

【表紙】	
【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年 4 月26日
【計算期間】	第 2 期（自 平成24年 1 月27日 至 平成25年 1 月28日）
【ファンド名】	e M A X I S バランス（波乗り型）
【発行者名】	三菱ＵＦＪ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 後藤 俊夫
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 5 号
【事務連絡者氏名】	井上 靖
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 5 号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

第一部【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】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、1,000億円です。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式 一般	年１回 年２回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経２２５	ブル・ベア型
大型株 中小型株 債券 一般	年４回 年６回 (隔月)	日本	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	TOPIX	条件付運用型
公債	年１２回 (毎月)	北米			その他 ()	ロング・ ショート型／ 絶対収益 追求型
社債	日々	欧州				
その他債券	その他	アジア				
クレジット 属性 ()	()	オセアニア				その他 ()
不動産投信		中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動産 投信)))		アフリカ				
資産複合 ()		中近東 (中東) エマージング				

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

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

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信および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。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に規定するＭＭＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に規定するＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回		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。
	年２回		信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年１２回（毎月）		信託約款において、年１２回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	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ものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものの

です。

〔ファンドの目的・特色〕

ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

1 各マザーファンド等を通じて、日本を含む世界各国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、公社債および不動産投資信託証券(リート)に実質的な投資を行います。

● 組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等を活用する場合があります。

 DR(預託証券)とは、Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

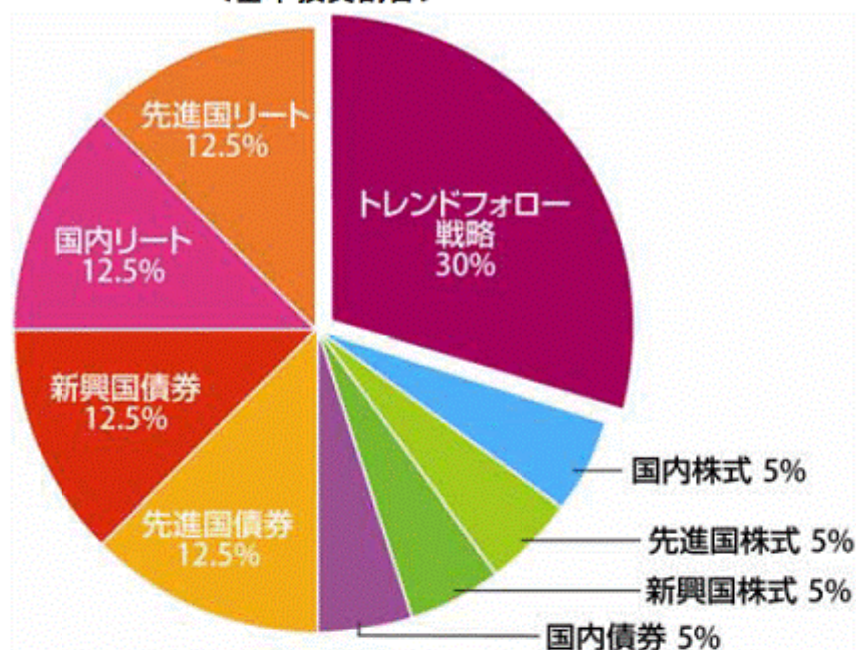
 資金動向および取引コスト等を勘案し、上場投資信託証券に直接投資することがあります。

＜各マザーファンドの主要投資対象と運用目標＞

	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	先進国株式	MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
新興国株式インデックスマザーファンド	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)と連動した投資成果をめざして運用を行います。
日本債券インデックスマザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国債券インデックスマザーファンド	先進国債券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
新興国債券インデックスマザーファンド	新興国債券	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
東証REIT指数マザーファンド	国内不動産投資信託証券	東証REIT指数(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
MUAM G-REITマザーファンド	先進国不動産投資信託証券	S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

2 国内株式、先進国株式、新興国株式および国内債券への投資にあたっては、トレンドフォロー戦略を活用し、機動的に資金を配分します。

＜基本投資割合＞



トレンドフォロー戦略

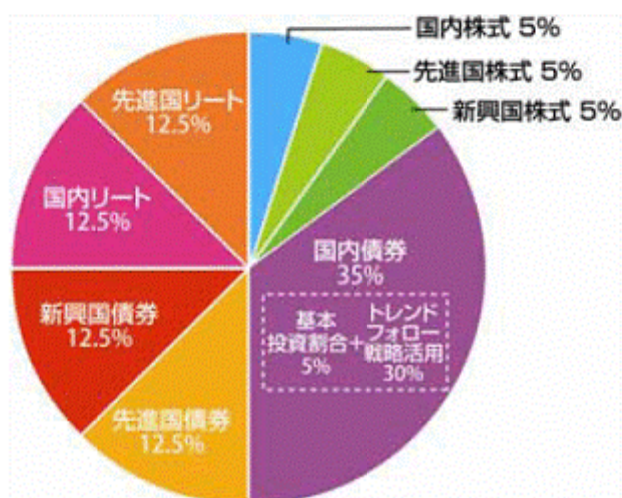
＜戦略の目的＞

この戦略の目的は、直近に良好な運用成績を記録した資産は、一定期間好調なパフォーマンスが継続するという仮定を基に、過去の運用成績が良い資産の投資比率を上げていくことです。言い換えれば、市場動向の「波に乗る」戦略と言えます。

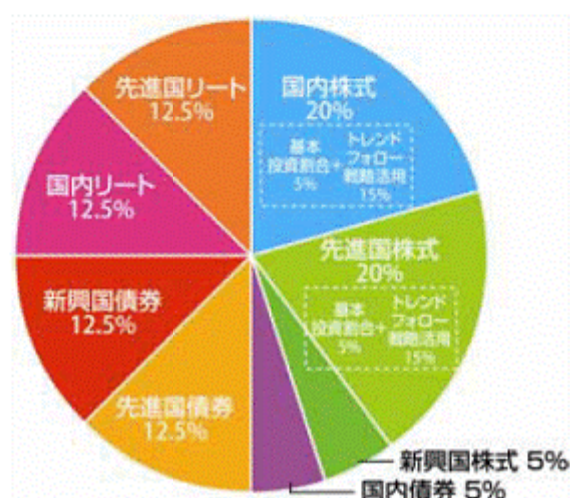
❗ 上記は当戦略の目的であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。例えば、市場のトレンドが反転を繰り返すような場合には、当戦略の効果が出ない、あるいは逆効果となることがあります。

（トレンドフォロー戦略 資産配分例）

I. 過去の国内債券の運用成績が好調だった場合



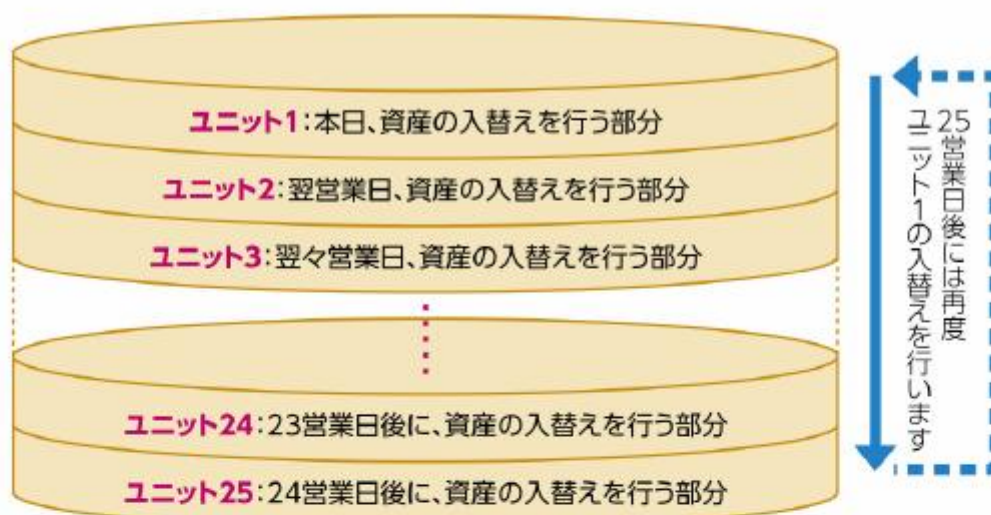
II. 過去の国内株式と先進国株式の運用成績が好調だった場合



＜戦略のプロセス＞

- ①トレンドフォロー戦略の活用部分を25ユニットに均等分割し、毎営業日1ユニットずつ資産の入替えを行います。

イメージ①



- ②資産の入替えにあたっては、トレンドフォロー戦略の対象とする4資産の過去25営業日間騰落率を測定し、最も良い運用成績を記録した資産を選定します。

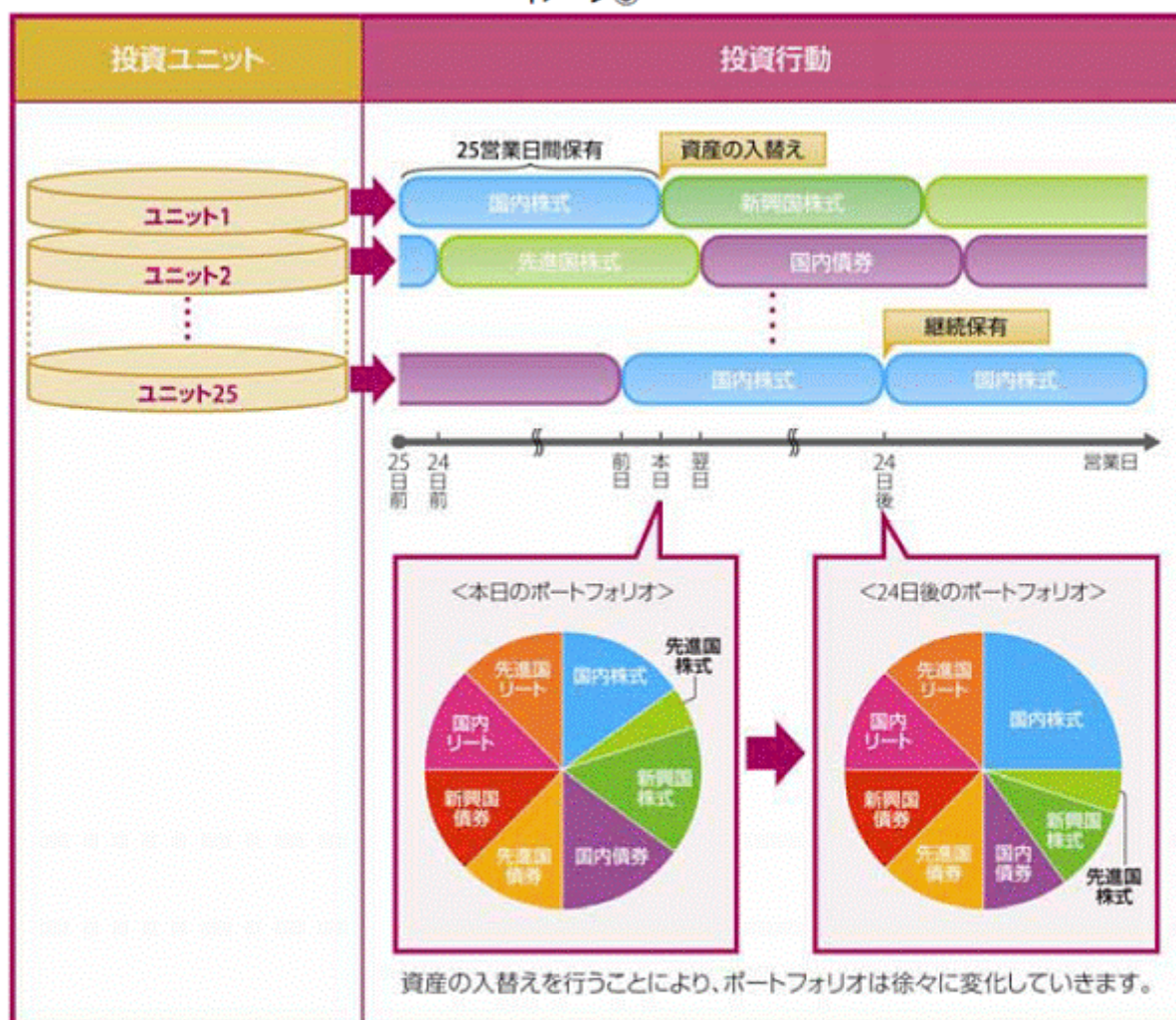
イメージ②

日付 (営業日)	過去25営業日間騰落率	測定結果
ユニット1 (本日)	<u>新興国株式</u> : 10% 先進国株式 : 5% 国内株式 : 1% 国内債券 : 0%	・新興国株式を選定
ユニット2 (翌日)	<u>国内債券</u> : -1% 先進国株式 : -2% 国内株式 : -5% 新興国株式 : -10%	・国内債券を選定
...		
ユニット25 (24日後)	<u>国内株式</u> : 15% 先進国株式 : 7% 国内債券 : 1% 新興国株式 : -5%	・国内株式を選定

- ③選定した資産は買付け後25営業日間保有します。また、保有期間の終了した資産は売却し、同様の選定方法を用いて資産の入替えを行います。

❗ 保有期間の終了した資産と新たに選定された資産が同一の場合は、25営業日間継続保有します。

イメージ③



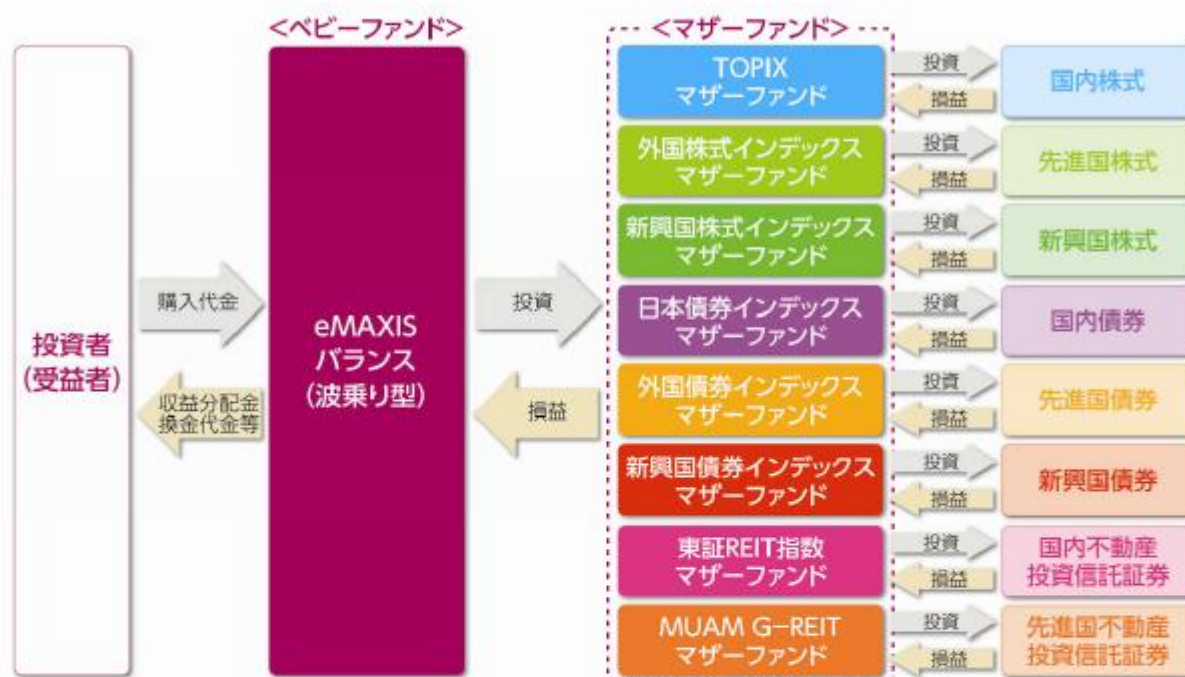
- ❗ 上記はトレンドフォロー戦略の基本的なプロセスとイメージを示したものであり、実際の運用においては資産の時価変動の影響によって生じる組入比率の変化の調節と合わせて資産の入替えを行います。
- ❗ 各市場の休業日や市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
- ❗ 本戦略は、各資産の過去の騰落率をもとに投資判断を行います。将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

3 原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

分配方針

- 年1回の決算時(1月26日(休業日の場合は翌営業日))に分配を行います。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。



指数について

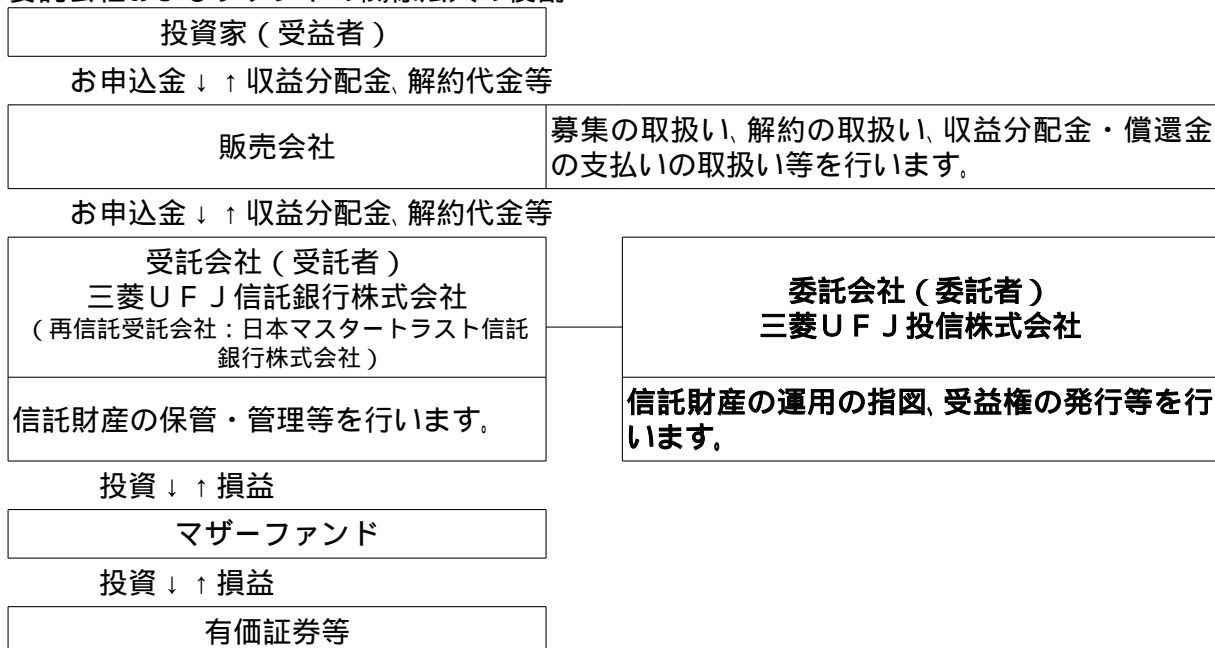
- ・ 東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す代表的な株価指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
- ・ MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されています。
MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(円換算ベース)は、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。
また、MSCI Kokusai Index(MSCIコクサイ インデックス)はMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。
- ・ MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。
MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス(米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。
また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。
- ・ NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
- ・ シティグループ世界国債インデックス(除く日本)とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し指数化した債券インデックスです。
シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)とは、シティグループ世界国債インデックス(除く日本)をもとに、委託会社が計算したものです。
- ・ JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ・ 東証REIT指数(配当込み)とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。
東証REIT指数の商標に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は東証REIT指数の内容の変更、公表の停止または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。東京証券取引所は東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対して、責任を負いません。
- ・ S&P先進国REITインデックスとは、スタンダード・amp・プアーズ ファイナンシャル サービスーズ エル エル シーが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。
S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。
スタンダード・amp・プアーズ及びその関連会社(以下、S&P)は、S&P先進国REITインデックスの計算及びその元になるデータの正確性や完全性を保証するものではありません。S&Pは、S&P先進国REITインデックスに含まれるいかなる誤り、欠落又は障害に対する責任を負いません。S&Pは、S&P先進国REITインデックス 又はそれらに含まれるデータの使用により、委託会社、本商品の所有者又はその他の人や組織に生じた結果に対して、明示的にも暗示的にも保証しません。S&Pは、S&P先進国REITインデックス 又はそれらに含まれるデータに関して、商品性の保証や適合性について何ら保証するものではないことを明示し、かつそれに関して明示もしくは暗示の保証を行いません。以上のことに関わらず、特定の、罰則的、間接的あるいは結果的な損害(利益の損失を含む)について、仮にその可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pが責任を負うことはありません。

(2) 【ファンドの沿革】

平成23年10月31日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

・資本金

2,000百万円（平成25年2月末現在）

・沿革

平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始

平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更

平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更

・大株主の状況（平成25年2月末現在）

株主名	住 所	所有株式数	所有比率
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	62,050株	50.0%
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,025株	25.0%
株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,023株	25.0%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、新興国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、新興国債券インデックスマザーファンド受益証券、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド受益証券およびＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド受益証券等への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、利子収益の確保および値上がり益の獲得をめざします。このほか、日本を含む世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。以下同じ。）、公社債および上場投資信託証券（不動産投資信託証券を含みます。）に直接投資することがあります。

各投資対象資産への実質的な基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率とします。なお、国内株式、先進国株式、新興国株式および国内債券への実質的な投資にあたっては、市況動向等を勘案し、以下の範囲内で機動的に資金を配分します。

国内株式	・・・ ５～３５％
先進国株式	・・・ ５～３５％
新興国株式	・・・ ５～３５％
国内債券	・・・ ５～３５％
先進国債券	・・・ １２．５％
新興国債券	・・・ １２．５％
国内不動産投資信託証券	・・・ １２．５％
先進国不動産投資信託証券	・・・ １２．５％

組入比率の調整等を目的として有価証券先物取引等を活用する場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託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。

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

イ．有価証券

ロ．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、信託約款に定める次のものに限り、）

ａ．有価証券先物取引等

ｂ．スワップ取引

ｃ．金利先渡取引および為替先渡取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（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。）は、三菱ＵＦＪ投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社とするＴＯＰＩＸマザーファンド、外国株式インデックスマザーファンド、新興国株式インデックスマザーファンド、日本債券インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、新興国債券インデックスマザーファンド、東証ＲＥＩＴ指数マザーファンドおよびＭＵＡＭ Ｇ－ＲＥＩＴマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

１．株券または新株引受権証券

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（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。）

6. 資産の流動化に係る特定社債券（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。）
 7. 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。）
 8. 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。）
 9. 資産の流動化に係る優先出資証券また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。）
 10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
 11. コマーシャル・ペーパー
 12. 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。）および新株予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国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。）
 15. 投資証券または外国投資証券（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。16. において同じ。）で16. で定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券（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。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 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。）
 18. オプションを表示する証券または証書（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。）
 19. 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。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 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。）
 22. 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。）
 23. 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
 24. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、1. から23. に該当するものを除きます。）
 25. 外国の者に対する権利で23. および24. の有価証券の性質を有するもの
- なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（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。）は、次に掲げるものとします。

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号で定め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. 信託の受益権（金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものをいい、1. から5. に該当するものを除きます。）
 7. 投資事業有限責任組合契約に基づく権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に該当するものをいいます。）
 8. 外国の者に対する権利で5. から7. の権利の性質を有するもの
- その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

- ・外国為替予約取引

< マザーファンドの概要 >

ＴＯＰＩＸマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）からカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

MSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

投資成果をMSCI Kokusai Index（MSCIコクサイ インデックス）（円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

新興国株式インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）と連動した投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

新興国の株式等（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

新興国の株式等を主要投資対象とし、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めざして運用を行います。

株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

金利先渡取引および為替先渡取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

日本債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、NOMURA - BPI 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

NOMURA - BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

投資態度

投資成果をNOMURA - BPI 総合の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・ 公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。

投資態度

投資成果をシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・ 公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を１００％以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の１０％以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の１０％以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

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

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

新興国債券インデックスマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。

投資態度

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざ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、および新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価額等が連動する債券に投資することがあります。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し公社債の投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するために行うことができます。

金利先渡し取引および為替先渡し取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

東証REIT指数マザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

投資対象

東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

MUAM G-REITマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

（運用方法）

投資対象

S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度

S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指して、運用を行います。

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

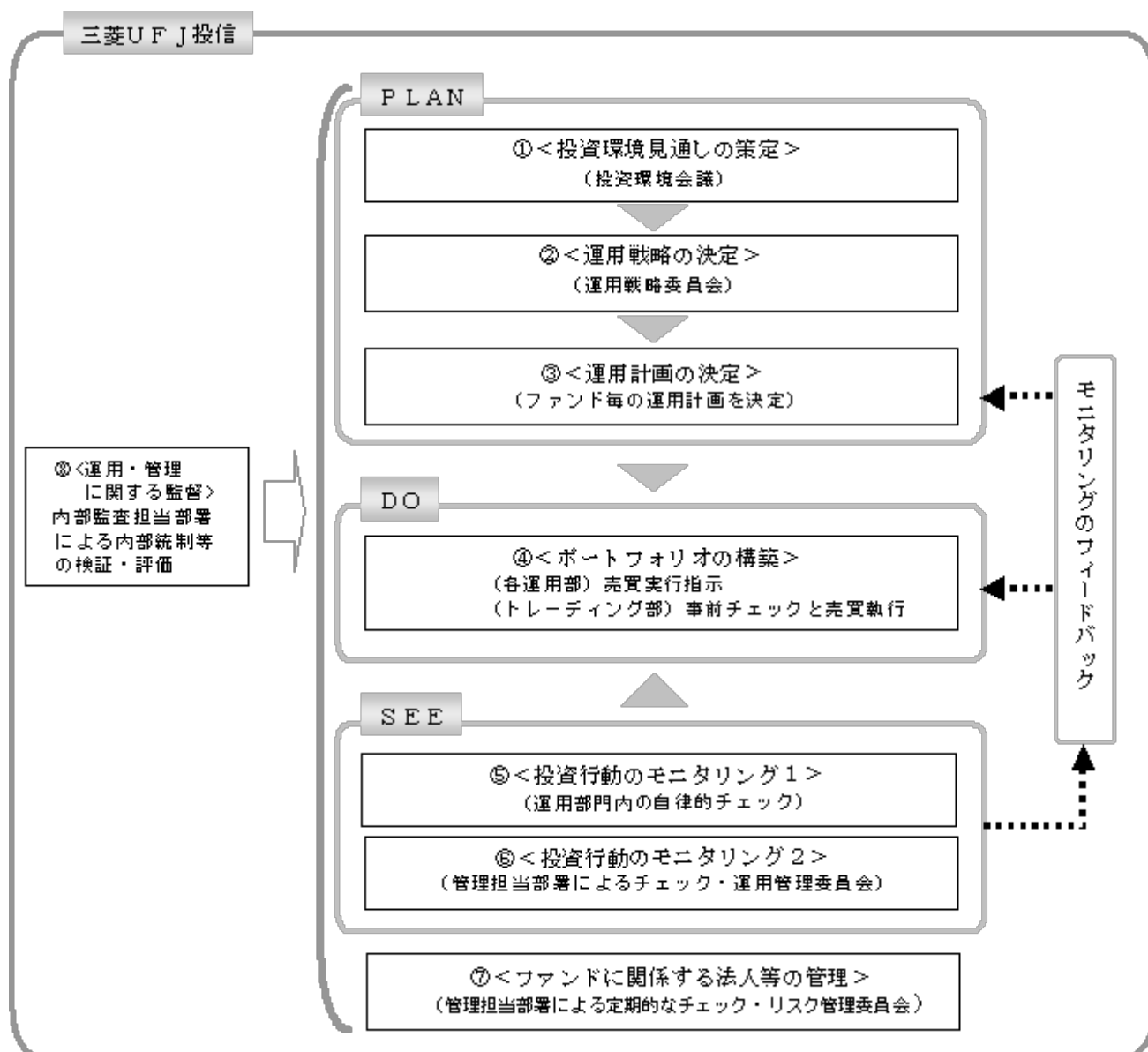
（投資制限）

株式への直接投資は行いません。

投資信託証券への投資割合に制限を設けません。

外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

（３）【運用体制】



投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング 1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているか

どうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング 2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（５名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱ＵＦＪ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成25年４月27日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

< 信託約款に定められた投資制限 >

株式

a．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

新株引受権証券および新株予約権証券

a．委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a．およびb．において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割

合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式

同一銘柄の株式への実質投資割合に制限を設けません。

同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（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ならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. 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。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書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. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（ に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ 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

外国為替予約取引

- a. 委託会社は、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。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち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。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。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。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から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信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、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。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品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および金融商品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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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ます。

金利先渡取引および為替先渡取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引およ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。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けること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、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、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。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券またはの規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまた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。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

< その他法令等に定められた投資制限 >

- ・ 同一の法人の発行する株式への投資制限

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すべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する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の率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。

- ・ デリバティブ取引の投資制限

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（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを内容とした運用を行うことをしないものとします。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

当ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けませんが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元金が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、投資元金を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

市場リスク

(価格変動リスク)

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、また、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

保有不動産等の価値は、不動産市況、社会情勢等のマクロ的な要因の他、不動産の質や収益増減等の個別の要因によって変動しますが、災害等による保有不動産の滅失、劣化または毀損があった場合には、その影響を大きく受けることがあります。なお、保有不動産等から得られる収益は、賃料水準、稼働率、借入金利等の要因により変動します。

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格が決定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受けることがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

(為替変動リスク)

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債、不動産投資信託証券の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。

また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、また、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

カントリーリスク

新興国への投資は、先進国への投資を行う場合に比べ、投資対象国におけるクーデターや重大な政治体制の変更、資産凍結を含む重大な規制の導入、政府のデフォルト等の発生による影響を受けることにより、市場・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元金を割り込む可能性が高まる場合があります。

留意事項

- ・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。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な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の方が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」をファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うこと、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

市場リスク

（価格変動リスク・為替変動リスク）

市場リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性

に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、市場リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、市場リスクと同様の管理体制をとっています。

信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.15％）が差し引かれます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年0.525％（税抜 年0.5％）

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

取扱純資産総額（注）	委託会社	販売会社	受託会社
50億円未満の部分	年0.231％ （税抜 年0.22％）	年0.231％ （税抜 年0.22％）	年0.063％ （税抜 年0.06％）
50億円以上100億円未満の部分	年0.2205％ （税抜 年0.21％）	年0.2415％ （税抜 年0.23％）	年0.063％ （税抜 年0.06％）
100億円以上の部分	年0.21％ （税抜 年0.2％）	年0.252％ （税抜 年0.24％）	年0.063％ （税抜 年0.06％）

（注）各販売会社における取扱純資産総額に応じて配分されます。

信託報酬は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

ファンドは実質的に上場投資信託（リート）を投資対象としており、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期間の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式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、外国債券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、東証REIT指数マザーファンドおよびMUAMG-REITマザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および

借入に係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等、外国での資産の保管等に要する費用等が含まれます。

（＊）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（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。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

２．解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）の税率による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）を利用する場合、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限り、）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

平成26年1月1日以降の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）となる予定です。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）

の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、当ファンドは、益金不算入制度は適用されません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

平成26年1月1日以降の税率は、15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となる予定です。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

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。

収益分配金について

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

なお、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。

上記は平成25年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

５【運用状況】

（１）【投資状況】

平成25年2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	595,384,804	95.43
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	28,538,621	4.57
純資産総額		623,923,425	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国／地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限	
							(年/月/日)	
日本	外国株式インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	—	122,478,006	1.3291 1.3209	162,787,189 161,781,198	— —	25.93
日本	東証REIT指数マザーファンド	親投資信託受益証券	—	46,379,761	1.5341 1.7129	71,151,192 79,443,892	— —	12.73
日本	MUAMG-REITマザーファンド	親投資信託受益証券	—	80,433,396	0.9574 0.9695	77,011,812 77,980,177	— —	12.50
日本	外国債券インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	—	48,458,277	1.5982 1.5997	77,448,319 77,518,705	— —	12.42
日本	新興国債券インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	—	59,655,209	1.2837 1.2983	76,582,632 77,450,357	— —	12.41
日本	TOPIXマザーファンド	親投資信託受益証券	—	69,609,242	0.8841 0.9254	61,545,504 64,416,392	— —	10.32
日本	新興国株式インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	—	23,095,496	1.7907 1.7865	41,358,256 41,260,103	— —	6.61
日本	日本債券インデックスマザーファンド	親投資信託受益証券	—	12,865,646	1.1978 1.2074	15,410,471 15,533,980	— —	2.49

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類／業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.43
合計	95.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成25年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成24年 1月26日)	42,391,869 (分配付) 42,391,869 (分配落)	9,968 (分配付) 9,968 (分配落)
第2計算期間末日 (平成25年 1月28日)	453,487,264 (分配付) 453,487,264 (分配落)	12,936 (分配付) 12,936 (分配落)
平成24年 2月末日	72,070,298	10,749
3月末日	109,142,912	10,888
4月末日	113,500,374	10,734
5月末日	121,364,302	10,130
6月末日	125,032,987	10,335

7月末日	143,877,599	10,391
8月末日	158,275,387	10,503
9月末日	171,386,957	10,736
10月末日	197,664,584	10,964
11月末日	240,145,305	11,324
12月末日	314,067,160	12,205
平成25年 1月末日	477,107,568	13,083
2月末日	623,923,425	13,316

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.32
第2計算期間	29.77

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	51,206,550	8,680,675	42,525,875
第2計算期間	422,324,976	114,297,236	350,553,615

[次へ](#)

< 参考 >

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	207,349,307,194	98.71
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,714,918,513	1.29
純資産総額		210,064,225,707	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引（買建）	2,000,260,000	0.95

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
日本	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	1,978,600	3,438.86 4,765.00	6,804,128,396 9,428,029,000	— —	4.49
日本	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	11,510,200	418.06 513.00	4,811,954,212 5,904,732,600	— —	2.81
日本	本田技研工業	株式	輸送用機器	1,299,400	3,107.07 3,455.00	4,037,326,758 4,489,427,000	— —	2.14
日本	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	1,149,600	2,773.77 3,710.00	3,188,725,992 4,265,016,000	— —	2.03
日本	みずほフィナンシャルグループ	株式	銀行業	19,605,600	139.26 204.00	2,730,275,856 3,999,542,400	— —	1.90
日本	キヤノン	株式	電気機器	956,800	3,808.31 3,365.00	3,643,791,008 3,219,632,000	— —	1.53
日本	武田薬品工業	株式	医薬品	604,200	3,741.43 4,795.00	2,260,572,006 2,897,139,000	— —	1.38
日本	日本電信電話	株式	情報・通信業	640,000	3,775.55 4,250.00	2,416,352,000 2,720,000,000	— —	1.29
日本	ソフトバンク	株式	情報・通信業	727,400	2,404.56 3,435.00	1,749,076,944 2,498,619,000	— —	1.19
日本	三菱地所	株式	不動産業	1,064,000	1,434.02 2,310.00	1,525,797,280 2,457,840,000	— —	1.17
日本	ファナック	株式	電気機器	160,400	14,837.42 14,310.00	2,379,922,168 2,295,324,000	— —	1.09
日本	日本たばこ産業	株式	食料品	765,200	2,277.99 2,925.00	1,743,117,948 2,238,210,000	— —	1.07
日本	三菱商事	株式	卸売業	1,186,100	1,912.85 1,839.00	2,268,831,385 2,181,237,900	— —	1.04
日本	東日本旅客鉄道	株式	陸運業	284,100	5,268.30 6,840.00	1,496,724,030 1,943,244,000	— —	0.93
日本	日立製作所	株式	電気機器	3,698,000	511.33 520.00	1,890,914,880 1,922,960,000	— —	0.92
日本	日産自動車	株式	輸送用機器	1,945,700	864.97 937.00	1,682,972,129 1,823,120,900	— —	0.87
日本	三井物産	株式	卸売業	1,312,100	1,378.95 1,374.00	1,809,320,295 1,802,825,400	— —	0.86
日本	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	株式	情報・通信業	12,525	139,844.05 143,400.00	1,751,546,726 1,796,085,000	— —	0.86
日本	アステラス製薬	株式	医薬品	358,100	3,427.45 5,010.00	1,227,369,845 1,794,081,000	— —	0.85
日本	小松製作所	株式	機械	752,200	2,345.41 2,338.00	1,764,217,402 1,758,643,600	— —	0.84
日本	セブン&アイ・ホールディングス	株式	小売業	635,900	2,365.79 2,706.00	1,504,405,861 1,720,745,400	— —	0.82
日本	新日鐵住金	株式	鉄鋼	6,817,000	219.58 251.00	1,496,876,860 1,711,067,000	— —	0.81
日本	三井不動産	株式	不動産業	717,000	1,537.08 2,358.00	1,102,086,360 1,690,686,000	— —	0.80

日本	野村ホールディングス	株式	証券、商品 先物取引業	3,107,700	357.71 532.00	1,111,655,367 1,653,296,400	— —	0.79
日本	信越化学工業	株式	化学	289,300	4,716.06 5,700.00	1,364,356,158 1,649,010,000	— —	0.79
日本	東京海上ホールディングス	株式	保険業	588,800	2,193.16 2,618.00	1,291,332,608 1,541,478,400	— —	0.73
日本	K D D I	株式	情報・通信業	214,500	5,354.68 6,960.00	1,148,578,860 1,492,920,000	— —	0.71
日本	デンソー	株式	輸送用機器	380,500	2,735.06 3,890.00	1,040,690,330 1,480,145,000	— —	0.70
日本	ブリヂストン	株式	ゴム製品	505,500	1,970.49 2,844.00	996,082,695 1,437,642,000	— —	0.68
日本	三菱重工業	株式	機械	2,581,000	394.05 514.00	1,017,043,050 1,326,634,000	— —	0.63

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.57
	建設業	2.43
	食料品	3.87
	繊維製品	0.79
	パルプ・紙	0.29
	化学	5.62
	医薬品	5.11
	石油・石炭製品	0.78
	ゴム製品	0.93
	ガラス・土石製品	0.91
	鉄鋼	1.76
	非鉄金属	1.06
	金属製品	0.66
	機械	5.07
	電気機器	11.50
	輸送用機器	11.46
	精密機器	1.27
	その他製品	1.31
	電気・ガス業	2.13
	陸運業	4.12
	海運業	0.35
	空運業	0.55
	倉庫・運輸関連業	0.26
	情報・通信業	5.94
	卸売業	5.05
	小売業	4.01
	銀行業	10.56
	証券、商品先物取引業	1.54
	保険業	2.34
	その他金融業	1.05
	不動産業	3.28
	サービス業	2.08
合 計		98.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年2月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引						
ＴＯＰＩＸ １３年３月限	東京証券取引所	買建	206	1,980,468,040	2,000,260,000	0.95

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

< 参考 >

「外国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	92,780,825,864	55.79
	イギリス	16,302,882,416	9.80
	カナダ	8,289,953,972	4.98
	スイス	6,853,787,090	4.12
	フランス	6,512,094,511	3.92
	オーストラリア	6,481,053,643	3.90
	ドイツ	6,415,899,307	3.86
	スウェーデン	2,502,579,985	1.50
	香港	2,299,804,437	1.38
	スペイン	2,181,830,779	1.31
	オランダ	2,053,576,932	1.23
	イタリア	1,506,981,436	0.91
	シンガポール	1,300,819,624	0.78
	デンマーク	914,237,497	0.55
	ベルギー	891,213,304	0.54
	ノルウェー	696,261,969	0.42
	フィンランド	610,166,905	0.37
	イスラエル	403,355,499	0.24
	ルクセンブルグ	232,937,901	0.14
	オーストリア	221,418,464	0.13
	アイルランド	199,367,895	0.12
	ポルトガル	125,180,802	0.08
	ニュージーランド	102,146,431	0.06
	ギリシャ	37,981,684	0.02
投資証券	アメリカ	2,599,416,196	1.56
	オーストラリア	502,818,803	0.30
	フランス	212,832,056	0.13
	イギリス	186,983,249	0.11
	香港	79,379,834	0.05
	シンガポール	74,617,351	0.04
	カナダ	36,223,958	0.02
	オランダ	18,770,189	0.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,682,774,439	1.63
純資産総額		166,310,174,422	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	2,530,569,296	1.52

