.25% 07/15/21	9,200,000,000.00	9,159,750,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	4,000,000,000.00	3,847,500,000.00	
	INDOGB 9.5% 05/15/41	4,765,000,000.00	4,887,103,125.00	
	INDOGB 9.5% 06/15/15	5,000,000,000.00	5,137,500,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	3,400,000,000.00	3,546,625,000.00	
インドネシアルピア小計		239,115,000,000.00	219,918,196,875.00 (1,891,296,493)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	6,100,000.00	7,783,478.00	
	MBONO 10% 12/05/24	16,300,000.00	20,931,971.00	
	MBONO 4.75% 06/14/18	16,200,000.00	15,899,895.00	
	MBONO 5% 06/15/17	20,500,000.00	20,662,360.00	
	MBONO 6% 06/18/15	12,500,000.00	12,888,562.50	
	MBONO 6.25% 06/16/16	27,500,000.00	28,896,450.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	16,000,000.00	16,300,320.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	20,700,000.00	21,301,128.00	
	MBONO 7% 06/19/14	7,400,000.00	7,503,563.00	
	MBONO 7.25% 12/15/16	23,500,000.00	25,312,672.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	14,200,000.00	15,237,097.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	23,126,070.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	20,700,000.00	21,230,437.50	
	MBONO 7.75% 12/14/17	12,650,000.00	13,881,730.50	
	MBONO 8% 06/11/20	12,800,000.00	14,330,048.00	
	MBONO 8% 12/07/23	12,500,000.00	14,028,375.00	
	MBONO 8% 12/17/15	11,500,000.00	12,366,180.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	15,500,000.00	17,690,615.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	20,700,000.00	22,988,385.00	
	MBONO 8.5% 12/13/18	9,800,000.00	11,145,981.00	
メキシコペソ小計		319,050,000.00	343,505,319.00 (2,693,081,700)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000.00	11,255,230.00	

	BLTN 0% 01/01/17	3,200,000.00	2,268,064.00	
	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000.00	9,021,763.00	
	BLTN 0% 07/01/16	550,000.00	415,228.55	
	BNTNF 10% 01/01/15	3,700,000.00	3,668,554.18	
	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000.00	8,998,486.73	
	BNTNF 10% 01/01/18	2,300,000.00	2,131,946.19	
	BNTNF 10% 01/01/21	4,450,000.00	3,927,143.37	
	BNTNF 10% 01/01/23	3,450,000.00	2,964,909.74	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	2,800,000.00	2,673,160.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000.00	9,864,705.00	
	BRAZIL 12.5% 01/05/22	2,500,000.00	2,761,150.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,400,000.00	1,235,563.00	
ブラジルレアル小計		67,600,000.00	61,185,903.76 (2,717,265,985)	
チリペソ	CHILE 5.5% 08/05/20	200,000,000.00	203,236,000.00	
チリペソ小計		200,000,000.00	203,236,000.00 (39,265,195)	
コロンビアペソ	COLOM 12% 10/22/15	8,750,000,000.00	9,828,437,500.00	
	COLOM 4.375% 03/21/23	1,000,000,000.00	888,285,000.00	
	COLOM 7.75% 04/14/21	4,170,000,000.00	4,640,146,650.00	
	COLOM 9.85% 06/28/27	1,155,000,000.00	1,466,341,800.00	
コロンビアペソ小計		15,075,000,000.00	16,823,210,950.00 (891,630,180)	
ハンガリーフォリント	HGB 5.5% 02/12/16	239,000,000.00	249,548,265.00	
	HGB 5.5% 12/20/18	110,000,000.00	115,540,150.00	
	HGB 5.5% 12/22/16	208,000,000.00	219,022,960.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	274,000,000.00	287,054,730.00	
	HGB 6.5% 06/24/19	489,000,000.00	534,609,030.00	
	HGB 6.75% 02/24/17	295,000,000.00	321,449,700.00	
	HGB 6.75% 11/24/17	362,000,000.00	398,732,140.00	
	HGB 7% 06/24/22	313,000,000.00	348,480,115.00	
	HGB 7.5% 11/12/20	181,000,000.00	207,386,180.00	
	HGB 7.75% 08/24/15	240,000,000.00	257,319,600.00	
	HGB 8% 02/12/15	500,000,000.00	526,540,000.00	
ハンガリーフォリント小計		3,211,000,000.00	3,465,682,870.00 (1,618,820,468)	
ペルーヌエボソル	PERUGB 6.9% 08/12/37	2,650,000.00	2,590,004.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	1,150,000.00	1,145,543.75	
	PERUGB 7.84% 08/12/20	3,750,000.00	4,266,881.25	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,250,000.00	2,635,267.50	
	PERUGB 8.6% 08/12/17	700,000.00	805,493.50	
	PERUGB 9.91% 05/05/15	910,000.00	979,405.70	

ペルーヌエボソル小計		11,410,000.00	12,422,595.70 (460,257,170)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	3,450,000.00	3,256,299.75	
	POLGB 0% 07/25/15	1,500,000.00	1,440,292.50	
	POLGB 2.5% 07/25/18	3,250,000.00	3,109,941.25	
	POLGB 3.75% 04/25/18	7,300,000.00	7,387,673.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,800,000.00	3,700,687.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	1,900,000.00	1,990,022.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000.00	9,245,064.00	
	POLGB 5% 04/25/16	5,000,000.00	5,222,000.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	4,100,000.00	4,376,176.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	5,400,000.00	5,799,708.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	9,000,000.00	9,311,850.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	5,700,000.00	6,193,278.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000.00	8,338,786.25	
	POLGB 5.75% 10/25/21	4,000,000.00	4,409,860.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	4,500,000.00	4,765,927.50	
ポーランドズロチ小計		75,300,000.00	78,547,565.25 (2,652,551,278)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	41,000,000.00	48,005,260.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	24,000,000.00	26,698,320.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	29,000,000.00	21,259,755.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	15,400,000.00	11,343,717.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	18,500,000.00	17,465,665.00	
	SAGB 7% 02/28/31	16,500,000.00	13,782,285.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	32,400,000.00	31,830,570.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	20,300,000.00	19,946,780.00	
	SAGB 8% 12/21/18	33,600,000.00	34,495,776.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	26,000,000.00	26,992,030.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	27,800,000.00	26,428,487.00	
南アフリカランド小計		284,500,000.00	278,248,645.00 (2,657,274,559)	
ロシアルーブル	RFLB 7% 06/03/15	248,100,000.00	251,470,438.50	
	RFLB 7.6% 04/14/21	202,600,000.00	204,189,397.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	157,000,000.00	160,238,125.00	
	RUSSIA 7.85% 03/10/18	230,000,000.00	236,865,500.00	
ロシアルーブル小計		837,700,000.00	852,763,460.50 (2,643,566,727)	
ナイジェリア ナイラ	NIGB 15.1% 04/27/17	300,000,000.00	314,518,500.00	
	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000.00	510,188,625.00	
ナイジェリアナイラ小計		975,000,000.00	824,707,125.00 (532,101,037)	
トルコリラ	TURKGB 10% 06/17/15	4,670,000.00	4,679,363.35	

		TURKGB 10.5% 01/15/20	6,200,000.00	6,361,882.00	
		TURKGB 5% 05/13/15	4,500,000.00	4,235,962.50	
		TURKGB 6.3% 02/14/18	4,350,000.00	3,858,210.75	
		TURKGB 6.5% 01/07/15	5,000,000.00	4,852,125.00	
		TURKGB 7.1% 03/08/23	12,200,000.00	10,141,189.00	
		TURKGB 8.3% 06/20/18	1,500,000.00	1,416,367.50	
		TURKGB 8.5% 09/14/22	3,200,000.00	2,939,232.00	
		TURKGB 9% 01/27/16	4,200,000.00	4,138,932.00	
		TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000.00	5,377,020.00	
		TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000.00	4,441,323.25	
	トルコリラ小計		55,870,000.00	52,441,607.35 (2,445,876,566)	
国債証券合計				26,179,415,141 (26,179,415,141)	
合計				26,179,415,141 (26,179,415,141)	