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国/ 地域	銘 柄	種類	業 種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評 価 額		利率（％） 償還期限 （年/月/日）	投資 比率 （％）
					単価（円）	金額（円）		
アメリカ	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	67,600	52,449.46 41,127.17	3,545,584,144 2,780,196,739	—	1.67
アメリカ	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	333,000	7,680.18 8,282.42	2,557,500,006 2,758,045,959	—	1.66
アメリカ	GENERAL ELECTRIC CO	株式	資本財	762,000	1,758.61 2,161.95	1,340,064,706 1,647,412,529	—	0.99
アメリカ	CHEVRON CORP	株式	エネルギー	141,800	9,490.60 10,791.29	1,345,767,207 1,530,205,134	—	0.92
スイス	NESTLE SA-REG	株式	食品・飲料・タバコ	232,463	5,491.60 6,416.17	1,276,595,112 1,491,522,591	—	0.90
アメリカ	INTL BUSINESS MACHINES CORP	株式	ソフトウェア・サービス	78,300	18,588.03 18,717.54	1,455,443,085 1,465,584,031	—	0.88
アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO/THE	株式	家庭用品・パーソナル用品	198,800	5,887.33 7,100.14	1,170,402,476 1,411,508,329	—	0.85
アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	198,700	5,939.14 7,060.36	1,180,107,515 1,402,894,167	—	0.84
アメリカ	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	544,500	2,875.21 2,572.70	1,565,552,280 1,400,836,837	—	0.84
アメリカ	GOOGLE INC-CL A	株式	ソフトウェア・サービス	18,900	55,947.27 73,987.64	1,057,403,454 1,398,366,543	—	0.84
アメリカ	AT&T INC	株式	電気通信サービス	415,900	3,108.33 3,316.48	1,292,756,942 1,379,325,487	—	0.83
アメリカ	PFIZER INC	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	538,400	2,093.50 2,535.69	1,127,141,099 1,365,220,395	—	0.82
イギリス	HSBC HOLDINGS PLC	株式	銀行	1,321,441	774.84 1,017.68	1,023,908,515 1,344,807,380	—	0.81
アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	株式	各種金融	274,200	3,405.29 4,558.89	933,731,368 1,250,048,405	—	0.75
アメリカ	WELLS FARGO & CO	株式	銀行	362,100	3,074.10 3,249.87	1,113,134,253 1,176,780,208	—	0.71
スイス	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,657	15,629.95 21,111.59	791,766,600 1,069,450,169	—	0.64
アメリカ	COCA-COLA CO/THE	株式	食品・飲料・タバコ	292,600	3,577.36 3,557.00	1,046,736,033 1,040,780,979	—	0.63
スイス	NOVARTIS AG-REG	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	165,790	4,951.61 6,221.89	820,927,587 1,031,527,723	—	0.62
アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	株式	食品・飲料・タバコ	121,500	7,960.48 8,458.18	967,198,988 1,027,669,999	—	0.62
アメリカ	ORACLE CORP	株式	ソフトウェア・サービス	282,000	2,497.77 3,208.24	704,371,140 904,725,597	—	0.54
アメリカ	WAL-MART STORES INC	株式	食品・生活必需品 小売り	134,100	5,515.44 6,629.26	739,621,335 888,984,651	—	0.53
アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	株式	電気通信サービス	205,300	3,808.63 4,287.83	781,913,114 880,293,244	—	0.53
アメリカ	MERCK & CO. INC.	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	219,400	3,517.23 3,975.15	771,680,305 872,148,941	—	0.52
イギリス	BP PLC	株式	エネルギー	1,374,603	581.13 627.38	798,825,515 862,403,535	—	0.52
アメリカ	CITIGROUP INC	株式	各種金融	211,000	2,704.99 3,900.22	570,753,396 822,946,757	—	0.49
イギリス	VODAFONE GROUP PLC	株式	電気通信サービス	3,544,973	240.03 231.75	850,909,440 821,550,576	—	0.49
アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	株式	各種金融	778,100	696.60 1,045.36	542,024,693 813,396,950	—	0.49
イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	株式	エネルギー	268,276	2,897.23 3,027.07	777,259,099 812,092,659	—	0.49
オーストラリア	BHP BILLITON LTD	株式	素材	232,798	3,246.10 3,480.41	755,687,729 810,233,278	—	0.49
アメリカ	PEPSICO INC	株式	食品・飲料・タバコ	112,000	6,183.36 6,982.65	692,537,260 782,057,337	—	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	エネルギー	10.85
	素材	6.49
	資本財	7.38
	商業・専門サービス	0.95
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	1.40
	耐久消費財・アパレル	1.41
	消費者サービス	1.65
	メディア	2.73
	小売	2.95
	食品・生活必需品小売り	2.31
	食品・飲料・タバコ	6.85
	家庭用品・パーソナル用品	1.94
	ヘルスケア機器・サービス	2.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.10
	銀行	7.87
	各種金融	5.05
	保険	4.32
	不動産	0.73
	ソフトウェア・サービス	6.11
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.98
	電気通信サービス	3.60
	公益事業	3.37
	半導体・半導体製造装置	1.42
	小計	96.16
投資証券	—	2.23
合 計		98.39

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年2月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引								
S&P 500 (2013年3月限)	シカゴ商業取引所	買建	43	アメリカドル	16,103,354.00	16,294,850.00	1,507,436,573	0.91
FTSE100 (2013年3月限)	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	29	イギリス ポンド	1,824,857.50	1,832,075.00	257,168,367	0.15
SP/TSE60 (2013年3月限)	モントリオール取引所	買建	8	カナダドル	1,164,630.00	1,171,200.00	105,935,040	0.06
SPI 200 (2013年3月限)	シドニー先物取引所	買建	12	オーストラ リアドル	1,377,048.00	1,506,000.00	142,859,160	0.09
EURO ST (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	130	ユーロ	3,454,907.50	3,395,600.00	413,074,740	0.25
SWISS IX (2013年3月限)	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	14	スイス フラン	1,040,122.50	1,044,820.00	104,095,416	0.06

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

< 参考 >

「新興国株式インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
株式	香港	3,823,401,794	17.79
	韓国	3,184,885,884	14.82
	ブラジル	2,579,301,020	12.00
	台湾	2,224,733,571	10.35
	アメリカ	1,640,482,337	7.63
	南アフリカ	1,514,618,972	7.05
	インド	1,358,851,206	6.32
	メキシコ	1,093,974,659	5.09
	マレーシア	703,548,860	3.27
	インドネシア	611,638,200	2.85
	タイ	558,777,901	2.60
	チリ	414,937,620	1.93
	トルコ	410,006,726	1.91
	ポーランド	322,005,060	1.50
	コロンビア	252,802,920	1.18
	フィリピン	213,618,554	0.99
	チェコ	54,012,250	0.25
	ハンガリー	45,943,010	0.21
	モロッコ	10,641,942	0.05
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	473,191,024	2.21
純資産総額		21,491,373,510	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	418,677,132	1.95

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘 柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評 価 額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
韓国	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	半導体・ 半導体製造装置	6,390	111,023.99 131,016.60	709,443,644 837,196,074	— —	3.90
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	株式	半導体・ 半導体製造装置	1,410,000	265.51 326.04	374,413,871 459,716,400	— —	2.14
香港	CHINA MOBILE LTD	株式	電気通信 サービス	355,000	1,031.34 1,013.45	366,169,536 359,775,992	— —	1.67
香港	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	株式	銀行	4,251,550	66.09 73.72	281,094,365 313,455,727	— —	1.46
アメリカ	GAZPROM OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	315,000	943.60 827.03	297,328,855 260,517,411	— —	1.21
香港	IND & COMM BK OF CHINA-H	株式	銀行	3,816,350	57.86 64.42	221,090,202 245,856,899	— —	1.14
アメリカ	SBERBANK-SPONSORED ADR	株式	銀行	171,500	1,104.56 1,258.13	189,509,565 215,770,324	— —	1.00
メキシコ	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	株式	電気通信 サービス	2,180,000	124.07 97.21	270,576,984 211,920,852	— —	0.99
ブラジル	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	株式	銀行	125,400	1,380.13 1,622.08	173,099,714 203,409,835	— —	0.95
香港	BANK OF CHINA LTD-H	株式	銀行	4,440,000	35.79 42.35	158,976,255 188,040,660	— —	0.87
ブラジル	VALE SA-PREF	株式	素材	113,000	1,751.25 1,659.06	197,920,476 187,473,780	— —	0.87

香港	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ソフトウェア・サービス	59,000	2,688.66 3,151.90	158,637,557 185,962,454	— —	0.87
香港	CNOOC LTD	株式	エネルギー	1,040,000	178.23 178.71	185,470,652 185,859,856	— —	0.86
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	株式	エネルギー	232,000	919.62 786.70	213,438,107 182,516,256	— —	0.85
南アフリカ	MTN GROUP LTD	株式	電気通信サービス	99,000	1,447.18 1,840.18	143,271,736 182,178,136	— —	0.85
アメリカ	LUKOIL OAO-SPON ADR	株式	エネルギー	30,400	5,143.55 5,966.89	156,386,865 181,393,608	— —	0.84
ブラジル	BANCO BRADESCO SA-PREF	株式	銀行	108,186	1,435.35 1,638.00	155,302,092 177,208,668	— —	0.82
ブラジル	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	株式	食品・飲料・タバコ	42,500	3,648.06 4,042.58	155,047,703 171,809,820	— —	0.80
韓国	HYUNDAI MOTOR CO	株式	自動車・自動車部品	8,750	21,209.93 18,447.00	185,587,082 161,411,250	— —	0.75
香港	PETROCHINA CO LTD-H	株式	エネルギー	1,219,000	123.71 125.98	150,950,775 153,570,595	— —	0.71
南アフリカ	NASPERS LTD-N SHS	株式	メディア	22,600	4,712.75 6,073.16	106,509,804 137,253,416	— —	0.64
台湾	HON HAI PRECISION INDUSTRY	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	505,336	246.01 254.90	124,327,861 128,812,167	— —	0.60
ブラジル	VALE SA	株式	素材	71,500	1,815.37 1,731.60	129,802,862 123,809,400	— —	0.58
南アフリカ	SASOL LTD	株式	エネルギー	30,800	3,829.18 3,981.87	117,941,357 122,641,780	— —	0.57
香港	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	株式	エネルギー	1,160,000	92.69 104.14	107,601,898 120,812,724	— —	0.56
韓国	POSCO	株式	素材	3,900	32,422.36 30,244.50	126,447,502 117,953,550	— —	0.55
ブラジル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	株式	エネルギー	171,000	959.86 689.36	164,193,806 117,881,244	— —	0.55
メキシコ	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	株式	食品・飲料・タバコ	111,000	814.06 1,046.52	90,368,052 116,164,719	— —	0.54
インド	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	株式	銀行	86,000	1,192.09 1,348.27	102,520,122 115,951,693	— —	0.54
香港	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	株式	保険	422,000	238.60 271.40	100,689,200 114,533,965	— —	0.53

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別		投資比率(%)
株式	エネルギー	11.78
	素材	10.81
	資本財	4.52
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.70
	自動車・自動車部品	3.35
	耐久消費財・アパレル	0.92
	消費者サービス	0.49
	メディア	1.27
	小売	1.63
	食品・生活必需品小売り	2.31
	食品・飲料・タバコ	5.27
	家庭用品・パーソナル用品	1.11
	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	0.71
	銀行	19.13
	各種金融	2.68
	保険	2.87
	不動産	2.12
	ソフトウェア・サービス	2.66
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.20
	電気通信サービス	7.25
	公益事業	3.43
	半導体・半導体製造装置	7.96
合 計		97.80

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年2月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	通貨	簿価	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引								
MINI MS (2013年3月限)	ニューヨーク証券取引所	買建	86	アメリカドル	4,591,292.00	4,525,750.00	418,677,132	1.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

< 参考 >

「日本債券インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域名	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	165,784,012,230	74.86
地方債証券	日本	14,425,194,879	6.51
特殊債券	日本	22,677,119,081	10.24
社債券	日本	14,847,283,500	6.70
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	3,723,513,801	1.69
純資産総額		221,457,123,491	100.00

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

その他の資産の投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引（買建）	1,740,240,000	0.79

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成25年2月28日現在

国／地域	銘柄	種類	業種	券面総額 (千円)	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	第262回利付国債(10年)	国債証券	—	5,420,000	103.66 102.4020	5,618,458,000 5,550,188,400	1.900000 2014/06/20	2.51
日本	第263回利付国債(10年)	国債証券	—	5,328,000	103.34 102.4050	5,506,041,600 5,456,138,400	1.600000 2014/09/20	2.46
日本	第284回利付国債(10年)	国債証券	—	4,146,000	106.76 106.1120	4,426,269,600 4,399,403,520	1.700000 2016/12/20	1.99
日本	第285回利付国債(10年)	国債証券	—	3,818,000	107.05 106.4860	4,087,169,000 4,065,635,480	1.700000 2017/03/20	1.84
日本	第281回利付国債(10年)	国債証券	—	3,543,000	107.36 106.3810	3,803,764,800 3,769,078,830	2.000000 2016/06/20	1.70
日本	第268回利付国債(10年)	国債証券	—	3,562,000	103.90 102.9710	3,701,093,900 3,667,827,020	1.500000 2015/03/20	1.66
日本	第283回利付国債(10年)	国債証券	—	3,432,000	106.91 106.1030	3,669,151,200 3,641,454,960	1.800000 2016/09/20	1.64
日本	第287回利付国債(10年)	国債証券	—	3,300,000	108.27 107.7220	3,572,919,000 3,554,826,000	1.900000 2017/06/20	1.61
日本	第276回利付国債(10年)	国債証券	—	3,290,000	105.19 104.3440	3,460,751,000 3,432,917,600	1.600000 2015/12/20	1.55
日本	第270回利付国債(10年)	国債証券	—	3,089,000	103.62 102.8780	3,200,968,500 3,177,901,420	1.300000 2015/06/20	1.43
日本	第265回利付国債(10年)	国債証券	—	2,988,000	103.59 102.6120	3,095,538,120 3,066,046,560	1.500000 2014/12/20	1.38
日本	第325回利付国債(10年)	国債証券	—	2,645,000	100.39 101.4850	2,655,551,250 2,684,278,250	0.800000 2022/09/20	1.21
日本	第279回利付国債(10年)	国債証券	—	2,455,000	107.02 105.9260	2,627,341,000 2,600,483,300	2.000000 2016/03/20	1.17

日本	第３２３回利付国債（１０年）	国債証券	—	2,475,000	100.88 102.6410	2,496,876,300 2,540,364,750	0.900000 2022/06/20	1.15
日本	第２７３回利付国債（１０年）	国債証券	—	2,388,000	104.56 103.7030	2,496,941,800 2,476,427,640	1.500000 2015/09/20	1.12
日本	第３１０回利付国債（１０年）	国債証券	—	2,256,000	102.73 104.5100	2,317,588,800 2,357,745,600	1.000000 2020/09/20	1.06
日本	第３２７回利付国債（１０年）	国債証券	—	2,210,000	100.76 101.2880	2,226,901,900 2,238,464,800	0.800000 2022/12/20	1.01
日本	第３０８回利付国債（１０年）	国債証券	—	2,024,000	105.44 106.7960	2,134,111,000 2,161,551,040	1.300000 2020/06/20	0.98
日本	第３０３回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,905,000	106.35 107.3740	2,026,150,800 2,045,474,700	1.400000 2019/09/20	0.92
日本	第３１９回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,929,000	102.58 104.7470	1,978,768,200 2,020,569,630	1.100000 2021/12/20	0.91
日本	第３１３回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,859,000	104.87 106.6390	1,949,606,100 1,982,419,010	1.300000 2021/03/20	0.90
日本	第３１７回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,877,000	102.96 104.8320	1,932,621,880 1,967,696,640	1.100000 2021/09/20	0.89
日本	第２９７回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,836,000	106.34 107.0610	1,952,572,200 1,965,639,960	1.400000 2018/12/20	0.89
日本	第２８８回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,796,000	107.49 107.2190	1,930,537,200 1,925,653,240	1.700000 2017/09/20	0.87
日本	第２９２回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,694,000	107.88 107.9480	1,827,487,200 1,828,639,120	1.700000 2018/03/20	0.83
日本	第３１５回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,703,000	103.88 105.7440	1,769,120,100 1,800,820,320	1.200000 2021/06/20	0.81
日本	第３０６回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,648,000	106.27 107.4390	1,751,384,250 1,770,594,720	1.400000 2020/03/20	0.80
日本	第３２１回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,705,000	101.52 103.6980	1,731,037,350 1,768,050,900	1.000000 2022/03/20	0.80
日本	第１０６回利付国債（５年）	国債証券	—	1,710,000	100.10 100.4070	1,711,878,200 1,716,959,700	0.200000 2017/09/20	0.78
日本	第３０５回利付国債（１０年）	国債証券	—	1,568,000	105.53 106.7680	1,654,710,400 1,674,122,240	1.300000 2019/12/20	0.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	74.86
地方債証券	6.51
特殊債券	10.24
社債券	6.70
合 計	98.32

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年2月28日現在

資産の種類	取引所名	建別	数量	簿価(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
債券先物取引						
長期国債先物 1 3 年 3 月 限	東京証券取引所	買建	12	1,726,572,600	1,740,240,000	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

< 参考 >

「外国債券インデックスマザーファンド」

(１) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	71,865,166,009	41.16
	フランス	16,852,357,279	9.65
	イタリア	15,919,611,378	9.12
	ドイツ	15,272,947,653	8.75
	イギリス	12,934,803,390	7.41
	スペイン	8,000,263,894	4.58
	カナダ	4,792,963,092	2.75
	ベルギー	4,671,089,632	2.68
	オランダ	4,518,840,704	2.59
	オーストリア	3,047,662,171	1.75
	オーストラリア	2,653,162,201	1.52
	メキシコ	1,758,663,401	1.01
	デンマーク	1,387,058,098	0.79
	アイルランド	1,311,749,517	0.75
	ポーランド	1,297,935,756	0.74
	フィンランド	1,082,838,887	0.62
	スウェーデン	1,080,100,808	0.62
	南アフリカ	1,074,414,955	0.62
	マレーシア	948,983,650	0.54
	シンガポール	675,740,463	0.39
	スイス	661,982,867	0.38
	ノルウェー	528,102,036	0.30
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,248,804,498	1.28
純資産総額		174,585,242,339	100.00

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

(２) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘 柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評 価 額		利率 (%)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)	償還期限 (年/月/日)	
アメリカ	2 T-NOTE 220215	国債証券	—	10,000,000.00	9,425.36 9,468.5430	942,536,978 946,854,304	2.000000 2022/02/15	0.54
アメリカ	4.25 T-BOND 401115	国債証券	—	6,300,000.00	11,584.70 11,425.7077	729,836,685 719,819,586	4.250000 2040/11/15	0.41
アメリカ	4.375 T-BOND 400515	国債証券	—	6,000,000.00	11,813.09 11,643.9735	708,785,601 698,638,410	4.375000 2040/05/15	0.40
アメリカ	3.875 T-BOND 400815	国債証券	—	6,400,000.00	10,888.71 10,745.6146	696,877,830 687,719,340	3.875000 2040/08/15	0.39
アメリカ	4.75 T-BOND 410215	国債証券	—	5,500,000.00	12,520.65 12,337.0757	688,635,767 678,539,167	4.750000 2041/02/15	0.39
アメリカ	3.125 T-NOTE 210515	国債証券	—	6,500,000.00	10,397.19 10,388.5839	675,817,928 675,257,953	3.125000 2021/05/15	0.39
アメリカ	4.375 T-BOND 410515	国債証券	—	5,700,000.00	11,821.76 11,651.2008	673,840,671 664,118,448	4.375000 2041/05/15	0.38
アメリカ	3.125 T-NOTE 190515	国債証券	—	6,300,000.00	10,449.00 10,412.4341	658,287,283 655,983,350	3.125000 2019/05/15	0.38
アメリカ	3.625 T-NOTE 210215	国債証券	—	6,100,000.00	10,792.21 10,749.2283	658,325,212 655,702,929	3.625000 2021/02/15	0.38
アメリカ	2 T-NOTE 211115	国債証券	—	6,900,000.00	9,514.59 9,502.1501	656,507,330 655,648,362	2.000000 2021/11/15	0.38
アメリカ	0.75 T-NOTE 171031	国債証券	—	7,000,000.00	9,266.81 9,268.3456	648,677,344 648,784,193	0.750000 2017/10/31	0.37
アメリカ	0.25 T-NOTE 140531	国債証券	—	7,000,000.00	9,248.59 9,257.1432	647,401,631 648,000,026	0.250000 2014/05/31	0.37
アメリカ	2.625 T-NOTE 201115	国債証券	—	6,300,000.00	10,035.88 10,058.2942	632,261,040 633,672,540	2.625000 2020/11/15	0.36

アメリカ	3.625 T-NOTE 200215	国債証券	—	5,800,000.00	10,781.11 10,739.1100	625,304,693 622,868,384	3.625000 2020/02/15	0.36
アメリカ	3.625 T-NOTE 190815	国債証券	—	5,800,000.00	10,770.91 10,706.5870	624,712,802 620,982,047	3.625000 2019/08/15	0.36
フランス	3 O.A.T 220425	国債証券	—	4,700,000.00	12,670.60 13,120.5607	595,518,354 616,666,355	3.000000 2022/04/25	0.35
アメリカ	2.25 T-NOTE 150131	国債証券	—	6,400,000.00	9,718.35 9,607.6694	621,974,722 614,890,841	2.250000 2015/01/31	0.35
フランス	3.5 O.A.T 260425	国債証券	—	4,600,000.00	12,536.44 13,338.9225	576,676,521 613,590,435	3.500000 2026/04/25	0.35
アメリカ	2.5 T-NOTE 150331	国債証券	—	6,300,000.00	9,813.28 9,684.2792	618,237,102 610,109,592	2.500000 2015/03/31	0.35
アメリカ	2.75 T-NOTE 190215	国債証券	—	5,900,000.00	10,215.12 10,189.1092	602,692,531 601,157,443	2.750000 2019/02/15	0.34
フランス	3.75 O.A.T 170425	国債証券	—	4,400,000.00	13,370.55 13,653.9960	588,304,266 600,775,824	3.750000 2017/04/25	0.34
アメリカ	2.125 T-NOTE 210815	国債証券	—	6,200,000.00	9,586.39 9,631.1582	594,356,513 597,131,813	2.125000 2021/08/15	0.34
アメリカ	3.5 T-NOTE 200515	国債証券	—	5,600,000.00	10,700.63 10,662.5002	599,235,375 597,100,013	3.500000 2020/05/15	0.34
フランス	5 O.A.T 161025	国債証券	—	4,200,000.00	14,002.52 14,082.8122	588,105,976 591,478,114	5.000000 2016/10/25	0.34
フランス	4.25 O.A.T 231025	国債証券	—	4,100,000.00	13,683.19 14,361.9990	561,010,872 588,841,959	4.250000 2023/10/25	0.34
フランス	4.25 O.A.T 190425	国債証券	—	4,100,000.00	13,750.70 14,328.5452	563,779,017 587,470,355	4.250000 2019/04/25	0.34
フランス	3 O.A.T 151025	国債証券	—	4,500,000.00	12,953.29 13,001.3437	582,898,140 585,060,468	3.000000 2015/10/25	0.34
アメリカ	2.375 T-NOTE 141031	国債証券	—	6,100,000.00	9,707.17 9,581.6509	592,137,674 584,480,709	2.375000 2014/10/31	0.33
フランス	3.75 O.A.T 191025	国債証券	—	4,100,000.00	13,476.76 13,988.5335	552,547,162 573,529,873	3.750000 2019/10/25	0.33
フランス	3.75 O.A.T 210425	国債証券	—	4,100,000.00	13,209.97 13,976.9767	541,608,913 573,056,046	3.750000 2021/04/25	0.33

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	98.71
合 計	98.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「新興国債券インデックスマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	286,225,049	10.05
	マレーシア	285,420,673	10.02
	ブラジル	282,286,742	9.91
	南アフリカ	280,938,428	9.86
	トルコ	268,983,039	9.44
	ポーランド	268,726,097	9.43
	インドネシア	268,283,555	9.42
	タイ	207,749,631	7.29
	ロシア	147,196,800	5.17
	ハンガリー	140,021,839	4.92
	コロンビア	96,314,265	3.38
	ペルー	62,712,621	2.20
	フィリピン	12,940,509	0.45
特殊債券	ロシア	114,266,121	4.01
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	126,764,753	4.45
純資産総額		2,848,830,122	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘 柄	種類	業種	券面総額	上段：帳簿価額 下段：評 価 額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
ロシア	7.85 RUSSIA (GL) 180310	国債証券	—	45,000,000.00	332.12 327.1040	149,454,000 147,196,800	7.850000 2018/03/10	5.17
コロン ビア	12 COLOMBIA (GL) 151022	国債証券	—	1,020,000,000.00	6.15 6.1493	62,826,322 62,723,115	12.000000 2015/10/22	2.20
ロシア	7.5 INTL BK(GL) 170302	特殊債券	—	19,000,000.00	326.81 326.0400	62,094,888 61,947,600	7.500000 2017/03/02	2.17
南アフ リカ	10.5 SOUTH AFRICA 261221	国債証券	—	4,200,000.00	1,331.03 1,337.4576	55,903,554 56,173,219	10.500000 2026/12/21	1.97
ブラジ ル	BRAZIL-LTN 160101	国債証券	—	1,500,000.00	3,680.45 3,667.1216	55,206,824 55,006,824	— 2016/01/01	1.93
ロシア	4.875 INTL BK(GL) 130916	特殊債券	—	17,300,000.00	302.66 302.4192	52,360,595 52,318,521	4.875000 2013/09/16	1.84
ブラジ ル	10(IN)BRAZIL NTN-F170101	国債証券	—	1,000,000.00	4,910.55 4,895.6076	49,105,555 48,956,076	10.000000 2017/01/01	1.72
ブラジ ル	BRAZIL-LTN 150101	国債証券	—	1,100,000.00	4,029.47 4,023.0122	44,324,177 44,253,134	— 2015/01/01	1.55
トルコ	10.5 TURKEY GOVT 200115	国債証券	—	700,000.00	6,297.72 6,254.9022	44,084,090 43,784,315	10.500000 2020/01/15	1.54
トルコ	9.5 TURKEY GOVT 220112	国債証券	—	700,000.00	6,149.05 6,068.0965	43,043,374 42,476,675	9.500000 2022/01/12	1.49
タイ	3.875 THAILAND 190613	国債証券	—	13,000,000.00	318.35 320.5152	41,386,085 41,666,976	3.875000 2019/06/13	1.46
ブラジ ル	12.5 BRAZIL (GL) 160105	国債証券	—	750,000.00	5,674.73 5,491.9800	42,560,505 41,189,850	12.500000 2016/01/05	1.45
トルコ	9 TURKEY GOVT 170308	国債証券	—	600,000.00	5,655.66 5,685.3198	33,933,969 34,111,919	9.000000 2017/03/08	1.20
ブラジ ル	12.5 BRAZIL (GL) 220105	国債証券	—	500,000.00	6,816.88 6,672.5100	34,084,440 33,362,550	12.500000 2022/01/05	1.17
南アフ リカ	7.25 SOUTH AFRICA 200115	国債証券	—	3,000,000.00	1,099.73 1,104.0051	32,992,178 33,120,153	7.250000 2020/01/15	1.16
ブラジ ル	BRAZIL-LTN 140401	国債証券	—	700,000.00	4,302.38 4,303.8730	30,116,693 30,127,111	— 2014/04/01	1.06
南アフ リカ	8.25 SOUTH AFRICA 170915	国債証券	—	2,600,000.00	1,149.32 1,151.9930	29,882,503 29,951,819	8.250000 2017/09/15	1.05
南アフ リカ	8 SOUTH AFRICA 181221	国債証券	—	2,600,000.00	1,145.02 1,148.0106	29,770,619 29,848,276	8.000000 2018/12/21	1.05
ペルー	7.84 PERU 200812	国債証券	—	650,000.00	4,522.42 4,494.6943	29,395,774 29,215,513	7.840000 2020/08/12	1.03

南アフリカ	6.75 SOUTH AFRICA 210331	国債証券	—	2,700,000.00	1,064.77 1,070.4167	28,749,018 28,901,251	6.750000 2021/03/31	1.01
トルコ	8.5 TURKEY GOVT 220914	国債証券	—	500,000.00	5,834.88 5,762.4003	29,174,439 28,812,001	8.500000 2022/09/14	1.01
ポーランド	5.25 POLAND 171025	国債証券	—	900,000.00	3,159.19 3,128.7262	28,432,755 28,158,536	5.250000 2017/10/25	0.99
マレーシア	4.262MALAYSIAGOV 160915	国債証券	—	900,000.00	3,102.31 3,103.4819	27,920,835 27,931,337	4.262000 2016/09/15	0.98
トルコ	9 TURKEY GOVT 160127	国債証券	—	500,000.00	5,536.46 5,567.9226	27,682,311 27,839,613	9.000000 2016/01/27	0.98
マレーシア	4.012 MALAYSIAGOV 170915	国債証券	—	900,000.00	3,087.50 3,087.2054	27,787,541 27,784,848	4.012000 2017/09/15	0.98
南アフリカ	13.5 SOUTH AFRICA 150915	国債証券	—	2,200,000.00	1,253.31 1,249.9391	27,572,900 27,498,660	13.500000 2015/09/15	0.97
コロンビア	7.75 COLOMBI (GL) 210414	国債証券	—	420,000,000.00	6.43 6.4795	27,015,953 27,214,110	7.750000 2021/04/14	0.96
インドネシア	8.25 INDONESIA 320615	国債証券	—	2,300,000,000.00	1.15 1.1644	26,516,534 26,781,715	8.250000 2032/06/15	0.94
ポーランド	5.75 POLAND 220923	国債証券	—	800,000.00	3,366.23 3,337.8637	26,929,890 26,702,910	5.750000 2022/09/23	0.94
トルコ	8 TURKEY GOVT 140604	国債証券	—	500,000.00	5,285.86 5,297.0852	26,429,302 26,485,426	8.000000 2014/06/04	0.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
国債証券	91.54
特殊債券	4.01
合 計	95.55

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「東証 R E I T 指数マザーファンド」

（１）投資状況

平成25年2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	日本	3,386,378,950	98.90
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	37,603,699	1.10
純資産総額		3,423,982,649	100.00

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

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘 柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評 価 額		利率 (%)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
日本	日本ビルファンド投資法人	投資証券	—	424	927,050.72 1,037,000	393,069,505 439,688,000	—	12.84
日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	—	364	904,698.56 1,017,000	329,310,275 370,188,000	—	10.81
日本	日本リテールファンド投資法人	投資証券	—	1,275	166,507.12 181,200	212,296,578 231,030,000	—	6.75
日本	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	—	1,290	106,268.32 121,800	137,086,132 157,122,000	—	4.59
日本	アドバンス・レジデンス投資法人	投資証券	—	757	182,978.77 196,900	138,514,928 149,053,300	—	4.35
日本	日本プライムリアルティ投資法人	投資証券	—	506	255,115.35 272,900	129,088,367 138,087,400	—	4.03
日本	森トラスト総合リート投資法人	投資証券	—	148	759,639.06 887,000	112,426,580 131,276,000	—	3.83

日本	フロンティア不動産投資法人	投資証券	—	139	808,334.33 892,000	112,358,471 123,988,000	—	3.62
日本	野村不動産オフィスファンド投資法人	投資証券	—	187	525,691.79 569,000	98,304,364 106,403,000	—	3.11
日本	大和証券オフィス投資法人	投資証券	—	243	332,591.77 393,500	80,819,800 95,620,500	—	2.79
日本	G L P 投資法人	投資証券	—	1,127	78,596.03 84,600	88,577,725 95,344,200	—	2.78
日本	オリックス不動産投資法人	投資証券	—	867	99,358.65 109,100	86,143,958 94,589,700	—	2.76
日本	アクティビア・プロパティーズ投資法人	投資証券	—	126	622,965.73 704,000	78,493,683 88,704,000	—	2.59
日本	日本アコモデーションファンド投資法人	投資証券	—	124	671,646.85 680,000	83,284,210 84,320,000	—	2.46
日本	日本ロジスティクスファンド投資法人	投資証券	—	91	795,748.07 881,000	72,413,075 80,171,000	—	2.34
日本	産業ファンド投資法人	投資証券	—	96	729,679.35 832,000	70,049,218 79,872,000	—	2.33
日本	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	投資証券	—	197	360,982.39 389,500	71,113,531 76,731,500	—	2.24
日本	ジャパンエクセレント投資法人	投資証券	—	136	502,440.57 561,000	68,331,918 76,296,000	—	2.23
日本	森ヒルズリート投資法人	投資証券	—	142	481,725.80 530,000	68,405,065 75,260,000	—	2.20
日本	ケネディクス不動産投資法人	投資証券	—	176	339,092.90 382,000	59,680,351 67,232,000	—	1.96
日本	日本賃貸住宅投資法人	投資証券	—	816	67,443.97 77,000	55,034,279 62,832,000	—	1.84
日本	福岡リート投資法人	投資証券	—	75	687,510.63 768,000	51,563,297 57,600,000	—	1.68
日本	東急リアル・エステート投資法人	投資証券	—	104	486,783.49 522,000	50,625,483 54,288,000	—	1.59
日本	プレミア投資法人	投資証券	—	121	368,529.65 416,000	44,592,088 50,336,000	—	1.47
日本	大和ハウスリート投資法人	投資証券	—	75	591,341.12 670,000	44,350,584 50,250,000	—	1.47
日本	野村不動産レジデンシャル投資法人	投資証券	—	93	494,065.89 502,000	45,948,128 46,686,000	—	1.36
日本	トップリート投資法人	投資証券	—	95	402,942.86 433,500	38,279,572 41,182,500	—	1.20
日本	ジャパン・ホテル・リート投資法人	投資証券	—	1,295	27,904.50 31,150	36,136,327 40,339,250	—	1.18
日本	積水ハウス・S I 投資法人	投資証券	—	84	425,111.33 472,000	35,709,352 39,648,000	—	1.16
日本	グローバル・ワン不動産投資法人	投資証券	—	59	554,177.00 632,000	32,696,443 37,288,000	—	1.09

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資証券	98.90
合 計	98.90

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

< 参考 >

「MUAM G - REITマザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年2月28日現在

(単位：円)

資産の種類	国 / 地域名	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	3,539,820,933	65.02
	オーストラリア	633,621,511	11.64
	イギリス	289,246,271	5.31
	フランス	266,745,260	4.90
	シンガポール	211,238,481	3.88
	カナダ	175,149,758	3.22
	香港	123,407,976	2.27
	オランダ	61,957,115	1.14
	ベルギー	30,582,688	0.56
	ニュージーランド	16,709,194	0.31
	ドイツ	9,260,484	0.17
	イタリア	4,482,358	0.08
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	82,280,536	1.50
純資産総額		5,444,502,565	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位 30 銘柄

平成25年2月28日現在

国 / 地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率 (%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価 (円)	金額 (円)		
アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	—	24,713	14,685.74 14,727.59	362,928,718 363,962,981	— —	6.68
オーストラリア	WESTFIELD GROUP	投資証券	—	165,600	1,001.39 1,056.74	165,831,419 174,996,210	— —	3.21
アメリカ	PUBLIC STORAGE	投資証券	—	11,544	13,563.07 14,046.71	156,572,120 162,155,317	— —	2.98
アメリカ	HCP INC	投資証券	—	35,900	4,240.85 4,510.78	152,246,757 161,937,274	— —	2.97
フランス	UNIBAIL-RODAMCO SE	投資証券	—	7,310	22,549.05 21,167.10	164,833,595 154,731,501	— —	2.84
アメリカ	VENTAS INC	投資証券	—	23,676	6,027.35 6,503.45	142,703,616 153,975,753	— —	2.83
アメリカ	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	—	25,780	5,300.16 5,179.63	136,638,333 133,530,987	— —	2.45
アメリカ	PROLOGIS INC	投資証券	—	36,913	3,499.20 3,575.51	129,166,088 131,982,855	— —	2.42
アメリカ	HEALTH CARE REIT INC	投資証券	—	20,800	5,718.15 5,921.56	118,937,520 123,168,554	— —	2.26
アメリカ	BOSTON PROPERTIES INC	投資証券	—	12,090	9,943.85 9,611.78	120,221,241 116,206,529	— —	2.13
アメリカ	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	—	9,167	12,587.55 11,650.70	115,390,143 106,802,053	— —	1.96
アメリカ	VORNADO REALTY TRUST	投資証券	—	13,598	7,624.04 7,648.72	103,671,809 104,007,387	— —	1.91
香港	LINK REIT	投資証券	—	182,000	469.58 491.51	85,463,925 89,455,912	— —	1.64
アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	投資証券	—	57,432	1,544.24 1,544.91	88,689,273 88,727,673	— —	1.63
イギリス	LAND SECURITIES GROUP PLC	投資証券	—	62,690	1,163.76 1,144.71	72,956,689 71,762,330	— —	1.32
オーストラリア	WESTFIELD RETAIL TRUST	投資証券	—	224,300	287.42 302.60	64,470,051 67,873,942	— —	1.25
アメリカ	KIMCO REALTY CORP	投資証券	—	32,290	1,837.26 2,013.01	59,325,245 65,000,338	— —	1.19
アメリカ	GENERAL GROWTH PROPERTIES	投資証券	—	35,948	1,784.58 1,787.29	64,152,101 64,249,615	— —	1.18
オーストラリア	STOCKLAND	投資証券	—	175,800	335.37 350.98	58,958,827 61,702,635	— —	1.13
アメリカ	MACERICH CO/THE	投資証券	—	10,806	5,464.05 5,579.27	59,044,536 60,289,679	— —	1.11

アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	—	9,770	6,357.66 6,117.68	62,114,382 59,769,795	— —	1.10
アメリカ	REALTY INCOME CORP	投資証券	—	14,170	3,900.44 4,198.10	55,269,264 59,487,130	— —	1.09
イギリス	BRITISH LAND CO PLC	投資証券	—	70,315	810.06 786.07	56,960,005 55,272,652	— —	1.02
アメリカ	SL GREEN REALTY CORP	投資証券	—	7,220	7,275.93 7,521.98	52,532,255 54,308,754	— —	1.00
オーストラリア	GOODMAN GROUP	投資証券	—	120,856	415.20 441.09	50,179,884 53,309,460	— —	0.98
アメリカ	FEDERAL REALTY INVS TRUST	投資証券	—	5,207	9,740.52 9,902.27	50,718,928 51,561,121	— —	0.95
オーストラリア	GPT GROUP	投資証券	—	131,300	348.38 368.05	45,742,317 48,325,857	— —	0.89
アメリカ	UDR INC	投資証券	—	20,046	2,222.90 2,244.29	44,560,319 44,989,089	— —	0.83
アメリカ	CAMDEN PROPERTY TRUST	投資証券	—	6,790	6,387.38 6,503.45	43,370,329 44,158,445	— —	0.81
オーストラリア	MIRVAC GROUP	投資証券	—	275,770	140.52 153.19	38,753,170 42,247,660	— —	0.78

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年2月28日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
投資証券	98.49
合 計	98.49

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

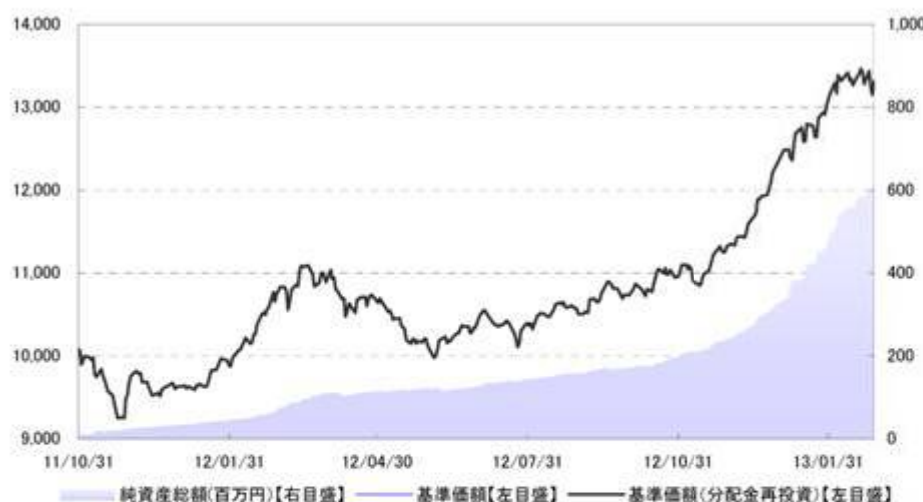
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2013年2月28日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したものと計算

2 分配の推移

2013 年 1月	0円
2012 年 1月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

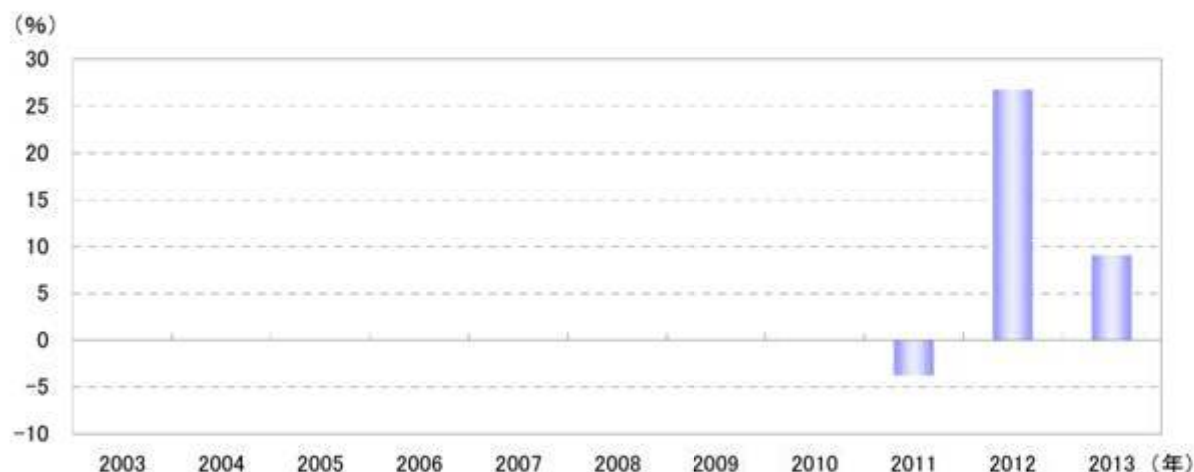
3 主要な資産の状況(2013年2月28日現在)

資産別構成	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄	種類	業種／種別	国・地域	比率
国内株式	10.2%	円	30.1%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
国内債券	2.4%	アメリカドル	29.1%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.4%
国内リート	12.6%	ユーロ	9.4%	EXXON MOBIL CORP	株式	エネルギー	アメリカ	0.4%
外国株式	31.4%	イギリスポンド	4.2%	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	銀行業	日本	0.3%
外国債券	24.1%	オーストラリアドル	2.8%	7.85 RUSSIA (GL) 180310	債券	国債	ロシア	0.6%
外国リート	12.9%	カナダドル	2.1%	12 COLOMBIA (GL) 151022	債券	国債	コロンビア	0.3%
		ブラジルレアル	2.1%	7.5 INTL BK(GL) 170302	債券	特殊債	ロシア	0.3%
		香港ドル	1.8%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	1.6%
コールローン他 (負債控除後)	6.4%	その他	18.4%	ジャパンリアルエステイト投資法人	リート	-	日本	1.4%
合計	100.0%	合計	100.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	リート	-	アメリカ	0.9%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	0.6%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2011年は設定日から年末までの、2013年は2月28日までの収益率を表示
- ・ファンドにベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。 ただし、以下の日は申込みができません。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日 オーストラリア証券取引所の休業日 シドニーの銀行の休業日 その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱ＵＦＪ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/ eMAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/e/
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります。この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後３時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。 ただし、以下の日は解約の請求ができません。 ニューヨーク証券取引所の休業日 ニューヨークの銀行の休業日 ロンドン証券取引所の休業日 ロンドンの銀行の休業日 香港取引所の休業日 香港の銀行の休業日 オーストラリア証券取引所の休業日 シドニーの銀行の休業日 その他ニューヨークまたはロンドンにおける債券市場の取引停止日
解約単位	販売会社が定める単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.15%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱ＵＦＪ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。
解約請求受付時間	原則、午後3時までに受け付けた解約請求（当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。 詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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解約請求を受け付けたものとします。 委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。 受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額の算出方法	基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数 なお、当ファンドでは１万口当たりの価額で表示されます。 （注）「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。 （主な評価方法） マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。 株式および不動産投資信託証券：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、外国金融商品市場における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。 公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。 外貨建資産：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り円換算します。 外国為替予約取引：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り評価します。
基準価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の照会方法	基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱ＵＦＪ投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 （受付時間：毎営業日の9:00～17:00） ホームページアドレス http://www.am.mufig.jp/ eMAXIS専用サイト http://maxis.muam.jp/e/

（２）【保管】

受益証券の保管	該当事項はありません。
---------	-------------

（３）【信託期間】

信託期間	平成23年10月31日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	---

（４）【計算期間】

計算期間	原則として、毎年１月27日から翌年１月26日まで 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この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ファンドの信託期間終了日とします。
------	--

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更等	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還、信託約款の変更のうち重大な内容の変更または併合について、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。 併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。
反対者の買取請求権	委託会社がファンドの任意償還、信託約款について重大な内容の変更または併合を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、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。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
運用報告書の作成	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、運用経過、信託財産の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を運用報告書に記載します。
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、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。

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。 ただし、平成25年6月21日以降は、以下の通り変更される予定です。 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。
----	---

4【受益者の権利等】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。 「分配金受取りコース（一般コース）」 ・収益分配金は、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。 ・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 「分配金再投資コース（累積投資コース）」 ・収益分配金は、課税後、原則として毎計算期間の終了日（決算日）の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。 ・償還金は、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金（解約）請求権	受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。 ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 （「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）

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）ならびに同規則第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2期計算期間（平成24年1月27日から平成25年1月28日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

e M A X I S バランス（波乗り型）

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第 1 期 [平成24年1月26日現在]	第 2 期 [平成25年1月28日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	961,432	21,018,726
親投資信託受益証券	40,463,541	433,152,751
未収入金	1,010,385	5,792,530
未収利息	2	55
流動資産合計	42,435,360	459,964,062
資産合計	42,435,360	459,964,062
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,818	5,874,147
未払受託者報酬	4,017	71,818
未払委託者報酬	29,441	526,582
その他未払費用	215	4,251
流動負債合計	43,491	6,476,798
負債合計	43,491	6,476,798
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 42,525,875	¹ 350,553,615
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 134,006	² 102,933,649
（分配準備積立金）	1,079,999	52,957,475
元本等合計	42,391,869	453,487,264
純資産合計	42,391,869	453,487,264
負債純資産合計	42,435,360	459,964,062

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日	第 2 期 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日
営業収益		
受取利息	177	5,070
有価証券売買等損益	923,212	60,618,409
営業収益合計	923,389	60,623,479
営業費用		
受託者報酬	4,017	103,829
委託者報酬	29,441	761,202
その他費用	215	6,109
営業費用合計	33,673	871,140
営業利益	889,716	59,752,339
経常利益	889,716	59,752,339
当期純利益	889,716	59,752,339
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	190,283	7,351,502
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	134,006
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,515	58,669,841
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	98,515	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	58,669,841
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,312,520	8,003,023
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,003,023
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,312,520	-
分配金	-	-
1	1	1
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	134,006	102,933,649

(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	(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年1月26日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年1月27日から平成25年1月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 1 期 [平成24年1月26日現在]	第 2 期 [平成25年1月28日現在]
1 期首元本額	10,000,000円	42,525,875円
期中追加設定元本額	41,206,550円	422,324,976円
期中一部解約元本額	8,680,675円	114,297,236円
2 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	134,006円	—
3 受益権の総数	42,525,875口	350,553,615口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9968円 (9,968円)	1.2936円 (12,936円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 1 期 (自 平成23年10月31日 至 平成24年1月26日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	237,623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	842,376円
収益調整金額	C	90,655円
分配準備積立金額	D	—
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,170,654円
当ファンドの期末残存口数	F	42,525,875口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	275円
1万口当たり分配金額	H	—
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—

第 2 期 (自 平成24年1月27日 至 平成25年1月28日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	5,350,675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	47,050,162円
収益調整金額	C	49,976,174円
分配準備積立金額	D	556,638円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	102,933,649円
当ファンドの期末残存口数	F	350,553,615口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,936円
1万口当たり分配金額	H	—
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—

1 金融商品の状況に関する事項

2 金融商品の時価等に関する事項

58/227

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 1 期 [平成24年1月26日現在]	第 2 期 [平成25年1月28日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,205,703	49,736,410
合計	1,205,703	49,736,410

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

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】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	MUAM G - REITマザーファンド	59,965,288	57,200,888	
	新興国株式インデックスマザーファンド	62,298,418	111,426,950	
	東証REIT指数マザーファンド	37,534,607	57,000,054	
	新興国債券インデックスマザーファンド	44,587,378	56,964,834	
	TOPIXマザーファンド	66,283,503	57,434,655	
	外国株式インデックスマザーファンド	19,270,810	25,127,209	
	日本債券インデックスマザーファンド	9,240,111	11,065,956	
	外国債券インデックスマザーファンド	35,732,257	56,932,205	
	親投資信託受益証券 小計	334,912,372	433,152,751	
	合計	334,912,372	433,152,751	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

< 参考 >

当ファンドは「TOPIXマザーファンド」、「外国株式インデックスマザーファンド」、「新興国株式インデックスマザーファンド」、「日本債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」、「新興国債券インデックスマザーファンド」、「東証REIT指数マザーファンド」および「MUAM G - REITマザーファンド」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た「親投資信託受益証券」は、これら親投資信託の受益証券です。

なお、これら親投資信託の状況は次の通りです。

[次へ](#)

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(１) 貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	56,054,808,334	20,436,202,246
株式 2,3	174,976,069,945	200,732,168,432
派生商品評価勘定	100,600,480	25,013,280
未収入金	4,423,760	46,215,760
未収配当金	184,705,075	210,097,190
未収利息	129,325	53,654
その他未収収益	10,296,722	19,625,549
流動資産合計	231,331,033,641	221,469,376,111
資産合計	231,331,033,641	221,469,376,111
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	10,840
前受金	112,428,000	75,685,000
未払解約金	149,626,054	517,224,369
未払利息	1,826,807	792,790
受入担保金	53,913,391,035	18,737,599,613
流動負債合計	54,177,271,896	19,331,312,612
負債合計	54,177,271,896	19,331,312,612
純資産の部		
元本等		
元本 1	250,369,277,064	233,272,112,521
剰余金		
剰余金又は欠損金 () 4	73,215,515,319	31,134,049,022
元本等合計	177,153,761,745	202,138,063,499
純資産合計	177,153,761,745	202,138,063,499
負債純資産合計	231,331,033,641	221,469,376,111

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月26日から翌年3月25日までであります。

(２) 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	株式は移動平均法、株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	246,720,849,285円	250,369,277,064円
期首からの追加設定元本額	8,191,064,460円	41,201,565,944円
期首からの一部解約元本額	4,542,636,681円	58,298,730,487円
元本の内訳＊		
ファンド・マネジャー（国内株式）	435,824,979円	290,534,464円
eMAXIS TOPIXインデックス	2,902,613,349円	4,684,621,137円
eMAXIS バランス（８資産均等型）	19,693,488円	126,282,524円
eMAXIS バランス（波乗り型）	2,573,548円	66,283,503円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,673,018,536円	53,411,208,015円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,587,141,668円	27,442,639,044円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,519,967,344円	1,277,272,837円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	9,986,560,139円	8,727,335,277円
MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,678,815,101円	9,114,955,757円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	34,572,195,094円	29,483,397,510円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	10,667,811,360円	9,388,107,125円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,531,100,705円	2,169,292,183円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	990,597,865円	901,824,343円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	838,138,300円	715,818,955円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,435,616,315円	1,224,442,537円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,048,741,057円	2,619,024,241円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,447,152円	11,715,500円
MUAMトピックスリスクコントロール（５％）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	—	108,703,906円
MUAMトピックスリスクコントロール（１０％）インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）	—	321,971,786円
三菱ＵＦＪ TOPIX・ファンド	18,432,287,060円	16,945,164,151円
三菱ＵＦＪ TOPIX・ライト	1,285,419,433円	1,063,937,277円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	194,359,744円	130,995,247円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	491,679,633円	394,106,157円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	617,401,777円	518,673,614円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	724,373,200円	562,971,389円
三菱ＵＦＪ TOPIX・ファンドＶＡ１	8,265,083,050円	7,326,851,162円
三菱ＵＦＪ TOPIX・ファンドＶＡ	5,407,552,820円	4,604,984,875円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	912,492,841円	768,383,713円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	6,831,276,815円	6,098,604,251円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	867,922,444円	755,674,757円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	3,931,964,742円	3,627,793,191円
三菱ＵＦＪ <DC>TOPIX・ファンド	2,084,782,863円	2,081,410,174円
三菱ＵＦＪ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	966,308,766円	866,871,856円
三菱ＵＦＪ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	3,406,228,932円	3,220,484,347円
三菱ＵＦＪ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	2,234,372,652円	2,214,154,324円
三菱ＵＦＪ <DC>インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	1,429,112,305円	1,450,293,345円
三菱ＵＦＪ DC国内株式インデックスファンド	25,384,801,987円	28,555,328,047円
（合 計）	250,369,277,064円	233,272,112,521円
2 貸付有価証券		
株券貸借取引契約により、以下の通り有価証券の貸付を行っております。		
株式	51,861,897,530円	18,167,350,930円

3 差入委託証拠金代用有価証券 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入れを行っております。 株式	976,750,000円	1,368,820,000円
4 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	73,215,515,319円	31,134,049,022円
5 受益権の総数	250,369,277,064口	233,272,112,521口
6 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7076円 (7,076円)	0.8665円 (8,665円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式を実質的な主要投資対象としております。株式の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	18,932,895,684	16,243,385,119
合計	18,932,895,684	16,243,385,119

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

区 分	種 類	[平成24年1月26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	2,023,086,000	—	2,123,920,000	100,834,000
	合 計	2,023,086,000	—	2,123,920,000	100,834,000

区 分	種 類	[平成25年1月28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	1,198,305,000	—	1,223,420,000	25,115,000
	合 計	1,198,305,000	—	1,223,420,000	25,115,000

(注) 時価の算定方法

1 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(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。

[次へ](#)

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

（単位：円）

コード	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄 名		単 価	金 額	
1301	極洋	76,000	202	15,352,000	
1332	日本水産	192,200	182	34,980,400	
1334	マルハニチロホールディングス	343,000	153	52,479,000	
1377	サカタのタネ	26,400	1,090	28,776,000	
1379	ホクト	18,200	1,690	30,758,000	
1514	住石ホールディングス	52,700	98	5,164,600	
1515	日鉄鉱業	45,000	398	17,910,000	
1518	三井松島産業	117,000	230	26,910,000	
1605	国際石油開発帝石	2,172	495,500	1,076,226,000	
1606	日本海洋掘削	4,400	2,851	12,544,400	
1661	関東天然瓦斯開発	18,000	502	9,036,000	
1662	石油資源開発	25,500	3,235	82,492,500	
1414	ショーボンドホールディングス	15,900	3,235	51,436,500	
1417	ミライト・ホールディングス	50,700	778	39,444,600	
1712	ダイセキ環境ソリューション	15	131,800	1,977,000	
1719	間組	60,500	237	14,338,500	
1720	東急建設	63,440	222	14,083,680	
1721	コムシスホールディングス	86,700	1,090	94,503,000	
1722	ミサワホーム	21,100	1,264	26,670,400	
1762	高松コンストラクショングループ	13,500	1,354	18,279,000	
1766	東建コーポレーション	6,670	5,050	33,683,500	
1780	ヤマウラ	8,500	292	2,482,000	
1801	大成建設	903,000	267	241,101,000	
1802	大林組	536,000	460	246,560,000	
1803	清水建設	547,000	303	165,741,000	
1805	飛島建設	110,400	103	11,371,200	
1808	長谷工コーポレーション	1,117,000	83	92,711,000	
1810	松井建設	20,000	352	7,040,000	
1812	鹿島建設	785,000	271	212,735,000	
1813	不動テトラ	126,200	182	22,968,400	
1814	大末建設	68,000	70	4,760,000	
1815	鉄建建設	109,000	123	13,407,000	
1816	安藤建設	59,000	125	7,375,000	
1819	太平工業	31,000	362	11,222,000	
1820	西松建設	220,000	171	37,620,000	
1821	三井住友建設	249,000	90	22,410,000	
1822	大豊建設	50,000	124	6,200,000	
1824	前田建設工業	110,000	404	44,440,000	
1826	佐田建設	61,000	82	5,002,000	
1827	ナカノフドー建設	13,500	261	3,523,500	
1833	奥村組	158,000	364	57,512,000	
1834	大和小田急建設	8,500	218	1,853,000	
1835	東鉄工業	23,200	1,207	28,002,400	
1847	イチケン	18,000	179	3,222,000	
1852	浅沼組	54,000	75	4,050,000	
1860	戸田建設	208,000	246	51,168,000	
1861	熊谷組	129,000	112	14,448,000	
1865	青木あすなろ建設	9,500	542	5,149,000	
1866	北野建設	41,000	233	9,553,000	
1867	植木組	22,000	193	4,246,000	
1868	三井ホーム	23,000	527	12,121,000	
1870	矢作建設工業	22,200	450	9,990,000	
1871	ピーエス三菱	11,300	550	6,215,000	
1878	大東建託	67,900	8,690	590,051,000	
1879	新日本建設	21,400	248	5,307,200	
1881	N I P P O	41,000	1,213	49,733,000	
1882	東亜道路工業	34,000	304	10,336,000	
1883	前田道路	51,000	1,326	67,626,000	
1884	日本道路	53,000	397	21,041,000	
1885	東亜建設工業	156,000	138	21,528,000	
1888	若築建設	96,000	102	9,792,000	
1890	東洋建設	55,500	301	16,705,500	

1893	五洋建設	212,500	228	48,450,000	
1896	大林道路	21,000	333	6,993,000	
1898	世紀東急工業	65,000	88	5,720,000	
1899	福田組	27,000	386	10,422,000	
1911	住友林業	123,000	890	109,470,000	
1914	日本基礎技術	21,500	314	6,751,000	
1916	日成ビルド工業	53,000	183	9,699,000	
1919	エス・パイ・エル	91,000	168	15,288,000	
1921	巴コーポレーション	24,300	366	8,893,800	
1924	パナホーム	67,000	601	40,267,000	
1925	大和ハウス工業	446,000	1,662	741,252,000	
1926	ライト工業	40,100	437	17,523,700	
1928	積水ハウス	536,000	1,014	543,504,000	
1929	日特建設	15,300	370	5,661,000	
1930	北陸電気工事	9,000	281	2,529,000	
1934	ユアテック	28,000	306	8,568,000	
1937	西部電気工業	15,000	395	5,925,000	
1939	四電工	15,000	322	4,830,000	
1941	中電工	25,800	831	21,439,800	
1942	関電工	81,000	409	33,129,000	
1944	きんでん	119,000	594	70,686,000	
1945	東京エネシス	18,000	468	8,424,000	
1946	トーエネック	25,000	483	12,075,000	
1949	住友電設	12,300	978	12,029,400	
1950	日本電設工業	32,000	899	28,768,000	
1951	協和エクシオ	64,200	944	60,604,800	
1952	新日本空調	12,500	525	6,562,500	
1956	N D S	27,000	269	7,263,000	
1959	九電工	29,000	466	13,514,000	
1961	三機工業	41,000	471	19,311,000	
1963	日揮	180,000	2,592	466,560,000	
1964	中外炉工業	57,000	225	12,825,000	
1967	ヤマト	16,000	310	4,960,000	
1968	太平電業	22,000	519	11,418,000	
1969	高砂熱学工業	51,000	699	35,649,000	
1972	三晃金属工業	20,000	239	4,780,000	
1975	朝日工業社	19,000	292	5,548,000	
1979	大気社	25,500	1,799	45,874,500	
1980	ダイダン	24,000	512	12,288,000	
1982	日比谷総合設備	21,900	1,013	22,184,700	
1983	東芝プラントシステム	29,000	1,287	37,323,000	
6330	東洋エンジニアリング	95,000	403	38,285,000	
6366	千代田化工建設	129,000	1,164	150,156,000	
6379	新興ブラントック	36,700	712	26,130,400	
2001	日本製粉	110,000	378	41,580,000	
2002	日清製粉グループ本社	162,000	1,110	179,820,000	
2003	日東富士製粉	14,000	309	4,326,000	
2004	昭和産業	73,000	294	21,462,000	
2009	鳥越製粉	14,200	621	8,818,200	
2052	協同飼料	62,000	105	6,510,000	
2053	中部飼料	15,800	518	8,184,400	
2056	日本配合飼料	49,000	117	5,733,000	
2107	東洋精糖	27,000	100	2,700,000	
2108	日本甜菜製糖	91,000	171	15,561,000	
2109	三井製糖	70,000	270	18,900,000	
2201	森永製菓	174,000	191	33,234,000	
2204	中村屋	41,000	415	17,015,000	
2206	江崎グリコ	65,000	901	58,565,000	
2207	名糖産業	7,900	976	7,710,400	
2211	不二家	102,000	198	20,196,000	
2212	山崎製パン	131,000	1,004	131,524,000	
2215	第一屋製パン	24,000	86	2,064,000	
2217	モロゾフ	27,000	316	8,532,000	
2220	亀田製菓	9,900	1,986	19,661,400	
2229	カルビー	16,200	7,240	117,288,000	
2264	森永乳業	151,000	285	43,035,000	
2267	ヤクルト本社	104,500	3,690	385,605,000	
2269	明治ホールディングス	52,900	3,970	210,013,000	
2270	雪印メグミルク	35,000	1,498	52,430,000	

2281	ブリマハム	100,000	176	17,600,000	
2282	日本ハム	136,000	1,252	170,272,000	
2284	伊藤ハム	98,000	421	41,258,000	
2286	林兼産業	57,000	83	4,731,000	
2288	丸大食品	85,000	301	25,585,000	
2290	米久	15,700	947	14,867,900	
2292	S F o o d s	11,000	887	9,757,000	
2501	サッポロホールディングス	293,000	293	85,849,000	
2502	アサヒグループホールディングス	359,200	1,913	687,149,600	
2503	麒麟ホールディングス	765,000	1,105	845,325,000	
2531	宝ホールディングス	140,000	775	108,500,000	
2533	オエノンホールディングス	45,000	206	9,270,000	
2540	養命酒製造	13,000	797	10,361,000	
2572	三国コカ・コーラボトリング	18,600	926	17,223,600	
2579	コカ・コーラウエスト	60,500	1,395	84,397,500	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	22,300	1,210	26,983,000	
2590	ダイドードリンコ	9,000	3,590	32,310,000	
2593	伊藤園	48,600	1,722	83,689,200	
2594	キーコーヒー	15,600	1,588	24,772,800	
2597	ユニカフェ	4,800	479	2,299,200	
2599	ジャパンフーズ	2,300	995	2,288,500	
2602	日清オイリオグループ	77,000	330	25,410,000	
2607	不二製油	43,400	1,256	54,510,400	
2613	J - オイルミルズ	75,000	261	19,575,000	
2801	キッコーマン	146,000	1,371	200,166,000	
2802	味の素	471,000	1,237	582,627,000	
2809	キューピー	90,900	1,184	107,625,600	
2810	ハウス食品	62,900	1,361	85,606,900	
2811	カゴメ	64,100	1,707	109,418,700	
2812	焼津水産化学工業	8,400	795	6,678,000	
2815	アリアケジャパン	16,200	1,658	26,859,600	
2871	ニチレイ	200,000	442	88,400,000	
2875	東洋水産	82,000	2,522	206,804,000	
2897	日清食品ホールディングス	69,800	3,355	234,179,000	
2899	永谷園	17,000	886	15,062,000	
2908	フジッコ	19,000	1,044	19,836,000	
2910	ロック・フィールド	9,300	1,505	13,996,500	
2914	日本たばこ産業	792,400	2,757	2,184,646,800	
2915	ケンコーマヨネーズ	5,300	897	4,754,100	
2918	わらべや日洋	10,700	1,492	15,964,400	
2922	なとり	8,200	873	7,158,600	
4404	ミヨシ油脂	56,000	217	12,152,000	
3001	片倉工業	20,900	908	18,977,200	
3002	グンゼ	125,000	241	30,125,000	
3101	東洋紡	706,000	145	102,370,000	
3103	ユニチカ	458,000	51	23,358,000	
3104	富士紡ホールディングス	80,000	297	23,760,000	
3105	日清紡ホールディングス	106,000	687	72,822,000	
3106	倉敷紡績	171,000	153	26,163,000	
3109	シキボウ	102,000	114	11,628,000	
3201	日本毛織	53,000	600	31,800,000	
3202	大東紡織	25,000	75	1,875,000	
3204	トーア紡コーポレーション	75,000	69	5,175,000	
3205	ダイドーリミテッド	18,700	615	11,500,500	
3302	帝国繊維	17,000	655	11,135,000	
3401	帝人	634,000	206	130,604,000	
3402	東レ	1,293,000	525	678,825,000	
3408	サカイオーベックス	44,000	135	5,940,000	
3501	住江織物	42,000	208	8,736,000	
3512	日本フェルト	9,300	422	3,924,600	
3513	イチカワ	11,000	170	1,870,000	
3514	日本バイリーン	21,000	396	8,316,000	
3524	日東製網	19,000	136	2,584,000	
3526	芦森工業	39,000	132	5,148,000	
3529	アツギ	140,000	116	16,240,000	
3551	ダイニツク	32,000	180	5,760,000	
3569	セーレン	44,800	567	25,401,600	
3577	東海染工	23,000	103	2,369,000	
3580	小松精練	28,000	389	10,892,000	

3591	ワコールホールディングス	99,000	943	93,357,000	
3593	ホギメディカル	10,500	4,335	45,517,500	
3606	レナウン	36,300	141	5,118,300	
3607	クラウドディア	1,700	1,155	1,963,500	
3608	ＴＳＩホールディングス	86,000	459	39,474,000	
8011	三陽商会	88,000	250	22,000,000	
8013	ナイガイ	62,000	68	4,216,000	
8016	オンワードホールディングス	111,000	676	75,036,000	
8029	ルック	28,000	372	10,416,000	
8111	ゴールドウイン	38,000	527	20,026,000	
8114	デサント	42,000	591	24,822,000	
8127	ヤマトインターナショナル	10,100	391	3,949,100	
3708	特種東海製紙	97,000	216	20,952,000	
3861	王子ホールディングス	738,000	275	202,950,000	
3864	三菱製紙	238,000	88	20,944,000	
3865	北越紀州製紙	103,500	444	45,954,000	
3877	中越パルプ工業	64,000	173	11,072,000	
3878	巴川製紙所	26,000	168	4,368,000	
3880	大王製紙	70,000	579	40,530,000	
3893	日本製紙グループ本社	80,600	1,206	97,203,600	
3941	レンゴー	134,000	441	59,094,000	
3946	トモク	53,000	270	14,310,000	
3950	ザ・バック	11,800	1,511	17,829,800	
3405	クラレ	284,400	1,150	327,060,000	
3407	旭化成	1,042,000	528	550,176,000	
3553	共和レザー	9,800	283	2,773,400	
4003	コープケミカル	25,000	113	2,825,000	
4004	昭和電工	1,038,000	135	140,130,000	
4005	住友化学	1,148,000	263	301,924,000	
4007	日本化成	31,000	152	4,712,000	
4008	住友精化	31,000	326	10,106,000	
4021	日産化学工業	118,600	1,082	128,325,200	
4022	ラサ工業	59,000	100	5,900,000	
4023	クレハ	117,000	336	39,312,000	
4027	テイカ	28,000	288	8,064,000	
4028	石原産業	300,000	74	22,200,000	
4031	片倉チッカリン	11,000	213	2,343,000	
4041	日本曹達	99,000	404	39,996,000	
4042	東ソー	447,000	214	95,658,000	
4043	トクヤマ	242,000	175	42,350,000	
4044	セントラル硝子	149,000	288	42,912,000	
4045	東亜合成	196,000	371	72,716,000	
4046	ダイソー	66,000	265	17,490,000	
4047	関東電化工業	40,000	164	6,560,000	
4061	電気化学工業	334,000	317	105,878,000	
4063	信越化学工業	299,600	5,480	1,641,808,000	
4064	日本カーバイド工業	49,000	478	23,422,000	
4078	堺化学工業	62,000	270	16,740,000	
4088	エア・ウォーター	138,000	1,120	154,560,000	
4091	大陽日酸	220,000	596	131,120,000	
4092	日本化学工業	62,000	136	8,432,000	
4095	日本パーカライジング	39,000	1,476	57,564,000	
4097	高圧ガス工業	25,000	513	12,825,000	
4098	チタン工業	19,000	232	4,408,000	
4099	四国化成工業	24,000	555	13,320,000	
4100	戸田工業	24,000	339	8,136,000	
4109	ステラ ケミファ	7,300	1,908	13,928,400	
4112	保土谷化学工業	37,000	172	6,364,000	
4114	日本触媒	121,000	899	108,779,000	
4116	大日精化工業	60,000	412	24,720,000	
4118	カネカ	208,000	486	101,088,000	
4182	三菱瓦斯化学	263,000	605	159,115,000	
4183	三井化学	709,000	211	149,599,000	
4185	ＪＳＲ	164,700	1,675	275,872,500	
4186	東京応化工業	32,300	1,722	55,620,600	
4187	大阪有機化学工業	11,100	387	4,295,700	
4188	三菱ケミカルホールディングス	1,044,500	414	432,423,000	
4201	日本合成化学工業	34,000	660	22,440,000	
4202	ダイセル	199,000	631	125,569,000	

4203	住友ベークライト	130,000	361	46,930,000	
4204	積水化学工業	343,000	881	302,183,000	
4205	日本ゼオン	144,000	772	111,168,000	
4206	アイカ工業	46,900	1,539	72,179,100	
4208	宇部興産	800,000	182	145,600,000	
4212	積水樹脂	23,000	1,082	24,886,000	
4215	タキロン	39,000	341	13,299,000	
4216	旭有機材工業	59,000	221	13,039,000	
4217	日立化成	72,200	1,266	91,405,200	
4218	ニチバン	16,000	279	4,464,000	
4220	リケンテクノス	27,000	256	6,912,000	
4221	大倉工業	40,000	310	12,400,000	
4228	積水化成成品工業	43,000	219	9,417,000	
4229	群栄化学工業	45,000	228	10,260,000	
4231	タイガースポリマー	8,300	311	2,581,300	
4238	ミライアル	4,100	1,883	7,720,300	
4271	日本カーリット	13,300	467	6,211,100	
4272	日本化薬	117,000	1,035	121,095,000	
4362	日本精化	13,800	577	7,962,600	
4401	A D E K A	71,900	769	55,291,100	
4403	日油	129,000	421	54,309,000	
4410	ハリマ化成グループ	14,300	471	6,735,300	
4452	花王	443,000	2,461	1,090,223,000	
4461	第一工業製薬	30,000	246	7,380,000	
4471	三洋化成工業	52,000	522	27,144,000	
4611	大日本塗料	96,000	148	14,208,000	
4612	日本ペイント	145,000	837	121,365,000	
4613	関西ペイント	189,000	998	188,622,000	
4614	トウペ	14,000	104	1,456,000	
4617	中国塗料	51,000	495	25,245,000	
4619	日本特殊塗料	12,900	394	5,082,600	
4620	藤倉化成	19,500	383	7,468,500	
4626	太陽ホールディングス	13,600	2,478	33,700,800	
4631	D I C	592,000	173	102,416,000	
4633	サカタインクス	34,000	473	16,082,000	
4634	東洋インキＳＣホールディングス	150,000	396	59,400,000	
4901	富士フイルムホールディングス	356,800	1,848	659,366,400	
4911	資生堂	297,100	1,236	367,215,600	
4912	ライオン	193,000	434	83,762,000	
4914	高砂香料工業	55,000	464	25,520,000	
4917	マンダム	17,900	2,531	45,304,900	
4919	ミルボン	8,200	2,950	24,190,000	
4921	ファンケル	42,000	985	41,370,000	
4922	コーセー	30,000	1,880	56,400,000	
4924	ドクターシーラボ	113	282,500	31,922,500	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	19,900	2,730	54,327,000	
4928	ノエビアホールディングス	9,700	1,378	13,366,600	
4951	エスター	10,300	958	9,867,400	
4956	コニシ	12,100	1,531	18,525,100	
4958	長谷川香料	21,100	1,123	23,695,300	
4963	星光ＰＭＣ	6,900	316	2,180,400	
4967	小林製薬	25,300	4,320	109,296,000	
4968	荒川化学工業	13,000	707	9,191,000	
4971	メック	12,000	314	3,768,000	
4973	日本高純度化学	44	210,000	9,240,000	
4975	J C U	2,400	3,335	8,004,000	
4985	アース製薬	12,000	2,910	34,920,000	
4989	イハラケミカル工業	28,000	482	13,496,000	
4992	北興化学工業	16,000	265	4,240,000	
4994	大成ラミック	4,700	2,453	11,529,100	
4996	クミアイ化学工業	34,000	511	17,374,000	
4997	日本農薬	38,000	526	19,988,000	
5142	アキレス	136,000	132	17,952,000	
5208	有沢製作所	26,100	331	8,639,100	
6988	日東電工	137,700	4,930	678,861,000	
7874	レック	5,200	1,035	5,382,000	
7908	きもと	14,900	654	9,744,600	
7917	藤森工業	12,900	2,203	28,418,700	
7925	前澤化成工業	11,700	892	10,436,400	

7942	ＪＳＰ	10,900	1,290	14,061,000	
7947	エフビコ	8,200	5,960	48,872,000	
7958	天馬	13,300	939	12,488,700	
7970	信越ポリマー	32,700	359	11,739,300	
7971	東リ	43,000	220	9,460,000	
7988	ニフコ	37,300	1,874	69,900,200	
7995	日本バルカー工業	69,000	236	16,284,000	
8113	ユニ・チャーム	92,200	4,765	439,333,000	
4151	協和発酵キリン	200,000	885	177,000,000	
4502	武田薬品工業	625,700	4,615	2,887,605,500	
4503	アステラス製薬	370,800	4,555	1,688,994,000	
4506	大日本住友製薬	118,200	1,381	163,234,200	
4507	塩野義製薬	243,400	1,641	399,419,400	
4508	田辺三菱製薬	139,000	1,207	167,773,000	
4512	わかもと製薬	19,000	243	4,617,000	
4514	あすか製薬	20,000	622	12,440,000	
4516	日本新薬	35,000	1,138	39,830,000	
4519	中外製薬	194,000	1,771	343,574,000	
4521	科研製薬	66,000	1,430	94,380,000	
4523	エーザイ	205,600	3,890	799,784,000	
4527	ロート製薬	70,000	1,151	80,570,000	
4528	小野薬品工業	81,700	4,775	390,117,500	
4530	久光製薬	51,800	4,905	254,079,000	
4531	有機合成薬品工業	12,000	253	3,036,000	
4534	持田製薬	63,000	1,174	73,962,000	
4536	参天製薬	57,100	3,910	223,261,000	
4538	扶桑薬品工業	56,000	367	20,552,000	
4539	日本ケミファ	23,000	568	13,064,000	
4540	ツムラ	45,600	2,957	134,839,200	
4541	日医工	24,200	1,861	45,036,200	
4547	キッセイ薬品工業	31,000	1,723	53,413,000	
4548	生化学工業	31,900	995	31,740,500	
4549	栄研化学	11,800	1,315	15,517,000	
4550	日水製薬	6,700	993	6,653,100	
4551	鳥居薬品	10,000	2,348	23,480,000	
4553	東和薬品	8,500	5,000	42,500,000	
4554	富士製薬工業	4,200	1,584	6,652,800	
4555	沢井製薬	11,000	9,340	102,740,000	
4559	ゼリア新薬工業	24,000	1,427	34,248,000	
4568	第一三共	526,700	1,500	790,050,000	
4569	キョーリン製薬ホールディングス	44,500	1,881	83,704,500	
4574	大幸薬品	7,800	935	7,293,000	
4577	ダイト	4,700	1,425	6,697,500	
4578	大塚ホールディングス	331,500	2,824	936,156,000	
4581	大正製薬ホールディングス	40,200	6,370	256,074,000	
3315	日本コークス工業	135,000	134	18,090,000	
5002	昭和シェル石油	149,300	501	74,799,300	
5007	コスモ石油	462,000	204	94,248,000	
5011	ニチレキ	20,000	517	10,340,000	
5012	東燃ゼネラル石油	252,000	757	190,764,000	
5013	ユシロ化学工業	9,000	889	8,001,000	
5015	ビービー・カストロール	6,900	378	2,608,200	
5017	ＡＯＣホールディングス	38,700	367	14,202,900	
5018	ＭＯＲＥＳＣＯ	3,200	803	2,569,600	
5019	出光興産	19,800	7,780	154,044,000	
5020	ＪＸホールディングス	1,853,700	515	954,655,500	
5101	横浜ゴム	187,000	671	125,477,000	
5105	東洋ゴム工業	139,000	289	40,171,000	
5108	ブリヂストン	523,500	2,373	1,242,265,500	
5110	住友ゴム工業	130,300	1,165	151,799,500	
5121	藤倉ゴム工業	9,300	270	2,511,000	
5122	オカモト	59,000	308	18,172,000	
5185	フコク	7,000	820	5,740,000	
5186	ニッタ	16,500	1,547	25,525,500	

（単位：円）

コード	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄 名		単 価	金 額	
5191	東海ゴム工業	30,900	909	28,088,100	
5192	三ツ星ベルト	42,000	491	20,622,000	
5195	バンドー化学	57,000	294	16,758,000	
3110	日東紡績	123,000	359	44,157,000	
5201	旭硝子	823,000	592	487,216,000	
5202	日本板硝子	761,000	101	76,861,000	
5204	石塚硝子	22,000	149	3,278,000	
5210	日本山村硝子	66,000	182	12,012,000	
5214	日本電気硝子	296,000	435	128,760,000	
5218	オハラ	6,300	663	4,176,900	
5232	住友大阪セメント	296,000	297	87,912,000	
5233	太平洋セメント	919,000	233	214,127,000	
5234	デイ・シイ	17,200	319	5,486,800	
5262	日本ヒューム	16,000	488	7,808,000	
5269	日本コンクリート工業	28,000	319	8,932,000	
5301	東海カーボン	145,000	345	50,025,000	
5302	日本カーボン	88,000	172	15,136,000	
5310	東洋炭素	8,200	2,039	16,719,800	
5331	ノリタケカンパニーリミテド	86,000	229	19,694,000	
5332	ＴＯＴＯ	258,000	712	183,696,000	
5333	日本碍子	217,000	1,035	224,595,000	
5334	日本特殊陶業	144,000	1,084	156,096,000	
5337	ダントーホールディングス	24,000	111	2,664,000	
5344	ＭＡＲＵＷＡ	3,700	2,623	9,705,100	
5351	品川リフラクトリーズ	42,000	202	8,484,000	
5352	黒崎播磨	36,000	226	8,136,000	
5363	東京窯業	20,000	165	3,300,000	
5367	ニッカトー	5,400	435	2,349,000	
5384	フジミインコーポレーテッド	15,200	1,513	22,997,600	
5391	エーアンドエーマテリアル	35,000	86	3,010,000	
5393	ニチアス	74,000	503	37,222,000	
7943	ニチハ	18,500	1,251	23,143,500	
5401	新日鐵住金	7,059,000	230	1,623,570,000	
5406	神戸製鋼所	2,314,000	103	238,342,000	
5408	中山製鋼所	85,000	64	5,440,000	
5410	合同製鐵	93,000	170	15,810,000	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	426,000	1,765	751,890,000	
5413	日新製鋼ホールディングス	70,700	649	45,884,300	
5423	東京製鐵	92,100	422	38,866,200	
5440	共英製鋼	15,600	1,590	24,804,000	
5444	大和工業	34,500	2,489	85,870,500	
5445	東京鐵鋼	32,000	352	11,264,000	
5449	大阪製鐵	8,400	1,563	13,129,200	
5451	淀川製鋼所	119,000	310	36,890,000	
5453	東洋鋼鈑	35,000	310	10,850,000	
5457	住友鋼管	11,300	706	7,977,800	
5463	丸一鋼管	55,900	1,952	109,116,800	
5464	モリ工業	25,000	263	6,575,000	
5471	大同特殊鋼	258,000	398	102,684,000	
5476	日本高周波鋼業	65,000	89	5,785,000	
5480	日本冶金工業	122,500	108	13,230,000	
5481	山陽特殊製鋼	83,000	273	22,659,000	
5482	愛知製鋼	89,000	384	34,176,000	
5486	日立金属	118,000	756	89,208,000	
5491	日本金属	43,000	125	5,375,000	
5541	大平洋金属	107,000	414	44,298,000	
5563	日本電工	66,000	246	16,236,000	
5602	栗本鐵工所	73,000	327	23,871,000	
5612	日本鑄鉄管	18,000	265	4,770,000	
5632	三菱製鋼	101,000	169	17,069,000	
5658	日亜鋼業	23,000	231	5,313,000	
5659	日本精線	11,000	327	3,597,000	
6319	シンニッタン	13,000	405	5,265,000	
7305	新家工業	36,000	128	4,608,000	
5702	大紀アルミニウム工業所	28,000	227	6,356,000	
5703	日本軽金属ホールディングス	350,900	99	34,739,100	

5706	三井金属鉱業	426,000	221	94,146,000	
5707	東邦亜鉛	94,000	381	35,814,000	
5711	三菱マテリアル	977,000	297	290,169,000	
5713	住友金属鉱山	432,000	1,362	588,384,000	
5714	ＤＯＷＡホールディングス	184,000	629	115,736,000	
5715	古河機械金属	280,000	93	26,040,000	
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	16,400	1,905	31,242,000	
5727	東邦チタニウム	28,200	805	22,701,000	
5738	住友軽金属工業	403,000	87	35,061,000	
5741	古河スカイ	56,000	255	14,280,000	
5801	古河電気工業	525,000	181	95,025,000	
5802	住友電気工業	589,800	998	588,620,400	
5803	フジクラ	268,000	255	68,340,000	
5805	昭和電線ホールディングス	214,000	84	17,976,000	
5807	東京特殊電線	24,000	95	2,280,000	
5809	タツタ電線	31,000	726	22,506,000	
5812	日立電線	130,000	143	18,590,000	
5815	沖電線	17,000	135	2,295,000	
5819	カナレ電気	2,300	1,298	2,985,400	
5821	平河ヒューテック	3,900	724	2,823,600	
5851	リョービ	93,000	221	20,553,000	
5857	アサヒホールディングス	25,100	1,526	38,302,600	
3421	稲葉製作所	7,100	1,101	7,817,100	
3431	宮地エンジニアリンググループ	55,000	170	9,350,000	
3433	トーカロ	9,400	1,392	13,084,800	
3434	アルファＣｏ	5,600	971	5,437,600	
3436	ＳＵＭＣＯ	102,100	883	90,154,300	
3443	川田テクノロジーズ	3,700	1,593	5,894,100	
5901	東洋製罐	118,600	1,141	135,322,600	
5902	ホッカンホールディングス	40,000	265	10,600,000	
5909	コロナ	7,600	1,200	9,120,000	
5911	横河ブリッジホールディングス	32,000	756	24,192,000	
5912	日本橋梁	12,200	394	4,806,800	
5915	駒井ハルテック	34,000	245	8,330,000	
5923	高田機工	13,000	203	2,639,000	
5929	三和ホールディングス	153,000	434	66,402,000	
5930	文化シャッター	43,000	438	18,834,000	
5932	三協立山	22,500	1,919	43,177,500	
5936	東洋シャッター	4,300	513	2,205,900	
5938	ＬＩＸＩＬグループ	232,500	2,100	488,250,000	
5942	日本フィルコン	12,100	373	4,513,300	
5943	ノーリツ	32,700	1,642	53,693,400	
5946	長府製作所	16,000	1,907	30,512,000	
5947	リンナイ	26,800	6,470	173,396,000	
5951	ダイニチ工業	8,500	989	8,406,500	
5957	日東精工	22,000	290	6,380,000	
5958	三洋工業	21,000	172	3,612,000	
5959	岡部	32,900	626	20,595,400	
5974	中国工業	25,000	91	2,275,000	
5975	東ブレ	32,100	849	27,252,900	
5976	高周波熱錬	22,100	610	13,481,000	
5981	東京製網	113,000	126	14,238,000	
5988	パイオラックス	7,100	2,192	15,563,200	
5991	日本発條	120,900	735	88,861,500	
5992	中央発條	21,000	306	6,426,000	
5998	アドバネクス	33,000	87	2,871,000	
8155	三益半導体工業	14,100	747	10,532,700	
1978	アタカ大機	11,000	354	3,894,000	
5631	日本製鋼所	258,000	519	133,902,000	
6005	三浦工業	24,800	2,360	58,528,000	
6013	タクマ	57,000	567	32,319,000	
6101	ツガミ	45,000	520	23,400,000	
6103	オークマ	109,000	657	71,613,000	
6104	東芝機械	83,000	425	35,275,000	
6113	アマダ	255,000	560	142,800,000	
6118	アイダエンジニアリング	39,200	701	27,479,200	
6135	牧野フライス製作所	77,000	563	43,351,000	
6136	オーエスジー	68,600	1,183	81,153,800	
6138	ダイジェット工業	19,000	157	2,983,000	