(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	21銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券	12銘柄	100.0%	8.2%
フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
インドネシアルピア	国債証券	21銘柄	100.0%	7.2%
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	13銘柄	100.0%	10.4%
チリペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.1%
コロンビアペソ	国債証券	4銘柄	100.0%	3.4%
ハンガリーフォリント	国債証券	11銘柄	100.0%	6.2%
ペルーヌエボソル	国債証券	6銘柄	100.0%	1.8%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	10.2%
ロシアルーブル	国債証券	4銘柄	100.0%	10.1%
ナイジェリアナイラ	国債証券	2銘柄	100.0%	2.0%
トルコリラ	国債証券	11銘柄	100.0%	9.3%

(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。

「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26年 1月20日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	603,740,590
コール・ローン	187,706,441
株式	20,370,653,352
投資信託受益証券	63,032,861
投資証券	25,146,549
派生商品評価勘定	709,924
未収入金	27,621,275
未収配当金	13,911,375
未収利息	252
差入委託証拠金	209,726,668
流動資産合計	21,502,249,287
資産合計	21,502,249,287
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,026,248
未払解約金	676,039
流動負債合計	22,702,287
負債合計	22,702,287
純資産の部	
元本等	
元本	9,889,841,624

剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	11,589,705,376
元本等合計	21,479,547,000
純資産合計	21,479,547,000
負債純資産合計	21,502,249,287

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 1月20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発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

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26年 1月20日現在
1.　計算期間の期首元本額	8,859,252,989円
計算期間中の追加設定元本額	3,129,849,684円
計算期間中の一部解約元本額	2,099,261,049円
計算日の元本額	9,889,841,624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	4,693,201,531円
世界経済インデックスファンド	352,368,066円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,714,289,339円
DC世界経済インデックスファンド	288,731,786円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,836,111,473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)	302,155,861円
コア投資戦略ファンド(安定型)	245,915,619円
コア投資戦略ファンド(成長型)	374,217,141円
分散投資コア戦略ファンドA	9,128,997円
分散投資コア戦略ファンドS	29,731,118円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	131,514円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	43,838円
コア投資戦略ファンド(切替型)	6,967,093円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	33,061,724円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,231,930円
新興国株式インデックス・オープン	554,594円
2.　計算日における受益権総数	9,889,841,624口
3.　1口当たり純資産額	2.1719円
(1万口当たり純資産額)	(21,719円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成26年 1月20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経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成26年 1月20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26年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△257,102,028
投資信託受益証券	△4,916,833
投資証券	3,073,594
合計	△258,945,267

(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25年11月12日から平成26年1月20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26年 1月20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	1,059,015,877	－	1,038,284,866	△20,731,011
合計		1,059,015,877	－	1,038,284,866	△20,731,011

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

通貨関連

区分	種類	平成26年 1月20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	205,445,432	－	204,860,096	△585,336
	計	205,445,432	－	204,860,096	△585,336
	売　建				
	ブラジルレアル	25,364	－	25,341	23
	計	25,364	－	25,341	23
合計		205,470,796	－	204,885,437	△585,313

(注)時価の算定方法

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

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

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

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 1月20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26年 1月20日現在
該当事項はありません。

(3)附属明細表(平成26年1月20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	25,637	35.56	911,651.72	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	316,824	8.17	2,588,452.08	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	58,400	1.62	94,900.00	
	LUKOIL-SPON ADR	28,180	58.65	1,652,757.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,032	128.80	648,121.60	
	ROSNEFT OJSC-GDR	66,687	7.34	489,816.01	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	57,602	8.17	470,896.35	
	TATNEFT-SPONSORED REGS GDR	13,214	35.32	466,718.48	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	12.28	207,900.40	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	32,996	16.59	547,403.64	
	SEVERSTAL - GDR REG S	16,824	9.09	152,930.16	
	SOUTHERN COPPER CORP	6,420	29.34	188,362.80	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	15,804	27.07	427,814.28	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	14,211	60.70	862,607.70	
	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	17,341	47.59	825,258.19	

	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	69,165	4.40	304,326.00	
	CREDICORP LTD	2,490	132.50	329,925.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	154,779	12.05	1,865,086.95	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	116,810	2.83	330,689.11	
	GLOBAL TELECOM HOLDING-GDR REG S	44,085	3.34	147,243.90	
	MEGAFON-GDR	5,181	31.15	161,388.15	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	29,756	19.70	586,193.20	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	11,069	20.05	221,933.45	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	6,706	31.09	208,489.54	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	72,272	1.66	120,188.33	
アメリカドル小計		1,204,415		14,811,054.04 (1,540,942,062)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	208,000	4.19	871,520.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	80,000	23.65	1,892,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,357,400	6.04	8,198,696.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	181,500	22.05	4,002,075.00	
	CNOOC LTD-R	945,000	13.86	13,097,700.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	180,000	13.94	2,509,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,124,000	8.10	9,104,400.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	96,000	6.41	615,360.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	180,000	2.82	507,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	66,000	30.60	2,019,600.00	
	BBMG CORPORATION - H	57,000	6.17	351,690.00	
	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	84,000	4.64	389,760.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	160,000	7.83	1,252,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	134,000	5.46	731,640.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	90,000	8.53	767,700.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	82,000	13.78	1,129,960.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	83,000	5.05	419,150.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	87,000	6.74	586,380.00	
	SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GROUP LIMITED	182,000	2.45	445,900.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	327,000	2.14	699,780.00	
	YINGDE GASES GROUP COMPANY	61,000	7.54	459,940.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	273,000	1.68	458,640.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	96,000	4.64	445,440.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	30,000	69.35	2,080,500.00	
	CHINA COMMUICATIONS CONST-H	222,000	5.63	1,249,860.00	
	CHINA INTL MARINE CO-H	18,200	18.26	332,332.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	102,500	6.80	697,000.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	222,000	3.63	805,860.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	92,000	14.42	1,326,640.00	
CITIC PACIFIC LIMITED -R	71,000	10.22	725,620.00	
CSR CORP LTD-H	100,000	5.82	582,000.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	168,000	2.54	426,720.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	23,000	27.25	626,750.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	24,000	10.80	259,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	25,200	29.25	737,100.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	21,000	25.25	530,250.00	
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	64,380	6.79	437,140.20	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	121,000	11.08	1,340,680.00	
AIR CHINA LIMITED-H	92,000	5.16	474,720.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	108,000	5.83	629,640.00	
CHINA COSCO HOLDONGS-H	142,500	3.46	493,050.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL-R	61,513	27.45	1,688,531.85	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	220,000	1.95	429,000.00	
COSCO PACIFIC LIMITED-R	100,000	10.26	1,026,000.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.91	605,880.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.86	603,680.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	162,000	12.66	2,050,920.00	
BYD CO LTD-H	26,000	36.90	959,400.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBI-B	29,900	15.40	460,460.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	148,000	11.78	1,743,440.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	265,000	3.23	855,950.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	54,250	35.05	1,901,462.50	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	122,246	7.84	958,408.64	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	47,000	11.70	549,900.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	42,000	24.45	1,026,900.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	32,000	26.25	840,000.00	
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	258,000	9.25	2,386,500.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	37,000	10.74	397,380.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	585,000	1.28	748,800.00	
INTIME RETAIL GROUP CO LTD	70,000	7.69	538,300.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	11.52	380,160.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE-R	66,000	24.30	1,603,800.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	130,500	10.98	1,432,890.00	
WUMART STORES INC-H	29,000	11.66	338,140.00	
BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	8,000	71.50	572,000.00	
CHAODA MODERN AGRICULTURE	68,000	—	—	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	92,300	3.64	335,972.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO-R	76,000	37.30	2,834,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	112,000	21.75	2,436,000.00	

TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	22,000	59.30	1,304,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	78,000	6.97	543,660.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	325,000	10.62	3,451,500.00	
YANTAI CHANGYU PIONEER-B	10,800	21.54	232,632.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	41,500	91.00	3,776,500.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	92,000	10.28	945,760.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	43,000	19.46	836,780.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	54,000	22.95	1,239,300.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	100,000	7.86	786,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	136,000	6.93	942,480.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,139,000	3.45	3,929,550.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,985,200	3.39	13,509,828.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	455,475	5.20	2,368,470.00	
CHINA CITIC BANK-H	441,200	3.86	1,703,032.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,833,620	5.49	21,046,573.80	
CHINA MERCHANTS BANK-H	244,923	14.50	3,551,383.50	
CHINA MINSHENG BANKING-H	276,000	7.91	2,183,160.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	139,000	3.42	475,380.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	3,921,515	4.88	19,136,993.20	
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	50,000	11.46	573,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	61,500	18.32	1,126,680.00	
FAR EAST HORIZON LTD	76,000	6.25	475,000.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	79,600	11.80	939,280.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	401,000	22.65	9,082,650.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	145,000	28.20	4,089,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	54,400	14.40	783,360.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	42,600	24.30	1,035,180.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	279,000	3.57	996,030.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	179,412	10.40	1,865,884.80	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	102,500	68.75	7,046,875.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	7.57	545,040.00	
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	28,000	6.87	192,360.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	219,040	21.65	4,742,216.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	110,000	19.40	2,134,000.00	
CHINA VANKE CO LTD-B	66,200	11.95	791,090.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	242,285	4.46	1,080,591.10	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	348,000	2.79	970,920.00	
FRANSHION PROPERTIES	220,000	2.60	572,000.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	29,500	11.24	331,580.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	45,600	10.54	480,624.00	