6140	旭ダイヤモンド工業	41,100	812	33,373,200	
6141	森精機製作所	88,000	831	73,128,000	
6146	ディスコ	18,500	5,120	94,720,000	
6151	日東工器	9,700	1,851	17,954,700	
6203	豊和工業	93,000	97	9,021,000	
6205	大阪機工	65,000	134	8,710,000	
6208	石川製作所	38,000	87	3,306,000	
6210	東洋機械金属	12,500	227	2,837,500	
6217	津田駒工業	40,000	191	7,640,000	
6218	エンシュウ	41,000	124	5,084,000	
6222	島精機製作所	21,800	1,571	34,247,800	
6247	日阪製作所	21,000	800	16,800,000	
6250	やまびこ	6,600	1,515	9,999,000	
6262	ベガスミシン製造	15,300	204	3,121,200	
6268	ナプテスコ	82,600	1,878	155,122,800	
6269	三井海洋開発	13,800	2,021	27,889,800	
6272	レオン自動機	15,000	205	3,075,000	
6273	S M C	49,800	15,420	767,916,000	
6274	新川	14,000	477	6,678,000	
6277	ホソカワミクロン	28,000	738	20,664,000	
6278	ユニオンツール	9,100	1,681	15,297,100	
6282	オイレス工業	17,400	1,789	31,128,600	
6287	サトーホールディングス	17,400	1,450	25,230,000	
6291	日本エアテック	4,900	440	2,156,000	
6293	日精樹脂工業	12,200	418	5,099,600	
6298	ワイエイシイ	6,100	498	3,037,800	
6301	小松製作所	779,000	2,355	1,834,545,000	
6302	住友重機械工業	457,000	411	187,827,000	
6305	日立建機	85,200	1,925	164,010,000	
6306	日工	23,000	381	8,763,000	
6309	巴工業	6,300	1,740	10,962,000	
6310	井関農機	159,000	245	38,955,000	
6315	T O W A	14,900	602	8,969,800	
6316	丸山製作所	37,000	187	6,919,000	
6317	北川鉄工所	72,000	153	11,016,000	
6326	クボタ	891,000	1,039	925,749,000	
6328	荏原実業	3,900	1,234	4,812,600	
6331	三菱化工機	51,000	158	8,058,000	
6332	月島機械	27,000	811	21,897,000	
6333	帝国電機製作所	5,100	1,740	8,874,000	
6335	東京機械製作所	58,000	65	3,770,000	
6339	新東工業	33,600	665	22,344,000	
6340	澁谷工業	10,500	874	9,177,000	
6345	アイチ コーポレーション	27,500	443	12,182,500	
6349	小森コーポレーション	40,600	846	34,347,600	
6351	鶴見製作所	12,000	734	8,808,000	
6355	住友精密工業	26,000	400	10,400,000	
6358	酒井重工業	32,000	292	9,344,000	
6361	荏原製作所	314,000	352	110,528,000	
6362	石井鐵工所	24,000	171	4,104,000	
6363	西島製作所	19,200	769	14,764,800	
6367	ダイキン工業	217,700	3,310	720,587,000	
6368	オルガノ	29,000	490	14,210,000	
6369	トーヨーカネツ	89,000	191	16,999,000	
6370	栗田工業	92,100	1,795	165,319,500	
6371	椿本チエイン	85,000	472	40,120,000	
6373	大同工業	33,000	157	5,181,000	
6375	日本コンベヤ	51,000	82	4,182,000	
6378	木村化工機	15,400	357	5,497,800	
6381	アネスト岩田	26,000	379	9,854,000	
6383	ダイフク	73,000	596	43,508,000	
6390	加藤製作所	38,000	258	9,804,000	
6393	油研工業	31,000	160	4,960,000	
6395	タダノ	77,000	768	59,136,000	
6406	フジテック	46,000	643	29,578,000	
6407	C K D	44,700	558	24,942,600	
6409	キトー	100	77,600	7,760,000	
6412	平和	34,600	1,559	53,941,400	
6413	理想科学工業	11,500	1,710	19,665,000	

6417	SANKYO	48,300	3,645	176,053,500	
6418	日本金銭機械	14,700	818	12,024,600	
6419	マースエンジニアリング	9,000	1,893	17,037,000	
6420	福島工業	4,400	1,913	8,417,200	
6428	オーイズミ	5,600	390	2,184,000	
6430	ダイコク電機	6,600	2,173	14,341,800	
6436	アマノ	48,300	794	38,350,200	
6440	JUKI	103,000	170	17,510,000	
6444	サンデン	90,000	365	32,850,000	
6445	蛇の目ミシン工業	155,000	102	15,810,000	
6454	マックス	25,000	1,081	27,025,000	
6457	グローリー	47,600	2,083	99,150,800	
6459	大和冷機工業	26,000	504	13,104,000	
6460	セガサミーホールディングス	171,400	1,612	276,296,800	
6461	日本ビストンリング	58,000	178	10,324,000	
6462	リケン	58,000	331	19,198,000	
6463	TPR	17,700	1,119	19,806,300	
6465	ホシザキ電機	34,800	2,625	91,350,000	
6470	大豊工業	11,300	998	11,277,400	
6471	日本精工	355,000	622	220,810,000	
6472	NTN	343,000	253	86,779,000	
6473	ジェイテクト	169,500	947	160,516,500	
6474	不二越	148,000	343	50,764,000	
6480	日本トムソン	55,000	357	19,635,000	
6481	THK	106,100	1,585	168,168,500	
6482	ユーシン精機	7,900	1,751	13,832,900	
6485	前澤給装工業	6,000	1,230	7,380,000	
6486	イーグル工業	20,000	733	14,660,000	
6489	前澤工業	11,700	237	2,772,900	
6490	日本ビラー工業	16,000	692	11,072,000	
6498	キッツ	65,600	444	29,126,400	
6581	日立工機	42,700	724	30,914,800	
6586	マキタ	97,100	4,115	399,566,500	
7004	日立造船	631,000	141	88,971,000	
7011	三菱重工業	2,673,000	484	1,293,732,000	
7013	IHI	1,090,000	234	255,060,000	
4062	イビデン	97,100	1,253	121,666,300	
4902	コニカミノルタホールディングス	421,500	735	309,802,500	
6448	ブラザー工業	206,200	960	197,952,000	
6479	ミネベア	217,000	284	61,628,000	
6501	日立製作所	3,732,000	552	2,060,064,000	
6502	東芝	3,148,000	395	1,243,460,000	
6503	三菱電機	1,595,000	731	1,165,945,000	
6504	富士電機	481,000	214	102,934,000	
6505	東洋電機製造	31,000	240	7,440,000	
6506	安川電機	175,000	804	140,700,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	96,000	172	16,512,000	
6508	明電舎	158,000	290	45,820,000	
6513	オリジン電気	23,000	382	8,786,000	
6517	デンヨー	15,700	1,098	17,238,600	
6588	東芝テック	100,000	513	51,300,000	
6590	芝浦メカトロニクス	28,000	217	6,076,000	
6592	マブチモーター	23,700	4,035	95,629,500	
6594	日本電産	86,200	5,030	433,586,000	
6617	東光高岳ホールディングス	8,100	1,477	11,963,700	
6620	宮越ホールディングス	5,400	306	1,652,400	
6622	ダイヘン	87,000	296	25,752,000	
6630	ヤーマン	1,300	1,242	1,614,600	
6632	JVCケンウッド	96,400	322	31,040,800	
6640	第一精工	5,000	1,272	6,360,000	
6641	日新電機	32,000	443	14,176,000	
6644	大崎電気工業	21,000	474	9,954,000	
6645	オムロン	177,600	2,158	383,260,800	
6651	日東工業	23,400	1,239	28,992,600	
6652	IDEC	20,800	798	16,598,400	
6674	ジーエス・ユアサ コーポレーション	307,000	329	101,003,000	
6675	サクサホールディングス	40,000	178	7,120,000	
6676	メルコホールディングス	9,900	1,565	15,493,500	
6678	テクノメディカ	12	548,000	6,576,000	

6701	日本電気	2,064,000	223	460,272,000	
6702	富士通	1,538,000	358	550,604,000	
6703	沖電気工業	580,000	101	58,580,000	
6704	岩崎通信機	70,000	82	5,740,000	
6706	電気興業	42,000	398	16,716,000	
6707	サンケン電気	81,000	356	28,836,000	
6715	ナカヨ通信機	15,000	268	4,020,000	
6718	アイホン	9,200	1,492	13,726,400	
6723	ルネサスエレクトロニクス	41,300	273	11,274,900	
6724	セイコーエプソン	108,800	968	105,318,400	
6727	ワコム	293	286,000	83,798,000	
6728	アルバック	31,800	791	25,153,800	
6730	アクセル	8,000	2,198	17,584,000	
6731	ビクセラ	6,700	188	1,259,600	
6737	ナナオ	13,500	1,422	19,197,000	
6741	日本信号	40,200	631	25,366,200	
6742	京三製作所	34,000	310	10,540,000	
6744	能美防災	21,000	635	13,335,000	
6745	ホーチキ	14,000	453	6,342,000	
6751	日本無線	34,000	247	8,398,000	
6752	パナソニック	1,822,200	609	1,109,719,800	70,000株
6753	シャープ	825,000	322	265,650,000	
6754	アンリツ	86,000	1,185	101,910,000	
6755	富士通ゼネラル	38,000	872	33,136,000	
6756	日立国際電気	37,000	620	22,940,000	
6758	ソニー	1,002,200	1,407	1,410,095,400	70,000株
6762	T D K	89,800	3,160	283,768,000	
6763	帝国通信工業	38,000	170	6,460,000	
6767	ミツミ電機	60,700	487	29,560,900	
6768	タムラ製作所	61,000	204	12,444,000	
6770	アルプス電気	116,900	492	57,514,800	
6771	池上通信機	50,000	71	3,550,000	
6773	パイオニア	193,800	227	43,992,600	
6779	日本電波工業	13,300	1,138	15,135,400	
6788	日本トリム	2,050	2,801	5,742,050	
6789	ローランド ディー・ジー	7,100	1,165	8,271,500	
6794	フォスター電機	16,300	1,357	22,119,100	
6796	クラリオン	84,000	140	11,760,000	
6798	S M K	47,000	267	12,549,000	
6800	ヨコオ	12,500	411	5,137,500	
6801	東光	80,000	219	17,520,000	
6803	ティアック	86,000	64	5,504,000	
6804	ホシデン	43,200	528	22,809,600	
6806	ヒロセ電機	27,800	10,750	298,850,000	
6807	日本航空電子工業	37,000	630	23,310,000	
6809	T O A	18,000	667	12,006,000	
6815	ユニデン	47,000	226	10,622,000	
6816	アルパイン	31,100	856	26,621,600	
6817	スミダコーポレーション	9,900	531	5,256,900	
6820	アイコム	8,800	2,002	17,617,600	
6823	リオン	3,500	670	2,345,000	
6839	船井電機	16,100	1,067	17,178,700	
6841	横河電機	159,600	980	156,408,000	
6844	新電元工業	51,000	273	13,923,000	
6845	アズビル	44,600	1,872	83,491,200	
6849	日本光電工業	31,700	2,915	92,405,500	
6850	チノー	28,000	216	6,048,000	
6853	共和電業	18,000	248	4,464,000	
6855	日本電子材料	6,900	401	2,766,900	
6856	堀場製作所	31,600	2,596	82,033,600	
6857	アドバンテスト	108,700	1,250	135,875,000	
6858	小野測器	19,000	389	7,391,000	
6859	エスベック	16,500	727	11,995,500	
6860	パナソニック デバイス S U N X	14,000	390	5,460,000	
6861	キーエンス	39,100	24,910	973,981,000	
6866	日置電機	8,300	1,371	11,379,300	
6869	シスメックス	56,200	4,345	244,189,000	
6875	メガチップス	13,100	1,603	20,999,300	
6877	O B A R A G R O U P	11,400	1,048	11,947,200	

6883	日本電産コバル電子	16,500	433	7,144,500	
6885	ミヤチテクノス	7,100	661	4,693,100	
6900	東京電波	4,700	442	2,077,400	
6901	澤藤電機	10,000	248	2,480,000	
6905	コーセル	23,200	1,058	24,545,600	
6910	日立メディコ	12,000	1,450	17,400,000	
6911	新日本無線	12,000	209	2,508,000	
6914	オブテックス	10,100	1,016	10,261,600	
6915	千代田インテグレ	7,700	919	7,076,300	
6923	スタンレー電気	124,100	1,358	168,527,800	
6924	岩崎電気	58,000	218	12,644,000	
6925	ウシオ電機	96,800	968	93,702,400	
6926	岡谷電機産業	8,600	340	2,924,000	
6927	ヘリオス テクノホールディング	13,600	189	2,570,400	
6929	日本セラミック	10,400	1,349	14,029,600	
6935	日本デジタル研究所	13,500	1,026	13,851,000	
6937	古河電池	11,000	498	5,478,000	
6938	双信電機	7,800	336	2,620,800	
6941	山一電機	17,400	161	2,801,400	
6947	図研	9,200	568	5,225,600	
6951	日本電子	59,000	347	20,473,000	
6952	カシオ計算機	152,000	828	125,856,000	
6954	ファナック	166,100	13,550	2,250,655,000	
6958	日本シイエムケイ	34,500	326	11,247,000	
6961	エンブラス	7,000	3,905	27,335,000	
6963	ローム	84,200	3,050	256,810,000	
6965	浜松ホトニクス	62,200	3,380	210,236,000	
6966	三井ハイテック	23,100	649	14,991,900	
6967	新光電気工業	53,600	687	36,823,200	
6971	京セラ	132,600	8,160	1,082,016,000	
6976	太陽誘電	77,600	801	62,157,600	
6981	村田製作所	167,300	5,390	901,747,000	
6985	ユースン	22,200	614	13,630,800	
6986	双葉電子工業	29,500	930	27,435,000	
6989	北陸電気工業	64,000	117	7,488,000	
6996	ニチコン	50,200	714	35,842,800	
6997	日本ケミコン	92,000	191	17,572,000	
6999	K O A	20,000	725	14,500,000	
7244	市光工業	38,000	150	5,700,000	
7276	小糸製作所	80,000	1,372	109,760,000	
7280	ミツバ	29,000	595	17,255,000	
7718	スター精密	28,000	888	24,864,000	
7735	大日本スクリーン製造	164,000	442	72,488,000	
7739	キャノン電子	14,600	1,917	27,988,200	
7751	キャノン	990,800	3,330	3,299,364,000	
7752	リコー	480,000	1,071	514,080,000	
7999	M U T O Hホールディングス	22,000	237	5,214,000	
8035	東京エレクトロン	134,200	3,915	525,393,000	
3116	トヨタ紡織	55,800	1,137	63,444,600	
5196	鬼怒川ゴム工業	30,000	497	14,910,000	
5949	ユニプレス	28,000	1,876	52,528,000	
6201	豊田自動織機	145,200	2,957	429,356,400	
6455	モリタホールディングス	28,000	814	22,792,000	
6584	三櫻工業	20,200	600	12,120,000	
6902	デンソー	394,000	3,285	1,294,290,000	
6995	東海理化電機製作所	37,300	1,335	49,795,500	
7003	三井造船	617,000	140	86,380,000	
7007	佐世保重工業	104,000	99	10,296,000	
7012	川崎重工業	1,242,000	263	326,646,000	
7102	日本車輛製造	58,000	353	20,474,000	
7105	日本輸送機	21,000	426	8,946,000	
7122	近畿車輛	27,000	323	8,721,000	
7201	日産自動車	2,014,900	895	1,803,335,500	70,000株
7202	いすゞ自動車	924,000	541	499,884,000	
7203	トヨタ自動車	2,049,000	4,315	8,841,435,000	270,000株

（単位：円）

コード	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄 名		単 価	金 額	
7205	日野自動車	199,000	946	188,254,000	
7211	三菱自動車工業	3,775,000	93	351,075,000	
7212	エフテック	5,500	1,250	6,875,000	
7220	武蔵精密工業	17,000	1,838	31,246,000	
7222	日産車体	55,000	1,132	62,260,000	
7224	新明和工業	64,000	574	36,736,000	
7226	極東開発工業	29,600	975	28,860,000	
7230	日信工業	32,400	1,327	42,994,800	
7231	トビー工業	119,000	206	24,514,000	
7236	ティラド	54,000	229	12,366,000	
7238	曙ブレーキ工業	74,100	435	32,233,500	
7239	タチエス	21,400	1,512	32,356,800	
7240	ＮＯＫ	77,200	1,291	99,665,200	
7241	フタバ産業	48,600	406	19,731,600	
7242	カヤバ工業	121,000	353	42,713,000	
7243	シロキ工業	35,000	231	8,085,000	
7245	大同メタル工業	22,000	747	16,434,000	
7246	プレス工業	68,000	364	24,752,000	
7248	カルソニックカンセイ	108,000	352	38,016,000	
7250	太平洋工業	32,400	467	15,130,800	
7251	ケーヒン	33,000	1,199	39,567,000	
7256	河西工業	20,000	418	8,360,000	
7259	アイシン精機	145,900	2,832	413,188,800	
7260	富士機工	18,000	297	5,346,000	
7261	マツダ	2,525,000	232	585,800,000	
7262	ダイハツ工業	169,000	1,905	321,945,000	
7266	今仙電機製作所	11,700	1,060	12,402,000	
7267	本田技研工業	1,345,600	3,400	4,575,040,000	
7269	スズキ	333,400	2,343	781,156,200	
7270	富士重工業	504,000	1,187	598,248,000	
7272	ヤマハ発動機	242,500	1,085	263,112,500	
7274	ショーワ	37,600	883	33,200,800	
7277	ＴＢＫ	16,000	490	7,840,000	
7278	エクセディ	21,700	2,020	43,834,000	
7282	豊田合成	45,100	1,954	88,125,400	
7283	愛三工業	16,500	759	12,523,500	
7294	ヨロズ	11,700	1,285	15,034,500	
7296	エフ・シー・シー	26,100	1,895	49,459,500	
7309	シマノ	64,300	5,950	382,585,000	
7312	タカタ	28,800	1,764	50,803,200	
7313	テイ・エス テック	33,700	1,636	55,133,200	
7728	日本電産トーソク	7,600	662	5,031,200	
4543	テルモ	122,200	3,760	459,472,000	
5187	クリエートメディック	4,800	817	3,921,600	
6376	日機装	56,000	945	52,920,000	
7701	島津製作所	191,000	601	114,791,000	
7702	ＪＭＳ	24,000	385	9,240,000	
7709	クボテック	34	30,650	1,042,100	
7714	モリテックス	3,500	283	990,500	
7715	長野計器	11,200	693	7,761,600	
7717	ブイ・テクノロジー	33	282,000	9,306,000	
7721	東京計器	51,000	190	9,690,000	
7723	愛知時計電機	17,000	290	4,930,000	
7729	東京精密	28,600	1,550	44,330,000	
7730	マニー	4,800	3,310	15,888,000	
7731	ニコン	297,800	2,551	759,687,800	
7732	トプコン	32,100	720	23,112,000	
7733	オリンパス	188,100	1,982	372,814,200	
7734	理研計器	12,900	548	7,069,200	
7740	タムロン	12,300	2,515	30,934,500	
7741	ＨＯＹＡ	387,800	1,756	680,976,800	
7744	ノーリツ鋼機	14,400	397	5,716,800	
7745	エー・アンド・デイ	14,500	365	5,292,500	
7756	日本電産コパル	12,500	653	8,162,500	
7762	シチズンホールディングス	180,000	533	95,940,000	
7769	リズム時計工業	72,000	181	13,032,000	

7775	大研医器	2,000	2,070	4,140,000	
7979	松風	7,800	816	6,364,800	
8050	セイコーホールディングス	102,000	293	29,886,000	
8086	ニプロ	84,900	672	57,052,800	
7817	パラマウントベッドホールディングス	13,700	2,872	39,346,400	
7819	S H O - B I	3,300	397	1,310,100	
7821	前田工繊	1,300	2,241	2,913,300	
7822	永大産業	21,000	360	7,560,000	
7825	ダンロップスポーツ	8,600	1,000	8,600,000	
7832	パンダイナムコホールディングス	164,900	1,299	214,205,100	
7838	共立印刷	20,700	248	5,133,600	
7840	フランスベッドホールディングス	100,000	201	20,100,000	
7846	パイロットコーポレーション	139	198,000	27,522,000	
7862	トッパン・フォームズ	28,500	872	24,852,000	
7864	フジシールインターナショナル	19,400	1,863	36,142,200	
7867	タカラトミー	52,500	488	25,620,000	
7868	廣済堂	13,600	327	4,447,200	
7873	アーク	54,200	182	9,864,400	
7885	タカノ	7,000	435	3,045,000	
7893	プロネクス	18,500	521	9,638,500	
7897	ホクシン	11,400	192	2,188,800	
7898	ウッドワン	27,000	293	7,911,000	
7905	大建工業	65,000	249	16,185,000	
7911	凸版印刷	450,000	564	253,800,000	
7912	大日本印刷	486,000	721	350,406,000	
7913	図書印刷	26,000	149	3,874,000	
7914	共同印刷	49,000	248	12,152,000	
7915	日本写真印刷	24,500	1,516	37,142,000	
7916	光村印刷	15,000	265	3,975,000	
7921	宝印刷	9,000	617	5,553,000	
7936	アシックス	148,500	1,292	191,862,000	
7937	ツツミ	8,000	2,263	18,104,000	
7944	ローランド	15,200	834	12,676,800	
7949	小松ウオール工業	5,900	1,618	9,546,200	
7951	ヤマハ	117,200	942	110,402,400	
7952	河合楽器製作所	55,000	181	9,955,000	
7955	クリナップ	16,300	655	10,676,500	
7956	ビジョン	12,000	4,650	55,800,000	
7961	兼松日産農林	25,000	157	3,925,000	
7962	キングジム	13,300	655	8,711,500	
7966	リンテック	34,100	1,646	56,128,600	
7968	T A S A K I	3,200	382	1,222,400	
7972	イトーキ	33,500	452	15,142,000	
7974	任天堂	91,200	9,630	878,256,000	
7976	三菱鉛筆	13,100	1,574	20,619,400	
7981	タカラスタンダード	73,000	654	47,742,000	
7984	コクヨ	82,900	632	52,392,800	
7987	ナカバヤシ	34,000	190	6,460,000	
7990	グローブライド	77,000	113	8,701,000	
7994	岡村製作所	61,000	642	39,162,000	
8022	美津濃	79,000	416	32,864,000	
8170	アデランス	19,900	1,080	21,492,000	
9501	東京電力	1,352,900	208	281,403,200	
9502	中部電力	488,000	1,144	558,272,000	
9503	関西電力	650,800	822	534,957,600	
9504	中国電力	220,500	1,166	257,103,000	
9505	北陸電力	156,200	990	154,638,000	
9506	東北電力	398,500	741	295,288,500	
9507	四国電力	143,600	1,125	161,550,000	
9508	九州電力	352,200	878	309,231,600	
9509	北海道電力	149,300	866	129,293,800	
9511	沖縄電力	9,500	2,970	28,215,000	
9513	電源開発	99,000	2,063	204,237,000	
9531	東京瓦斯	1,915,000	435	833,025,000	
9532	大阪瓦斯	1,548,000	334	517,032,000	
9533	東邦瓦斯	406,000	498	202,188,000	
9534	北海道瓦斯	29,000	240	6,960,000	
9536	西部瓦斯	180,000	220	39,600,000	
9543	静岡瓦斯	41,500	658	27,307,000	

9001	東武鉄道	905,000	488	441,640,000	
9003	相鉄ホールディングス	255,000	305	77,775,000	
9005	東京急行電鉄	939,000	502	471,378,000	
9006	京浜急行電鉄	410,000	781	320,210,000	
9007	小田急電鉄	511,000	915	467,565,000	
9008	京王電鉄	446,000	676	301,496,000	
9009	京成電鉄	239,000	813	194,307,000	
9010	富士急行	43,000	544	23,392,000	
9014	新京成電鉄	20,000	361	7,220,000	
9020	東日本旅客鉄道	294,200	6,110	1,797,562,000	
9021	西日本旅客鉄道	137,500	3,575	491,562,500	
9022	東海旅客鉄道	132,600	7,650	1,014,390,000	
9031	西日本鉄道	206,000	364	74,984,000	
9037	ハマキョウレックス	4,500	2,746	12,357,000	
9039	サカイ引越センター	2,900	2,055	5,959,500	
9041	近畿日本鉄道	1,441,000	378	544,698,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	1,007,000	494	497,458,000	
9044	南海電気鉄道	332,000	408	135,456,000	
9045	京阪電気鉄道	357,000	415	148,155,000	
9047	名糖運輸	6,500	620	4,030,000	
9048	名古屋鉄道	557,000	244	135,908,000	
9062	日本通運	631,000	371	234,101,000	
9064	ヤマトホールディングス	301,300	1,474	444,116,200	
9065	山九	194,000	352	68,288,000	
9067	丸運	8,600	217	1,866,200	
9068	丸全昭和運輸	53,000	263	13,939,000	
9069	センコー	64,000	416	26,624,000	
9070	トナミホールディングス	33,000	185	6,105,000	
9072	日本梱包運輸倉庫	51,500	1,208	62,212,000	
9074	日本石油輸送	18,000	207	3,726,000	
9075	福山通運	97,000	470	45,590,000	
9076	セイノーホールディングス	123,000	615	75,645,000	
9081	神奈川中央交通	19,000	480	9,120,000	
9086	日立物流	27,700	1,363	37,755,100	
9101	日本郵船	1,263,000	208	262,704,000	
9104	商船三井	777,000	281	218,337,000	
9107	川崎汽船	698,000	156	108,888,000	
9110	N S ユナイテッド海運	69,000	144	9,936,000	
9113	乾汽船	19,000	301	5,719,000	
9115	明治海運	14,300	314	4,490,200	
9119	飯野海運	66,000	397	26,202,000	
9130	共栄タンカー	13,000	203	2,639,000	
9132	第一中央汽船	117,000	86	10,062,000	
9201	日本航空	134,700	3,705	499,063,500	
9202	全日本空輸	3,135,000	177	554,895,000	
9232	パスコ	15,000	295	4,425,000	
9066	日新	60,000	221	13,260,000	
9301	三菱倉庫	113,000	1,300	146,900,000	
9302	三井倉庫	74,000	370	27,380,000	
9303	住友倉庫	107,000	444	47,508,000	
9304	澁澤倉庫	41,000	283	11,603,000	
9306	東陽倉庫	25,000	214	5,350,000	
9310	日本トランスシティ	37,000	336	12,432,000	
9312	ケイヒン	29,000	129	3,741,000	
9324	安田倉庫	12,400	636	7,886,400	
9351	東洋埠頭	46,000	149	6,854,000	
9358	宇徳	12,900	261	3,366,900	
9364	上組	177,000	725	128,325,000	
9366	サンリツ	4,200	575	2,415,000	
9368	キムラユニティー	3,600	833	2,998,800	
9369	キューソー流通システム	4,400	927	4,078,800	
9370	郵船ロジスティクス	12,500	895	11,187,500	
9375	近鉄エクスプレス	14,300	2,963	42,370,900	
9380	東海運	8,600	262	2,253,200	
9381	エーアイティー	1,300	1,608	2,090,400	
1973	N E C ネットエスアイ	14,800	1,717	25,411,600	
2317	システナ	167	80,000	13,360,000	
2327	新日鉄住金ソリューションズ	10,500	1,780	18,690,000	
2359	コア	5,900	730	4,307,000	

3371	ソフトクリエイティブホールディングス	1,700	1,454	2,471,800	
3620	デジタルハーツ	2,900	693	2,009,700	
3626	ＩＴホールディングス	52,200	1,287	67,181,400	
3627	ネオス	31	63,000	1,953,000	
3630	電算システム	1,700	1,196	2,033,200	
3632	グリー	81,200	1,373	111,487,600	
3635	コーエーテックモホールディングス	31,100	744	23,138,400	
3636	三菱総合研究所	6,100	1,939	11,827,900	
3639	ボルテージ	2,500	981	2,452,500	
3656	K L a b	4,800	477	2,289,600	
3657	ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,400	1,668	4,003,200	
3659	ネクソン	129,100	944	121,870,400	
3660	アイスタイル	2,600	703	1,827,800	
3662	エイチーム	1,100	2,745	3,019,500	
3715	ダウンゴ	81	204,100	16,532,100	
3724	ベリサーブ	9	139,900	1,259,100	
3730	マクロミル	15,300	987	15,101,100	
3738	ティーガイア	19,500	895	17,452,500	
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	5,100	1,307	6,665,700	
3770	ザッパラス	87	100,500	8,743,500	
3774	インターネットイニシアティブ	18,400	2,506	46,110,400	
3817	S R Aホールディングス	7,500	982	7,365,000	
3834	朝日ネット	13,000	442	5,746,000	
4283	パナソニック インフォメーションシステムズ	3,700	2,049	7,581,300	
4295	フェイス	536	10,000	5,360,000	
4307	野村総合研究所	89,100	2,009	179,001,900	
4312	サイバネットシステム	130	25,300	3,289,000	
4326	インテージ	4,600	2,102	9,669,200	
4340	シンプレクス・ホールディングス	292	29,410	8,587,720	
4344	ソースネクスト	3,900	400	1,560,000	
4674	クレスコ	3,600	623	2,242,800	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	1,522	152,200	231,648,400	
4684	オービック	5,430	19,560	106,210,800	
4687	T D Cソフトウェアエンジニアリング	3,100	796	2,467,600	
4689	ヤフー	11,528	32,400	373,507,200	
4704	トレンドマイクロ	62,500	2,618	163,625,000	
4716	日本オラクル	31,500	3,765	118,597,500	
4719	アルファシステムズ	5,100	1,160	5,916,000	
4722	フューチャーアーキテクト	190	36,200	6,878,000	
4725	シーエーシー	9,600	763	7,324,800	
4726	ソフトバンク・テクノロジー	3,700	935	3,459,500	
4728	トーセ	3,800	570	2,166,000	
4733	オービックビジネスコンサルタント	5,000	5,170	25,850,000	
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	18,600	3,960	73,656,000	
4743	アイティフォー	17,600	351	6,177,600	
4746	東計電算	2,800	1,239	3,469,200	
4762	エックスネット	14	124,300	1,740,200	
4768	大塚商会	14,100	7,630	107,583,000	
4776	サイボウズ	263	27,760	7,300,880	
4779	ソフトブレーン	233	13,980	3,257,340	
4799	アグレックス	4,100	828	3,394,800	
4812	電通国際情報サービス	9,700	827	8,021,900	
4820	E Mシステムズ	2,400	1,725	4,140,000	
4825	ウェザーニューズ	4,100	2,421	9,926,100	
4826	C I J	15,700	365	5,730,500	
4839	WOWOW	48	200,800	9,638,400	
6791	日本コロムビア	157,000	53	8,321,000	
7518	ネットワンシステムズ	57,300	895	51,283,500	
7595	アルゴグラフィックス	5,700	1,276	7,273,200	
7844	マーベラスA Q L	180	36,200	6,516,000	
7860	エイベックス・グループ・ホールディングス	29,700	2,521	74,873,700	
8056	日本ユニシス	43,400	703	30,510,200	
8096	兼松エレクトロニクス	9,900	1,061	10,503,900	
9401	東京放送ホールディングス	84,900	1,037	88,041,300	
9404	日本テレビホールディングス	143,700	1,307	187,815,900	
9409	テレビ朝日	39,900	1,446	57,695,400	
9412	スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,365	41,000	55,965,000	

9413	テレビ東京ホールディングス	11,400	985	11,229,000	
9422	アイ・ティー・シーネットワーク	13,800	682	9,411,600	
9430	ＮＥＣモバイリング	5,800	4,080	23,664,000	
9432	日本電信電話	662,700	3,740	2,478,498,000	
9433	K D D I	222,100	6,350	1,410,335,000	
9435	光通信	15,900	4,245	67,495,500	
9437	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	12,970	132,600	1,719,822,000	
9449	G M Oインターネット	52,500	646	33,915,000	
9470	学研ホールディングス	47,000	290	13,630,000	
9474	ゼンリン	20,800	1,207	25,105,600	
9475	昭文社	9,400	588	5,527,200	
9477	角川グループホールディングス	13,500	2,505	33,817,500	
9479	インプレスホールディングス	13,000	137	1,781,000	
9600	アイネット	6,800	674	4,583,200	
9601	松竹	104,000	1,005	104,520,000	
9602	東宝	112,300	1,700	190,910,000	
9605	東映	66,000	484	31,944,000	
9607	A O I P r o .	7,300	587	4,285,100	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	972	270,500	262,926,000	
9682	D T S	15,000	1,156	17,340,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,100	1,115	63,666,500	
9692	シーイーシー	10,200	576	5,875,200	
9697	カプコン	30,200	1,429	43,155,800	
9717	ジャステック	9,100	548	4,986,800	
9719	S C S K	37,400	1,650	61,710,000	
9739	日本システムウエア	5,900	365	2,153,500	
9742	アイネス	21,400	636	13,610,400	
9746	T K C	14,600	1,560	22,776,000	
9749	富士ソフト	22,400	1,923	43,075,200	
9759	N S D	31,000	850	26,350,000	
9766	コナミ	71,100	1,899	135,018,900	
9790	福井コンピュータホールディングス	2,100	560	1,176,000	
9889	J B C Cホールディングス	13,200	702	9,266,400	
9928	ミロク情報サービス	10,500	344	3,612,000	
9984	ソフトバンク	752,400	3,040	2,287,296,000	
1352	ハウスイ	12,000	123	1,476,000	
2676	高千穂交易	6,500	894	5,811,000	
2692	伊藤忠食品	3,900	3,160	12,324,000	
2715	エレマテック	7,300	1,201	8,767,300	
2729	J A L U X	4,400	897	3,946,800	
2733	あらた	35,000	345	12,075,000	
2737	トーマンデバイス	2,400	1,830	4,392,000	
2760	東京エレクトロン デバイス	31	149,700	4,640,700	
2768	双日	991,600	132	130,891,200	
2784	アルフレッサ ホールディングス	40,700	3,970	161,579,000	
2874	横浜冷凍	39,000	631	24,609,000	
3004	神栄	20,000	124	2,480,000	
3022	山下医科器械	1,300	1,284	1,669,200	
3023	ラサ商事	6,800	434	2,951,200	
3036	アルコニックス	4,400	1,550	6,820,000	
3076	あい ホールディングス	25,200	708	17,841,600	
3107	ダイワボウホールディングス	143,000	181	25,883,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,600	892	26,403,200	
3153	八洲電機	11,400	381	4,343,400	
3156	U K Cホールディングス	9,300	1,663	15,465,900	
3167	T O K A Iホールディングス	61,500	288	17,712,000	
3321	ミタチ産業	3,700	439	1,624,300	
3360	シップヘルスケアホールディングス	22,500	2,678	60,255,000	
5009	富士興産	5,600	590	3,304,000	
6973	協栄産業	19,000	161	3,059,000	
7414	小野建	13,700	840	11,508,000	
7420	佐島電機	11,600	439	5,092,400	
7427	エコートレーディング	3,900	824	3,213,600	
7433	伯東	9,600	833	7,996,800	
7438	コンドーテック	12,700	503	6,388,100	
7442	中山福	9,000	668	6,012,000	
7447	ナガイレーベン	20,800	1,153	23,982,400	
7451	三菱食品	17,300	2,723	47,107,900	
7456	松田産業	11,400	1,153	13,144,200	

7459	メディバルホールディングス	157,400	1,125	177,075,000	
7463	アドヴァン	8,000	875	7,000,000	
7466	ＳＰＫ	3,700	1,530	5,661,000	
7476	アズワン	10,200	1,854	18,910,800	
7480	スズデン	5,100	474	2,417,400	
7481	尾家産業	5,000	838	4,190,000	
7482	シモジマ	9,600	994	9,542,400	
7483	ドウシシャ	8,300	2,415	20,044,500	
7504	高速	9,300	775	7,207,500	
7517	黒田電気	21,000	1,061	22,281,000	
7537	丸文	14,000	450	6,300,000	
7552	ハビネット	9,500	714	6,783,000	
7558	トーメンエレクトロニクス	8,000	1,191	9,528,000	
7591	エクセル	6,700	795	5,326,500	
7594	マルカキカイ	5,100	1,255	6,400,500	
7599	ガリバーインターナショナル	5,290	3,790	20,049,100	
7600	日本エム・ディ・エム	14,400	273	3,931,200	
7607	進和	9,300	1,090	10,137,000	
7608	エスケイジャパン	3,800	273	1,037,400	
7609	ダイトエレクトロン	7,200	379	2,728,800	
7613	シークス	10,000	1,022	10,220,000	
7619	田中商事	5,300	475	2,517,500	
7628	オーハシテクニカ	8,400	656	5,510,400	
7631	マクニカ	8,100	1,665	13,486,500	
7637	白銅	5,100	816	4,161,600	
8001	伊藤忠商事	1,255,800	995	1,249,521,000	
8002	丸紅	1,291,000	667	861,097,000	
8007	高島	29,000	280	8,120,000	
8008	F & A アクアホールディングス	12,000	1,032	12,384,000	
8012	長瀬産業	89,100	970	86,427,000	
8014	蝶理	10,000	978	9,780,000	
8015	豊田通商	175,300	2,151	377,070,300	
8018	三共生興	26,700	312	8,330,400	
8020	兼松	335,000	133	44,555,000	
8025	ツカモトコーポレーション	26,000	171	4,446,000	
8031	三井物産	1,358,800	1,328	1,804,486,400	
8032	日本紙パルプ商事	82,000	305	25,010,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	47,700	1,768	84,333,600	
8037	カメイ	19,000	787	14,953,000	
8038	東都水産	28,000	146	4,088,000	
8043	スターゼン	52,000	257	13,364,000	
8051	山善	60,400	678	40,951,200	
8052	椿本興業	18,000	253	4,554,000	
8053	住友商事	929,000	1,159	1,076,711,000	
8057	内田洋行	34,000	252	8,568,000	
8058	三菱商事	1,228,300	1,918	2,355,879,400	
8059	第一実業	36,000	435	15,660,000	
8060	キャノンマーケティングジャパン	52,400	1,251	65,552,400	
8061	西華産業	56,000	257	14,392,000	
8065	佐藤商事	14,000	607	8,498,000	
8068	菱洋エレクトロ	18,500	832	15,392,000	
8070	東京産業	15,500	283	4,386,500	
8074	ユアサ商事	161,000	172	27,692,000	
8075	神鋼商事	39,000	194	7,566,000	
8078	阪和興業	157,000	337	52,909,000	
8081	カナデン	16,000	565	9,040,000	
8084	菱電商事	23,000	576	13,248,000	
8087	フルサト工業	8,500	784	6,664,000	
8088	岩谷産業	174,000	339	58,986,000	
8089	すてきなイスグループ	62,000	235	14,570,000	
8090	昭光通商	56,000	136	7,616,000	
8091	ニチモウ	23,000	204	4,692,000	
8093	極東貿易	18,000	164	2,952,000	
8095	イワキ	24,000	180	4,320,000	
8097	三愛石油	37,000	394	14,578,000	