	LONGFOR PROPERTIES	68,500	11.12	761,720.00	
	POLY PRORERTY GROUP CO LIMITED	137,000	3.90	534,300.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	17.78	1,369,060.00	
	SHUI ON LAND LTD	209,278	2.40	502,267.20	
	SINO-OCEAN LAND HOLDINGS-R	160,178	4.80	768,854.40	
	SOHO CHINA LTD	113,000	6.23	703,990.00	
	YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	344,000	1.78	612,320.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	54,800	529.00	28,989,200.00	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	31,800	19.20	610,560.00	
	LENOVO GROUP LTD	348,000	10.04	3,493,920.00	
	ZTE CORP-H	40,424	16.26	657,294.24	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	114,000	4.38	499,320.00	
	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	322,500	77.85	25,106,625.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	772,000	3.66	2,825,520.00	
	CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	260,000	10.40	2,704,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	94,000	4.58	430,520.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	108,000	12.04	1,300,320.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	137,000	10.04	1,375,480.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	46,000	25.45	1,170,700.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	107,400	19.34	2,077,116.00	
	DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD.-H	158,000	3.28	518,240.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	44,000	55.35	2,435,400.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	162,000	7.56	1,224,720.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	188,000	7.31	1,374,280.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	503,000	2.97	1,493,910.00	
	HANERGY SOLAR GROUP LTD	534,000	1.18	630,120.00	
香港ドル小計		34,135,139		300,403,368.43 (4,028,409,170)	
マレーシアリンギット	BUMI ARMADA BERHAD	43,800	4.04	176,952.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	11,800	30.70	362,260.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	188,000	4.67	877,960.00	
	LAFARGE MALAYAN BHD	26,100	7.90	206,190.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	130,900	6.67	873,103.00	
	GAMUDA BHD	88,900	4.28	380,492.00	
	IJM CORP BHD	65,200	5.72	372,944.00	
	MMC CORP BHD	53,800	2.88	154,944.00	
	SIME DARBY BERHAD	146,342	9.12	1,334,639.04	
	AIRASIA BHD	64,800	2.36	152,928.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,419	8.75	266,166.25	
	MISC BHD	56,540	5.57	314,927.80	
	UMW HOLDINGS BHD	20,000	11.76	235,200.00	

	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	30,607	4.05	123,958.35	
	GENTING BHD	110,100	10.20	1,123,020.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	158,200	4.30	680,260.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	75,200	2.97	223,344.00	
	PARKSON HOLDINGS BHD	50,285	2.88	144,820.80	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,900	62.00	427,800.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	80,300	4.35	349,305.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,000	10.72	150,080.00	
	IOI CORPORATION BHD	158,340	4.14	655,527.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	29,000	23.66	686,140.00	
	PPB GROUP BERHAD	25,800	15.24	393,192.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	122,600	3.80	465,880.00	
	ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,600	4.82	340,292.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	241,200	7.11	1,714,932.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	32,680	14.26	466,016.80	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,100	15.12	137,592.00	
	MALAYAN BANKING BHD	225,553	9.80	2,210,419.40	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	53,500	19.20	1,027,200.00	
	RHB CAPITAL BHD	33,195	7.89	261,908.55	
	AMMB HOLDINGS BHD	98,200	7.31	717,842.00	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	52,780	3.00	158,340.00	
	UEM SUNRISE BHD	68,900	2.17	149,513.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	139,375	6.64	925,450.00	
	DIGI.COM BERHAD	198,100	4.74	938,994.00	
	MAXIS BHD	128,400	7.00	898,800.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	66,300	5.51	365,313.00	
	PETRONAS GAS BHD	31,000	23.14	717,340.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	146,275	11.46	1,676,311.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	280,217	1.56	437,138.52	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	116,500	1.88	219,020.00	
マレーシアリンギット小計		3,779,808		24,494,456.61 (769,125,937)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	79,000	27.00	2,133,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	572,800	3.24	1,855,872.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	74,200	159.00	11,797,800.00	
	PTT PCL-NVDR	46,000	288.00	13,248,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	48,000	55.00	2,640,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	64,000	21.30	1,363,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	92,734	74.25	6,885,499.50	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO-FOR REG	20,300	406.00	8,241,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	23,800	161.00	3,831,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	127,500	8.35	1,064,625.00	

	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	113,200	21.50	2,433,800.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	56,100	47.50	2,664,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	168,900	9.05	1,528,545.00	
	CP ALL PCL-NVDR	239,800	39.50	9,472,100.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	168,800	29.25	4,937,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	17,700	120.00	2,124,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	71,100	179.50	12,762,450.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	76,300	172.00	13,123,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	24,600	168.00	4,132,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	199,750	17.10	3,415,725.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	97,400	147.00	14,317,800.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	323,000	2.14	691,220.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	79,400	39.75	3,156,150.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	57,800	214.00	12,369,200.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	298,100	7.85	2,340,085.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	35,600	67.50	2,403,000.00	
タイバーツ小計		3,175,884		144,934,221.50 (457,992,139)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	81,000	52.75	4,272,750.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	139,100	26.40	3,672,240.00	
	DMCI HOLDINGS INC	21,700	57.95	1,257,515.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	63,500	39.00	2,476,500.00	
	SM INVESTMENTS CORP	8,467	709.00	6,003,103.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	39,080	96.60	3,775,128.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	25,450	167.00	4,250,150.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	44,760	121.80	5,451,768.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	47,476	84.20	3,997,479.20	
	BDO UNIBANK INC	67,381	72.25	4,868,277.25	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	5,869	76.40	448,391.60	
	AYALA CORPORATION	9,900	537.50	5,321,250.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	735,700	4.12	3,031,084.00	
	AYALA LAND INC	342,400	26.45	9,056,480.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	309,750	14.46	4,478,985.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,790	1,772.00	3,171,880.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,410	2,678.00	6,453,980.00	
	ABOITIZ POWER CORP	89,500	35.80	3,204,100.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	606,300	5.30	3,213,390.00	
フィリピンペソ小計		2,641,533		78,404,451.05 (181,114,281)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	800,500	975.00	780,487,500.00	
	INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	17,000	25,125.00	427,125,000.00	
	TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	37,500	9,475.00	355,312,500.00	

	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	82,000	21,900.00	1,795,800,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	171,500	15,200.00	2,606,800,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	94,000	19,300.00	1,814,200,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	123,500	5,000.00	617,500,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,091,500	6,925.00	7,558,637,500.00	
	GLOBAL MEDIACOM TBK PT	322,000	1,910.00	615,020,000.00	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	224,000	2,450.00	548,800,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	132,000	2,600.00	343,200,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TB	73,500	11,800.00	867,300,000.00	
	ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	20,000	20,875.00	417,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	387,000	3,915.00	1,515,105,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	27,500	45,000.00	1,237,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	80,500	10,925.00	879,462,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	234,500	6,675.00	1,565,287,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	86,500	27,650.00	2,391,725,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	1,356,500	1,390.00	1,885,535,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	668,000	9,900.00	6,613,200,000.00	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK	196,500	4,125.00	810,562,500.00	
	BANK MANDIRI	506,698	8,750.00	4,433,607,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	402,000	4,275.00	1,718,550,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	606,000	8,325.00	5,044,950,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	349,500	1,455.00	508,522,500.00	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,213,000	965.00	1,170,545,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA	2,447,500	2,225.00	5,445,687,500.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	60,500	6,000.00	363,000,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	172,500	5,125.00	884,062,500.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	620,500	4,385.00	2,720,892,500.00	
	インドネシアルピア小計	12,604,198		57,935,877,500.00 (498,248,546)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	604,223	16.48	9,957,595.04	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	203,392	43.33	8,812,975.36	
	INDUSTRIAS CH S.A.B.-SER B	8,600	81.82	703,652.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,565	331.82	2,510,218.30	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	59,690	52.55	3,136,709.50	
	MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	31,700	24.00	760,800.00	
	ALFA S.A.B.-A	152,100	36.87	5,607,927.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	31,700	68.31	2,165,427.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	9,000	163.43	1,470,870.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	11,700	153.21	1,792,557.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	17,480	70.01	1,223,774.80	
	OHL MEXICO SAB DE CV	37,600	35.32	1,328,032.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	140,590	80.03	11,251,417.70	

	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,900	142.32	1,551,288.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	19,600	41.54	814,184.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	283,480	32.70	9,269,796.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	21,275	75.83	1,613,283.25	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER	23,400	146.62	3,430,908.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	105,040	123.34	12,955,633.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	88,500	36.16	3,200,160.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	88,500	36.40	3,221,400.00	
	GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	47,800	34.51	1,649,578.00	
	GRUPO FIN SANTANDER-B	99,300	34.12	3,388,116.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	134,300	90.20	12,113,860.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	126,600	34.88	4,415,808.00	
	COMPARTAMOS SAB DE CV	59,900	24.14	1,445,986.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	1,899,340	14.44	27,426,469.60	
メキシコペソ小計		4,323,275		137,218,426.15 (1,075,792,461)	
ブラジルレアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	6,600	38.20	252,120.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	157,800	14.61	2,305,458.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	223,140	15.51	3,460,901.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,700	53.00	938,100.00	
	BRADESPAR SA -PREF	12,900	22.27	287,283.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,900	19.30	171,770.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	39,500	13.75	543,125.00	
	DURATEX SA	15,520	12.33	191,361.60	
	FIBRIA CELULOSE SA	12,900	25.87	333,723.00	
	GERDAU SA-PREF	45,800	17.29	791,882.00	
	KLABIN SA-PREF	28,900	12.69	366,741.00	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	16,100	21.83	351,463.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	18,500	9.29	171,865.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,779	13.94	247,839.26	
	VALE SA	68,200	32.49	2,215,818.00	
	VALE SA-PREF A	102,815	30.02	3,086,506.30	
	EMBRAER SA	33,200	19.83	658,356.00	
	MARCOPOLO SA-PREF	31,400	4.93	154,802.00	
	WEG SA	12,400	28.75	356,500.00	
	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	24,700	6.81	168,207.00	
	CCR SA	46,500	16.50	767,250.00	
	ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	7,900	13.22	104,438.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	8,890	31.15	276,923.50	
	CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	16,100	14.78	237,958.00	
	MRV ENGENHARIA	15,300	8.53	130,509.00	
	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	20,100	13.76	276,576.00	

ESTACIO PARTICIPACOES SA	12,900	19.41	250,389.00	
KROTON EDUCATIONAL SA	10,100	37.65	380,265.00	
CIA HERING	7,700	28.16	216,832.00	
LOJAS AMERICANAS SA	7,200	12.73	91,656.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	21,858	14.88	325,247.04	
LOJAS RENNER S.A.	7,300	56.57	412,961.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	7,600	95.41	725,116.00	
RAIA DROGASIL SA	11,600	14.26	165,416.00	
AMBEV SA	247,200	16.64	4,113,408.00	
BRF SA	35,100	43.18	1,515,618.00	
JBS SA	38,900	8.75	340,375.00	
M DIAS BRANCO SA	2,100	96.00	201,600.00	
SOUZA CRUZ SA	21,300	22.72	483,936.00	
HYPERMARCAS SA	19,800	15.95	315,810.00	
NATURA COSMETICOS SA	9,500	37.40	355,300.00	
ODONTOPREV S.A.	12,400	9.05	112,220.00	
QUALICORP SA	11,200	20.55	230,160.00	
BANCO BRADESCO S.A.	32,300	29.22	943,806.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	113,200	27.16	3,074,512.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	29,000	22.40	649,600.00	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	7,700	11.94	91,938.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	133,290	30.00	3,998,700.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	154,044	8.47	1,304,752.68	
BM&FBOVESPA SA	101,900	10.08	1,027,152.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	11,500	23.10	265,650.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	32,100	23.97	769,437.00	
PORTO SEGURO SA	5,900	29.03	171,277.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	21,900	16.87	369,453.00	
BR PROPERTIES SA	13,000	18.10	235,300.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,900	46.69	182,091.00	
CIELO SA	18,960	66.15	1,254,204.00	
TOTVS SA	5,800	35.19	204,102.00	
OI SA-PREFERENCE	45,431	4.42	200,805.02	
TELEFONICA BRASIL S.A.	16,100	46.33	745,913.00	
TIM PARTICIPACOES SA	44,600	13.40	597,640.00	
AES TIETE SA-PREF	6,100	18.83	114,863.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,300	5.41	88,183.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	9,000	9.15	82,350.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	9,700	21.79	211,363.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	38,592	13.50	520,992.00	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,500	30.30	166,650.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,300	23.62	455,866.00	

	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	3,400	32.40	110,160.00	
	CPFL ENERGIA SA	12,768	18.70	238,761.60	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	12,900	10.36	133,644.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	9,200	34.45	316,940.00	
ブラジルレアル小計		2,426,687		47,609,890.40 (2,114,355,232)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	24,721	7,001.90	173,093,969.90	
	CAP SA	3,824	9,588.30	36,665,659.20	
	EMPRESAS CMPC SA	70,597	1,276.20	90,095,891.40	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,515	15,388.00	84,864,820.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	15,211	8,791.60	133,729,027.60	
	S.A.C.I. FALABELLA	38,516	4,416.90	170,121,320.40	
	CENCOSUD SA	62,468	1,731.80	108,182,082.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,096	6,000.60	36,579,657.60	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,212	2,270.10	34,532,761.20	
	VINA CONCHA Y TORO SA	36,750	952.00	34,986,000.00	
	BANCO DE CHILE	982,651	72.47	71,212,717.97	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,608	31,593.00	50,801,544.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	3,588,220	30.01	107,682,482.20	
	CORPBANCA	8,419,981	7.38	62,206,819.62	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	6,094	7,209.80	43,936,521.20	
	AES GENER SA	141,749	268.03	37,992,984.47	
	AGUAS ANDINAS SA-A	172,048	330.49	56,860,143.52	
	COLBUN SA	410,079	121.96	50,013,234.84	
	E.CL SA	48,523	692.51	33,602,662.73	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	184,233	794.68	146,406,280.44	
	ENERSIS SA	1,075,857	161.05	173,266,769.85	
チリペソ小計		15,309,953		1,736,833,350.54 (335,556,203)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,786	53,000.00	147,658,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,210	130,500.00	418,905,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,270	69,800.00	158,446,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	2,566	78,700.00	201,944,200.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	4,696	21,150.00	99,320,400.00	
	HANWHA CORPORATION	1,835	37,550.00	68,904,250.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,409	70,700.00	99,616,300.00	
	HYUNDAI HYSCO	1,460	41,500.00	60,590,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	3,171	79,800.00	253,045,800.00	
	KOREA ZINC CO LTD	443	324,500.00	143,753,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	580	86,200.00	49,996,000.00	
	LG CHEM LTD	2,523	270,000.00	681,210,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	172	137,000.00	23,564,000.00	