（単位：円）

コード	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄 名		単 価	金 額	
8098	稲畑産業	38,700	628	24,303,600	
8101	G S Iクレオス	42,000	135	5,670,000	
8103	明和産業	12,500	474	5,925,000	
8129	東邦ホールディングス	50,400	1,760	88,704,000	
8130	サンゲツ	27,900	2,209	61,631,100	
8131	ミツウロコグループホールディングス	25,300	497	12,574,100	
8132	シナネン	34,000	369	12,546,000	
8133	伊藤忠エネクス	34,700	469	16,274,300	
8136	サンリオ	39,700	3,350	132,995,000	
8137	サンワテクノス	7,700	641	4,935,700	
8140	リョーサン	25,600	1,720	44,032,000	
8141	新光商事	17,200	793	13,639,600	
8142	トーホー	33,000	325	10,725,000	
8150	三信電気	22,500	608	13,680,000	
8151	東陽テクニカ	22,800	1,031	23,506,800	
8153	モスフードサービス	20,600	1,695	34,917,000	
8154	加賀電子	15,600	776	12,105,600	
8158	ソーダニッカ	16,000	384	6,144,000	
8159	立花エレテック	9,500	776	7,372,000	
8283	P a l t a c	18,600	1,124	20,906,400	
8835	太平洋興発	57,000	96	5,472,000	
9305	ヤマタネ	73,000	141	10,293,000	
9763	丸紅建材リース	13,000	173	2,249,000	
9810	日鐵商事	35,000	241	8,435,000	
9830	トラスコ中山	18,000	1,636	29,448,000	
9832	オートバックスセブン	19,400	3,710	71,974,000	
9869	加藤産業	22,700	1,707	38,748,900	
9880	イノテック	13,600	439	5,970,400	
9882	イエローハット	14,800	1,403	20,764,400	
9883	富士エレクトロニクス	8,100	1,223	9,906,300	
9896	J Kホールディングス	13,200	445	5,874,000	
9902	日伝	7,100	2,135	15,158,500	
9930	北沢産業	12,000	170	2,040,000	
9932	杉本商事	8,500	808	6,868,000	
9934	因幡電機産業	18,500	2,741	50,708,500	
9938	住金物産	81,000	250	20,250,000	
9957	パイテック	3,600	655	2,358,000	
9962	ミスミグループ本社	58,500	2,395	140,107,500	
9963	江守商事	3,500	967	3,384,500	
9972	アルテック	7,700	207	1,593,900	
9982	タキヒヨー	24,000	457	10,968,000	
9987	スズケン	60,500	2,764	167,222,000	
9991	ジェコス	10,800	686	7,408,800	
2651	ローソン	59,600	6,510	387,996,000	
2659	サンエー	5,900	3,695	21,800,500	
2660	キリン堂	5,600	645	3,612,000	
2662	ダイユーエイト	3,200	669	2,140,800	
2664	カワチ薬品	11,000	1,860	20,460,000	
2670	エービーシー・マート	18,600	3,435	63,891,000	
2674	ハードオフコーポレーション	7,600	621	4,719,600	
2678	アスクル	10,800	1,290	13,932,000	
2681	ゲオホールディングス	269	91,300	24,559,700	
2685	ポイント	14,500	3,085	44,732,500	
2687	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	20,000	88	1,760,000	
2695	くらコーポレーション	9,200	1,228	11,297,600	
2698	キャンドゥ	83	108,600	9,013,800	
2726	バル	4,600	4,035	18,561,000	
2730	エディオン	68,000	444	30,192,000	
2734	サーラコーポレーション	13,600	498	6,772,800	
2753	あみやき亭	27	203,700	5,499,900	
2764	ひらまつ	54	159,300	8,602,200	
2772	ゲンキー	1,500	2,100	3,150,000	
2791	大黒天物産	2,700	2,299	6,207,300	
2792	ハニーズ	13,820	1,135	15,685,700	
3028	アルペン	12,000	1,633	19,596,000	
3048	ビックカメラ	597	44,850	26,775,450	

3050	D C Mホールディングス	81,500	605	49,307,500	
3064	M o n o t a R O	10,500	2,870	30,135,000	
3086	J . フロント リテイリング	372,000	500	186,000,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,250	34,500,000	
3088	マツモトキヨシホールディングス	26,500	2,151	57,001,500	
3091	ブロンコビリー	1,000	2,328	2,328,000	
3092	スタートトゥデイ	32,700	762	24,917,400	
3097	物語コーポレーション	2,000	2,244	4,488,000	
3098	ココカラファイン	16,400	3,005	49,282,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	312,800	896	280,268,800	
3141	ウエルシアホールディングス	5,500	3,135	17,242,500	
3148	クリエイトＳＤホールディングス	6,600	2,943	19,423,800	
3159	丸善ＣＨＩホールディングス	9,300	333	3,096,900	
3313	ブックオフコーポレーション	8,700	680	5,916,000	
3333	あさひ	9,100	1,187	10,801,700	
3341	日本調剤	1,990	2,329	4,634,710	
3349	コスモス薬品	6,900	9,760	67,344,000	
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	658,500	2,794	1,839,849,000	
3391	ツルハホールディングス	13,000	7,500	97,500,000	
3395	サンマルクホールディングス	5,100	3,325	16,957,500	
3396	フェリシモ	4,500	1,060	4,770,000	
3397	トリドール	13,600	1,079	14,674,400	
3398	クスリのアオキ	2,300	4,910	11,293,000	
4350	メディカルシステムネットワーク	8,700	410	3,567,000	
4775	総合メディカル	3,800	2,979	11,320,200	
7416	はるやま商事	6,600	492	3,247,200	
7421	カップ・クリエイトホールディングス	11,550	2,018	23,307,900	
7445	ライトオン	11,700	682	7,979,400	
7448	ジーンズメイト	5,000	362	1,810,000	
7453	良品計画	16,700	5,180	86,506,000	
7455	三城ホールディングス	19,500	474	9,243,000	
7494	コナカ	18,500	674	12,469,000	
7506	ハウス オブ ローゼ	1,700	1,336	2,271,200	
7508	G - 7ホールディングス	4,600	491	2,258,600	
7512	イオン北海道	9,900	483	4,781,700	
7513	コジマ	23,300	317	7,386,100	
7514	ヒマラヤ	4,600	714	3,284,400	
7516	コーナン商事	20,600	1,087	22,392,200	
7520	エコス	5,300	581	3,079,300	
7522	ワタミ	18,600	1,706	31,731,600	
7524	マルシェ	3,800	779	2,960,200	
7532	ドン・キホーテ	42,000	3,650	153,300,000	
7541	メガネトップ	27,000	1,135	30,645,000	
7545	西松屋チェーン	31,000	721	22,351,000	
7550	ゼンショーホールディングス	60,000	1,045	62,700,000	
7554	幸楽苑	9,700	1,295	12,561,500	
7561	ハークスレイ	4,400	702	3,088,800	
7581	サイゼリヤ	23,300	1,205	28,076,500	
7601	ポプラ	4,000	577	2,308,000	
7606	ユナイテッドアローズ	16,800	2,191	36,808,800	
7611	ハイデイ日高	8,300	2,185	18,135,500	
7615	京都きもの友禅	10,400	1,059	11,013,600	
7616	コロワイド	52,000	901	46,852,000	
7630	壱番屋	6,300	2,946	18,559,800	
7640	トップカルチャー	5,700	394	2,245,800	
7649	スギホールディングス	25,100	3,095	77,684,500	
8005	スクロール	20,500	267	5,473,500	
8028	ファミリーマート	48,400	3,700	179,080,000	
8160	木曽路	19,200	1,816	34,867,200	
8165	千趣会	28,300	554	15,678,200	
8166	タカキュー	12,000	302	3,624,000	
8168	ケーヨー	26,600	490	13,034,000	
8173	上新電機	34,000	936	31,824,000	
8174	日本瓦斯	21,600	1,154	24,926,400	
8175	ベスト電器	49,000	134	6,566,000	
8178	マルエツ	32,000	290	9,280,000	
8179	ロイヤルホールディングス	26,300	1,053	27,693,900	
8181	東天紅	11,000	205	2,255,000	
8182	いなげや	17,500	998	17,465,000	

8184	島忠	35,600	1,897	67,533,200	
8185	チヨダ	18,500	2,135	39,497,500	
8194	ライフコーポレーション	9,900	1,258	12,454,200	
8196	カスミ	32,200	576	18,547,200	
8200	リンガーハット	14,200	1,147	16,287,400	
8201	さが美	12,000	130	1,560,000	
8203	M r M a x	15,800	332	5,245,600	
8207	テンアライド	11,900	300	3,570,000	
8214	A O K I ホールディングス	13,600	2,129	28,954,400	
8217	オークワ	25,000	1,077	26,925,000	
8218	コメリ	24,300	2,459	59,753,700	
8219	青山商事	43,400	1,720	74,648,000	
8227	しまむら	18,300	8,880	162,504,000	
8229	C F S コーポレーション	10,400	440	4,576,000	
8233	高島屋	213,000	671	142,923,000	
8237	松屋	31,700	816	25,867,200	
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	102,000	728	74,256,000	
8245	丸栄	26,000	105	2,730,000	
8248	ニッセンホールディングス	28,400	328	9,315,200	
8251	バルコ	30,100	944	28,414,400	
8252	丸井グループ	205,100	732	150,133,200	
8255	原信ナルスホールディングス	8,700	1,616	14,059,200	
8260	井筒屋	85,000	102	8,670,000	
8263	ダイエー	91,050	205	18,665,250	
8266	イズミヤ	59,000	492	29,028,000	
8267	イオン	555,000	1,021	566,655,000	
8270	ユニー	150,700	668	100,667,600	
8273	イズミ	39,100	1,942	75,932,200	
8274	東武ストア	20,000	282	5,640,000	
8276	平和堂	31,900	1,329	42,395,100	
8278	フジ	17,500	1,853	32,427,500	
8279	ヤオコー	7,900	3,635	28,716,500	
8281	ゼビオ	21,400	1,842	39,418,800	
8282	ケーズホールディングス	39,300	2,392	94,005,600	
8289	O l y m p i c	9,300	770	7,161,000	
8291	日産東京販売ホールディングス	23,000	344	7,912,000	
9627	アインファーマシーズ	8,700	4,870	42,369,000	
9828	元気寿司	4,800	1,110	5,328,000	
9831	ヤマダ電機	71,790	3,580	257,008,200	
9842	アークランドサカモト	10,200	1,473	15,024,600	
9843	ニトリホールディングス	31,150	6,690	208,393,500	
9850	グルメ杵屋	11,000	624	6,864,000	
9854	愛眼	12,600	300	3,780,000	
9861	吉野家ホールディングス	426	109,000	46,434,000	
9887	松屋フーズ	7,600	1,631	12,395,600	
9900	サガミチェーン	18,000	702	12,636,000	
9945	ブレナス	17,600	1,455	25,608,000	
9946	ミニストップ	11,600	1,503	17,434,800	
9948	アークス	26,800	1,714	45,935,200	
9956	パロー	33,900	1,448	49,087,200	
9974	ベルク	7,800	1,317	10,272,600	
9979	大庄	7,300	1,185	8,650,500	
9983	ファーストリテイリング	31,500	22,940	722,610,000	
9989	サンドラッグ	29,900	3,335	99,716,500	
9990	東京デリカ	5,200	1,026	5,335,200	
9993	ヤマザワ	4,100	1,520	6,232,000	
9994	やまや	3,200	1,218	3,897,600	
9997	ペルーナ	19,600	690	13,524,000	
7150	島根銀行	3,500	1,205	4,217,500	
7161	じもとホールディングス	112,900	198	22,354,200	
8303	新生銀行	1,362,000	173	235,626,000	
8304	あおぞら銀行	572,000	246	140,712,000	
8306	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,919,700	479	5,709,536,300	
8308	りそなホールディングス	1,619,100	398	644,401,800	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	3,291,000	310	1,020,210,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	1,190,500	3,305	3,934,602,500	
8324	第四銀行	203,000	290	58,870,000	
8325	北越銀行	161,000	187	30,107,000	
8327	西日本シティ銀行	552,000	226	124,752,000	

8331	千葉銀行	607,000	573	347,811,000	
8332	横浜銀行	1,001,000	436	436,436,000	
8333	常陽銀行	594,000	426	253,044,000	
8334	群馬銀行	356,000	436	155,216,000	
8336	武蔵野銀行	25,400	3,115	79,121,000	
8337	千葉興業銀行	30,100	718	21,611,800	
8338	筑波銀行	65,400	323	21,124,200	
8339	東京都民銀行	29,800	890	26,522,000	
8341	七十七銀行	247,000	371	91,637,000	
8342	青森銀行	118,000	269	31,742,000	
8343	秋田銀行	108,000	262	28,296,000	
8344	山形銀行	96,000	399	38,304,000	
8345	岩手銀行	11,300	3,830	43,279,000	
8346	東邦銀行	133,000	288	38,304,000	
8349	東北銀行	80,000	148	11,840,000	
8350	みちのく銀行	78,000	180	14,040,000	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	639,000	389	248,571,000	
8355	静岡銀行	461,000	862	397,382,000	
8356	十六銀行	197,000	314	61,858,000	
8358	スルガ銀行	153,000	1,188	181,764,000	
8359	八十二銀行	290,000	454	131,660,000	
8360	山梨中央銀行	96,000	367	35,232,000	
8361	大垣共立銀行	210,000	295	61,950,000	
8362	福井銀行	136,000	177	24,072,000	
8363	北國銀行	182,000	363	66,066,000	
8364	清水銀行	5,300	2,660	14,098,000	
8366	滋賀銀行	148,000	538	79,624,000	
8367	南都銀行	157,000	399	62,643,000	
8368	百五銀行	142,000	389	55,238,000	
8369	京都銀行	282,000	741	208,962,000	
8374	三重銀行	65,000	198	12,870,000	
8377	ほくほくフィナンシャルグループ	1,103,000	142	156,626,000	
8379	広島銀行	465,000	385	179,025,000	
8381	山陰合同銀行	92,000	685	63,020,000	
8382	中国銀行	122,000	1,244	151,768,000	
8383	鳥取銀行	50,000	182	9,100,000	
8385	伊予銀行	168,000	714	119,952,000	
8386	百十四銀行	173,000	335	57,955,000	
8387	四国銀行	114,000	231	26,334,000	
8388	阿波銀行	129,000	551	71,079,000	
8390	鹿児島銀行	109,000	575	62,675,000	
8392	大分銀行	93,000	330	30,690,000	
8393	宮崎銀行	105,000	230	24,150,000	
8394	肥後銀行	130,000	503	65,390,000	
8395	佐賀銀行	95,000	206	19,570,000	
8396	十八銀行	101,000	235	23,735,000	
8397	沖縄銀行	11,700	3,520	41,184,000	
8399	琉球銀行	32,700	1,033	33,779,100	
8409	八千代銀行	8,100	2,141	17,342,100	
8410	セブン銀行	530,800	222	117,837,600	
8411	みずほフィナンシャルグループ	20,284,400	170	3,448,348,000	
8415	紀陽ホールディングス	627,000	130	81,510,000	
8418	山口フィナンシャルグループ	157,000	838	131,566,000	
8521	長野銀行	55,000	162	8,910,000	
8522	名古屋銀行	142,000	320	45,440,000	
8524	北洋銀行	237,100	295	69,944,500	
8527	愛知銀行	5,700	4,725	26,932,500	
8529	第三銀行	89,000	168	14,952,000	
8530	中京銀行	65,000	194	12,610,000	
8536	東日本銀行	69,000	220	15,180,000	
8537	大光銀行	56,000	225	12,600,000	
8541	愛媛銀行	92,000	232	21,344,000	
8542	トマト銀行	61,000	179	10,919,000	
8543	みなと銀行	142,000	158	22,436,000	
8544	京葉銀行	130,000	425	55,250,000	
8545	関西アーバン銀行	219,000	112	24,528,000	
8550	栃木銀行	79,000	332	26,228,000	
8551	北日本銀行	4,600	2,397	11,026,200	
8558	東和銀行	169,000	102	17,238,000	

8562	福島銀行	194,000	97	18,818,000	
8563	大東銀行	100,000	102	10,200,000	
8600	トモニホールディングス	120,800	393	47,474,400	
8713	フィデアホールディングス	90,600	199	18,029,400	
8714	池田泉州ホールディングス	129,900	501	65,079,900	
7148	F P G	1,900	1,382	2,625,800	
8473	S B Iホールディングス	200,100	720	144,072,000	
8518	日本アジア投資	107,000	71	7,597,000	
8595	ジャフコ	21,500	3,065	65,897,500	
8601	大和証券グループ本社	1,559,000	487	759,233,000	
8604	野村ホールディングス	3,218,100	494	1,589,741,400	
8609	岡三証券グループ	134,000	453	60,702,000	
8613	丸三証券	48,100	583	28,042,300	
8614	東洋証券	59,000	229	13,511,000	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	181,000	414	74,934,000	
8617	光世証券	38,000	159	6,042,000	
8622	水戸証券	46,000	258	11,868,000	
8624	いちよし証券	35,200	668	23,513,600	
8628	松井証券	93,300	819	76,412,700	
8692	だいこう証券ビジネス	8,900	489	4,352,100	
8698	マネックスグループ	1,781	22,880	40,749,280	
8703	カブドットコム証券	64,200	407	26,129,400	
8706	極東証券	21,100	1,147	24,201,700	
8707	岩井コスモホールディングス	14,900	522	7,777,800	
8742	小林洋行	4,100	201	824,100	
8630	N K S Jホールディングス	349,700	1,879	657,086,300	
8725	M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	470,400	1,866	877,766,400	
8729	ソニーフィナンシャルホールディングス	150,800	1,576	237,660,800	
8750	第一生命保険	8,419	130,000	1,094,470,000	
8766	東京海上ホールディングス	609,700	2,666	1,625,460,200	
8795	T & Dホールディングス	540,000	1,101	594,540,000	
8253	クレディセゾン	137,800	1,995	274,911,000	
8423	アクリーティブ	87	13,880	1,207,560	
8424	芙蓉総合リース	15,000	3,045	45,675,000	
8425	興銀リース	23,700	2,428	57,543,600	
8439	東京センチュリーリース	37,000	1,970	72,890,000	
8511	日本証券金融	60,300	588	35,456,400	
8512	大阪証券金融	20,300	260	5,278,000	
8515	アイフル	131,250	644	84,525,000	
8519	ポケットカード	15,800	496	7,836,800	
8566	リコーリース	10,800	2,376	25,660,800	
8570	イオンクレジットサービス	57,300	1,839	105,374,700	
8572	アコム	31,620	2,360	74,623,200	
8584	ジャックス	87,000	446	38,802,000	
8585	オリエントコーポレーション	304,000	351	106,704,000	
8586	日立キャピタル	30,900	1,750	54,075,000	
8591	オリックス	81,910	9,400	769,954,000	
8593	三菱ＵＦＪリース	39,930	4,065	162,315,450	
8772	アサックス	27	121,300	3,275,100	
8793	N E Cキャピタルソリューション	6,400	1,341	8,582,400	
2353	日本駐車場開発	1,715	5,380	9,226,700	
3003	ヒューリック	203,900	570	116,223,000	
3225	東京建物不動産販売	8,200	362	2,968,400	
3228	三栄建築設計	3,900	836	3,260,400	
3231	野村不動産ホールディングス	75,500	1,633	123,291,500	
3258	常和ホールディングス	2,900	1,844	5,347,600	
3521	エコナックホールディングス	49,000	52	2,548,000	
4666	パーク２４	81,900	1,599	130,958,100	
8801	三井不動産	742,000	2,042	1,515,164,000	
8802	三菱地所	1,102,000	2,123	2,339,546,000	
8803	平和不動産	29,800	1,211	36,087,800	
8804	東京建物	300,000	425	127,500,000	
8806	ダイビル	40,500	825	33,412,500	
8815	東急不動産	343,000	637	218,491,000	
8818	京阪神ビルディング	20,600	500	10,300,000	
8830	住友不動産	377,000	2,707	1,020,539,000	
8833	東宝不動産	13,800	739	10,198,200	
8840	大京	243,000	241	58,563,000	

8841	デーオーシー	54,200	565	30,623,000	
8842	東京楽天地	26,000	376	9,776,000	
8848	レオパレス 2 1	126,200	322	40,636,400	
8860	フジ住宅	20,200	489	9,877,800	
8864	空港施設	19,100	451	8,614,100	
8869	明和地所	7,800	486	3,790,800	
8870	住友不動産販売	5,670	4,315	24,466,050	
8871	ゴールドクレスト	12,400	1,484	18,401,600	
8875	東栄住宅	10,700	1,384	14,808,800	
8877	日本エスリード	6,900	974	6,720,600	
8879	東急リバブル	16,600	1,397	23,190,200	
8880	飯田産業	14,900	1,196	17,820,400	
8881	日神不動産	9,300	556	5,170,800	
8895	アーネストワン	26,000	1,622	42,172,000	
8897	タカラレーベン	16,500	1,036	17,094,000	
8904	サンヨーハウジング名古屋	81	113,800	9,217,800	
8905	イオンモール	71,800	2,170	155,806,000	
8907	フージャースコーポレーション	210	74,200	15,582,000	
8915	タクトホーム	83	138,100	11,462,300	
8918	ランド	32,200	6	193,200	
8923	トーセイ	204	64,300	13,117,200	
8933	エヌ・ティ・ティ都市開発	978	88,800	86,846,400	
8934	サンフロンティア不動産	129	53,200	6,862,800	
8944	ランドビジネス	107	43,800	4,686,600	
8999	グランディハウス	3,400	823	2,798,200	
9706	日本空港ビルディング	54,400	960	52,224,000	
1954	日本工営	56,000	351	19,656,000	
2120	ネクスト	7,400	968	7,163,200	
2127	日本M & A センター	8,600	3,210	27,606,000	
2128	ノバレーゼ	42	56,300	2,364,600	
2131	アコーディア・ゴルフ	731	88,900	64,985,900	
2151	タケエイ	1,700	2,489	4,231,300	
2168	パソナグループ	166	47,850	7,943,100	
2170	リンクアンドモチベーション	67	40,150	2,690,050	
2174	G C A サヴィアングループ	7,400	1,012	7,488,800	
2175	エス・エム・エス	46	195,500	8,993,000	
2181	テンプホールディングス	22,700	1,208	27,421,600	
2193	クックパッド	3,200	2,940	9,408,000	
2196	エスクリ	3,400	830	2,822,000	
2301	学情	5,400	296	1,598,400	
2305	スタジオアリス	7,700	1,300	10,010,000	
2309	シミックホールディングス	6,300	1,358	8,555,400	
2322	N E C フィールディング	13,500	1,085	14,647,500	
2331	総合警備保障	60,600	1,240	75,144,000	
2371	カカコム	22,700	3,395	77,066,500	
2372	アイロムホールディングス	326	6,380	2,079,880	
2378	ルネサンス	7,400	692	5,120,800	
2395	新日本科学	10,300	389	4,006,700	
2398	ツクイ	7,400	1,848	13,675,200	
2413	エムスリー	393	152,100	59,775,300	
2418	ベストブライダル	48	85,500	4,104,000	
2432	ディー・エヌ・エー	82,200	2,840	233,448,000	
2433	博報堂 D Y ホールディングス	23,090	6,090	140,618,100	
2440	ぐるなび	11,600	994	11,530,400	
2450	一休	103	84,200	8,672,600	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	20	81,100	1,622,000	
2462	ジェイコムホールディングス	2,900	705	2,044,500	
2466	P G M ホールディングス	235	68,500	16,097,500	
2491	パリュウコマース	50	53,400	2,670,000	
2749	J P ホールディングス	5,000	1,099	5,495,000	
4282	イービーエス	99	260,800	25,819,200	
4301	アミューズ	5,100	1,996	10,179,600	
4310	ドリームインキュベータ	52	108,500	5,642,000	
4319	T A C	10,300	198	2,039,400	
4321	ケネディクス	1,588	25,160	39,954,080	

（単位：円）

コード	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄 名		単 価	金 額	
4324	電通	151,500	2,471	374,356,500	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	650	9,760	6,344,000	
4337	びあ	4,900	1,277	6,257,300	
4343	イオンファンタジー	5,400	1,372	7,408,800	
4346	ネクシィーズ	609	2,478	1,509,102	
4544	みらかホールディングス	43,500	3,810	165,735,000	
4641	アルプス技研	6,700	655	4,388,500	
4651	サニックス	24,200	334	8,082,800	
4653	ダイオーズ	3,000	556	1,668,000	
4658	日本空調サービス	4,100	803	3,292,300	
4661	オリエンタルランド	49,500	11,840	586,080,000	
4665	ダスキン	46,000	1,729	79,534,000	
4668	明光ネットワークジャパン	15,100	1,020	15,402,000	
4671	ファルコＳＤホールディングス	9,000	1,049	9,441,000	
4678	秀英予備校	3,000	353	1,059,000	
4679	田谷	2,500	721	1,802,500	
4680	ラウンドワン	52,000	530	27,560,000	
4681	リゾートトラスト	28,200	1,915	54,003,000	
4694	ビー・エム・エル	9,800	2,256	22,108,800	
4696	ワタベウェディング	4,900	702	3,439,800	
4708	もしもしホットライン	27,500	1,306	35,915,000	
4711	東急コミュニティー	4,300	3,375	14,512,500	
4714	リソー教育	1,690	7,150	12,083,500	
4724	ウェアハウス	2,800	220	616,000	
4732	ユー・エス・エス	18,620	9,810	182,662,200	
4745	東京個別指導学院	8,200	231	1,894,200	
4767	テー・オー・ダブリュー	5,500	528	2,904,000	
4801	セントラルスポーツ	5,100	1,480	7,548,000	
4848	フルキャストホールディングス	155	16,080	2,492,400	
5261	リゾートソリューション	14,000	190	2,660,000	
6054	リブセンス	1,300	3,830	4,979,000	
8876	リロ・ホールディング	5,700	3,320	18,924,000	
9603	エイチ・アイ・エス	13,600	3,115	42,364,000	
9616	共立メンテナンス	8,200	2,153	17,654,600	
9619	イチネンホールディングス	17,400	608	10,579,200	
9621	建設技術研究所	9,100	625	5,687,500	
9622	スペース	9,000	677	6,093,000	
9628	燦ホールディングス	3,600	1,308	4,708,800	
9632	スバル興業	12,000	337	4,044,000	
9633	東京テアトル	63,000	141	8,883,000	
9671	よみうりランド	33,000	454	14,982,000	
9672	東京都競馬	128,000	230	29,440,000	
9675	常磐興産	51,000	158	8,058,000	
9678	カナモト	20,000	1,372	27,440,000	
9681	東京ドーム	123,000	358	44,034,000	
9704	アゴラ・ホスピタリティー・グループ	69,000	49	3,381,000	
9715	トランス・コスモス	21,700	1,085	23,544,500	
9716	乃村工藝社	36,000	405	14,580,000	
9722	藤田観光	42,000	305	12,810,000	
9726	ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	52,000	138	7,176,000	
9728	日本管財	6,100	1,597	9,741,700	
9729	トーカイ	7,400	2,578	19,077,200	
9731	白洋舎	17,000	209	3,553,000	
9735	セコム	173,300	4,430	767,719,000	
9740	セントラル警備保障	7,300	839	6,124,700	
9743	丹青社	15,000	373	5,595,000	
9744	メイテック	25,800	2,218	57,224,400	
9747	アサツー ディ・ケイ	27,500	2,307	63,442,500	
9755	応用地質	17,500	1,079	18,882,500	
9757	船井総合研究所	17,000	568	9,656,000	
9760	進学会	8,000	321	2,568,000	
9783	ベネッセホールディングス	50,700	3,900	197,730,000	
9787	イオンディライト	16,100	1,715	27,611,500	
9788	ナック	3,700	2,447	9,053,900	
9792	ニチイ学館	32,500	767	24,927,500	
9793	ダイセキ	24,600	1,324	32,570,400	

9795	ステップ	5,000	730	3,650,000	
	合 計	246,966,171	—	200,732,168,432	

（注）備考欄の数値は、差入委託証拠金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

貸付有価証券一覧表
(株式)

銘 柄		株式数	
コード	銘 柄 名		
1301	極洋	52,000	(52,000)
1332	日本水産	141,300	(141,300)
1334	マルハニチロホールディングス	224,000	(224,000)
1379	ホクト	11,600	(11,600)
1414	ショーボンドホールディングス	10,900	(10,900)
1606	日本海洋掘削	2,800	(2,800)
1720	東急建設	43,530	(43,530)
1762	高松コンストラクショングループ	1,900	(1,900)
1801	大成建設	581,000	(581,000)
1803	清水建設	349,000	(349,000)
1813	不動テトラ	86,600	(86,600)
1814	大末建設	4,000	(4,000)
1833	奥村組	107,000	(107,000)
1835	東鉄工業	15,000	(15,000)
1852	浅沼組	24,000	(24,000)
1860	戸田建設	133,000	(133,000)
1867	植木組	10,000	(10,000)
1871	ピーエス三菱	8,000	(8,000)
1896	大林道路	14,000	(14,000)
1899	福田組	11,000	(11,000)
1921	巴コーポレーション	3,900	(3,900)
1926	ライト工業	25,600	(25,600)
1929	日特建設	9,800	(9,800)
1954	日本工営	6,000	(6,000)
1964	中外炉工業	42,000	(42,000)
1978	アタカ大機	8,000	(8,000)
2003	日東富士製粉	5,000	(5,000)
2009	鳥越製粉	10,500	(10,500)
2056	日本配合飼料	15,000	(15,000)
2120	ネクスト	600	(600)
2127	日本M & A センター	200	(200)
2168	パソナグループ	50	(50)
2181	テンプホールディングス	14,500	(14,500)
2204	中村屋	27,000	(27,000)
2206	江崎グリコ	39,000	(39,000)
2207	名糖産業	5,000	(5,000)
2211	不二家	67,000	(67,000)
2212	山崎製パン	2,000	(2,000)
2215	第一屋製パン	17,000	(17,000)
2220	亀田製菓	700	(700)
2284	伊藤ハム	62,000	(62,000)
2286	林兼産業	40,000	(40,000)
2309	シミックホールディングス	4,000	(4,000)
2372	アイロムホールディングス	207	(207)
2395	新日本科学	2,800	(2,800)
2413	エムスリー	318	(318)
2466	P G Mホールディングス	60	(60)
2501	サッポロホールディングス	44,000	(44,000)
2531	宝ホールディングス	104,000	(104,000)
2540	養命酒製造	3,000	(3,000)
2651	ローソン	38,100	(38,100)
2678	アスクル	4,700	(4,700)
2681	ゲオホールディングス	199	(199)
2685	ポイント	9,710	(9,710)
2730	エディオン	43,500	(43,500)
2733	あらた	17,000	(17,000)
2734	サーラコーポレーション	100	(100)
2737	トーマンデバイス	600	(600)
2760	東京エレクトロン デバイス	20	(20)
2768	双日	101,600	(101,600)
2772	ゲンキー	1,000	(1,000)
2791	大黒天物産	1,700	(1,700)
2792	ハニーズ	8,830	(8,830)
2801	キッコーマン	107,000	(107,000)
2811	カゴメ	40,800	(40,800)
2897	日清食品ホールディングス	44,600	(44,600)

2899	永谷園	6,000	(6,000)
2922	なとり	100	(100)
3002	グンゼ	71,000	(71,000)
3048	ビックカメラ	382	(382)
3050	D C Mホールディングス	54,200	(54,200)
3088	マツモトキヨシホールディングス	20,000	(20,000)
3097	物語コーポレーション	900	(900)
3103	ユニチカ	292,000	(292,000)
3107	ダイワボウホールディングス	94,000	(94,000)
3109	シキボウ	74,000	(74,000)
3110	日東紡績	13,000	(13,000)
3116	トヨタ紡織	38,300	(38,300)
3153	八洲電機	2,300	(2,300)
3205	ダイドーリミテッド	5,700	(5,700)
3258	常和ホールディングス	1,900	(1,900)
3333	あさひ	5,800	(5,800)
3341	日本調剤	1,220	(1,220)
3349	コスモス薬品	4,900	(4,900)
3398	クスリのアオキ	1,500	(1,500)
3401	帝人	469,000	(469,000)
3402	東レ	548,000	(548,000)
3524	日東製網	15,000	(15,000)
3529	アツギ	90,000	(90,000)
3608	T S Iホールディングス	8,600	(8,600)
3620	デジタルハーツ	1,900	(1,900)
3639	ボルテージ	1,300	(1,300)
3708	特種東海製紙	52,000	(52,000)
3715	ダウンゴ	41	(41)
3738	ティーガイア	12,500	(12,500)
3769	G M Oペイメントゲートウェイ	300	(300)
3861	王子ホールディングス	472,000	(472,000)
3864	三菱製紙	163,000	(163,000)
3878	巴川製紙所	7,000	(7,000)
3880	大王製紙	48,000	(48,000)
4005	住友化学	496,000	(496,000)
4007	日本化成	22,000	(22,000)
4022	ラサ工業	47,000	(47,000)
4028	石原産業	179,000	(179,000)
4047	関東電化工業	26,000	(26,000)
4062	イビデン	76,900	(76,900)
4091	太陽日酸	178,000	(178,000)
4095	日本バーカライジング	3,000	(3,000)
4100	戸田工業	16,000	(16,000)
4182	三菱瓦斯化学	118,000	(118,000)
4183	三井化学	453,000	(453,000)
4216	旭有機材工業	22,000	(22,000)
4217	日立化成	49,600	(49,600)
4307	野村総合研究所	56,900	(56,900)
4319	T A C	1,100	(1,100)
4324	電通	113,400	(113,400)
4340	シンプレクス・ホールディングス	187	(187)
4346	ネクシィーズ	75	(75)
4350	メディカルシステムネットワーク	6,400	(6,400)
4404	ミヨシ油脂	39,000	(39,000)
4471	三洋化成工業	15,000	(15,000)
4512	わかもと製薬	3,000	(3,000)
4523	エーザイ	119,300	(119,300)
4530	久光製薬	35,600	(35,600)
4534	持田製薬	26,000	(26,000)
4540	ツムラ	8,200	(8,200)
4541	日医工	17,300	(17,300)
4548	生化学工業	21,900	(21,900)
4549	栄研化学	7,500	(7,500)
4553	東和薬品	5,500	(5,500)
4555	沢井製薬	7,500	(7,500)
4578	大塚ホールディングス	85,400	(85,400)
4611	大日本塗料	11,000	(11,000)
4613	関西ペイント	130,000	(130,000)
4626	太陽ホールディングス	8,100	(8,100)

4666	パーク 2 4	19,800	(19,800)
4689	ヤフー	7,367	(7,367)
4704	トレンドマイクロ	52,500	(52,500)
4714	リソー教育	1,173	(1,173)
4779	ソフトブレーン	55	(55)
4799	アグレックス	800	(800)
4825	ウェザーニューズ	2,900	(2,900)
4848	フルキャストホールディングス	59	(59)
4911	資生堂	60,300	(60,300)
4912	ライオン	132,000	(132,000)
4921	ファンケル	25,700	(25,700)
4922	コーセー	1,600	(1,600)
4924	ドクターシーラボ	77	(77)
4967	小林製薬	1,500	(1,500)
4973	日本高純度化学	4	(4)
4985	アース製薬	8,900	(8,900)
4989	イハラケミカル工業	10,000	(10,000)
4994	大成ラミック	1,000	(1,000)
5007	コスモ石油	3,000	(3,000)
5018	M O R E S C O	400	(400)
5122	オカモト	4,000	(4,000)
5191	東海ゴム工業	21,200	(21,200)
5192	三ツ星ベルト	27,000	(27,000)
5201	旭硝子	210,000	(210,000)
5202	日本板硝子	486,000	(486,000)
5214	日本電気硝子	196,000	(196,000)
5234	デイ・シイ	3,700	(3,700)
5302	日本カーボン	56,000	(56,000)
5310	東洋炭素	5,600	(5,600)
5333	日本碍子	35,000	(35,000)
5334	日本特殊陶業	101,000	(101,000)
5344	M A R U W A	2,300	(2,300)
5391	エーアンドエーマテリアル	23,000	(23,000)
5406	神戸製鋼所	591,000	(591,000)
5413	日新製鋼ホールディングス	48,400	(48,400)
5440	共英製鋼	10,900	(10,900)
5444	大和工業	22,500	(22,500)
5480	日本冶金工業	58,000	(58,000)
5481	山陽特殊製鋼	57,000	(57,000)
5541	大平洋金属	79,000	(79,000)
5563	日本電工	45,000	(45,000)
5602	栗本鐵工所	24,000	(24,000)
5702	大紀アルミニウム工業所	17,000	(17,000)
5707	東邦亜鉛	60,000	(60,000)
5727	東邦チタニウム	18,600	(18,600)
5801	古河電気工業	70,000	(70,000)
5805	昭和電線ホールディングス	132,000	(132,000)
5812	日立電線	9,000	(9,000)
5819	カナレ電気	400	(400)
5851	リョービ	69,000	(69,000)
5857	アサヒホールディングス	16,100	(16,100)
5912	日本橋梁	7,750	(7,750)
5915	駒井ハルテック	23,000	(23,000)
5923	高田機工	7,000	(7,000)
5947	リンナイ	17,200	(17,200)
5951	ダイニチ工業	2,400	(2,400)
5959	岡部	22,700	(22,700)
5981	東京製綱	83,000	(83,000)
6135	牧野フライス製作所	53,000	(53,000)
6140	旭ダイヤモンド工業	28,000	(28,000)
6141	森精機製作所	56,200	(56,200)
6151	日東工器	5,000	(5,000)
6222	島精機製作所	13,900	(13,900)
6268	ナブテスコ	52,800	(52,800)
6269	三井海洋開発	8,800	(8,800)
6273	S M C	8,200	(8,200)
6274	新川	10,200	(10,200)
6287	サトーホールディングス	11,900	(11,900)
6306	日工	6,000	(6,000)

6309	巴工業	1,800	(1,800)
6317	北川鉄工所	4,000	(4,000)
6328	荏原実業	2,800	(2,800)
6331	三菱化工機	16,000	(16,000)
6340	澁谷工業	5,900	(5,900)
6355	住友精密工業	4,000	(4,000)
6363	西島製作所	12,300	(12,300)
6367	ダイキン工業	139,100	(139,100)
6368	オルガノ	4,000	(4,000)
6369	トーヨーカネツ	71,000	(71,000)
6375	日本コンベヤ	40,000	(40,000)
6390	加藤製作所	24,000	(24,000)
6417	SANKYO	30,900	(30,900)
6418	日本金銭機械	3,600	(3,600)
6440	JUKI	65,000	(65,000)
6444	サンデン	62,000	(62,000)
6445	蛇の目ミシン工業	107,000	(107,000)
6448	ブラザー工業	132,000	(132,000)
6454	マックス	4,000	(4,000)
6461	日本ビストンリング	44,000	(44,000)
6470	大豊工業	8,600	(8,600)
6472	NTN	226,000	(226,000)
6474	不二越	33,000	(33,000)
6479	ミネベア	163,000	(163,000)
6480	日本トムソン	35,000	(35,000)
6482	ユーシン精機	5,100	(5,100)
6486	イーグル工業	14,000	(14,000)
6504	富士電機	307,000	(307,000)
6505	東洋電機製造	20,000	(20,000)
6506	安川電機	3,000	(3,000)
6507	シンフォニアテクノロジー	66,000	(66,000)
6513	オリジン電気	10,000	(10,000)
6581	日立工機	15,100	(15,100)
6586	マキタ	100	(100)
6622	ダイヘン	58,000	(58,000)
6652	IDEC	14,300	(14,300)
6676	メルコホールディングス	6,400	(6,400)
6707	サンケン電気	64,000	(64,000)
6723	ルネサスエレクトロニクス	22,400	(22,400)
6724	セイコーエプソン	82,900	(82,900)
6731	ピクセラ	4,200	(4,200)
6742	京三製作所	26,000	(26,000)
6745	ホーチキ	7,000	(7,000)
6751	日本無線	22,000	(22,000)
6753	シャープ	528,000	(528,000)
6758	ソニー	200,300	(200,300)
6762	TDK	57,400	(57,400)
6763	帝国通信工業	13,000	(13,000)
6768	タムラ製作所	33,000	(33,000)
6773	パイオニア	96,500	(96,500)
6779	日本電波工業	8,500	(8,500)
6794	フォスター電機	300	(300)
6798	SMK	32,000	(32,000)
6803	ティアック	16,000	(16,000)
6806	ヒロセ電機	19,100	(19,100)
6815	ユニデン	32,000	(32,000)
6820	アイコム	5,700	(5,700)
6844	新電元工業	38,000	(38,000)
6857	アドバンテスト	74,600	(74,600)
6869	シスメックス	1,800	(1,800)
6905	コーセル	14,800	(14,800)
6929	日本セラミック	8,100	(8,100)
6963	ローム	54,800	(54,800)
6965	浜松ホトニクス	39,800	(39,800)
6981	村田製作所	122,500	(122,500)
6985	ユーシン	13,600	(13,600)
6996	ニチコン	34,400	(34,400)
6997	日本ケミコン	59,000	(59,000)
6999	KOA	15,200	(15,200)

7007	佐世保重工業	67,000	(67,000)
7012	川崎重工業	16,000	(16,000)
7102	日本車輛製造	37,000	(37,000)
7122	近畿車輛	19,000	(19,000)
7150	島根銀行	200	(200)
7211	三菱自動車工業	2,446,000	(2,446,000)
7220	武蔵精密工業	10,900	(10,900)
7241	フタバ産業	31,000	(31,000)
7244	市光工業	2,000	(2,000)
7245	大同メタル工業	18,000	(18,000)
7250	太平洋工業	15,000	(15,000)
7251	ケーヒン	25,100	(25,100)
7261	マツダ	227,000	(227,000)
7262	ダイハツ工業	116,000	(116,000)
7272	ヤマハ発動機	159,200	(159,200)
7278	エクセディ	13,900	(13,900)
7296	エフ・シー・シー	16,700	(16,700)
7309	シマノ	24,000	(24,000)
7312	タカタ	19,500	(19,500)
7421	カップバ・クリエイトホールディングス	4,100	(4,100)
7427	エコートレーディング	1,800	(1,800)
7442	中山福	1,500	(1,500)
7482	シモジマ	6,300	(6,300)
7483	ドウシシャ	5,600	(5,600)
7513	コジマ	14,400	(14,400)
7518	ネットワンシステムズ	100	(100)
7554	幸楽苑	2,300	(2,300)
7599	ガリバーインターナショナル	3,380	(3,380)
7619	田中商事	3,300	(3,300)
7630	壱番屋	4,000	(4,000)
7709	クボテック	22	(22)
7718	スター精密	20,800	(20,800)
7730	マニー	3,100	(3,100)
7731	ニコン	44,000	(44,000)
7732	トプコン	22,000	(22,000)
7735	大日本スクリーン製造	121,000	(121,000)
7752	リコー	325,000	(325,000)
7819	S H O - B I	2,100	(2,100)
7825	ダンロップスポーツ	7,000	(7,000)
7840	フランスベッドホールディングス	74,000	(74,000)
7846	パイロットコーポレーション	58	(58)
7867	タカラトミー	33,500	(33,500)
7874	レック	200	(200)
7897	ホクシン	8,600	(8,600)
7908	きもと	9,500	(9,500)
7911	凸版印刷	2,000	(2,000)
7912	大日本印刷	333,000	(333,000)
7917	藤森工業	8,200	(8,200)
7936	アシックス	109,000	(109,000)
7942	J S P	7,400	(7,400)
7947	エフビコ	100	(100)
7951	ヤマハ	87,200	(87,200)
7988	ニフコ	8,300	(8,300)
7995	日本バルカー工業	43,000	(43,000)
7999	M U T O Hホールディングス	14,000	(14,000)
8013	ナイガイ	11,000	(11,000)
8016	オンワードホールディングス	77,000	(77,000)
8018	三共生興	9,500	(9,500)
8020	兼松	230,000	(230,000)
8032	日本紙バルブ商事	46,000	(46,000)
8043	スターゼン	23,000	(23,000)
8050	セイコーホールディングス	65,000	(65,000)
8074	ユアサ商事	118,000	(118,000)
8086	ニプロ	54,200	(54,200)
8088	岩谷産業	60,000	(60,000)
8111	ゴールドウイン	14,000	(14,000)
8131	ミツウロコグループホールディングス	3,400	(3,400)
8132	シナネン	4,000	(4,000)
8136	サンリオ	29,900	(29,900)