LOTTE CHEMICAL CORPORATION	906	210,500.00	190,713,000.00	
OCI COMPANY LTD	926	201,000.00	186,126,000.00	
POSCO	3,505	311,500.00	1,091,807,500.00	
CJ CORP	898	119,000.00	106,862,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	1,470	82,900.00	121,863,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	4,210	6,180.00	26,017,800.00	
DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,422	40,350.00	97,727,700.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	5,280	37,000.00	195,360,000.00	
DOOSAN CORP	423	131,500.00	55,624,500.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	2,311	36,250.00	83,773,750.00	
DOOSAN INFRACORE CO LTD	5,550	12,500.00	69,375,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,822	34,750.00	63,314,500.00	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	3,000	24,500.00	73,500,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	3,909	59,100.00	231,021,900.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,189	230,000.00	503,470,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	585	179,500.00	105,007,500.00	
KCC CORP	260	475,000.00	123,500,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,570	29,800.00	76,586,000.00	
LG CORP	4,876	60,700.00	295,973,200.00	
LS CORP	1,095	83,900.00	91,870,500.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	617	68,900.00	42,511,300.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,691	58,100.00	388,747,100.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,603	68,700.00	110,126,100.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	8,480	34,150.00	289,592,000.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,380	52,900.00	125,902,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,338	180,500.00	241,509,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,700	8,020.00	37,694,000.00	
S-1 CORPORATION	981	76,700.00	75,242,700.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	719	228,000.00	163,932,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,118	12,150.00	50,033,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,615	32,750.00	52,891,250.00	
HALLA VISTEON CLIMATE CONTRO	1,690	35,350.00	59,741,500.00	
HANKOOK TIRE CO LTD	3,722	61,000.00	227,042,000.00	
HYUNDAI MOBIS	3,592	283,500.00	1,018,332,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	8,383	228,500.00	1,915,515,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,719	122,500.00	210,577,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	903	115,500.00	104,296,500.00	
HYUNDAI WIA CORP	859	171,500.00	147,318,500.00	
KIA MOTORS CORPORATION	13,769	50,300.00	692,580,700.00	
COWAY CO.,LTD.	2,830	66,000.00	186,780,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,643	68,400.00	385,981,200.00	
KANGWON LAND INC	5,180	33,600.00	174,048,000.00	

CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	27,100.00	137,397,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	832	150,000.00	124,800,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	588	388,500.00	228,438,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	417	231,500.00	96,535,500.00	
EMART	1,071	253,000.00	270,963,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	404	266,500.00	107,666,000.00	
HITE JINRO CO LTD	1,710	22,100.00	37,791,000.00	
KT&G CORP	5,994	74,700.00	447,751,800.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	45	1,875,000.00	84,375,000.00	
ORION CORP	206	890,000.00	183,340,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	180	984,000.00	177,120,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	532	565,000.00	300,580,000.00	
PACIFIC CORP	121	464,500.00	56,204,500.00	
CELLTRION INC	3,160	45,650.00	144,254,000.00	
YUHAN CORPORATION	366	195,500.00	71,553,000.00	
BS FINANCIAL GROUP INC	9,300	15,500.00	144,150,000.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	6,090	15,950.00	97,135,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	14,651	40,350.00	591,167,850.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7,770	12,500.00	97,125,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	20,508	39,100.00	801,862,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	22,515	43,200.00	972,648,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	18,960	12,300.00	233,208,000.00	
DAEWOO SECURITIES CO LTD	9,828	8,730.00	85,798,440.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	7,320	5,850.00	42,822,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,840	40,050.00	73,692,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	1,508	37,850.00	57,077,800.00	
SAMSUNG CARD CO	1,896	34,850.00	66,075,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,786	43,750.00	165,637,500.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,202	9,580.00	78,575,160.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	2,150	54,800.00	117,820,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE	12,220	7,120.00	87,006,400.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,170	31,500.00	99,855,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,900	243,000.00	461,700,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	3,104	99,600.00	309,158,400.00	
NAVER CORP	1,503	715,000.00	1,074,645,000.00	
NCSOFT CORPORATION	863	217,000.00	187,271,000.00	
NHN ENTERTAINMENT CORP	703	82,400.00	57,927,200.00	
SK C&C CO LTD	1,235	128,500.00	158,697,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	12,960	26,300.00	340,848,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	857	86,700.00	74,301,900.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,224	70,100.00	226,002,400.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,850	157,500.00	291,375,000.00	

	KT CORP	2,340	30,700.00	71,838,000.00	
	LG UPLUS CORP	12,570	11,000.00	138,270,000.00	
	SK TELECOM	945	223,500.00	211,207,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	13,540	34,750.00	470,515,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,263	67,000.00	84,621,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,882	1,292,000.00	7,599,544,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,078	940,000.00	1,013,320,000.00	
	SK HYNIX INC	28,200	36,000.00	1,015,200,000.00	
韓国ウォン小計		423,287		32,963,709,600.00 (3,227,147,169)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	58,240	79.30	4,618,432.00	
	ASIA CEMENT CORP	119,957	37.60	4,510,383.20	
	CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	82,720	13.55	1,120,856.00	
	CHINA STEEL	646,452	26.50	17,130,978.00	
	FENG HSIN IRON & STEEL CO	25,000	52.90	1,322,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	166,061	80.30	13,334,698.30	
	FORMOSA PLASTICS CORP	215,824	78.70	16,985,348.80	
	LCY CHEMICAL CORP	21,796	39.65	864,211.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	248,752	66.00	16,417,632.00	
	TAIWAN CEMENT	173,929	43.80	7,618,090.20	
	TAIWAN FERTILIZER CO LTD	34,000	65.90	2,240,600.00	
	TSRC CORP	27,830	44.00	1,224,520.00	
	CTCI CORP	33,000	46.00	1,518,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	159,743	32.90	5,255,544.70	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	11,797	260.00	3,067,220.00	
	TAIWAN GLASS IND CORP	65,486	32.40	2,121,746.40	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	83,000	33.50	2,780,500.00	
	WALSIN LIHWA CORP	199,000	9.87	1,964,130.00	
	CHINA AIRLINES LTD	133,203	10.80	1,438,592.40	
	EVA AIRWAYS CORP	95,000	16.40	1,558,000.00	
	EVERGREEN MARINE	106,499	17.95	1,911,657.05	
	U-MING MARINE TRANSPORT CORP	32,000	53.00	1,696,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	28,350	15.15	429,502.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	143,900	13.40	1,928,260.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	83,061	78.50	6,520,288.50	
	CHINA MOTOR CORP	51,000	28.80	1,468,800.00	
	NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	43,309	36.95	1,600,267.55	
	YULON MOTOR COMPANY	43,000	52.80	2,270,400.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	7,000	279.50	1,956,500.00	
	FORMOSA TAFFETA CO.	40,000	32.50	1,300,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	15,464	198.00	3,061,872.00	
	MERIDA INDUSTRY CO LTD	11,000	200.00	2,200,000.00	

POU CHEN	117,780	43.00	5,064,540.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	23,847	73.90	1,762,293.30	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	2,928	334.00	977,952.00	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	49,632	27.55	1,367,361.60	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,000	367.00	4,404,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	29,544	193.00	5,701,992.00	
STANDARD FOODS CORP	12,834	90.40	1,160,193.60	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	233,805	51.40	12,017,577.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	12,080	86.80	1,048,544.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	252,186	18.40	4,640,222.40	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	775,780	9.10	7,059,598.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	687,537	20.05	13,785,116.85	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	256,442	18.85	4,833,931.70	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	405,874	18.30	7,427,494.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	313,206	17.50	5,481,105.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	524,557	24.70	12,956,557.90	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	282,390	14.55	4,108,774.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	387,390	14.60	5,655,894.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	177,843	9.15	1,627,263.45	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	337,508	16.30	5,501,380.40	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	43,900	79.00	3,468,100.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	347,082	43.05	14,941,880.10	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	479,944	17.60	8,447,014.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	449,287	46.95	21,094,024.65	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	129,685	30.70	3,981,329.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	333,349	10.40	3,466,829.60	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	10,000	49.55	495,500.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	21,600	60.10	1,298,160.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	33,445	53.10	1,775,929.50	
ACER INC	146,375	19.00	2,781,125.00	
ADVANTECH CO LTD	15,600	198.00	3,088,800.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	37,092	286.00	10,608,312.00	
AU OPTRONICS CORP	520,090	9.37	4,873,243.30	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	38,700	203.00	7,856,100.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	17,340	63.00	1,092,420.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,085	77.50	2,176,587.50	
CLEVO COMPANY	21,008	63.80	1,340,310.40	
COMPAL ELECTRONICS	224,760	23.05	5,180,718.00	
DELTA ELECTRONICS INC	97,520	167.00	16,285,840.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,447	70.00	3,811,290.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	591,352	83.80	49,555,297.60	
HTC CORPORATION	42,430	135.50	5,749,265.00	