8137	サンワテクノス	2,800	(2,800)
8153	モスフードサービス	15,200	(15,200)
8154	加賀電子	9,200	(9,200)
8160	木曽路	12,300	(12,300)
8165	千趣会	19,400	(19,400)
8168	ケーヨー	22,200	(22,200)
8170	アデランス	12,800	(12,800)
8173	上新電機	5,000	(5,000)
8174	日本瓦斯	2,000	(2,000)
8175	ベスト電器	9,500	(9,500)
8178	マルエツ	7,000	(7,000)
8182	いなげや	12,000	(12,000)
8185	チヨダ	10,600	(10,600)
8194	ライフコーポレーション	6,500	(6,500)
8218	コメリ	8,300	(8,300)
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	65,000	(65,000)
8248	ニッセンホールディングス	19,300	(19,300)
8255	原信ナルスホールディングス	500	(500)
8267	イオン	3,000	(3,000)
8278	フジ	11,500	(11,500)
8281	ゼビオ	13,100	(13,100)
8282	ケーズホールディングス	25,100	(25,100)
8283	P a l t a c	11,700	(11,700)
8291	日産東京販売ホールディングス	19,000	(19,000)
8304	あおぞら銀行	392,000	(392,000)
8339	東京都民銀行	20,400	(20,400)
8344	山形銀行	48,000	(48,000)
8345	岩手銀行	7,300	(7,300)
8358	スルガ銀行	98,000	(98,000)
8366	滋賀銀行	12,000	(12,000)
8369	京都銀行	154,000	(154,000)
8379	広島銀行	202,000	(202,000)
8382	中国銀行	44,000	(44,000)
8397	沖縄銀行	3,500	(3,500)
8411	みずほフィナンシャルグループ	100	(100)
8473	S B Iホールディングス	107,000	(107,000)
8511	日本証券金融	41,400	(41,400)
8512	大阪証券金融	5,300	(5,300)
8515	アイフル	87,700	(87,700)
8519	ポケットカード	10,600	(10,600)
8530	中京銀行	13,000	(13,000)
8537	大光銀行	4,000	(4,000)
8545	関西アーバン銀行	151,000	(151,000)
8562	福島銀行	94,000	(94,000)
8570	イオンクレジットサービス	48,000	(48,000)
8572	アコム	24,580	(24,580)
8595	ジャフコ	13,700	(13,700)
8601	大和証券グループ本社	490,000	(490,000)
8613	丸三証券	35,800	(35,800)
8614	東洋証券	41,000	(41,000)
8617	光世証券	20,000	(20,000)
8622	水戸証券	35,000	(35,000)
8624	いちよし証券	24,200	(24,200)
8630	N K S Jホールディングス	89,900	(89,900)
8698	マネックスグループ	1,138	(1,138)
8703	カブドットコム証券	14,000	(14,000)
8714	池田泉州ホールディングス	83,000	(83,000)
8806	ダイビル	28,400	(28,400)
8830	住友不動産	275,000	(275,000)
8841	テーオーシー	41,900	(41,900)
8848	レオパレス 2 1	49,600	(49,600)
8864	空港施設	4,100	(4,100)
8869	明和地所	2,600	(2,600)
8871	ゴールドクレスト	5,200	(5,200)
8876	リロ・ホールディング	2,000	(2,000)
8879	東急リパブル	9,400	(9,400)
8934	サンフロンティア不動産	101	(101)
8944	ランドビジネス	38	(38)
9003	相鉄ホールディングス	145,000	(145,000)

9006	京浜急行電鉄	281,000	(281,000)
9007	小田急電鉄	350,000	(350,000)
9008	京王電鉄	1,000	(1,000)
9010	富士急行	30,000	(30,000)
9044	南海電気鉄道	229,000	(229,000)
9045	京阪電気鉄道	143,000	(143,000)
9048	名古屋鉄道	383,000	(383,000)
9075	福山通運	57,000	(57,000)
9086	日立物流	22,800	(22,800)
9101	日本郵船	807,000	(807,000)
9104	商船三井	381,000	(381,000)
9113	乾汽船	8,900	(8,900)
9119	飯野海運	52,800	(52,800)
9375	近鉄エクスプレス	9,800	(9,800)
9401	東京放送ホールディングス	61,500	(61,500)
9470	学研ホールディングス	30,000	(30,000)
9477	角川グループホールディングス	6,300	(6,300)
9501	東京電力	489,600	(489,600)
9503	関西電力	161,000	(161,000)
9504	中国電力	96,000	(96,000)
9505	北陸電力	24,700	(24,700)
9507	四国電力	113,300	(113,300)
9508	九州電力	8,800	(8,800)
9509	北海道電力	102,400	(102,400)
9533	東邦瓦斯	285,000	(285,000)
9601	松竹	66,000	(66,000)
9627	アインファーマシーズ	5,600	(5,600)
9633	東京テアトル	41,000	(41,000)
9672	東京都競馬	74,000	(74,000)
9675	常磐興産	32,000	(32,000)
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,500	(36,500)
9697	カプコン	23,000	(23,000)
9722	藤田観光	33,000	(33,000)
9747	アサツー ディ・ケイ	23,000	(23,000)
9766	コナミ	49,800	(49,800)
9787	イオンディライト	11,300	(11,300)
9788	ナック	2,900	(2,900)
9793	ダイセキ	16,900	(16,900)
9828	元気寿司	200	(200)
9831	ヤマダ電機	52,430	(52,430)
9843	ニトリホールディングス	23,350	(23,350)
9854	愛眼	1,100	(1,100)
9887	松屋フーズ	5,200	(5,200)
9945	プレナス	13,600	(13,600)
9962	ミスミグループ本社	13,100	(13,100)
9972	アルテック	4,700	(4,700)
9989	サンドラッグ	20,600	(20,600)
9994	やまや	1,600	(1,600)
合 計		27,865,911	(27,865,911)

（注）貸付株式の（ ）内は、委託者の利害関係人であるモルガン・スタンレーＭＵＦＧ証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

（２）株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第２ 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,103,723,955	317,465,780
コール・ローン	240,705,766	312,264,272
株式	140,598,452,842	163,526,479,317
投資証券	2,838,231,659	3,782,024,296
派生商品評価勘定	116,572,712	28,792,271
未収入金	15,142,201	1,273,613,144
未収配当金	157,821,977	162,976,167
未収利息	555	819
差入委託証拠金	1,196,501,235	788,338,604
流動資産合計	146,267,152,902	170,191,954,670
資産合計	146,267,152,902	170,191,954,670
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	300,240
未払解約金	154,589,777	281,352,688
流動負債合計	154,589,777	281,652,928
負債合計	154,589,777	281,652,928
純資産の部		
元本等		
元本	152,966,217,901	130,314,013,541
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	6,853,654,776	39,596,288,201
元本等合計	146,112,563,125	169,910,301,742
純資産合計	146,112,563,125	169,910,301,742
負債純資産合計	146,267,152,902	170,191,954,670

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(2) 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	株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	160,631,176,540円	152,966,217,901円
期首からの追加設定元本額	7,824,298,221円	13,892,253,884円
期首からの一部解約元本額	15,489,256,860円	36,544,458,244円
元本の内訳＊		
ファンド・マネジャー（海外株式）	395,154,854円	38,411,836円
e M A X I S 先進国株式インデックス	6,843,380,397円	7,349,584,806円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	14,597,580円	84,916,884円
e M A X I S バランス（波乗り型）	7,788,874円	19,270,810円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,331,229,001円	1,499,942,798円
e M A X I S 全世界株式インデックス	909,297,717円	1,129,171,481円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,122,058,304円	46,305,295,275円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	39,452,589,454円	30,523,985,791円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	1,134,750,555円	863,771,127円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	7,419,043,560円	5,931,153,773円
M U A M 外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	7,564,059,426円	6,752,005,577円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	925,851,386円	764,785,597円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	630,286,271円	487,917,822円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,345,334,335円	4,112,438,026円
M S C I コクサイインデックスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	2,083,256,017円	1,743,323,566円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,344,882円	23,775,854円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	5,792,069,515円	5,805,181,219円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンド	2,590,536,930円	2,485,272,027円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	72,088,548円	44,784,745円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	185,270,735円	133,585,723円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	263,581,280円	200,683,389円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	336,615,868円	239,515,902円
三菱ＵＦＪ 外国株式インデックスファンドＶＡ	2,912,661,401円	2,434,162,777円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	356,695,992円	260,775,431円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	2,608,846,212円	2,087,096,357円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	677,534,675円	513,289,360円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	2,969,919,359円	2,470,816,153円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>外国株式インデックスファンド	2,742,334,817円	3,146,261,813円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	361,940,449円	292,250,258円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	1,272,085,497円	1,097,814,399円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	954,526,538円	858,261,533円
三菱ＵＦＪ <ＤＣ>インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	665,487,472円	614,511,432円
（合 計）	152,966,217,901円	130,314,013,541円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	6,853,654,776円	—
3 受益権の総数	152,966,217,901口	130,314,013,541口
4 １口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.9552円 （ 9,552円 ）	1.3039円 （ 13,039円 ）

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,366,907,894	19,306,743,255
投資証券	48,244,821	334,085,241
合 計	4,318,663,073	19,640,828,496

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

区 分	種 類	[平成24年1月26日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,212,406,664	—	2,328,955,426
	合 計	2,212,406,664	—	2,328,955,426

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]		
		契 約 額 等 (円)	時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
		うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,018,522,832	—	2,047,285,693
	合 計	2,018,522,832	—	2,047,285,693

（注）時価の算定方法

- 1 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

区 分	種 類	[平成24年1月26日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	101,112,700	—	101,101,000	11,700
	イギリスポンド	18,263,100	—	18,262,500	600
	スイスフラン	16,862,400	—	16,862,000	400
	香港ドル	25,050,000	—	25,050,000	—
	スウェーデンクローネ	17,306,250	—	17,295,000	11,250
	合 計	178,594,450	—	178,570,500	23,950

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカドル	282,097,370	—	282,162,000	64,630
	カナダドル	22,581,250	—	22,580,000	1,250
	オーストラリアドル	18,964,400	—	18,964,000	400
	イギリスポンド	57,374,250	—	57,440,000	65,750
	スイスフラン	19,632,000	—	19,632,000	—
	香港ドル	11,739,900	—	11,740,000	100
	ユーロ	91,725,500	—	91,867,500	142,000
	合 計	504,114,670	—	504,385,500	270,830

(注) 時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。
 （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

（単位：円）

通 貨		株式数	評 価 額		備 考
	銘 柄		単 価	金 額	
アメリカドル					
	3M CO	48,800	100.590000	4,908,792.00	
	ABBOTT LABORATORIES	117,300	32.790000	3,846,267.00	
	ABBVIE INC	117,100	37.600000	4,402,960.00	
	ACCENTURE PLC-CL A	47,400	72.210000	3,422,754.00	
	ACE LTD	25,400	85.340000	2,167,636.00	
	ACTAVIS INC	9,500	84.270000	800,565.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	33,300	11.390000	379,287.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	36,793	38.320000	1,409,907.76	
	ADT CORP/THE	16,900	47.180000	797,342.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	5,300	75.250000	398,825.00	
	AES CORP	49,100	11.090000	544,519.00	
	AETNA INC	25,000	49.760000	1,244,000.00	
	AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,900	144.930000	565,227.00	
	AFLAC INC	34,700	53.480000	1,855,756.00	
	AGCO CORP	7,200	53.540000	385,488.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,666	45.290000	1,162,413.14	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,900	88.360000	1,404,924.00	
	AIRGAS INC	4,800	93.220000	447,456.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,382	41.150000	550,669.30	
	ALBEMARLE CORP	6,500	62.430000	405,795.00	
	ALCOA INC	78,400	9.030000	707,952.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	14,511	94.680000	1,373,901.48	
	ALLEGHANY CORP	1,000	356.970000	356,970.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,800	30.290000	236,262.00	
	ALLERGAN INC	23,009	107.210000	2,466,794.89	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,700	158.050000	584,785.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	8,300	45.800000	380,140.00	
	ALLSTATE CORP	36,100	43.910000	1,585,151.00	
	ALTERA CORP	23,400	33.515000	784,251.00	
	ALTRIA GROUP INC	151,700	33.450000	5,074,365.00	
	AMAZON.COM INC	27,000	283.990000	7,667,730.00	
	AMEREN CORPORATION	18,100	32.170000	582,277.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,600	44.460000	1,627,236.00	
	AMERICAN EXPRESS CO	76,300	59.500000	4,539,850.00	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	104,300	36.700000	3,827,810.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,700	37.400000	512,380.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,500	67.380000	1,044,390.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	18,700	45.030000	842,061.00	
	AMETEK INC	17,800	41.070000	731,046.00	
	AMGEN INC	57,400	83.420000	4,788,308.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	11,900	67.700000	805,630.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	37,300	81.000000	3,021,300.00	
	ANALOG DEVICES INC	22,600	43.800000	989,880.00	
	ANSYS INC	6,800	73.520000	499,936.00	
	AON PLC	22,862	57.620000	1,317,308.44	
	APACHE CORP	29,320	84.150000	2,467,278.00	
	APPLE INC	69,900	439.880000	30,747,612.00	
	APPLIED MATERIALS INC	91,942	12.830000	1,179,615.86	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,100	45.320000	457,732.00	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,700	28.970000	1,410,839.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	7,900	39.470000	311,813.00	
	ASSURANT INC	5,600	38.620000	216,272.00	
	AT&T INC	429,800	34.020000	14,621,796.00	
	AUTODESK INC	16,700	38.990000	651,133.00	
	AUTOLIV INC	6,900	66.590000	459,471.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,700	59.890000	2,138,073.00	
	AUTOZONE INC	2,500	365.360000	913,400.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	18,300	34.160000	625,128.00	
	AVERY DENNISON CORP	8,000	36.000000	288,000.00	
	AVNET INC	10,700	35.460000	379,422.00	

AVON PRODUCTS INC	32,900	16.680000	548,772.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,700	38.160000	331,992.00
BAKER HUGHES INC	33,000	45.610000	1,505,130.00
BALL CORP	11,100	46.610000	517,371.00
BANK OF AMERICA CORP	803,400	11.620000	9,335,508.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	88,200	27.080000	2,388,456.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,600	68.000000	2,760,800.00
BB&T CORP	52,100	30.870000	1,608,327.00
BEAM INC	10,800	61.980000	669,384.00
BECTON DICKINSON AND CO	15,100	84.590000	1,277,309.00
BED BATH & BEYOND INC	17,200	59.780000	1,028,216.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	68,800	97.390000	6,700,432.00
BEST BUY CO INC	20,600	15.780000	325,068.00
BIOGEN IDEC INC	16,765	146.200000	2,451,043.00
BLACKROCK INC	10,000	236.420000	2,364,200.00
BMC SOFTWARE INC	11,700	44.500000	520,650.00
BOEING CO/THE	53,300	75.030000	3,999,099.00
BORGWARNER INC	8,600	77.290000	664,694.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	104,700	6.860000	718,242.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	125,200	36.690000	4,593,588.00
BROADCOM CORP-CL A	38,100	34.250000	1,304,925.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,000	65.090000	585,810.00
BUNGE LTD	10,800	78.380000	846,504.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,900	67.190000	799,561.00
CA INC	24,300	25.050000	608,715.00
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	14,800	15.200000	224,960.00
CABOT OIL & GAS CORP	15,700	52.850000	829,745.00
CALPINE CORP	22,400	19.140000	428,736.00
CAMERON INTERNATIONAL CORP	18,500	60.720000	1,123,320.00
CAMPBELL SOUP CO	13,900	36.530000	507,767.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,300	56.320000	2,438,656.00
CARDINAL HEALTH INC	25,500	44.900000	1,144,950.00
CAREFUSION CORP	16,300	31.440000	512,472.00
CARMAX INC	17,407	39.690000	690,883.83
CARNIVAL CORP	33,100	39.120000	1,294,872.00
CATERPILLAR INC	48,800	95.580000	4,664,304.00
CBRE GROUP INC - A	22,700	21.840000	495,768.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	44,300	42.190000	1,869,017.00
CELANESE CORP-SERIES A	11,600	46.970000	544,852.00
CELGENE CORP	32,000	99.760000	3,192,320.00
CENTERPOINT ENERGY INC	30,100	20.330000	611,933.00
CENTURYLINK INC	46,800	40.130000	1,878,084.00
CERNER CORP	10,800	83.380000	900,504.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,700	230.280000	1,082,316.00
CHARTER COMMUNICATION-A	3,000	80.680000	242,040.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	49,600	19.360000	960,256.00
CHEVRON CORP	146,400	116.200000	17,011,680.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,400	303.480000	728,352.00
CHUBB CORP	19,700	81.010000	1,595,897.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,200	57.150000	582,930.00
CIGNA CORP	21,500	58.480000	1,257,320.00
CIMAREX ENERGY CO	6,200	64.000000	396,800.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,400	42.780000	487,692.00
CINTAS CORP	8,300	42.510000	352,833.00
CISCO SYSTEMS INC	399,600	21.150000	8,451,540.00
CIT GROUP INC	14,100	40.710000	574,011.00
CITIGROUP INC	218,700	42.910000	9,384,417.00
CITRIX SYSTEMS INC	14,100	71.550000	1,008,855.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,900	35.710000	389,239.00
CLOROX COMPANY	9,000	77.540000	697,860.00
CME GROUP INC	23,200	57.700000	1,338,640.00
CMS ENERGY CORP	20,000	25.230000	504,600.00
COACH INC	21,100	51.210000	1,080,531.00
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,000	24.470000	415,990.00
COCA-COLA CO/THE	302,500	37.050000	11,207,625.00
COCA-COLA ENTERPRISES	21,800	34.480000	751,664.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,100	77.630000	1,715,623.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	35,463	110.150000	3,906,249.45
COMCAST CORP-CLASS A	157,900	39.760000	6,278,104.00

COMCAST CORP-SPECIAL CL A	42,900	38.310000	1,643,499.00	
COMERICA INC	15,000	33.710000	505,650.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	11,700	42.440000	496,548.00	
CONAGRA FOODS INC	30,300	32.330000	979,599.00	
CONCHO RESOURCES INC	7,300	91.900000	670,870.00	
CONOCOPHILLIPS	86,000	61.060000	5,251,160.00	
CONSOL ENERGY INC	17,100	32.080000	548,568.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,858	56.510000	1,235,195.58	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	38.500000	427,350.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,500	82.570000	288,995.00	
CORE LABORATORIES N.V.	3,500	118.740000	415,590.00	
CORNING INC	110,200	12.240000	1,348,848.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,200	102.360000	3,295,992.00	
COVENTRY HEALTH CARE INC	9,700	46.390000	449,983.00	
COVIDIEN PLC	36,000	62.280000	2,242,080.00	
CR BARD INC	5,900	103.440000	610,296.00	
CREE INC	7,900	41.970000	331,563.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	21,700	73.450000	1,593,865.00	
CROWN HOLDINGS INC	10,900	38.190000	416,271.00	
CSX CORP	77,300	22.240000	1,719,152.00	
CUMMINS INC	13,400	116.980000	1,567,532.00	
CVS CAREMARK CORP	94,600	51.860000	4,905,956.00	
DANAHER CORP	43,900	60.540000	2,657,706.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,900	45.870000	454,113.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS I	7,500	114.530000	858,975.00	
DEERE & CO	27,880	93.470000	2,605,943.60	
DELL INC	110,400	13.160000	1,452,864.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,000	39.270000	903,210.00	
DELTA AIR LINES INC	17,300	14.170000	245,141.00	
DENBURY RESOURCES INC	29,539	18.500000	546,471.50	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	11,000	42.330000	465,630.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	28,900	54.980000	1,588,922.00	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,400	74.660000	403,164.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,500	48.820000	366,150.00	
DIRECTV	47,077	53.650000	2,525,681.05	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,400	39.090000	1,501,056.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,800	69.000000	745,200.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6,800	62.800000	427,040.00	
DISH NETWORK CORP-A	15,700	37.730000	592,361.00	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,500	31.320000	109,620.00	
DOLLAR GENERAL CORP	19,600	46.840000	918,064.00	
DOLLAR TREE INC	17,488	41.050000	717,882.40	
DOMINION RESOURCES INC/VA	42,700	53.880000	2,300,676.00	
DOVER CORP	13,800	66.780000	921,564.00	
DOW CHEMICAL CO/THE	89,200	34.580000	3,084,536.00	
DR HORTON INC	21,800	21.760000	474,368.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,800	44.560000	704,048.00	
DTE ENERGY COMPANY	12,900	62.750000	809,475.00	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	69,500	48.330000	3,358,935.00	
DUKE ENERGY CORP	52,500	67.920000	3,565,800.00	
DUN & BRADSTREET CORP	3,600	79.900000	287,640.00	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,200	71.900000	805,280.00	
EATON CORP PLC	34,600	57.520000	1,990,192.00	
EATON VANCE CORP	8,900	35.780000	318,442.00	
EBAY INC	86,600	56.530000	4,895,498.00	
ECOLAB INC	21,800	73.440000	1,600,992.00	
EDISON INTERNATIONAL	23,500	47.030000	1,105,205.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,500	92.090000	782,765.00	
ELECTRONIC ARTS INC	23,600	14.770000	348,572.00	
ELI LILLY & CO	77,900	53.210000	4,145,059.00	
EMC CORP/MA	156,200	25.260000	3,945,612.00	
EMERSON ELECTRIC CO	54,000	57.470000	3,103,380.00	
ENERGEN CORP	5,700	48.220000	274,854.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,600	87.520000	402,592.00	
ENSCO PLC-CL A	17,100	62.110000	1,062,081.00	
ENTERGY CORP	13,100	64.590000	846,129.00	
EOG RESOURCES INC	20,194	125.270000	2,529,702.38	
EQT CORP	11,100	61.950000	687,645.00	
EQUIFAX INC	9,200	58.870000	541,604.00	

EQUINIX INC	3,600	225.250000	810,900.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,500	63.250000	1,106,875.00	
EVEREST RE GROUP LTD	3,700	114.950000	425,315.00	
EXELON CORP	64,289	31.010000	1,993,601.89	
EXPEDIA INC	7,500	66.490000	498,675.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	16,500	43.540000	718,410.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	60,200	54.160000	3,260,432.00	
EXXON MOBIL CORP	344,100	91.730000	31,564,293.00	
F5 NETWORKS INC	5,800	105.430000	611,494.00	
FACEBOOK INC-A	74,000	31.540000	2,333,960.00	
FAMILY DOLLAR STORES	7,600	58.550000	444,980.00	
FASTENAL CO	20,900	48.960000	1,023,264.00	
FEDEX CORP	22,400	102.570000	2,297,568.00	
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,100	25.160000	379,916.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	17,300	37.200000	643,560.00	
FIFTH THIRD BANCORP	68,300	16.370000	1,118,071.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	35.340000	250,914.00	
FIRSTENERGY CORP	31,234	40.270000	1,257,793.18	
FISERV INC	10,100	80.850000	816,585.00	
FLEXTRONICS INTL LTD	47,600	6.440000	306,544.00	
FLIR SYSTEMS INC	11,131	24.190000	269,258.89	
FLOWSERVE CORP	3,900	154.470000	602,433.00	
FLUOR CORP	12,500	66.060000	825,750.00	
FMC CORP	10,200	61.870000	631,074.00	
FMC TECHNOLOGIES INC	18,142	46.800000	849,045.60	
FORD MOTOR CO	265,800	13.680000	3,636,144.00	
FOREST LABORATORIES INC	19,700	36.790000	724,763.00	
FOSSIL INC	3,700	107.460000	397,602.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,217	134.480000	1,508,462.16	
FREEPORT-MCMORAN COPPER	70,500	34.870000	2,458,335.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	74,600	4.460000	332,716.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	8,600	23.710000	203,906.00	
GAP INC/THE	23,300	33.540000	781,482.00	
GARMIN LTD	8,400	38.770000	325,668.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,100	70.960000	1,568,216.00	
GENERAL ELECTRIC CO	787,000	22.290000	17,542,230.00	
GENERAL MILLS INC	48,400	41.750000	2,020,700.00	
GENERAL MOTORS CO	58,000	29.070000	1,686,060.00	
GENUINE PARTS CO	11,700	66.980000	783,666.00	
GILEAD SCIENCES INC	56,700	79.360000	4,499,712.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,900	144.460000	4,897,194.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,500	13.870000	242,725.00	
GOOGLE INC-CL A	19,500	753.670000	14,696,565.00	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	10,066	46.310000	466,156.46	
H&R BLOCK INC	20,900	22.330000	466,697.00	
HALLIBURTON CO	68,900	39.720000	2,736,708.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	17,000	53.940000	916,980.00	
HARRIS CORP	8,100	49.490000	400,869.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,500	24.820000	781,830.00	
HASBRO INC	8,700	37.310000	324,597.00	
HCA HOLDINGS INC	16,600	37.740000	626,484.00	
HELMERICH & PAYNE	7,700	62.200000	478,940.00	
HENRY SCHEIN INC	6,600	87.790000	579,414.00	
HERBALIFE LTD	8,500	43.590000	370,515.00	
HERSHEY CO/THE	11,700	77.850000	910,845.00	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,400	18.120000	424,008.00	
HESS CORP	23,080	58.900000	1,359,412.00	
HEWLETT-PACKARD CO	147,400	16.990000	2,504,326.00	
HJ HEINZ CO	24,081	60.720000	1,462,198.32	
HOLLYFRONTIER CORP	14,880	47.270000	703,377.60	
HOLOGIC INC	20,300	23.740000	481,922.00	
HOME DEPOT INC	112,300	67.820000	7,616,186.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,200	68.330000	3,771,816.00	
HORMEL FOODS CORP	10,400	35.340000	367,536.00	
HOSPIRA INC	12,000	35.100000	421,200.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	34,700	8.640000	299,808.00	
HUMANA INC	12,263	74.930000	918,866.59	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,300	67.560000	493,188.00	
IHS INC-CLASS A	4,000	103.950000	415,800.00	

ILLINOIS TOOL WORKS	31,319	64.990000	2,035,421.81	
ILLUMINA INC	9,000	52.060000	468,540.00	
INGERSOLL-RAND PLC	23,100	51.470000	1,188,957.00	
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,800	54.610000	316,738.00	
INTEL CORP	372,900	20.960000	7,815,984.00	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,400	134.820000	728,028.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,400	42.510000	1,334,814.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,300	12.170000	405,261.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	80,900	204.970000	16,582,073.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6,100	71.130000	433,893.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	20,095	15.120000	303,836.40	
INTUIT INC	20,600	63.710000	1,312,426.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,000	577.820000	1,733,460.00	
INVESCO LTD	33,900	28.200000	955,980.00	
IRON MOUNTAIN INC	10,352	34.290000	354,970.08	
J.C. PENNEY CO INC	12,900	19.350000	249,615.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,400	48.460000	455,524.00	
JM SMUCKER CO/THE	8,400	89.260000	749,784.00	
JOHNSON & JOHNSON	205,400	73.920000	15,183,168.00	
JOHNSON CONTROLS INC	51,200	30.940000	1,584,128.00	
JOY GLOBAL INC	7,900	63.260000	499,754.00	
JPMORGAN CHASE & CO	282,900	47.160000	13,341,564.00	
JUNIPER NETWORKS INC	39,400	22.570000	889,258.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,300	94.020000	780,366.00	
KBR INC	11,100	31.770000	352,647.00	
KELLOGG CO	18,900	58.840000	1,112,076.00	
KEYCORP	71,400	9.290000	663,306.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,300	86.260000	2,527,418.00	
KINDER MORGAN INC	48,200	37.250000	1,795,450.00	
KLA-TENCOR CORPORATION	12,700	56.340000	715,518.00	
KOHL'S CORP	16,500	45.250000	746,625.00	
KRAFT FOODS GROUP INC	41,700	47.140000	1,965,738.00	
KROGER CO	38,900	27.840000	1,082,976.00	
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,100	78.710000	558,841.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,100	88.660000	629,486.00	
LAM RESEARCH CORP	13,600	41.840000	569,024.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,500	52.710000	1,607,655.00	
LEGG MASON INC	9,700	27.620000	267,914.00	
LEGGETT & PLATT INC	11,100	29.570000	328,227.00	
LENNAR CORP-A	11,700	43.070000	503,919.00	
LEUCADIA NATIONAL CORP	16,500	25.100000	414,150.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	11,300	24.390000	275,607.00	
LIBERTY GLOBAL INC-A	10,500	68.430000	718,515.00	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,300	64.020000	531,366.00	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	38,400	21.010000	806,784.00	
LIBERTY MEDIA CORP	8,100	110.750000	897,075.00	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	13,286	63.490000	843,528.14	
LIMITED BRANDS INC	18,400	48.280000	888,352.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	21,102	29.110000	614,279.22	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	17,900	36.700000	656,930.00	
LINKEDIN CORP - A	5,800	123.780000	717,924.00	
LKQ CORP	21,200	23.380000	495,656.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,500	92.390000	1,893,995.00	
LOEWS CORP	23,600	43.470000	1,025,892.00	
LORILLARD INC	30,003	39.660000	1,189,918.98	
LOWE'S COS INC	87,866	38.580000	3,389,870.28	
LSI CORP	40,000	7.320000	292,800.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,400	69.830000	516,742.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	23,700	62.750000	1,487,175.00	
M & T BANK CORP	8,700	103.990000	904,713.00	
MACY'S INC	30,200	38.740000	1,169,948.00	
MANPOWER INC	5,700	48.120000	274,284.00	
MARATHON OIL CORP	52,600	33.780000	1,776,828.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	25,300	68.670000	1,737,351.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,600	39.560000	775,376.00	
MARSH & MCLENNAN COS	40,500	35.000000	1,417,500.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,300	99.350000	327,855.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	37,600	9.160000	344,416.00	
MASCO CORP	26,300	18.360000	482,868.00	

MASTERCARD INC-CLASS A	8,000	519.420000	4,155,360.00	
MATTEL INC	25,300	37.150000	939,895.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,100	31.630000	699,023.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	61.870000	569,204.00	
MCDONALD'S CORP	75,200	93.720000	7,047,744.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	19,000	56.980000	1,082,620.00	
MCKESSON CORP	17,600	106.620000	1,876,512.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	13,700	22.700000	310,990.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	15,300	70.030000	1,071,459.00	
MEADWESTVACO CORP	12,600	33.050000	416,430.00	
MEDTRONIC INC	76,500	46.420000	3,551,130.00	
MERCK & CO. INC.	226,800	43.460000	9,856,728.00	
METLIFE INC	63,200	37.650000	2,379,480.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	24,000	9.710000	233,040.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,200	13.000000	366,600.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	14,200	33.300000	472,860.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,400	7.870000	601,268.00	
MICROSOFT CORP	562,500	27.880000	15,682,500.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,300	102.470000	440,621.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,100	45.120000	500,832.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	125,700	27.780000	3,491,946.00	
MONSANTO CO	39,600	103.450000	4,096,620.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,000	46.710000	513,810.00	
MOODY'S CORP	15,100	54.340000	820,534.00	
MORGAN STANLEY	109,800	22.700000	2,492,460.00	
MOSAIC CO/THE	23,000	63.220000	1,454,060.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,300	58.600000	1,130,980.00	
MURPHY OIL CORP	13,900	61.790000	858,881.00	
MYLAN INC	31,000	28.460000	882,260.00	
NABORS INDUSTRIES LTD	21,543	16.630000	358,260.09	
NASDAQ OMX GROUP/THE	9,267	27.700000	256,695.90	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	31,800	74.000000	2,353,200.00	
NETAPP INC	27,300	36.150000	986,895.00	
NETFLIX INC	3,800	169.560000	644,328.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,400	13.070000	436,538.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	22,700	23.230000	527,321.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,600	28.890000	277,344.00	
NEWMONT MINING CORP	37,400	43.360000	1,621,664.00	
NEWS CORP-B	33,000	27.830000	918,390.00	
NEWS CORP-CL A	116,200	27.210000	3,161,802.00	
NEXTERA ENERGY INC	30,100	72.500000	2,182,250.00	
NIELSEN HOLDINGS NV	9,300	32.140000	298,902.00	
NIKE INC -CL B	54,400	55.550000	3,021,920.00	
NISOURCE INC	22,400	26.660000	597,184.00	
NOBLE CORP	18,400	38.230000	703,432.00	
NOBLE ENERGY INC	13,341	108.300000	1,444,830.30	
NORDSTROM INC	11,800	56.050000	661,390.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,900	69.690000	1,665,591.00	
NORTHEAST UTILITIES	24,000	40.320000	967,680.00	
NORTHERN TRUST CORP	16,300	51.320000	836,516.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,600	67.740000	1,192,224.00	
NRG ENERGY INC	24,200	23.590000	570,878.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	18,900	23.580000	445,662.00	
NUCOR CORP	24,000	47.680000	1,144,320.00	
NVIDIA CORP	45,900	12.410000	569,619.00	
NYSE EURONEXT	18,100	33.610000	608,341.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	60,600	84.060000	5,094,036.00	
OCEANEERING INTL INC	7,900	61.820000	488,378.00	
OGE ENERGY CORP	7,400	57.980000	429,052.00	
OMNICARE INC	7,900	39.090000	308,811.00	
OMNICOM GROUP	19,800	54.190000	1,072,962.00	
ONEOK INC	14,962	47.420000	709,498.04	
ORACLE CORP	291,300	35.380000	10,306,194.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,700	92.170000	801,879.00	
OWENS-ILLINOIS INC	11,300	22.960000	259,448.00	

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	P G & E CORP	32,200	41.890000	1,348,858.00	
	PACCAR INC	24,991	48.230000	1,205,315.93	
	PALL CORP	8,700	67.990000	591,513.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	11,100	94.370000	1,047,507.00	
	PARTNERRE LTD	4,600	85.490000	393,254.00	
	PATTERSON COS INC	6,500	36.640000	238,160.00	
	PAYCHEX INC	24,100	31.840000	767,344.00	
	PEABODY ENERGY CORP	20,781	25.820000	536,565.42	
	PENTAIR LTD-REGISTERED	15,529	53.250000	826,919.25	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	27,300	12.470000	340,431.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	17,300	19.260000	333,198.00	
	PEPSICO INC	115,900	72.490000	8,401,591.00	
	PERRIGO CO	6,600	103.120000	680,592.00	
	PETSMART INC	8,288	69.990000	580,077.12	
	PFIZER INC	556,300	27.000000	15,020,100.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,600	89.420000	11,231,152.00	
	PHILLIPS 66	44,728	56.810000	2,540,997.68	
	PINNACLE WEST CAPITAL	8,800	53.320000	469,216.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,700	115.610000	1,005,807.00	
	PITNEY BOWES INC	15,700	12.150000	190,755.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,900	47.380000	469,062.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,400	61.970000	2,441,618.00	
	POLARIS INDUSTRIES INC	4,700	93.230000	438,181.00	
	PPG INDUSTRIES INC	11,300	144.210000	1,629,573.00	
	PPL CORPORATION	43,800	29.600000	1,296,480.00	
	PRAXAIR INC	22,100	111.730000	2,469,233.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	10,805	191.490000	2,069,049.45	
	PRICELINE.COM INC	3,700	718.820000	2,659,634.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,700	30.780000	667,926.00	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	205,400	73.250000	15,045,550.00	
	PROGRESSIVE CORP	43,200	22.630000	977,616.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,400	59.090000	2,032,696.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,600	30.530000	1,147,928.00	
	PULTEGROUP INC	26,000	21.670000	563,420.00	
	PVH CORP	5,200	120.860000	628,472.00	
	QEP RESOURCES INC	12,900	29.810000	384,549.00	
	QUALCOMM INC	127,100	63.660000	8,091,186.00	
	QUANTA SERVICES INC	15,900	29.720000	472,548.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	11,900	57.940000	689,486.00	
	RACKSPACE HOSTING INC	8,200	78.930000	647,226.00	
	RALCORP HOLDINGS INC	4,197	89.960000	377,562.12	
	RALPH LAUREN CORP	4,500	170.080000	765,360.00	
	RANGE RESOURCES CORP	12,000	68.700000	824,400.00	
	RAYTHEON COMPANY	24,500	55.880000	1,369,060.00	
	RED HAT INC	14,300	56.050000	801,515.00	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,700	174.480000	994,536.00	
	REGIONS FINANCIAL CORP	104,500	7.690000	803,605.00	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,000	82.700000	330,800.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	23,000	31.110000	715,530.00	
	RESMED INC	10,200	48.310000	492,762.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	25,500	43.850000	1,118,175.00	
	ROBERT HALF INTL INC	9,500	33.670000	319,865.00	
	ROCK TENN COMPANY -CL A	5,500	79.800000	438,900.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	10,600	89.650000	950,290.00	
	ROCKWELL COLLINS INC	10,000	59.420000	594,200.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	7,400	118.830000	879,342.00	
	ROSS STORES INC	17,000	61.090000	1,038,530.00	
	ROWAN COMPANIES PLC-A	9,600	34.940000	335,424.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	38.420000	411,094.00	
	SAFEWAY INC	17,700	19.430000	343,911.00	
	SAIC INC	20,200	12.130000	245,026.00	
	SALESFORCE.COM INC	9,800	173.860000	1,703,828.00	
	SANDISK CORP	18,100	49.660000	898,846.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,000	71.350000	642,150.00	
	SCANA CORP	9,600	46.720000	448,512.00	

SCHLUMBERGER LTD	98,700	79.510000	7,847,637.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	80,000	16.050000	1,284,000.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,800	59.930000	407,524.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	26,500	37.250000	987,125.00	
SEALED AIR CORP	13,300	18.620000	247,646.00	
SEARS HOLDINGS CORP	3,100	45.120000	139,872.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,000	25.530000	255,300.00	
SEMPRA ENERGY	17,400	74.360000	1,293,864.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,434	34.720000	223,388.48	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,500	165.510000	1,075,815.00	
SIGMA-ALDRICH	8,909	77.400000	689,556.60	
SIRIUS XM RADIO INC	284,000	3.150000	894,600.00	
SLM CORP	34,700	16.900000	586,430.00	
SOUTHERN CO/THE	65,100	44.450000	2,893,695.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,400	11.440000	176,176.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	26,731	34.630000	925,694.53	
SPECTRA ENERGY CORP	49,000	27.090000	1,327,410.00	
SPRINT NEXTEL CORP	226,900	5.640000	1,279,716.00	
SPX CORP	4,000	73.790000	295,160.00	
ST JUDE MEDICAL INC	23,100	40.880000	944,328.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,900	76.870000	914,753.00	
STAPLES INC	50,100	12.970000	649,797.00	
STARBUCKS CORP	56,500	56.810000	3,209,765.00	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,600	60.890000	888,994.00	
STATE STREET CORP	35,900	56.450000	2,026,555.00	
STERICYCLE INC	6,400	94.500000	604,800.00	
STRYKER CORP	22,500	63.550000	1,429,875.00	
SUNTRUST BANKS INC	40,300	29.350000	1,182,805.00	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,200	24.960000	279,552.00	
SYMANTEC CORP	51,600	22.130000	1,141,908.00	
SYNOPSYS INC	11,500	33.610000	386,515.00	
SYSCO CORP	44,000	31.830000	1,400,520.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,700	72.090000	1,348,083.00	
TARGET CORP	46,300	61.540000	2,849,302.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	17,100	19.230000	328,833.00	
TE CONNECTIVITY LTD	31,700	39.470000	1,251,199.00	
TERADATA CORP	12,800	69.340000	887,552.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	84,600	32.800000	2,774,880.00	
TEXTRON INC	21,212	28.750000	609,845.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,400	71.210000	1,951,154.00	
TIFFANY & CO	9,300	64.170000	596,781.00	
TIME WARNER CABLE	22,900	100.600000	2,303,740.00	
TIME WARNER INC	70,500	50.400000	3,553,200.00	
TJX COMPANIES INC	54,864	45.120000	2,475,463.68	
TOLL BROTHERS INC	11,700	37.980000	444,366.00	
TORCHMARK CORP	7,000	55.980000	391,860.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,400	23.750000	294,500.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,400	95.860000	517,644.00	
TRANSDIGM GROUP INC	3,700	138.410000	512,117.00	
TRAVELERS COS INC/THE	28,700	78.350000	2,248,645.00	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	9,300	63.560000	591,108.00	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,900	58.370000	461,123.00	
TYCO INTERNATIONAL LTD	34,100	31.230000	1,064,943.00	
TYSON FOODS INC-CL A	22,100	22.440000	495,924.00	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	4,538	100.400000	455,615.20	
ULTRA PETROLEUM CORP	11,300	18.600000	210,180.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	5,700	48.260000	275,082.00	
UNION PACIFIC CORP	35,400	134.770000	4,770,858.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	6,016	25.500000	153,408.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,000	82.450000	4,452,300.00	
UNITED STATES STEEL CORP	11,800	24.530000	289,454.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,500	89.790000	5,791,455.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,000	56.040000	4,315,080.00	
UNUM GROUP	20,500	23.290000	477,445.00	
URBAN OUTFITTERS INC	9,000	43.620000	392,580.00	
US BANCORP	141,600	33.170000	4,696,872.00	
VALERO ENERGY CORP	41,000	38.100000	1,562,100.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,100	73.410000	594,621.00	
VERIFONE SYSTEMS INC	8,400	35.940000	301,896.00	