	INVENTEC CO LTD	136,511	27.95	3,815,482.45	
	LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	1,210.00	7,308,400.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	126,571	46.20	5,847,580.20	
	PEGATRON CORP	93,474	40.30	3,767,002.20	
	QUANTA COMPUTER INC	133,270	76.80	10,235,136.00	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	13,354	143.50	1,916,299.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	69,381	53.10	3,684,131.10	
	TPK HOLDING CO LTD	10,969	195.00	2,138,955.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	59,000	24.65	1,454,350.00	
	WISTRON CORP	139,129	25.50	3,547,789.50	
	WPG HOLDINGS CO LTD	81,187	35.30	2,865,901.10	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	9,922	77.00	763,994.00	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	35,000	15.25	533,750.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	205,315	92.00	18,888,980.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	62.70	5,078,700.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	91,200	94.40	8,609,280.00	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	323,739	28.70	9,291,309.30	
	EPISTAR CORP	57,000	64.60	3,682,200.00	
	HERMES MICROVISION INC	3,000	940.00	2,820,000.00	
	KINSUS INTERCONNECT TECH	12,000	100.00	1,200,000.00	
	MEDIATEK INC	65,064	415.00	27,001,560.00	
	MSTAR SEMICONDUCTOR INC	11,008	332.00	3,654,656.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	31,045	122.50	3,803,012.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	6,599	193.00	1,273,607.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,770	44.15	1,667,545.50	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	26,157	129.00	3,374,253.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	23,944	84.20	2,016,084.80	
	SILICONWARE PRECISION INDS	161,000	37.50	6,037,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,309,389	107.50	140,759,317.50	
	TRANSCEND INFORMATION INC	9,445	88.50	835,882.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	635,000	12.75	8,096,250.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	32,000	36.25	1,160,000.00	
新台湾ドル小計		15,819,110		710,514,308.10 (2,458,379,506)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,660	340.10	1,924,966.00	
	CAIRN INDIA LTD	22,150	326.05	7,222,007.50	
	COAL INDIA LTD	26,750	272.00	7,276,000.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	38,927	287.50	11,191,512.50	
	OIL INDIA LTD	7,461	472.75	3,527,187.75	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	68,667	884.75	60,753,128.25	
	ACC LTD	1,768	1,027.65	1,816,885.20	

AMBUJA CEMENTS LTD	32,735	170.00	5,564,950.00	
ASIAN PAINTS LTD	15,325	491.55	7,533,003.75	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	49,471	111.30	5,506,122.30	
JINDAL STEEL & POWER LTD	19,814	260.35	5,158,574.90	
JSW STEEL LTD	3,763	1,000.20	3,763,752.60	
SESA STERLITE LTD	54,186	200.60	10,869,711.60	
TATA STEEL LTD	14,409	377.65	5,441,558.85	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,438	1,719.25	2,472,281.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	7,547	239.85	1,810,147.95	
ADITYA BIRLA NUVO LTD	2,306	1,090.40	2,514,462.40	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	32,256	171.85	5,543,193.60	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	37,334	47.25	1,764,031.50	
LARSEN & TOUBRO LTD	15,987	1,002.85	16,032,562.95	
SIEMENS INDIA LTD	5,358	590.75	3,165,238.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	22,044	148.65	3,276,840.60	
BAJAJ AUTO LTD	4,420	1,933.45	8,545,849.00	
HERO MOTOCORP LTD	4,416	2,075.75	9,166,512.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,220	899.55	14,590,701.00	
TATA MOTORS LTD	40,268	369.70	14,887,079.60	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	14,116	278.60	3,932,717.60	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	529	4,331.75	2,291,495.75	
ITC LTD	118,068	324.85	38,354,389.80	
UNITED BREWERIES LTD	4,195	778.40	3,265,388.00	
UNITED SPIRITS LTD	4,606	2,663.40	12,267,620.40	
DABUR INDIA LTD	19,484	167.20	3,257,724.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,666	770.55	5,136,486.30	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	36,032	558.90	20,138,284.80	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,650	927.40	2,457,610.00	
CIPLA LTD	22,105	417.60	9,231,048.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,694	1,269.45	3,419,898.30	
DR. REDDY'S LABORATORIES	5,561	2,651.85	14,746,937.85	
LUPIN LTD	3,277	909.35	2,979,939.95	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	3,535	560.25	1,980,483.75	
RANBAXY LABORATORIES LTD	6,355	406.35	2,582,354.25	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	33,279	594.00	19,767,726.00	
BANK OF BARODA	4,124	628.35	2,591,315.40	
HDFC BANK LTD	62,489	665.00	41,555,185.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	79,339	840.05	66,648,726.95	
ICICI BANK LTD	12,000	1,034.55	12,414,600.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	19,565	208.70	4,083,215.50	
STATE BANK OF INDIA	7,459	1,621.55	12,095,141.45	
YES BANK LTD	7,228	351.15	2,538,112.20	

	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	17,648	727.10	12,831,860.80	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	13,160	279.15	3,673,614.00	
	POWER FINANCE CORPORATION	9,522	145.70	1,387,355.40	
	RELIANCE CAPITAL LTD	4,769	341.35	1,627,898.15	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP	13,706	192.80	2,642,516.80	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	7,385	599.65	4,428,415.25	
	DLF LTD	24,294	155.35	3,774,072.90	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,334	1,379.65	15,636,953.10	
	INFOSYS LTD	24,574	3,729.75	91,654,876.50	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	25,006	2,213.05	55,339,528.30	
	TECH MAHINDRA LTD	4,848	1,775.25	8,606,412.00	
	WIPRO LTD	34,648	552.70	19,149,949.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	33,641	310.90	10,458,986.90	
	IDEA CELLULAR LTD	29,763	151.00	4,494,213.00	
	RELIANCE COMMUNICATIONS LTD	32,379	125.25	4,055,469.75	
	GAIL INDIA LTD	17,528	351.60	6,162,844.80	
	NTPC LTD	48,348	131.60	6,362,596.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	56,375	97.25	5,482,468.75	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,423	400.65	2,974,024.95	
	RELIANCE POWER LTD	26,910	67.60	1,819,116.00	
	TATA POWER CO LTD	54,425	78.35	4,264,198.75	
インドルピー小計		1,523,722		775,882,036.35 (1,318,999,461)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	943	4,314.00	4,068,102.00	
	TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	6,181	295.50	1,826,485.50	
	CEZ AS	9,976	522.50	5,212,460.00	
チェココルナ小計		17,100		11,107,047.50 (56,868,083)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	2,292	14,300.00	32,775,600.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	6,305	4,680.00	29,507,400.00	
	OTP BANK NYRT	11,567	4,418.00	51,103,006.00	
ハンガリーフォリント小計		20,164		113,386,006.00 (52,962,603)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	2,227	35.50	79,058.50	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	17,887	42.10	753,042.70	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	92,344	5.01	462,643.44	
	GRUPA AZOTY SA	2,479	58.00	143,782.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,244	50.00	112,200.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,554	113.80	859,645.20	
	SYNTHOS SA	33,750	5.46	184,275.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,880	19.40	230,472.00	
	EUROCASH SA	5,057	40.30	203,797.10	

	KERNEL HOLDING SA	3,178	40.51	128,740.78	
	ALIOR BANK SA	2,685	81.35	218,424.75	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	103.90	208,839.00	
	BANK MILLENNIUM SA	22,475	7.59	170,585.25	
	BANK PEKAO SA	7,179	180.00	1,292,220.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	1,418	380.50	539,549.00	
	M BANK SA	761	495.10	376,771.10	
	PKO BANK POLSKI SA	48,057	40.16	1,929,969.12	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,098	428.20	1,326,563.60	
	ORANGE POLSKA SA	36,440	10.12	368,772.80	
	ENEA SA	4,648	13.24	61,539.52	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	43,389	16.55	718,087.95	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	62,618	4.22	264,247.96	
ポーランドズロチ小計		413,378		10,633,226.77 (359,084,068)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,884	157.50	1,241,730.00	
	SASOL LTD	29,032	537.00	15,590,184.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	5,864	211.53	1,240,411.92	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	3,264	405.81	1,324,563.84	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	19,662	144.50	2,841,159.00	
	ASSORE LTD	1,860	365.92	680,611.20	
	GOLD FIELDS LTD	41,694	36.50	1,521,831.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	20,054	29.50	591,593.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	27,861	120.06	3,344,991.66	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,710	460.00	2,166,600.00	
	NAMPAK LTD	37,852	38.88	1,471,685.76	
	NORTHAM PLATINUM LTD	13,846	43.65	604,377.90	
	PPC LIMITED	30,677	29.60	908,039.20	
	SAPPI LIMITED	26,526	33.20	880,663.20	
	BARLOWORLD LTD	13,028	104.00	1,354,912.00	
	BIDVEST GROUP LTD	16,104	264.00	4,251,456.00	
	REUNERT LTD	11,234	70.25	789,188.50	
	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	68,370	46.00	3,145,020.00	
	NASPERS LTD-N SHS	20,986	1,165.00	24,448,690.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,524	201.32	2,118,691.68	
	MR PRICE GROUP LTD	13,725	150.80	2,069,730.00	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	10,233	97.52	997,922.16	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	23,443	76.00	1,781,668.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	40,049	68.75	2,753,368.75	
	MASSMART HOLDINGS LTD	5,649	125.50	708,949.50	
	PICK N PAY STORES LTD	10,581	49.10	519,527.10	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	22,917	151.65	3,475,363.05	