VERISIGN INC	11,927	42.960000	512,383.92	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	10,500	54.990000	577,395.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	212,300	42.670000	9,058,841.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,000	46.850000	749,600.00	
VF CORP	6,500	148.970000	968,305.00	
VIACOM INC-CLASS B	34,600	59.020000	2,042,092.00	
VIRGIN MEDIA INC	19,000	39.780000	755,820.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	39,300	159.840000	6,281,712.00	
VMWARE INC-CLASS A	6,000	99.000000	594,000.00	
VULCAN MATERIALS CO	9,800	57.200000	560,560.00	
WALGREEN CO	66,900	39.670000	2,653,923.00	
WAL-MART STORES INC	138,600	69.000000	9,563,400.00	
WALT DISNEY CO/THE	127,400	54.380000	6,928,012.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	14,900	13.720000	204,428.00	
WASTE MANAGEMENT INC	33,000	35.690000	1,177,770.00	
WATERS CORP	6,500	92.610000	601,965.00	
WEATHERFORD INTL LTD	55,700	12.820000	714,074.00	
WELLPOINT INC	24,000	66.170000	1,588,080.00	
WELLS FARGO & CO	374,100	35.140000	13,145,874.00	
WESTERN DIGITAL CORP	16,400	48.080000	788,512.00	
WESTERN UNION CO	43,900	13.530000	593,967.00	
WHIRLPOOL CORP	5,700	109.680000	625,176.00	
WHITING PETROLEUM CORP	9,000	47.750000	429,750.00	
WHOLE FOODS MARKET INC	12,900	95.650000	1,233,885.00	
WILLIAMS COS INC	50,600	34.830000	1,762,398.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	13,400	34.880000	467,392.00	
WINDSTREAM CORP	43,500	9.650000	419,775.00	
WISCONSIN ENERGY CORP	17,300	38.770000	670,721.00	
WR BERKLEY CORP	8,500	41.550000	353,175.00	
WW GRAINGER INC	4,400	217.090000	955,196.00	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,000	57.130000	628,430.00	
WYNN RESORTS LTD	6,000	123.930000	743,580.00	
XCEL ENERGY INC	36,700	27.550000	1,011,085.00	
XEROX CORP	95,600	7.930000	758,108.00	
XILINX INC	19,400	36.850000	714,890.00	
XL GROUP PLC	23,000	27.790000	639,170.00	
XYLEM INC	13,500	27.700000	373,950.00	
YAHOO! INC	83,400	20.370000	1,698,858.00	
YUM! BRANDS INC	33,800	64.630000	2,184,494.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	12,900	75.120000	969,048.00	
アメリカドル 小 計	22,730,425	—	1,027,707,963.97 (93,552,255,960)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES LTD	12,700	46.200000	586,740.00	
AGRIUM INC	11,100	115.360000	1,280,496.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,600	48.190000	462,624.00	
ARC RESOURCES LTD	21,000	23.840000	500,640.00	
ATHABASCA OIL CORP	23,600	10.570000	249,452.00	
BANK OF MONTREAL	48,100	64.150000	3,085,615.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	85,300	58.480000	4,988,344.00	
BARRICK GOLD CORP	74,100	33.020000	2,446,782.00	
BAYTEX ENERGY CORP	9,300	45.850000	426,405.00	
BCE INC	18,800	44.360000	833,968.00	
BELL ALIANT INC	5,500	26.100000	143,550.00	
BOMBARDIER INC-B	109,400	3.990000	436,506.00	
BONAVISTA ENERGY CORP	13,200	13.900000	183,480.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	41,900	37.740000	1,581,306.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	20,800	17.150000	356,720.00	
CAE INC	18,000	10.860000	195,480.00	
CAMECO CORP	31,100	21.540000	669,894.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	30,100	83.560000	2,515,156.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,400	95.550000	3,095,820.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	81,500	30.920000	2,519,980.00	
CANADIAN OIL SANDS LTD	35,500	21.520000	763,960.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,700	112.640000	1,430,528.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5,900	70.440000	415,596.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,200	74.810000	314,202.00	
CATAMARAN CORP	15,200	53.680000	815,936.00	
CENOVUS ENERGY INC	56,900	33.450000	1,903,305.00	
CENTERRA GOLD INC	11,300	8.900000	100,570.00	

CGI GROUP INC - CLASS A	15,800	24.930000	393,894.00	
CI FINANCIAL CORP	11,500	26.340000	302,910.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	26,100	39.570000	1,032,777.00	
DOLLARAMA INC	5,100	59.040000	301,104.00	
ELDORADO GOLD CORP	50,900	11.550000	587,895.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,000	60.630000	121,260.00	
ENBRIDGE INC	57,000	44.180000	2,518,260.00	
ENCANA CORP	55,400	19.710000	1,091,934.00	
ENERPLUS CORP	14,000	13.440000	188,160.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	12,600	25.950000	326,970.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	35,500	20.610000	731,655.00	
FORTIS INC	14,500	34.380000	498,510.00	
FRANCO-NEVADA CORP	10,800	52.140000	563,112.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,500	38.050000	323,425.00	
GOLDCORP INC	60,500	35.810000	2,166,505.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	20,800	26.380000	548,704.00	
HUSKY ENERGY INC	26,200	31.970000	837,614.00	
IAMGOLD CORP	26,700	8.450000	225,615.00	
IGM FINANCIAL INC	7,900	43.300000	342,070.00	
IMPERIAL OIL LTD	22,300	45.080000	1,005,284.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,700	34.770000	232,959.00	
INMET MINING CORPORATION	4,000	70.800000	283,200.00	
INTACT FINANCIAL CORP	9,600	65.390000	627,744.00	
KINROSS GOLD CORP	84,100	8.580000	721,578.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,400	40.580000	340,872.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,600	53.490000	887,934.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	135,700	14.800000	2,008,360.00	
MEG ENERGY CORP	9,900	34.800000	344,520.00	
METRO INC	7,100	65.110000	462,281.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	12,200	79.400000	968,680.00	
NEW GOLD INC	34,900	9.470000	330,503.00	
NEXEN INC	39,800	27.140000	1,080,172.00	
ONEX CORPORATION	7,400	43.790000	324,046.00	
OPEN TEXT CORP	4,300	59.680000	256,624.00	
OSISKO MINING CORP	29,700	6.970000	207,009.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	22,800	23.260000	530,328.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	10,800	17.740000	191,592.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,200	29.300000	650,460.00	
PENGROWTH ENERGY CORP	37,300	4.670000	174,191.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	33,900	10.460000	354,594.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	63,600	43.930000	2,793,948.00	
POWER CORP OF CANADA	25,900	26.850000	695,415.00	
POWER FINANCIAL CORP	18,000	29.100000	523,800.00	
RESEARCH IN MOTION	34,400	17.610000	605,784.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,800	21.920000	127,136.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,700	46.260000	1,327,662.00	
ROYAL BANK OF CANADA	107,500	62.100000	6,675,750.00	
SAPUTO INC	9,400	49.820000	468,308.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	29,300	23.570000	690,601.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,000	41.320000	619,800.00	
SILVER WHEATON CORP	26,200	34.550000	905,210.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	11,300	44.880000	507,144.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,200	29.360000	1,297,712.00	
SUNCOR ENERGY INC	115,800	34.370000	3,980,046.00	
TALISMAN ENERGY INC	77,300	12.040000	930,692.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	42,900	37.730000	1,618,617.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	11,200	65.050000	728,560.00	
THOMSON REUTERS CORP	28,100	30.960000	869,976.00	
TIM HORTONS INC	11,400	50.560000	576,384.00	
TORONTO-DOMINION BANK	68,000	83.580000	5,683,440.00	
TOURMALINE OIL CORP	9,700	33.580000	325,726.00	
TRANSALTA CORP	20,300	16.210000	329,063.00	
TRANSCANADA CORP	53,000	48.770000	2,584,810.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	30,800	8.400000	258,720.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	21,300	66.070000	1,407,291.00	
VERMILION ENERGY INC	7,300	51.200000	373,760.00	
WESTON (GEORGE) LTD	3,800	72.840000	276,792.00	
YAMANA GOLD INC	57,500	16.410000	943,575.00	
カナダドル 小 計	2,838,400	—	95,514,082.00 (8,627,787,027)	

オーストラリアドル				
AGL ENERGY LTD	40,931	15.370000	629,109.47	
ALS LTD	24,520	11.870000	291,052.40	
ALUMINA LTD	173,982	1.080000	187,900.56	
AMCOR LIMITED	89,350	8.320000	743,392.00	
AMP LTD	217,960	5.320000	1,159,547.20	
ASCIANO LTD	79,833	4.840000	386,391.72	
ASX LTD	13,045	33.790000	440,790.55	
AURIZON HOLDINGS LTD	141,692	4.010000	568,184.92	
AUST AND NZ BANKING GROUP	202,839	26.070000	5,288,012.73	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,612	9.100000	287,669.20	
BHP BILLITON LTD	240,529	37.100000	8,923,625.90	
BORAL LTD	58,154	4.860000	282,628.44	
BRAMBLES LTD	119,229	8.010000	955,024.29	
CALTEX AUSTRALIA LTD	11,100	19.530000	216,783.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	42,133	13.710000	577,643.43	
COCHLEAR LTD	4,243	81.070000	343,980.01	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	118,744	63.590000	7,550,930.96	
COMPUTERSHARE LTD	34,247	10.040000	343,839.88	
CROWN LTD	29,303	11.710000	343,138.13	
CSL LTD	37,745	53.050000	2,002,372.25	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	52,860	3.550000	187,653.00	
FLIGHT CENTRE LTD	3,594	29.600000	106,382.40	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	106,352	4.560000	484,965.12	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	44,167	1.985000	87,671.49	
ILUKA RESOURCES LTD	30,113	9.240000	278,244.12	
INCITEC PIVOT LTD	122,641	3.100000	380,187.10	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	154,180	4.920000	758,565.60	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	35,024	9.720000	340,433.28	
LEIGHTON HOLDINGS LTD	11,861	20.000000	237,220.00	
LEND LEASE GROUP	42,089	10.190000	428,886.91	
MACQUARIE GROUP LTD	24,491	37.990000	930,413.09	
METCASH LTD	71,035	3.720000	264,250.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	170,043	27.240000	4,631,971.32	
NEWCREST MINING LTD	57,600	23.620000	1,360,512.00	
ORICA LTD	27,127	25.300000	686,313.10	
ORIGIN ENERGY LTD	83,000	12.270000	1,018,410.00	
OZ MINERALS LTD	26,401	6.850000	180,846.85	
QANTAS AIRWAYS LTD	84,658	1.525000	129,103.45	
QBE INSURANCE GROUP LTD	88,997	11.590000	1,031,475.23	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,223	29.320000	299,738.36	
RIO TINTO LTD	32,664	66.060000	2,157,783.84	
SANTOS LTD	71,370	11.850000	845,734.50	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	11,143	9.000000	100,287.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	29,332	13.250000	388,649.00	
SP AUSNET	120,000	1.150000	138,000.00	
SUNCORP GROUP LTD	97,114	10.910000	1,059,513.74	
TABCORP HOLDINGS LTD	58,291	3.090000	180,119.19	
TATTS GROUP LTD	101,040	3.190000	322,317.60	
TELSTRA CORP LTD	322,602	4.580000	1,477,517.16	
TOLL HOLDINGS LTD	50,032	5.080000	254,162.56	
TRANSURBAN GROUP	102,793	6.110000	628,065.23	
TREASURY WINE ESTATES LTD	47,168	4.640000	218,859.52	
WESFARMERS LTD	74,823	37.950000	2,839,532.85	
WESTPAC BANKING CORP	229,831	27.550000	6,331,844.05	
WHITEHAVEN COAL LTD	38,500	3.500000	134,750.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	49,442	35.750000	1,767,551.50	
WOOLWORTHS LTD	92,158	31.610000	2,913,114.38	
WORLEYPARSONS LTD	15,483	24.320000	376,546.56	
オーストラリアドル 小 計	4,501,433	—	67,479,608.34 (6,399,766,054)	
イギリスポンド				
3I GROUP PLC	74,814	2.571000	192,346.79	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	65,035	4.154000	270,155.39	
ADMIRAL GROUP PLC	15,622	12.220000	190,900.84	
AGGREKO PLC	20,500	17.540000	359,570.00	
AMEC PLC	23,583	11.000000	259,413.00	
ANGLO AMERICAN PLC	104,030	18.860000	1,962,005.80	
ANTOFAGASTA PLC	30,767	12.570000	386,741.19	
ARM HOLDINGS PLC	103,732	8.705000	902,987.06	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,890	17.080000	442,201.20	
ASTRAZENECA PLC	92,554	31.565000	2,921,467.01	
AVIVA PLC	217,779	3.705000	806,871.19	
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,898	10.120000	262,087.76	
BAE SYSTEMS PLC	241,893	3.432000	830,176.77	
BALFOUR BEATTY PLC	53,446	2.785000	148,847.11	
BARCLAYS PLC	865,359	3.007000	2,602,134.51	
BG GROUP PLC	254,249	11.655000	2,963,272.09	
BHP BILLITON PLC	157,952	21.040000	3,323,310.08	
BP PLC	1,420,298	4.653000	6,608,646.59	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	144,617	32.620000	4,717,406.54	
BRITISH SKY BROADCASTING GRO	82,000	8.020000	657,640.00	
BT GROUP PLC	589,900	2.531000	1,493,036.90	
BUNZL PLC	24,504	11.160000	273,464.64	
BURBERRY GROUP PLC	33,674	13.870000	467,058.38	
CAPITA PLC	48,246	7.940000	383,073.24	
CARNIVAL PLC	13,753	26.150000	359,640.95	
CENTRICA PLC	389,137	3.469000	1,349,916.25	
COBHAM PLC	79,780	2.165000	172,723.70	
COMPASS GROUP PLC	139,597	7.590000	1,059,541.23	
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,278	24.510000	251,913.78	
DIAGEO PLC	186,416	18.570000	3,461,745.12	
EURASIAN NATURAL RESOURCES	15,840	3.311000	52,446.24	
EXPERIAN PLC	75,888	10.900000	827,179.20	
FRESNILLO PLC	13,239	16.980000	224,798.22	
G4S PLC	105,850	2.769000	293,098.65	
GKN PLC	118,661	2.466000	292,618.02	
GLAXOSMITHKLINE PLC	370,269	14.155000	5,241,157.69	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	283,886	3.926000	1,114,536.43	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,727	7.100000	111,661.70	
HSBC HOLDINGS PLC	1,363,716	7.103000	9,686,474.74	
ICAP PLC	41,055	3.292000	135,153.06	
IMI PLC	23,237	11.930000	277,217.41	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	73,878	24.200000	1,787,847.60	
INMARSAT PLC	33,703	6.250000	210,643.75	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20,114	18.800000	378,143.20	
INTERTEK GROUP PLC	12,000	31.300000	375,600.00	
INVENSYS PLC	62,894	3.445000	216,669.83	
INVESTEC PLC	42,361	4.607000	195,157.12	
ITV PLC	286,433	1.158000	331,689.41	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,286	23.900000	365,335.40	
KAZAKHMYS PLC	14,604	7.535000	110,041.14	
KINGFISHER PLC	176,441	2.774000	489,447.33	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	433,966	1.516000	657,892.45	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,129,095	0.534500	1,672,501.27	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,677	12.250000	155,293.25	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	118,098	3.842000	453,732.51	
MEGGITT PLC	60,487	4.324000	261,545.78	
MELROSE INDUSTRIES PLC	90,300	2.398000	216,539.40	
NATIONAL GRID PLC	270,717	7.000000	1,895,019.00	
NEXT PLC	12,236	40.590000	496,659.24	
OLD MUTUAL PLC	365,841	1.876000	686,317.71	
PEARSON PLC	61,404	11.850000	727,637.40	
PETROFAC LTD	18,983	17.300000	328,405.90	
PRUDENTIAL PLC	190,852	9.475000	1,808,322.70	
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,635	60.200000	399,427.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	48,639	41.950000	2,040,406.05	
REED ELSEVIER PLC	91,346	6.915000	631,657.59	
RESOLUTION LTD	106,767	2.666000	284,640.82	
REXAM PLC	66,364	4.692000	311,379.88	
RIO TINTO PLC	100,218	35.180000	3,525,669.24	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	138,936	9.440000	1,311,555.84	

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリスポンド					
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	155,454	3.659000	568,806.18	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	277,161	22.635000	6,273,539.23	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	196,476	23.155000	4,549,401.78	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	269,300	1.300000	350,090.00	
	SABMILLER PLC	71,282	30.645000	2,184,436.89	
	SAGE GROUP PLC/THE	90,532	3.257000	294,862.72	
	SAINSBURY (J) PLC	93,015	3.305000	307,414.57	
	SCHRODERS PLC	8,259	19.160000	158,242.44	
	SERCO GROUP PLC	35,290	5.610000	197,976.90	
	SEVERN TRENT PLC	18,744	16.470000	308,713.68	
	SHIRE PLC	41,656	21.100000	878,941.60	
	SMITH & NEPHEW PLC	67,930	7.235000	491,473.55	
	SMITHS GROUP PLC	29,471	12.440000	366,619.24	
	SSE PLC	70,068	13.860000	971,142.48	
	STANDARD CHARTERED PLC	178,588	16.645000	2,972,597.26	
	STANDARD LIFE PLC	178,616	3.457000	617,475.51	
	TATE & LYLE PLC	34,700	8.340000	289,398.00	
	TESCO PLC	601,084	3.556500	2,137,755.24	
	TUI TRAVEL PLC	32,165	2.931000	94,275.61	
	TULLOW OIL PLC	67,986	11.830000	804,274.38	
	UNILEVER PLC	96,008	25.330000	2,431,882.64	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,530	7.450000	383,898.50	
	VEDANTA RESOURCES PLC	7,455	11.800000	87,969.00	
	VODAFONE GROUP PLC	3,661,242	1.702500	6,233,264.50	
	WEIR GROUP PLC/THE	15,942	20.470000	326,332.74	
	WHITBREAD PLC	13,198	25.670000	338,792.66	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	166,884	2.574000	429,559.41	
	WOLSELEY PLC	20,393	30.000000	611,790.00	
	WPP PLC	93,614	9.800000	917,417.20	
	XSTRATA PLC	155,907	11.830000	1,844,379.81	
イギリスポンド 小 計		20,823,896	—	119,084,538.00 (17,101,730,502)	
スイスフラン					
	ABB LTD-REG	163,200	19.640000	3,205,248.00	
	ACTELION LTD-REG	7,979	46.200000	368,629.80	
	ADECCO SA-REG	10,297	52.200000	537,503.40	
	ARYZTA AG	6,650	51.650000	343,472.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,493	83.850000	292,888.05	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	200	488.750000	97,750.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	110	913.000000	100,430.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	38,812	77.400000	3,004,048.80	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	93,823	27.380000	2,568,873.74	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	500	230.100000	115,050.00	
	GEBERIT AG-REG	2,734	218.500000	597,379.00	
	GIVAUDAN-REG	646	1,025.000000	662,150.00	
	HOLCIM LTD-REG	17,059	71.700000	1,223,130.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	16,019	37.310000	597,668.89	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,257	109.700000	466,992.90	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	58	3,332.000000	193,256.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	37,270.000000	298,160.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,916	54.700000	214,205.20	
	NESTLE SA-REG	240,195	64.100000	15,396,499.50	
	NOVARTIS AG-REG	171,292	62.150000	10,645,797.80	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,257	68.000000	153,476.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,205	220.000000	265,100.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,357	203.500000	10,654,649.50	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,723	134.000000	230,882.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,733	136.600000	509,927.80	
	SGS SA-REG	414	2,196.000000	909,144.00	
	SIKA AG-BR	162	2,283.000000	369,846.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,559	108.200000	385,083.80	
	SULZER AG-REG	1,914	147.500000	282,315.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,308	504.500000	1,164,386.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,051	86.250000	263,148.75	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,256	138.500000	312,456.00	

	SWISS PRIME SITE-REG	3,731	76.900000	286,913.90	
	SWISS RE AG	26,379	70.000000	1,846,530.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,749	400.000000	699,600.00	
	SYNGENTA AG-REG	6,965	401.500000	2,796,447.50	
	TRANSOCEAN LTD	27,033	51.900000	1,403,012.70	
	UBS AG-REG	271,320	16.090000	4,365,538.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,014	260.700000	2,871,349.80	
	スイスフラン 小 計	1,204,378	—	70,698,941.43 (6,939,808,090)	
香港ドル					
	AIA GROUP LTD	810,600	30.850000	25,007,010.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	15,600	98.800000	1,541,280.00	
	BANK OF EAST ASIA	94,020	31.800000	2,989,836.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	280,000	26.450000	7,406,000.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	86,000	15.500000	1,333,000.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	104,000	129.700000	13,488,800.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	38,000	47.450000	1,803,100.00	
	CLP HOLDINGS LTD	131,500	65.300000	8,586,950.00	
	FIRST PACIFIC CO	164,000	9.240000	1,515,360.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	154,000	34.400000	5,297,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	167,000	29.200000	4,876,400.00	
	HANG SENG BANK LTD	58,600	124.500000	7,295,700.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	71,000	58.500000	4,153,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	393,482	21.550000	8,479,537.10	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	82,000	147.000000	12,054,000.00	
	HOPEWELL HOLDINGS LTD	40,000	32.500000	1,300,000.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	159,000	87.050000	13,840,950.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	44,000	38.800000	1,707,200.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	51,000	41.700000	2,126,700.00	
	LI & FUNG LTD	446,000	11.520000	5,137,920.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	66,000	17.280000	1,140,480.00	
	MTR CORP	113,500	31.350000	3,558,225.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	269,000	15.060000	4,051,140.00	
	NWS HOLDINGS LTD	106,500	13.580000	1,446,270.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	16,500	54.900000	905,850.00	
	PCCW LTD	333,000	3.280000	1,092,240.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,000	66.400000	6,839,200.00	
	SANDS CHINA LTD	178,800	38.550000	6,892,740.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	116,000	16.880000	1,958,080.00	
	SINO LAND CO	225,400	15.180000	3,421,572.00	
	SJM HOLDINGS LTD	148,000	20.200000	2,989,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	117,000	129.900000	15,198,300.00	
	SWIRE PACIFIC LTD-A	51,500	98.500000	5,072,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	82,600	28.350000	2,341,710.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	112,000	68.650000	7,688,800.00	
	WHELOCK & CO LTD	69,000	43.950000	3,032,550.00	
	WING HANG BANK LTD	15,500	81.600000	1,264,800.00	
	WYNN MACAU LTD	120,400	20.850000	2,510,340.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	60,000	25.600000	1,536,000.00	
	香港ドル 小 計	5,693,502	—	202,881,490.10 (2,381,828,693)	
シンガポールドル					
	CAPITALAND LTD	202,000	3.980000	803,960.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	95,000	2.140000	203,300.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,000	11.300000	440,700.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	157,000	1.880000	295,160.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,000	14.720000	2,001,920.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	72,000	9.550000	687,600.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	471,000	1.450000	682,950.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	160,000	2.730000	436,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	553,360	0.630000	348,616.80	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	52.250000	418,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	110,000	11.450000	1,259,500.00	
	KEPPEL LAND LTD	60,000	4.140000	248,400.00	
	NOBLE GROUP LTD	304,090	1.225000	372,510.25	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	117,000	1.630000	190,710.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	191,000	9.740000	1,860,340.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	72,000	5.510000	396,720.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	69,000	4.760000	328,440.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,340	11.080000	480,207.20	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	69,000	7.700000	531,300.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,250	4.070000	501,627.50	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	121,000	3.840000	464,640.00	
	SINGAPORE TELECOM LTD	595,260	3.450000	2,053,647.00	
	STARHUB LTD	40,000	3.930000	157,200.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,000	18.860000	1,791,700.00	
	UOL GROUP LTD	39,000	6.170000	240,630.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	148,000	3.840000	568,320.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	168,000	1.000000	168,000.00	
	シンガポールドル 小 計	4,258,300	—	17,932,898.75 (1,321,833,966)	
ニュージーランドドル					
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81,688	2.795000	228,317.96	
	CONTACT ENERGY LTD	26,093	5.160000	134,639.88	
	FLETCHER BUILDING LTD	50,812	9.200000	467,470.40	
	SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP	49,774	3.980000	198,100.52	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	129,226	2.380000	307,557.88	
	ニュージーランドドル 小 計	337,593	—	1,336,086.64 (101,662,832)	
スウェーデンクローネ					
	ALFA LAVAL AB	24,444	139.700000	3,414,826.80	
	ASSA ABLOY AB-B	25,146	244.300000	6,143,167.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	50,214	187.700000	9,425,167.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	28,507	167.900000	4,786,325.30	
	BOLIDEN AB	20,204	118.700000	2,398,214.80	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,432	164.200000	2,862,334.40	
	ELEKTA AB-B SHS	28,320	97.300000	2,755,536.00	
	ERICSSON LM-B SHS	226,947	69.350000	15,738,774.45	
	GETINGE AB-B SHS	15,461	206.600000	3,194,242.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	70,960	235.800000	16,732,368.00	
	HEXAGON AB-B SHS	17,190	178.800000	3,073,572.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	29,317	40.170000	1,177,663.89	
	INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS	15,038	146.800000	2,207,578.40	
	INVESTOR AB-B SHS	34,889	177.000000	6,175,353.00	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,150	168.300000	2,718,045.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,766	578.000000	2,754,748.00	
	NORDEA BANK AB	198,198	66.350000	13,150,437.30	
	RATOS AB-B SHS	15,854	62.500000	990,875.00	
	SANDVIK AB	75,284	106.000000	7,980,104.00	
	SCANIA AB-B SHS	24,907	138.500000	3,449,619.50	
	SECURITAS AB-B SHS	20,695	59.800000	1,237,561.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	105,934	60.850000	6,446,083.90	
	SKANSKA AB-B SHS	27,980	109.100000	3,052,618.00	
	SKF AB-B SHARES	28,925	163.100000	4,717,667.50	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	43,360	150.500000	6,525,680.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	36,866	248.700000	9,168,574.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	60,512	135.800000	8,217,529.60	
	SWEDISH MATCH AB	15,894	233.700000	3,714,427.80	
	TELE2 AB-B SHS	23,298	115.000000	2,679,270.00	
	TELIASONERA AB	162,475	45.680000	7,421,858.00	
	VOLVO AB-B SHS	105,332	97.200000	10,238,270.40	
	スウェーデンクローネ 小 計	1,570,499	—	174,548,494.44 (2,457,642,801)	
ノルウェークローネ					
	AKER SOLUTIONS ASA	13,200	124.000000	1,636,800.00	
	DNB ASA	74,639	76.200000	5,687,491.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,111	83.500000	1,094,768.50	
	NORSK HYDRO ASA	70,019	26.940000	1,886,311.86	
	ORKLA ASA	57,733	48.420000	2,795,431.86	
	SEADRILL LTD	26,296	215.400000	5,664,158.40	
	STATOIL ASA	83,692	146.500000	12,260,878.00	
	SUBSEA 7 SA	21,777	140.200000	3,053,135.40	
	TELENOR ASA	52,253	121.900000	6,369,640.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,749	292.300000	4,018,832.70	
	ノルウェークローネ 小 計	426,469	—	44,467,449.22 (731,044,865)	
デンマーククローネ					
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	41	43,800.000000	1,795,800.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	100	46,080.000000	4,608,000.00	
	CARLSBERG AS-B	7,890	598.500000	4,722,165.00	

	COLOPLAST-B	8,520	289.200000	2,463,984.00	
	DANSKE BANK A/S	48,919	106.700000	5,219,657.30	
	DSV A/S	14,376	146.500000	2,106,084.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	30,358	1,016.000000	30,843,728.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	17,900	179.000000	3,204,100.00	
	TDC A/S	40,164	41.900000	1,682,871.60	
	TRYG A/S	1,908	418.900000	799,261.20	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,860	491.100000	913,446.00	
	デンマーククローネ 小 計	172,036	—	58,359,097.10 (958,256,374)	
イスラエルシェケル					
	BANK HAPOLIM BM	90,170	15.760000	1,421,079.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	97,273	12.700000	1,235,367.10	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	143,512	4.320000	619,971.84	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	35,743	50.000000	1,787,150.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	227	2,614.000000	593,378.00	
	MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	2,800	181.800000	509,040.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,700	135.400000	636,380.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	69,987	139.500000	9,763,186.50	
	イスラエルシェケル 小 計	444,412	—	16,565,552.64 (404,199,484)	
ユーロ					
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	27,742	12.890000	357,594.38	
	ACCIONA SA	2,042	62.990000	128,625.58	
	ACCOR SA	11,062	28.995000	320,742.69	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,024	18.225000	182,687.40	
	ADIDAS AG	15,462	70.160000	1,084,813.92	
	ADP	2,200	61.290000	134,838.00	
	AEGON NV	128,092	4.939000	632,646.38	
	AGEAS	17,646	24.355000	429,768.33	
	AIR LIQUIDE SA	23,282	94.300000	2,195,492.60	
	AKZO NOBEL	17,885	51.620000	923,223.70	
	ALLIANZ SE-REG	33,932	105.200000	3,569,646.40	
	ALSTOM	15,230	32.595000	496,421.85	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,576	18.995000	447,826.12	
	ANDRITZ AG	5,327	48.990000	260,969.73	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	59,857	68.090000	4,075,663.13	
	ARCELORMITTAL	75,079	13.165000	988,415.03	
	ARKEMA	4,790	84.040000	402,551.60	
	ASML HOLDING NV	23,364	54.700000	1,278,010.80	
	ASSICURAZIONI GENERALI	86,504	14.110000	1,220,571.44	
	ATLANTIA SPA	24,178	13.450000	325,194.10	
	ATOS	3,954	55.940000	221,186.76	
	AXA SA	132,004	13.525000	1,785,354.10	
	AXEL SPRINGER AG	3,401	34.810000	118,388.81	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	485,915	0.259800	126,240.71	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	406,396	7.811000	3,174,359.15	
	BANCO DE SABADELL SA	208,527	2.155000	449,375.68	
	BANCO POPOLARE SCARL	130,709	1.512000	197,632.00	
	BANCO POPULAR ESPANOL	392,000	0.708000	277,536.00	
	BANCO SANTANDER SA	771,331	6.539000	5,043,733.40	
	BASF SE	68,434	75.600000	5,173,610.40	
	BAYER AG-REG	61,709	75.920000	4,684,947.28	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,831	75.850000	1,883,431.35	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,702	50.700000	187,691.40	
	BEIERSDORF AG	7,591	64.750000	491,517.25	
	BELGACOM SA	11,168	22.590000	252,285.12	
	BNP PARIBAS	75,020	46.665000	3,500,808.30	
	BOSKALIS WESTMINSTER	5,800	34.065000	197,577.00	
	BOUYGUES SA	13,649	21.870000	298,503.63	
	BRENNTAG AG	3,800	106.850000	406,030.00	
	BUREAU VERITAS SA	4,037	88.290000	356,426.73	
	CAIXABANK	64,431	3.083000	198,640.77	
	CAP GEMINI	11,302	36.295000	410,206.09	
	CARREFOUR SA	44,753	21.455000	960,175.61	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,324	73.430000	317,511.32	
	CELESIO AG	6,516	13.620000	88,747.92	
	CHRISTIAN DIOR	4,066	132.050000	536,915.30	
	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	12,146	21.815000	264,964.99	
	CNP ASSURANCES	11,531	12.435000	143,387.98	

COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	16,655	17.970000	299,290.35	
COLRUYT SA	5,864	36.600000	214,622.40	
COMMERZBANK AG	290,419	1.658000	481,514.70	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	29,532	31.625000	933,949.50	
CONTINENTAL AG	8,240	85.710000	706,250.40	
CREDIT AGRICOLE SA	73,425	7.578000	556,414.65	
CRH PLC	54,553	15.770000	860,300.81	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	67,332	43.805000	2,949,478.26	
DANONE	43,199	51.820000	2,238,572.18	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,676	84.290000	394,140.04	
DE MASTER BLENDERS1753 NV	45,640	9.069000	413,909.16	
DELHAIZE GROUP	7,843	35.055000	274,936.36	
DELTA LLOYD NV	8,059	14.715000	118,588.18	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	68,985	36.655000	2,528,645.17	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,321	49.180000	704,306.78	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	18,144	15.275000	277,149.60	
DEUTSCHE POST AG-REG	67,458	17.535000	1,182,876.03	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	209,716	8.905000	1,867,520.98	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,659	5.450000	248,841.55	
E.ON SE	133,616	13.315000	1,779,097.04	
EADS NV	31,005	34.785000	1,078,508.92	
EDENRED	12,975	23.885000	309,907.87	
EDF	17,335	14.550000	252,224.25	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,121	2.360000	359,005.56	
ELAN CORP PLC	38,783	7.630000	295,914.29	
ELISA OYJ	11,720	17.300000	202,756.00	
ENAGAS SA	13,875	18.010000	249,888.75	
ENEL GREEN POWER SPA	136,769	1.533000	209,666.87	
ENEL SPA	492,059	3.162000	1,555,890.55	
ENI SPA	190,135	19.210000	3,652,493.35	
ERSTE GROUP BANK AG	16,458	24.630000	405,360.54	
ESSILOR INTERNATIONAL	15,122	77.560000	1,172,862.32	
EURAZEO	2,151	39.500000	84,964.50	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,740	25.400000	247,396.00	
EXOR SPA	5,660	22.250000	125,935.00	
FERROVIAL SA	30,716	11.805000	362,602.38	
FIAT INDUSTRIAL	63,049	9.490000	598,335.01	
FIAT SPA	64,516	4.616000	297,805.85	
FINMECCANICA SPA	31,249	5.010000	156,557.49	
FORTUM OYJ	33,279	13.480000	448,600.92	
FRANCE TELECOM SA	139,073	8.448000	1,174,888.70	
FRAPORT AG	2,774	45.550000	126,355.70	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	16,000	51.950000	831,200.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,448	88.560000	836,714.88	
FUGRO NV-CVA	5,393	46.295000	249,668.93	
GALP ENERGIA SGPS SA	23,337	12.220000	285,178.14	
GAS NATURAL SDG SA	26,655	14.795000	394,360.72	
GDF SUEZ	95,227	15.320000	1,458,877.64	
GEA GROUP AG	13,359	27.720000	370,311.48	
GEMALTO	6,051	65.040000	393,557.04	
GRIFOLS SA	11,671	25.400000	296,443.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,173	61.870000	381,923.51	
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	43,627	6.460000	281,830.42	
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,400	60.000000	264,000.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,630	45.925000	488,182.75	
HEINEKEN HOLDING NV	7,371	43.015000	317,063.56	
HEINEKEN NV	16,899	51.600000	871,988.40	
HENKEL AG & CO KGAA	9,861	55.500000	547,285.50	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,413	65.260000	875,332.38	
HOCHTIEF AG	2,392	48.290000	115,509.68	
HUGO BOSS AG -ORD	1,750	88.240000	154,420.00	
IBERDROLA SA	297,858	4.124000	1,228,366.39	
ILIAD SA	1,783	138.100000	246,232.30	
IMERYS SA	2,595	49.730000	129,049.35	
IMMOFINANZ AG	72,491	3.262000	236,465.64	
INDITEX	16,383	107.350000	1,758,715.05	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	80,419	6.695000	538,405.20	
ING GROEP NV-CVA	284,598	7.361000	2,094,925.87	
INTESA SANPAOLO	762,171	1.486000	1,132,586.10	

INTESA SANPAOLO-RSP	65,939	1.227000	80,907.15	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	69,461	2.614000	181,571.05	
IRISH BANK RESOLUTION CORPOR	47,248	—	—	
JERONIMO MARTINS	18,589	15.905000	295,658.04	
K+S AG-REG	12,544	34.450000	432,140.80	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,650	60.200000	400,330.00	
KBC GROEP NV	17,738	28.595000	507,218.11	
KERRY GROUP PLC-A	10,990	38.100000	418,719.00	
KESKO OYJ-B SHS	5,314	24.430000	129,821.02	
KONE OYJ-B	11,543	58.850000	679,305.55	
KONINKLIJKE AHOLD NV	73,424	10.875000	798,486.00	
KONINKLIJKE DSM NV	11,343	47.195000	535,332.88	
KONINKLIJKE KPN NV	72,214	4.243000	306,404.00	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	77,247	22.090000	1,706,386.23	
LAFARGE SA	13,931	46.870000	652,945.97	
LAGARDERE S.C.A.	9,629	26.290000	253,146.41	
LANXESS AG	6,085	64.490000	392,421.65	
LEGRAND SA	17,723	34.250000	607,012.75	
LINDE AG	13,842	136.650000	1,891,509.30	
L'OREAL	17,861	111.100000	1,984,357.10	
LUXOTTICA GROUP SPA	12,020	33.550000	403,271.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,991	140.850000	2,674,882.35	
MAN SE	3,277	88.740000	290,800.98	
MAPFRE SA	60,537	2.340000	141,656.58	
MEDIOBANCA SPA	38,192	5.490000	209,674.08	
MERCK KGAA	4,736	103.050000	488,044.80	
METRO AG	9,801	22.920000	224,638.92	
METSO OYJ	9,355	34.310000	320,970.05	
MICHELIN (CGDE)	13,464	70.480000	948,942.72	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,353	135.350000	1,807,328.55	
NATIXIS	68,194	2.943000	200,694.94	
NESTE OIL OYJ	10,293	11.010000	113,325.93	
NOKIA OYJ	277,638	3.080000	855,125.04	
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,978	32.900000	262,476.20	
OMV AG	11,398	30.685000	349,747.63	
ORION OYJ-CLASS B	7,072	20.910000	147,875.52	
PERNOD-RICARD SA	15,930	91.980000	1,465,241.40	
PEUGEOT SA	15,951	6.140000	97,939.14	
PIRELLI & C.	17,226	9.225000	158,909.85	
POHJOLA BANK PLC-A SHS	11,086	12.540000	139,018.44	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	11,500	65.670000	755,205.00	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	51,177	4.163000	213,049.85	
PPR	5,637	156.050000	879,653.85	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PRF	6,092	25.180000	153,396.56	
PRYSMIAN SPA	14,910	16.250000	242,287.50	
PUBLICIS GROUPE	13,262	49.155000	651,893.61	
QIAGEN N.V.	17,950	14.905000	267,544.75	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,565	33.000000	117,645.00	
RANDSTAD HOLDING NV	8,635	30.245000	261,165.57	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,782	42.000000	326,844.00	
REED ELSEVIER NV	52,490	11.530000	605,209.70	
REMY COINTREAU	1,488	93.300000	138,830.40	
RENAULT SA	13,980	43.995000	615,050.10	
REPSOL SA	62,308	17.450000	1,087,274.60	
REXEL SA	8,736	16.330000	142,658.88	
RWE AG	36,387	28.435000	1,034,664.34	
RWE AG-NON VTG PREF	2,346	26.600000	62,403.60	
SAFRAN SA	16,740	34.450000	576,693.00	
SAIPEM SPA	20,062	31.490000	631,752.38	
SALZGITTER AG	3,128	35.730000	111,763.44	
SAMPO OYJ-A SHS	31,153	25.810000	804,058.93	
SANOFI	88,835	73.090000	6,492,950.15	
SAP AG	68,502	60.040000	4,112,860.08	

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ユーロ	SCHNEIDER ELECTRIC SA	39,157	56.300000	2,204,539.10	
	SCOR SE	12,398	21.010000	260,481.98	
	SES	22,479	21.685000	487,457.11	
	SIEMENS AG-REG	61,100	81.830000	4,999,813.00	
	SNAM SPA	127,832	3.728000	476,557.69	
	SOCIETE BIC SA	2,250	97.210000	218,722.50	
	SOCIETE GENERALE	52,103	33.725000	1,757,173.67	
	SODEXO	7,250	66.140000	479,515.00	
	SOLVAY SA	4,392	117.500000	516,060.00	
	STMICROELECTRONICS NV	48,058	6.420000	308,532.36	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	42,501	5.445000	231,417.94	
	SUEDZUCKER AG	6,399	30.550000	195,489.45	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	20,106	9.880000	198,647.28	
	TECHNIP SA	7,597	84.820000	644,377.54	
	TELECOM ITALIA SPA	685,560	0.723500	496,002.66	
	TELECOM ITALIA-RSP	454,039	0.628000	285,136.49	
	TELEFONICA SA	305,712	10.900000	3,332,260.80	
	TELEKOM AUSTRIA AG	15,491	5.513000	85,401.88	
	TELENET GROUP HOLDING NV	4,189	35.925000	150,489.82	
	TENARIS SA	35,899	15.740000	565,050.26	
	TERNA SPA	95,507	3.106000	296,644.74	
	THALES SA	6,433	26.995000	173,658.83	
	THYSSENKRUPP AG	28,811	17.745000	511,251.19	
	TNT EXPRESS NV	25,247	5.507000	139,035.22	
	TOTAL SA	159,100	39.825000	6,336,157.50	
	UBI BANCA SCPA	65,520	3.892000	255,003.84	
	UCB SA	7,990	42.845000	342,331.55	
	UMICORE	8,315	40.705000	338,462.07	
	UNICREDIT SPA	301,668	4.672000	1,409,392.89	
	UNILEVER NV-CVA	121,092	29.820000	3,610,963.44	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,427	17.180000	127,595.86	
	UPM-KYMMENE OYJ	38,542	9.550000	368,076.10	
	VALLOUREC	7,908	42.890000	339,174.12	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,852	9.461000	254,046.77	
	VERBUND AG	4,728	16.610000	78,532.08	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG	2,881	39.050000	112,503.05	
	VINCI SA	34,253	38.495000	1,318,569.23	
	VIVENDI	97,269	15.860000	1,542,686.34	
	VOESTALPINE AG	8,689	27.460000	238,599.94	
	VOLKSWAGEN AG	2,159	172.750000	372,967.25	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	10,771	184.650000	1,988,865.15	
	VOPAK	5,118	50.310000	257,486.58	
	WARTSILA OYJ ABP	12,374	36.010000	445,587.74	
	WENDEL	2,600	82.510000	214,526.00	
	WOLTERS KLUWER	22,853	15.130000	345,765.89	
	ZARDOYA OTIS SA	11,750	11.650000	136,887.50	
	ZIGGO NV	9,455	22.655000	214,203.02	
	ZODIAC AEROSPACE	2,528	80.990000	204,742.72	
ユーロ 小計		12,981,000	—	184,085,743.08 (22,548,662,669)	
合 計		77,982,343	—	163,526,479,317 (163,526,479,317)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の（）内は、邦貨換算額であります。