	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,016	122.11	1,223,053.76	
	TIGER BRANDS LTD	9,125	262.00	2,390,750.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	49,296	37.84	1,865,360.64	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	20,704	70.50	1,459,632.00	
	NETCARE LTD	56,730	24.10	1,367,193.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	17,513	255.30	4,471,068.90	
	BARCLAYS AFRICA GROUP	18,634	129.50	2,413,103.00	
	NEDBANK GROUP LTD	11,565	203.80	2,356,947.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	65,001	126.45	8,219,376.45	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	57,953	11.00	637,483.00	
	FIRSTRAND LTD	165,628	33.43	5,536,944.04	
	INVESTEC LTD	15,904	77.25	1,228,584.00	
	REMGRO LTD	26,619	202.50	5,390,347.50	
	RMB HOLDINGS LTD	38,777	45.53	1,765,516.81	
	DISCOVERY LIMITED	18,014	79.40	1,430,311.60	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,226	124.00	772,024.00	
	MMI HOLDINGS LTD	67,408	25.00	1,685,200.00	
	RMI HOLDINGS	40,408	26.23	1,059,901.84	
	SANLAM LTD	96,130	49.51	4,759,396.30	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	105,682	23.16	2,447,595.12	
	MTN GROUP LTD	90,101	211.25	19,033,836.25	
	VODACOM GROUP	20,425	130.50	2,665,462.50	
南アフリカランド小計		1,545,488		157,002,016.13 (1,499,369,254)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,478	42.50	275,315.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	100,241	2.71	271,653.11	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	1,677	20.50	34,378.50	
	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	25,327	6.70	169,690.90	
	KOC HOLDING AS	31,393	8.28	259,934.04	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	30,142	2.55	76,862.10	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,836	15.30	150,490.80	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,354	6.79	219,683.66	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	3,258	20.85	67,929.30	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	6,750	11.85	79,987.50	
	ARCELIK AS	15,358	12.65	194,278.70	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,606	37.50	435,225.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	12,636	21.20	267,883.20	
	COCA-COLA ICECEK AS	2,991	47.40	141,773.40	
	ULKER BISKUVI SANAYI	4,385	13.50	59,197.50	
	AKBANK T.A.S.	102,451	6.37	652,612.87	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	126,341	6.54	826,270.14	
	TURKIYE HALK BANKASI	34,977	12.65	442,459.05	

	TURKIYE IS BANKASI-C	85,644	4.64	397,388.16	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	35,938	3.85	138,361.30	
	YAPI VE KREDI BANKASI	41,263	3.71	153,085.73	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	45,798	8.09	370,505.82	
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	82,847	2.13	176,464.11	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	26,540	5.78	153,401.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	45,632	11.16	509,253.12	
トルコリラ小計		921,863		6,524,084.21 (304,283,287)	
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	6,895	21.20	146,174.00	
	OPAP SA	20,672	10.10	208,787.20	
	FOLLI FOLLIE SA	4,750	26.30	124,925.00	
	JUMBO SA	13,419	13.02	174,715.38	
ユーロ小計		45,736		654,601.58 (92,023,890)	
合計		100,330,740		20,370,653,352 (20,370,653,352)	

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	23,900.00	1,247,341.00	
	メキシコペソ小計		23,900.00	1,247,341.00 (9,779,153)	
	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER SA	49,200.00	615,492.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	8,518.00	120,103.80	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	7,500.00	134,250.00	
	ブラジルレアル小計		65,218.00	869,845.80 (38,629,851)	
	南アフリカランド	REDEFINE PROPERTIES LTD	166,445.00	1,531,294.00	
	南アフリカランド小計		166,445.00	1,531,294.00 (14,623,857)	
投資信託受益証券合計				63,032,861 (63,032,861)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	72,600.00	3,207,468.00	
	メキシコペソ小計		72,600.00	3,207,468.00 (25,146,549)	
投資証券合計				25,146,549 (25,146,549)	
合計				88,179,410 (88,179,410)	

(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	25銘柄	100.0%	7.5%
香港ドル	株式	135銘柄	100.0%	19.7%
マレーシアリンギット	株式	43銘柄	100.0%	3.8%
タイバーツ	株式	26銘柄	100.0%	2.2%
フィリピンペソ	株式	19銘柄	100.0%	0.9%
インドネシアルピア	株式	30銘柄	100.0%	2.4%
メキシコペソ	株式	27銘柄	96.9%	5.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	0.9%	0.0%
	投資証券	1銘柄	2.3%	0.1%
ブラジルレアル	株式	72銘柄	98.2%	10.3%
	投資信託受益証券	3銘柄	1.8%	0.2%
チリペソ	株式	21銘柄	100.0%	1.6%
韓国ウォン	株式	105銘柄	100.0%	15.8%
新台湾ドル	株式	106銘柄	100.0%	12.0%
インドルピー	株式	70銘柄	100.0%	6.4%
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%	0.3%
ポーランドズロチ	株式	22銘柄	100.0%	1.8%
南アフリカランド	株式	49銘柄	99.0%	7.3%
	投資信託受益証券	1銘柄	1.0%	0.1%
トルコリラ	株式	25銘柄	100.0%	1.5%
ユーロ	株式	4銘柄	100.0%	0.4%

(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26年2月28日現在)

Ⅰ 資産総額	5,069,418,772 円
Ⅱ 負債総額	62,777,243 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	5,006,641,529 円
Ⅳ 発行済口数	2,790,281,694 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.7943 円
1万口当たり純資産額	17,943 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	256,404,681,803 円
Ⅱ 負債総額	8,309,994,367 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	248,094,687,436 円
Ⅳ 発行済口数	192,571,364,044 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.2883 円
1万口当たり純資産額	12,883 円

国内株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	141,530,661,802 円
Ⅱ 負債総額	1,475,730,468 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	140,054,931,334 円
Ⅳ 発行済口数	141,057,405,498 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9929 円
1万口当たり純資産額	9,929 円

外国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	222,480,468,394 円
Ⅱ 負債総額	722,918,383 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	221,757,550,011 円
Ⅳ 発行済口数	89,816,396,812 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	2.4690 円
1万口当たり純資産額	24,690 円

外国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	168,590,701,432 円
Ⅱ 負債総額	2,052,794,437 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	166,537,906,995 円
Ⅳ 発行済口数	101,404,377,862 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.6423 円

1万口当たり純資産額	16,423　円

新興国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	29,290,029,965　円
Ⅱ 負債総額	692,944,975　円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	28,597,084,990　円
Ⅳ 発行済口数	18,094,407,302　口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.5804　円
1万口当たり純資産額	15,804　円

新興国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	22,091,032,650　円
Ⅱ 負債総額	9,909,470　円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	22,081,123,180　円
Ⅳ 発行済口数	10,408,242,978　口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	2.1215　円
1万口当たり純資産額	21,215　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26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）］

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。
このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。
また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。
こうした牽制態勢のもと、PLAN－DO－CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。
さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役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26年4月18日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。
平成26年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	369	4,746,449
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	369	4,746,449

3【委託会社等の経理状況】

(1)委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）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。

(2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自　平成24年4月1日　至　平成25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28期事業年度の中間会計期間（自 平成25年4月1日　至 平成25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24年3月31日現在）		当事業年度 （平成25年3月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		4,826,115		8,192,444
前払費用		30,184		81,751
未収委託者報酬		944,716		2,210,605
未収運用受託報酬		26,998		31,051
未収入金		75,514		676
一年以内返還予定保証金		187,128		―
繰延税金資産		69,857		61,743
その他		31,325		19,263
流動資産合計		6,191,840		10,597,535
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	3,525	※1	79,281
器具備品	※1	14,970	※1	103,209
建設仮勘定		62,454		―
有形固定資産合計		80,949		182,491
無形固定資産				
ソフトウェア		60,130		168,561
ソフトウェア仮勘定		12,151		―
その他無形固定資産		928		1,770
無形固定資産合計		73,209		170,332
投資その他の資産				
投資有価証券		43,194		47,112
長期前払費用		357		―
長期貸付金		―		31,838
会員権		―		25,000
その他の投資		165		633
貸倒引当金		―		△31,838
投資その他の資産合計		43,717		72,746
固定資産合計		197,876		425,570
資産合計		6,389,717		11,023,105

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		

流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	―
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	―
その他流動負債	―	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	―	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	―	350,000
資本剰余金合計	―	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 9,859	4,998
評価・換算差額等合計	△9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410
負債・純資産合計	6,389,717	11,023,105

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 (自　平成23年4月1日 至　平成24年3月31日)		当事業年度 (自　平成24年4月1日 至　平成25年3月31日)
営業収益			
委託者報酬	7,821,113		19,128,296
運用受託報酬	98,179		94,659
営業収益合計	7,919,292		19,222,955
営業費用			
支払手数料	3,715,816		9,030,246
広告宣伝費	61,165		73,287
公告費	2,451		2,244
調査費	1,023,870		4,132,154
調査費	86,225		207,030
委託調査費	936,024		3,922,394
図書費	1,620		2,729
営業雑経費	610,455		1,294,879
通信費	10,764		21,905
印刷費	121,287		330,735
協会費	10,136		21,939
諸会費	803		757
情報機器関連費	436,328		874,151
その他営業雑経費	31,135		45,391
営業費用合計	5,413,759		14,532,812
一般管理費			
給料	1,276,685		2,259,238
役員報酬	35,160		78,205
給料・手当	1,048,061		1,967,177
賞与	193,464		213,855
退職給付費用	66,790		64,787
福利費	152,149		190,716
交際費	1,012		879
旅費交通費	25,687		45,160
租税公課	16,148		25,420
不動産賃借料	238,033		129,096
寄付金	2,832		―
減価償却費	55,540		129,966
敷金償却	2,804		―
諸経費	81,858	※1	257,947
一般管理費合計	1,919,541		3,103,213
営業利益	585,991		1,586,929

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成23年4月1日 至　平成24年3月31日）	当事業年度 （自　平成24年4月1日 至　平成25年3月31日）
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	―	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	―
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25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	―
合併による増加	―	350,000
当期変動額合計	―	350,000
当期末残高	―	350,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
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	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
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	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	△ 33,000	△ 33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
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	―
合併による増加	―	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	―
合併による増加	―	2,542,294
当期変動額合計	△ 1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25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	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	－
合併による増加	－	2,892,294
当期変動額合計	△ 1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	△ 8,501	△ 9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,357	14,857
当期末残高	△ 9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	△ 8,501	△ 9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,357	14,857
当期末残高	△ 9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	－
合併による増加	－	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

２．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(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、当事業年度より、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千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、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

３．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当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。

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
建　　物	84,592　千円	23,594　千円
器具備品	127,549　〃	235,212　〃
計	212,142　〃	258,807　〃

（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23年4月1日 至　平成24年3月31日)	当事業年度 (自　平成24年4月1日 至　平成25年3月31日)
諸経費	―　千円	97,199　千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	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に関する事項

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

(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

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24年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項
該当事項はありません。

３.剰余金の配当に関する事項

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

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
　平成25年6月28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。

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

平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

（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。

当事業年度（平成25年3月31日）　（単位:千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　　)で示しております。

（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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

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

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	―	―	―

当事業年度（平成25年3月31日）　（単位:千円）

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

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（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
合計	58,513	43,194	△ 15,318

当事業年度（平成25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	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,030	1,952	△ 77
小計	2,030	1,952	△ 77
合計	39,345	47,112	7,766

２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成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

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

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

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要
当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

２．退職給付債務に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度（平成24年3月31日）	当事業年度（平成25年3月31日）
(1) 退職給付債務	199,976	268,531
(2) 退職給付引当金	199,976	268,531

(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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
(1) 退職給付費用	66,790	64,787

(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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項
当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

１．　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成24年3月31日）		当事業年度 （平成25年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	4,898	千円	16,142	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	―	〃	11,347	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004	〃	35,285	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271	〃	95,704	〃
その他有価証券評価差額金	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	〃	1,067	〃
敷金償却超過額	19,348	〃	―	〃
その他	3,334	〃	11,680	〃
繰延税金資産　小計	159,817	〃	171,228	〃
評価性引当額	―	〃	△11,347	〃
繰延税金資産 合計	159,817	〃	159,881	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	―	〃	△2,767	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	△398,925	〃	△398,925	〃
繰延税金負債 合計	△398,925	〃	△401,693	〃
繰延税金資産(負債)の純額	△239,107	〃	△241,812	〃

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24年3月31日）		当事業年度 （平成25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	〃	―	〃

当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。

（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

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）	2,429,898千円

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

（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	（直接）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。

当事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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	（直接）100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	―	―

(注) 1．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

①経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成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等の支払	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。

当事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

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

兄弟会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	－	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

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．平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード（株)	三井住友トラスト・カード（株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム＆サービス(株)	東京都府中市

（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）

当事業年度（平成25年3月31日）

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

（企業結合等関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

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

1．企業結合の概要

(1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称　　当社

事業の内容　　投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社
事業の内容　　投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日
平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式
当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併
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。

（１株当たり情報）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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23年4月1日 至　平成24年3月31日)	当事業年度 (自　平成24年4月1日 至　平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

中間貸借対照表

（単位：千円）

	第28期中間会計期間末 （平成25年9月30日）

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	73,320
器具備品	※1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		△ 30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	※2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070

（単位：千円）

	第28期中間会計期間末 （平成25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	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

中間損益計算書

（単位：千円）

		第28期中間会計期間 （自　平成25年4月1日 至　平成25年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		11,222,467
運用受託報酬		36,913
営業収益合計		11,259,380
営業費用		8,307,878
一般管理費	※1	1,553,438
営業利益		1,398,063
営業外収益	※2	8,577
営業外費用		9,483
経常利益		1,397,157
税引前中間純利益		1,397,157
法人税、住民税及び事業税		577,514
法人税等調整額		△55,190
法人税等合計		522,324
中間純利益		874,833

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25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	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	―
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	―
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
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	62,500
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	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25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	4,998
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）	△ 3,247
当中間期変動額合計	△ 3,247
当中間期末残高	1,751
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998
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）	△ 3,247
当中間期変動額合計	△ 3,247
当中間期末残高	1,751
純資産合計	
当期首残高	8,546,410
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 3,247
当中間期変動額合計	841,585
当中間期末残高	9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間
（自　平成25年4月1日
至　平成25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。）

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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当中間会計期間の負担額を計上しております。

（3）退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当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28期中間会計期間末
（平成25年9月30日）

※1　有形固定資産の減価償却累計額

建　　物	29,556千円
器具備品	251,697千円
計	281,253千円

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

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間
（自　平成25年4月1日
至　平成25年9月30日）

※1　減価償却実施額

有形固定資産	23,080千円
無形固定資産	33,012千円

※2　営業外収益の主要項目

受取利息	4,063千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日　至 平成25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	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月28日

（リース取引関係）
第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日　至 平成25年9月30日）
該当事項はありません。

（金融商品関係）
第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）
平成25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。
（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	―
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	―
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,285	58,285	―
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	―

(*)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。

（有価証券関係）
第28期中間会計期間末（平成25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	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	14,024	13,494	△ 529
小計	14,024	13,494	△ 529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）
第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日　至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（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28期中間会計期間（自　平成25年4月1日　至　平成25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28期中間会計期間（自　平成25年4月1日　至　平成25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）	1,535,927千円

（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28期中間会計期間（自　平成25年4月1日　至　平成25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28期中間会計期間（自　平成25年4月1日　至　平成25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28期中間会計期間（自　平成25年4月1日　至　平成25年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自　平成25年4月1日 至　平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭

1株当たり中間純利益　291,611円01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28期中間会計期間 （自　平成25年4月1日 至　平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
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。

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
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成26年4月18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25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25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。
立花証券株式会社	6,695	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。
株式会社みちのく銀行	34,167	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	7,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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25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６月７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	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白　川　芳　樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊　藤　浩　之	印

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２６年３月２０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２５年１月２２日から平成２６年１月２０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２６年１月２０日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月９日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白　川　芳　樹　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊　藤　浩　之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年４月１日から平成26年３月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年４月１日から平成25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25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25年４月１日から平成25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

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