（注２）合計金額欄の（）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨		口数	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	25,000.00	783,250.00	
	AMERICAN TOWER CORP	29,300.00	2,341,070.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	71,200.00	1,057,320.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,300.00	1,148,886.00	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,400.00	1,247,844.00	

	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,000.00	422,640.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000.00	651,060.00	
	DUKE REALTY CORP	19,400.00	296,432.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	23,800.00	1,382,542.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,954.00	522,399.30	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	31,100.00	612,048.00	
	HCP INC	34,207.00	1,607,729.00	
	HEALTH CARE REIT INC	19,097.00	1,202,156.15	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	54,000.00	928,260.00	
	KIMCO REALTY CORP	30,200.00	625,140.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,900.00	345,498.00	
	MACERICH CO/THE	10,000.00	593,400.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	12,458.00	589,387.98	
	PROLOGIS INC	34,700.00	1,410,208.00	
	PUBLIC STORAGE	10,800.00	1,649,160.00	
	RAYONIER INC	9,000.00	488,430.00	
	REALTY INCOME CORP	9,500.00	413,060.00	
	REGENCY CENTERS CORP	6,700.00	336,742.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,669.00	3,680,312.15	
	SL GREEN REALTY CORP	6,900.00	561,936.00	
	UDR INC	19,600.00	485,296.00	
	VENTAS INC	21,900.00	1,459,635.00	
	VORNADO REALTY TRUST	12,400.00	1,059,580.00	
	WEYERHAEUSER CO	40,200.00	1,244,190.00	
	投資証券 小 計	602,685.00	29,145,611.58 (2,653,125,022)	
	アメリカドル 小 計	602,685.00	29,145,611.58 (2,653,125,022)	
	カナダドル			
投資証券	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,100.00	145,302.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,600.00	257,568.00	
	投資証券 小 計	15,700.00	402,870.00 (36,391,247)	
	カナダドル 小 計	15,700.00	402,870.00 (36,391,247)	
	オーストラリアドル			
投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	142,816.00	289,916.48	
	DEXUS PROPERTY GROUP	342,794.00	363,361.64	
	FEDERATION CENTRES	99,634.00	228,161.86	
	GOODMAN GROUP	125,866.00	566,397.00	
	GPT GROUP	104,969.00	387,335.61	
	MIRVAC GROUP	249,258.00	388,842.48	
	STOCKLAND	168,731.00	592,245.81	
	WESTFIELD GROUP	160,009.00	1,755,298.73	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	213,231.00	675,942.27	
	投資証券 小 計	1,607,308.00	5,247,501.88 (497,673,078)	
	オーストラリアドル 小 計	1,607,308.00	5,247,501.88 (497,673,078)	
	イギリスポンド			
投資証券	BRITISH LAND CO PLC	64,653.00	364,966.18	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	42,078.00	151,102.09	
	HAMMERSON PLC	52,875.00	259,669.12	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	57,984.00	471,989.76	
	SEGRO PLC	57,308.00	142,410.38	
	投資証券 小 計	274,898.00	1,390,137.53 (199,637,650)	
	イギリスポンド 小 計	274,898.00	1,390,137.53 (199,637,650)	
	香港ドル			
投資証券	LINK REIT	168,500.00	6,689,450.00	
	投資証券 小 計	168,500.00	6,689,450.00 (78,534,143)	
	香港ドル 小 計	168,500.00	6,689,450.00 (78,534,143)	
	シンガポールドル			
投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	142,000.00	359,260.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	151,000.00	255,190.00	
	CAPITAMALL TRUST	180,000.00	381,600.00	

投資証券 小 計		473,000.00	996,050.00 (73,418,845)	
シンガポールドル 小 計		473,000.00	996,050.00 (73,418,845)	
ユーロ				
投資証券	CORIO NV	5,173.00	187,935.09	
	FONCIERE DES REGIONS	1,756.00	110,786.04	
	GECINA SA	1,635.00	142,245.00	
	ICADE	1,941.00	128,106.00	
	KLEPIERRE	7,368.00	217,798.08	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,861.00	1,198,959.75	
投資証券 小 計		24,734.00	1,985,829.96 (243,244,311)	
ユーロ 小 計		24,734.00	1,985,829.96 (243,244,311)	
合 計		—	3,782,024,296 (3,782,024,296)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 575銘柄	97.24%	—	55.92%
	投資証券 29銘柄	—	2.76%	1.59%
カナダドル	株式 95銘柄	99.58%	—	5.16%
	投資証券 2銘柄	—	0.42%	0.02%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	92.78%	—	3.83%
	投資証券 9銘柄	—	7.22%	0.30%
イギリスポンド	株式 100銘柄	98.85%	—	10.22%
	投資証券 5銘柄	—	1.15%	0.12%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.00%	—	4.15%
香港ドル	株式 39銘柄	96.81%	—	1.42%
	投資証券 1銘柄	—	3.19%	0.05%
シンガポールドル	株式 27銘柄	94.74%	—	0.79%
	投資証券 3銘柄	—	5.26%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.00%	—	0.06%
スウェーデンクローネ	株式 31銘柄	100.00%	—	1.47%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.00%	—	0.44%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.00%	—	0.57%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.00%	—	0.24%
ユーロ	株式 228銘柄	98.93%	—	13.48%
	投資証券 6銘柄	—	1.07%	0.15%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「新興国株式インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	285,596,161	580,333,506
コール・ローン	66,228,570	89,313,714
株式	12,517,424,739	20,628,179,002
投資証券	123,598,583	—
派生商品評価勘定	46,637,666	5,647,501
未収配当金	13,525,326	16,499,069
未収利息	152	234
差入委託証拠金	123,010,487	47,452,672
流動資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698
資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	—	3,486,449
未払金	—	7,232
未払解約金	7,760,426	67,882,882
流動負債合計	7,760,426	71,376,563
負債合計	7,760,426	71,376,563
純資産の部		
元本等		
元本	1 9,361,956,272	11,906,677,405
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	3,806,304,986	9,389,371,730
元本等合計	13,168,261,258	21,296,049,135
純資産合計	13,168,261,258	21,296,049,135
負債純資産合計	13,176,021,684	21,367,425,698

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(2) 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	株式および投資証券は移動平均法、株式および投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	8,529,931,787円	9,361,956,272円
期首からの追加設定元本額	980,282,025円	3,515,599,009円
期首からの一部解約元本額	148,257,540円	970,877,876円
元本の内訳＊		
ＦＰバランスファンド（安定型）	6,276,576円	5,784,651円
ＦＰバランスファンド（安定成長型）	42,732,885円	31,068,433円
e M A X I S 新興国株式インデックス	7,938,153,268円	9,665,560,377円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	9,945,628円	60,856,926円
e M A X I S バランス（波乗り型）	2,388,202円	62,298,418円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	—	264,392円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国株式インデックスファンド	518,388,873円	1,173,326,842円
新興国株式インデックスオープン	88,742,635円	99,900,371円
e M A X I S 全世界株式インデックス	101,760,173円	130,663,297円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,803,933円	5,684,274円
M U A M 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	647,764,099円	671,269,424円
（合 計）	9,361,956,272円	11,906,677,405円
2 受益権の総数	9,361,956,272口	11,906,677,405口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4066円 (14,066円)	1.7886円 (17,886円)

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および投資証券を実質的な主要投資対象としております。株式および投資証券の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左 同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	628,717,128	1,855,060,107
投資証券	17,959,633	—
合 計	646,676,761	1,855,060,107

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

区 分	種 類	[平成24年1月26日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	440,630,700	—	487,268,366	46,637,666
	合 計	440,630,700	—	487,268,366	46,637,666

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	675,605,999	—	677,767,051	2,161,052
	合 計	675,605,999	—	677,767,051	2,161,052

(注) 時価の算定方法

1 株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(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。

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通 貨	銘 柄	株式数	評 価 額		備 考
			単 価	金 額	
アメリカドル					
	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	5,000	24.970000	124,850.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	7,199	18.820000	135,485.18	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	10,800	31.240000	337,392.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	43,132	5.575000	240,460.90	
	COMPANHIA DE BEBIDAS-PRF ADR	3,000	45.770000	137,310.00	
	CREDICORP LTD	3,800	156.490000	594,662.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	2,000	63.270000	126,540.00	
	FEDERAL HYDROGENERATING-ADR	75,000	2.568000	192,600.00	
	GAZPROM OAO-SPON ADR	315,000	9.740000	3,068,100.00	
	HDFC BANK LTD-ADR	4,500	40.810000	183,645.00	
	HON HAI PRECISION-GDR REG S	43,366	5.635000	244,367.41	
	INFOSYS LTD-SP ADR	4,000	52.670000	210,680.00	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,000	5.839000	210,204.00	
	ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	7,090	17.640000	125,067.60	
	LSR GROUP OJSC-GDR REGS	18,000	4.989000	89,802.00	
	LUKOIL OAO-SPON ADR	30,400	67.400000	2,048,960.00	
	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	15,000	46.250000	693,750.00	
	MECHEL-SPONSORED ADR	18,400	6.820000	125,488.00	
	MEGAFON-GDR	4,500	27.000000	121,500.00	
	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	27,300	20.340000	555,282.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	30,000	19.210000	576,300.00	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	5,600	119.200000	667,520.00	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7,000	22.090000	154,630.00	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	6,900	38.250000	263,925.00	
	ORASCOM TELECOM-GDR REG S	40,000	3.168000	126,720.00	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	5,500	19.810000	108,955.00	
	RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A	6,000	34.070000	204,420.00	
	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	72,000	9.100000	655,200.00	
	ROSTELECOM-SPONSORED ADR	10,500	24.800000	260,400.00	
	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	340	648.000000	220,320.00	
	SASOL LTD-SPONSORED ADR	2,000	42.650000	85,300.00	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	167,000	13.900000	2,321,300.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	10,000	12.920000	129,200.00	
	SISTEMA JSFC-REG S SPONS GDR	9,000	21.400000	192,600.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	10,107	41.250000	416,913.75	
	SURGUTNEFTGAS-SP ADR	76,000	9.830000	747,080.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	7,614	17.750000	135,148.50	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	14,766	46.220000	682,484.52	
	TMK-GDR REG S	6,000	15.360000	92,160.00	
	URALKALI-SPON GDR-REG S	15,400	38.250000	589,050.00	
	VALE SA-SP ADR	10,000	19.550000	195,500.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S	89,000	3.880000	345,320.00	
	アメリカドル 小 計	1,274,214	—	18,736,592.86 (1,705,592,048)	
香港ドル					
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	10.980000	1,317,600.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,230,000	4.220000	5,190,600.00	
	AIR CHINA LTD-H	26,000	6.660000	173,160.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.780000	793,800.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	24,000	6.060000	145,440.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	74,000	28.750000	2,127,500.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	65,000	6.890000	447,850.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	120,000	3.650000	438,000.00	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,330,000	3.760000	16,280,800.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	401,900	6.390000	2,568,141.00	
	BBMG CORPORATION-H	80,000	7.150000	572,000.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	130,000	6.380000	829,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	30,000	54.450000	1,633,500.00	
	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	255,000	17.300000	4,411,500.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	220,000	2.260000	497,200.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	150,000	10.060000	1,509,000.00	

BYD CO LTD-H	10,500	25.950000	272,475.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	134,000	4.720000	632,480.00	
CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	100,000	5.410000	541,000.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	450,000	5.230000	2,353,500.00	
CHINA COAL ENERGY CO-H	230,000	8.520000	1,959,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	265,000	7.820000	2,072,300.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	170,000	4.460000	758,200.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,175,550	6.670000	27,850,918.50	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	70,000	4.300000	301,000.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	54,000	14.420000	778,680.00	
CHINA FOODS LTD	56,000	7.120000	398,720.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	180,000	6.610000	1,189,800.00	
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H	9,300	14.800000	137,640.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	422,000	25.650000	10,824,300.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	106,000	6.380000	676,280.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	76,000	23.050000	1,751,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	209,550	18.440000	3,864,102.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	68,000	26.850000	1,825,800.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	280,000	10.860000	3,040,800.00	
CHINA MOBILE LTD	349,500	84.000000	29,358,000.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	150,000	11.760000	1,764,000.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	68,000	16.480000	1,120,640.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	224,000	24.200000	5,420,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	138,000	30.700000	4,236,600.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	990,000	9.440000	9,345,600.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	120,000	8.160000	979,200.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	283,000	4.320000	1,222,560.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	140,000	4.890000	684,600.00	
CHINA RESOURCES ENTERPRISE	74,000	27.300000	2,020,200.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	60,000	16.760000	1,005,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	136,000	22.800000	3,100,800.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	110,000	20.400000	2,244,000.00	
CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	100,000	5.370000	537,000.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	192,000	32.350000	6,211,200.00	
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	161,000	2.430000	391,230.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	40,000	4.510000	180,400.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	140,000	4.590000	642,600.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	100,000	10.160000	1,016,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	26,000	15.500000	403,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	830,000	4.190000	3,477,700.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	284,000	12.240000	3,476,160.00	
CHINA VANKE CO LTD -B	84,951	16.160000	1,372,808.16	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	120,000	4.850000	582,000.00	
CITIC PACIFIC LTD	50,000	12.520000	626,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	42,000	19.720000	828,240.00	
CNOOC LTD	1,040,000	15.820000	16,452,800.00	
COSCO PACIFIC LTD	80,000	12.240000	979,200.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	197,232	3.920000	773,149.44	
CSR CORP LTD - H	80,000	6.260000	500,800.00	
DAH CHONG HONG	70,000	8.820000	617,400.00	
DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	60,000	9.790000	587,400.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	200,000	3.090000	618,000.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	5,600	14.700000	82,320.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	168,000	12.220000	2,052,960.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	40,000	38.400000	1,536,000.00	
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	240,000	4.140000	993,600.00	
FAR EAST HORIZON LTD	70,000	5.710000	399,700.00	
FOSUN INTERNATIONAL	93,000	5.400000	502,200.00	
FRANSHION PROPERTIES	200,000	2.820000	564,000.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	400,000	2.140000	856,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	290,000	4.040000	1,171,600.00	
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP	40,000	17.780000	711,200.00	
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	310,000	0.960000	297,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	29.900000	1,794,000.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	116,000	6.180000	716,880.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	130,675	6.380000	833,706.50	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	39,200	13.880000	544,096.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	65,000	12.400000	806,000.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	70,000	12.480000	873,600.00	

HENGAN INTL GROUP CO LTD	40,000	76.350000	3,054,000.00	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	120,000	4.210000	505,200.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	196,000	7.270000	1,424,920.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,756,350	5.910000	22,200,028.50	
INTIME DEPARTMENT STORE	80,000	10.540000	843,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	70,000	7.850000	549,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	82,000	20.350000	1,668,700.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	45,000	26.200000	1,179,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	180,000	16.340000	2,941,200.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	170,000	5.080000	863,600.00	
LENOVO GROUP LTD	368,000	8.220000	3,024,960.00	
LONGFOR PROPERTIES	100,000	14.420000	1,442,000.00	
MMG LTD	140,000	3.090000	432,600.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	128,000	6.960000	890,880.00	
PARKSON RETAIL GROUP LTD	64,000	6.200000	396,800.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,219,000	11.040000	13,457,760.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	160,000	11.500000	1,840,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	109,000	68.650000	7,482,850.00	
POLY PROPERTY GROUP CO LTD	90,000	5.950000	535,500.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	104,000	7.300000	759,200.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	300,000	3.220000	966,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	32,000	27.450000	878,400.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,000	16.080000	804,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	104,500	15.960000	1,667,820.00	
SHOUGANG FUSHAN RESOURCES GR	168,000	3.210000	539,280.00	
SHUI ON LAND LTD	227,600	3.670000	835,292.00	
SIHUA PHARMACEUTICAL HLDGS	160,000	3.390000	542,400.00	
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	130,000	6.210000	807,300.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	24,000	2.560000	61,440.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	30,000	24.500000	735,000.00	
SOHO CHINA LTD	150,000	6.960000	1,044,000.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	140,000	11.140000	1,559,600.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	59,000	267.200000	15,764,800.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	108,000	21.650000	2,338,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	45.700000	731,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	86,000	9.480000	815,280.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	335,000	10.420000	3,490,700.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	29,200	31.250000	912,500.00	
WUMART STORES INC-H	35,000	15.380000	538,300.00	
YANZHOU COAL MINING CO-H	126,000	13.160000	1,658,160.00	
YINGDE GASES GROUP COMPANY	80,000	8.340000	667,200.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	500,000	2.730000	1,365,000.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	50,000	11.640000	582,000.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	100,000	6.730000	673,000.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	52,000	11.880000	617,760.00	
ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	31,000	25.000000	775,000.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	240,000	3.010000	722,400.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	52,000	10.360000	538,720.00	
ZTE CORP-H	38,276	14.360000	549,643.36	
香港ドル 小 計	34,283,884	—	326,348,330.46 (3,831,329,399)	
マレーシアリンギット				
AIRASIA BHD	130,000	2.780000	361,400.00	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	70,000	4.270000	298,900.00	
AMMB HOLDINGS BHD	114,000	6.370000	726,180.00	
AXIATA GROUP BERHAD	150,000	6.370000	955,500.00	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	42,928	4.360000	187,166.08	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD-NEW	953	4.360000	4,155.08	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	6,000	58.340000	350,040.00	
BUMI ARMADA BERHAD	70,000	3.770000	263,900.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	276,800	7.210000	1,995,728.00	
DIGI.COM BHD	175,000	4.930000	862,750.00	
FELDA GLOBAL VENTURES	70,000	4.590000	321,300.00	
GAMUDA BHD	105,000	3.640000	382,200.00	
GENTING BHD	114,900	9.600000	1,103,040.00	
GENTING MALAYSIA BHD	127,900	3.700000	473,230.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	15,000	8.550000	128,250.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	29,000	14.220000	412,380.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	9,000	13.700000	123,300.00	
IHH HEALTHCARE BHD	140,000	3.300000	462,000.00	

	IJM CORP BHD	59,100	5.020000	296,682.00	
	IOI CORPORATION BHD	176,400	4.930000	869,652.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	25,700	21.860000	561,802.00	
	LAFARGE MALAYAN CEMENT BHD	25,000	9.400000	235,000.00	
	MALAYAN BANKING BHD	236,000	8.900000	2,100,400.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	40,000	5.500000	220,000.00	
	MAXIS BHD	138,000	6.380000	880,440.00	
	MISC BHD	60,000	4.350000	261,000.00	
	MMC CORP BHD	14,000	2.520000	35,280.00	
	PARKSON HOLDINGS BHD	45,000	4.770000	214,650.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	145,000	6.070000	880,150.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	12,000	23.000000	276,000.00	
	PETRONAS GAS BHD	33,700	18.900000	636,930.00	
	PPB GROUP BERHAD	16,300	12.400000	202,120.00	
	PUBLIC BANK BHD-FOREIGN MKT	60,000	15.660000	939,600.00	
	RHB CAPITAL BHD	45,000	7.760000	349,200.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	130,000	2.950000	383,500.00	
	SIME DARBY BERHAD	160,000	9.290000	1,486,400.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	60,000	5.570000	334,200.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	150,000	7.050000	1,057,500.00	
	UEM LAND HOLDINGS BHD	120,000	2.190000	262,800.00	
	UMW HOLDINGS BHD	35,000	12.100000	423,500.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	302,464	1.730000	523,262.72	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	200,000	1.550000	310,000.00	
	マレーシアリングット 小 計	3,935,145	—	23,151,487.88 (689,914,338)	
タイバーツ					
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	72,700	206.000000	14,976,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	32,000	108.000000	3,456,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	85,000	202.000000	17,170,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	24,000	129.000000	3,096,000.00	
	BANK OF AYUDHYA PUBLIC-NVDR	123,300	34.000000	4,192,200.00	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	6,000	392.000000	2,352,000.00	
	BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	55,000	68.750000	3,781,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	50,000	82.500000	4,125,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	150,000	34.250000	5,137,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	265,200	49.000000	12,994,800.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	40,000	77.250000	3,090,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	60,000	27.000000	1,620,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	650,000	4.320000	2,808,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	108,000	196.500000	21,222,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	200,000	23.700000	4,740,000.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	81,000	162.500000	13,162,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	81,561	79.500000	6,484,099.50	
	PTT PCL-NVDR	51,000	333.000000	16,983,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	22,000	446.000000	9,812,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	97,000	178.000000	17,266,000.00	
	SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	7,000	432.000000	3,024,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	70,000	73.000000	5,110,000.00	
	タイバーツ 小 計	2,330,761	—	176,602,549.50 (536,871,750)	
フィリピンペソ					
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	150,000	55.750000	8,362,500.00	
	ABOITIZ POWER CORP	110,000	37.900000	4,169,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	300,000	17.480000	5,244,000.00	
	AYALA CORPORATION	11,920	552.000000	6,579,840.00	
	AYALA LAND INC	300,000	27.750000	8,325,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	52,000	105.000000	5,460,000.00	
	BDO UNIBANK INC	70,000	76.150000	5,330,500.00	
	DMCI HOLDINGS INC	60,000	54.300000	3,258,000.00	
	ENERGY DEVELOPMENT CORP	500,000	6.980000	3,490,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,000	1,168.000000	2,336,000.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	50,000	76.350000	3,817,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	10,200	107.100000	1,092,420.00	
	PHILIPPINE LONG DISTANCE TEL	2,500	2,820.000000	7,050,000.00	
	SAN MIGUEL CORP	30,000	105.900000	3,177,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	9,400	944.000000	8,873,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	562,500	16.980000	9,551,250.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	55,000	86.200000	4,741,000.00	

フィリピンペソ 小 計	2,275,520	—	90,857,610.00 (203,521,046)	
インドネシアルピア				
ADARO ENERGY TBK PT	1,000,000	1,700.000000	1,700,000,000.00	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	36,000	19,350.000000	696,600,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,140,000	7,800.000000	8,892,000,000.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	720,000	9,350.000000	6,732,000,000.00	
BANK DANAMON INDONESIA TBK	116,000	6,050.000000	701,800,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	477,000	8,800.000000	4,197,600,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	330,000	3,875.000000	1,278,750,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	670,000	7,850.000000	5,259,500,000.00	
BUMI RESOURCES TBK PT	1,000,000	620.000000	620,000,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	420,000	3,650.000000	1,533,000,000.00	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	450,000	2,300.000000	1,035,000,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	25,000	50,500.000000	1,262,500,000.00	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH TBK P	22,000	40,400.000000	888,800,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	85,000	21,600.000000	1,836,000,000.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	247,000	6,000.000000	1,482,000,000.00	
INDOSAT TBK PT	120,000	7,000.000000	840,000,000.00	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	150,000	5,150.000000	772,500,000.00	
KALBE FARMA TBK PT	1,250,000	1,060.000000	1,325,000,000.00	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	260,000	2,425.000000	630,500,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	602,500	4,650.000000	2,801,625,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	180,000	15,450.000000	2,781,000,000.00	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	56,500	15,700.000000	887,050,000.00	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	590,000	9,800.000000	5,782,000,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	90,000	22,250.000000	2,002,500,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	95,000	20,000.000000	1,900,000,000.00	
XL AXIATA TBK PT	130,000	5,300.000000	689,000,000.00	
インドネシアルピア 小 計	10,262,000	—	58,526,725,000.00 (550,151,215)	
メキシコペソ				
ALFA S.A.B. -A	170,000	30.940000	5,259,800.00	
ALPEK SA DE CV	35,000	32.500000	1,137,500.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,115,000	15.950000	33,734,250.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	19,866	95.920000	1,905,546.72	
CEMEX SAB-CPO	671,031	13.620000	9,139,442.22	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	24,200	199.680000	4,832,256.00	
COMPARTAMOS SAB DE CV	56,000	19.400000	1,086,400.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	11,000	139.570000	1,535,270.00	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	111,000	138.450000	15,367,950.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,000	152.560000	2,135,840.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	17,000	78.660000	1,337,220.00	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	108,000	33.360000	3,602,880.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	33,700	61.620000	2,076,594.00	
GRUPO FIN SANTANDER-B	95,000	42.510000	4,038,450.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	112,000	89.770000	10,054,240.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	118,000	36.480000	4,304,640.00	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	226,770	49.730000	11,277,272.10	
GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	34,200	114.760000	3,924,792.00	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	140,000	71.790000	10,050,600.00	
INDUSTRIAS CH S.A.B.-SER B	11,000	101.960000	1,121,560.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,000	635.010000	5,080,080.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	84,600	34.550000	2,922,930.00	
MEXICHEM SAB DE CV-*	65,000	73.250000	4,761,250.00	
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	38,700	54.430000	2,106,441.00	
WALMART DE MEXICO-SER V	307,000	40.990000	12,583,930.00	
メキシコペソ 小 計	4,626,067	—	155,377,134.04 (1,115,607,822)	
ブラジルレアル				
AES TIETE SA-PREF	6,700	21.500000	144,050.00	
ALL AMERICA LATINA LOGISTICA	33,000	8.570000	282,810.00	
AMIL PARTICIPACOES SA	6,000	31.160000	186,960.00	
ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTI	9,000	35.900000	323,100.00	
ARTERIS SA	8,000	19.700000	157,600.00	
BANCO BRADESCO S.A.	28,800	36.350000	1,046,880.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	108,186	37.750000	4,084,021.50	
BANCO DO BRASIL S.A.	30,900	25.400000	784,860.00	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	10,000	17.500000	175,000.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	46,000	14.640000	673,440.00	

BM&FBOVESPA SA	100,000	13.640000	1,364,000.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	25,000	26.850000	671,250.00	
BR PROPERTIES SA	14,000	26.560000	371,840.00	
BRADSPAR SA -PREF	9,000	30.520000	274,680.00	
BRASKEM SA-PREF A	2,000	13.960000	27,920.00	
BRF - BRASIL FOODS SA	36,500	45.600000	1,664,400.00	
CCR SA	51,000	20.270000	1,033,770.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR	18,500	7.250000	134,125.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	12,000	12.650000	151,800.00	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	14,000	24.720000	346,080.00	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	6,100	88.670000	540,887.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	42,500	92.400000	3,927,000.00	
CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	5,500	91.130000	501,215.00	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	8,700	20.900000	181,830.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	27,833	22.560000	627,912.48	
CIA HERING	7,000	36.500000	255,500.00	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,000	33.220000	265,760.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	7,000	90.770000	635,390.00	
CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS	4,500	46.900000	211,050.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,200	11.380000	480,236.00	
CIELO SA	15,744	54.750000	861,984.00	
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	7,500	44.490000	333,675.00	
CPFL ENERGIA SA	14,500	21.470000	311,315.00	
CYRELA BRAZIL REALTY SA EMP	20,000	18.000000	360,000.00	
DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA	10,000	13.220000	132,200.00	
DURATEX SA	14,760	14.020000	206,935.20	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	12,000	17.460000	209,520.00	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	18,000	12.350000	222,300.00	
ELETROPAULO METROPOLI-PREF	6,000	14.150000	84,900.00	
EMBRAER SA	33,000	15.930000	525,690.00	
FIBRIA CELULOSE SA	11,000	26.200000	288,200.00	
GERDAU SA-PREF	49,200	17.690000	870,348.00	
HYPERMARCAS SA	21,000	16.480000	346,080.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	125,400	35.740000	4,481,796.00	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	138,972	10.490000	1,457,816.28	
JBS SA	30,000	7.590000	227,700.00	
KLABIN SA-PREF	25,000	13.680000	342,000.00	
KROTON EDUCACIONAL SA	3,000	45.550000	136,650.00	
LIGHT SA	5,000	21.250000	106,250.00	
LOCALIZA RENT A CAR	6,000	36.400000	218,400.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	29,215	17.280000	504,835.20	
LOJAS RENNER S.A.	7,500	78.270000	587,025.00	
MARCOPOLO SA-PREF	15,000	13.150000	197,250.00	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	16,500	22.320000	368,280.00	
MPX ENERGIA SA	13,500	11.400000	153,900.00	
MRV ENGENHARIA	22,000	10.900000	239,800.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	5,000	57.190000	285,950.00	
MULTIPLUS SA	3,500	43.950000	153,825.00	
NATURA COSMETICOS SA	10,000	55.150000	551,500.00	
ODONTOPREV S.A.	21,000	10.140000	212,940.00	
OGX PETROLEO E GAS PARTICIPA	68,000	4.820000	327,760.00	
OI SA	5,589	9.050000	50,580.45	
OI SA-PREFERENCE	63,815	7.960000	507,967.40	
PDG REALTY SA	79,000	3.200000	252,800.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	171,000	19.920000	3,406,320.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	232,000	19.610000	4,549,520.00	
PORTO SEGURO SA	8,900	24.080000	214,312.00	
QUALICORP SA	6,000	21.330000	127,980.00	
RAIA DROGASIL SA	9,000	22.900000	206,100.00	
SOUZA CRUZ SA	21,000	32.300000	678,300.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	10,000	17.400000	174,000.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	16,975	50.520000	857,577.00	
TIM PARTICIPACOES SA	54,377	8.600000	467,642.20	

（単位：円）

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ブラジルリアル					
	TOTVS SA	6,000	43.070000	258,420.00	
	TRACTEBEL ENERGIA SA	7,500	36.030000	270,225.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	18,000	45.500000	819,000.00	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	17,000	10.570000	179,690.00	
	VALE SA	67,000	40.000000	2,680,000.00	
	VALE SA-PREF	113,000	38.630000	4,365,190.00	
	WEG SA	15,000	26.870000	403,050.00	
	ブラジルリアル 小 計	2,426,366	—	57,300,865.71 (2,569,370,818)	
チリペソ					
	AES GENER SA	140,000	318.650000	44,611,000.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	180,000	348.600000	62,748,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,100,000	77.500000	85,250,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,522	35,399.000000	53,877,278.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	3,800,000	35.590000	135,242,000.00	
	CAP SA	4,500	17,500.000000	78,750,000.00	
	CENCOSUD SA	61,000	2,835.800000	172,983,800.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	6,900	7,603.300000	52,462,770.00	
	COLBUN SA	350,000	144.060000	50,421,000.00	
	CORPBANCA	6,000,000	6.571000	39,426,000.00	
	E.CL SA	30,000	1,124.500000	33,735,000.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	14,000	3,070.000000	42,980,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC	200,000	809.390000	161,878,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	5,000	10,290.000000	51,450,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	64,000	1,863.800000	119,283,200.00	
	EMPRESAS COPEC SA	25,200	7,215.600000	181,833,120.00	
	ENERSIS SA	760,000	182.850000	138,966,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	16,500	11,688.000000	192,852,000.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	27,000	5,295.600000	142,981,200.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,300	27,080.000000	143,524,000.00	
	VINA CONCHA Y TORO SA	35,000	943.950000	33,038,250.00	
	チリペソ 小 計	12,825,922	—	2,018,292,618.00 (389,328,646)	
韓国ウォン					
	AMOREPACIFIC CORP	150	1,062,000.000000	159,300,000.00	
	AMOREPACIFIC GROUP	220	427,500.000000	94,050,000.00	
	BS FINANCIAL GROUP INC	9,500	14,450.000000	137,275,000.00	
	CELLTRION INC	5,250	25,000.000000	131,250,000.00	
	CELLTRION INC-NEW	779	25,000.000000	19,475,000.00	
	CHEIL INDUSTRIES INC	2,800	87,700.000000	245,560,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	6,500	20,800.000000	135,200,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	500	370,000.000000	185,000,000.00	
	CJ CORP	1,200	128,000.000000	153,600,000.00	
	COWAY CO LTD	1,800	46,350.000000	83,430,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2,000	88,100.000000	176,200,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,000	9,390.000000	84,510,000.00	
	DAEWOO INTERNATIONAL CORP	2,618	36,450.000000	95,426,100.00	
	DAEWOO SECURITIES CO LTD	10,738	11,850.000000	127,245,300.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	4,500	29,350.000000	132,075,000.00	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	7,000	14,550.000000	101,850,000.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	2,050	46,000.000000	94,300,000.00	
	DOOSAN CORP	450	129,000.000000	58,050,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,100	45,600.000000	141,360,000.00	
	DOOSAN INFRACORE CO LTD	5,000	16,400.000000	82,000,000.00	
	E-MART CO LTD	1,200	221,500.000000	265,800,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,300	54,000.000000	70,200,000.00	
	GS HOLDINGS	2,500	68,600.000000	171,500,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	14,300	39,250.000000	561,275,000.00	
	HANKOOK TIRE CO LTD	4,476	45,600.000000	204,105,600.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	4,000	19,150.000000	76,600,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,500	32,550.000000	81,375,000.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,000	7,570.000000	98,410,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,200	62,600.000000	75,120,000.00	
	HYUNDAI DEPT STORE CO	900	159,000.000000	143,100,000.00	
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	1,400	21,750.000000	30,450,000.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4,000	68,200.000000	272,800,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	750	189,000.000000	141,750,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,250	215,500.000000	484,875,000.00	
HYUNDAI HYSKO	2,500	40,650.000000	101,625,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,500	34,900.000000	122,150,000.00	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	4,000	21,200.000000	84,800,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	550	120,500.000000	66,275,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	3,950	263,500.000000	1,040,825,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	8,750	201,000.000000	1,758,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2,100	73,500.000000	154,350,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,000	67,000.000000	134,000,000.00	
HYUNDAI SECURITIES CO	8,500	8,690.000000	73,865,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	3,500	81,700.000000	285,950,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	800	140,000.000000	112,000,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	10,500	11,850.000000	124,425,000.00	
KANGWON LAND INC	5,500	31,300.000000	172,150,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	21,200	39,500.000000	837,400,000.00	
KCC CORP	60	283,000.000000	16,980,000.00	
KIA MOTORS CORPORATION	15,200	49,750.000000	756,200,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,500	25,000.000000	87,500,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,000	34,750.000000	556,000,000.00	
KOREA EXCHANGE BANK	16,000	7,330.000000	117,280,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,400	70,600.000000	98,840,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,000	44,450.000000	133,350,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	350	385,000.000000	134,750,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,800	44,750.000000	125,300,000.00	
KT CORP	2,500	38,150.000000	95,375,000.00	
KT&G CORP	6,000	76,000.000000	456,000,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	650	123,000.000000	79,950,000.00	
LG CHEM LTD	2,700	309,000.000000	834,300,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	750	94,000.000000	70,500,000.00	
LG CORP	6,100	63,400.000000	386,740,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	12,500	27,850.000000	348,125,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,471	72,600.000000	397,194,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	550	590,000.000000	324,500,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	850	77,300.000000	65,705,000.00	
LG UPLUS CORP	11,000	8,160.000000	89,760,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	930	238,000.000000	221,340,000.00	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	55	1,656,000.000000	91,080,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	600	366,500.000000	219,900,000.00	
LS CORP	1,330	87,600.000000	116,508,000.00	
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	250	65,900.000000	16,475,000.00	
MANDO CORP	500	117,500.000000	58,750,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	300	37,900.000000	11,370,000.00	
NCSOFT CORPORATION	900	150,500.000000	135,450,000.00	
NHN CORP	2,500	248,500.000000	621,250,000.00	
OCI CO LTD	900	173,500.000000	156,150,000.00	
ORION CORP	200	1,037,000.000000	207,400,000.00	
POSCO	3,900	367,000.000000	1,431,300,000.00	
S1 CORPORATION	1,300	69,400.000000	90,220,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,900	60,000.000000	414,000,000.00	
SAMSUNG CARD CO	3,000	36,500.000000	109,500,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3,200	93,200.000000	298,240,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,350	1,417,000.000000	8,997,950,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	980	828,000.000000	811,440,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,800	150,500.000000	270,900,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,850	221,500.000000	409,775,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	9,800	37,150.000000	364,070,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,700	108,500.000000	401,450,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,950	143,000.000000	278,850,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	3,863	56,200.000000	217,100,600.00	
SAMSUNG TECHWIN CO LTD	2,380	56,800.000000	135,184,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	24,700	40,500.000000	1,000,350,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	234	216,500.000000	50,661,000.00	
SK C&C CO LTD	1,200	102,500.000000	123,000,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,550	174,500.000000	270,475,000.00	
SK HYNIX INC	29,000	24,200.000000	701,800,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	3,460	169,500.000000	586,470,000.00	
SK NETWORKS CO LTD	9,000	8,130.000000	73,170,000.00	

SK TELECOM	450	170,500.000000	76,725,000.00	
S-OIL CORPORATION	2,700	98,500.000000	265,950,000.00	
WOORI FINANCE HOLDINGS CO	21,500	12,550.000000	269,825,000.00	
WOORI INVESTMENT & SECURITIE	8,539	12,300.000000	105,029,700.00	
YUHAN CORPORATION	582	179,000.000000	104,178,000.00	
韓国ウォン 小 計	476,015	—	35,070,717,900.00 (2,959,968,590)	
ニュー台湾ドル				
ACER INC	113,168	24.000000	2,716,032.00	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	352,589	24.100000	8,497,394.90	
ADVANTECH CO LTD	25,000	118.500000	2,962,500.00	
ASIA CEMENT CORP	124,915	36.450000	4,553,151.75	
ASUSTEK COMPUTER INC	36,774	337.500000	12,411,225.00	
AU OPTRONICS CORP	440,000	12.000000	5,280,000.00	
CAPITAL SECURITIES CORP	200,000	10.750000	2,150,000.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	34,000	127.000000	4,318,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	408,887	32.000000	13,084,384.00	
CHAILLEASE HOLDING CO LTD	50,000	76.900000	3,845,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	306,608	15.700000	4,813,745.60	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	103,968	74.000000	7,693,632.00	
CHENG UEI PRECISION INDUSTRY	32,000	55.200000	1,766,400.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	41,400	75.900000	3,142,260.00	
CHINA AIRLINES LTD	180,000	12.700000	2,286,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	615,255	7.700000	4,737,463.50	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	112,784	27.850000	3,141,034.40	
CHINA PETROCHEMICAL DEV CORP	129,250	18.200000	2,352,350.00	
CHINA STEEL CORP	617,214	27.400000	16,911,663.60	
CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	669,605	16.600000	11,115,443.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	213,000	94.400000	20,107,200.00	
CLEVO COMPANY	8,403	38.800000	326,036.40	
COMPAL ELECTRONICS	231,775	20.700000	4,797,742.50	
CTCI CORP	50,000	57.300000	2,865,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	102,220	106.000000	10,835,320.00	
E INK HOLDINGS INC	48,000	20.150000	967,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	247,170	15.900000	3,930,003.00	
EPISTAR CORP	40,000	54.800000	2,192,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	132,000	18.150000	2,395,800.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	153,999	18.200000	2,802,781.80	
FAR EASTERN DEPARTMENT STORE	71,656	28.700000	2,056,527.20	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	139,410	33.100000	4,614,471.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	88,000	74.000000	6,512,000.00	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	8,000	53.600000	428,800.00	
FENG HSIN IRON & STEEL CO	7,000	52.000000	364,000.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	420,477	17.500000	7,358,347.50	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	181,000	77.400000	14,009,400.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,150	81.500000	4,983,725.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	222,000	78.800000	17,493,600.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	80,000	27.200000	2,176,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	50,300	83.800000	4,215,140.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	306,087	36.400000	11,141,566.80	
GIANT MANUFACTURING	12,000	152.500000	1,830,000.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	36,000	56.700000	2,041,200.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10,815	230.000000	2,487,450.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	486,336	83.400000	40,560,422.40	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	13,000	227.000000	2,951,000.00	
HTC CORP	38,744	284.000000	11,003,296.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	325,077	16.450000	5,347,516.65	
INNOLUX CORP	320,112	14.650000	4,689,640.80	
INVENTEC CORP	200,429	11.450000	2,294,912.05	
KINSUS INTERCONNECT TECH	25,000	89.600000	2,240,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,020	742.000000	4,466,840.00	
LCY CHEMICAL CORP	42,000	37.800000	1,587,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	123,182	40.200000	4,951,916.40	
MACRONIX INTERNATIONAL	186,836	8.620000	1,610,526.32	
MEDIATEK INC	65,042	322.000000	20,943,524.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	436,754	23.200000	10,132,692.80	
MSTAR SEMICONDUCTOR INC	15,320	218.000000	3,339,760.00	
NAN KANG RUBBER TIRE CO LTD	53,104	33.550000	1,781,639.20	
NAN YA PLASTICS CORP	263,750	58.100000	15,323,875.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	36,000	113.000000	4,068,000.00	

ORIENTAL UNION CHEMICAL	40,000	34.650000	1,386,000.00	
PEGATRON CORP	86,976	38.800000	3,374,668.80	
PHISON ELECTRONICS CORP	7,000	207.000000	1,449,000.00	
POU CHEN	150,500	29.500000	4,439,750.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	36,300	45.300000	1,644,390.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	30,000	159.500000	4,785,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	132,150	63.600000	8,404,740.00	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	25,750	106.500000	2,742,375.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,350	61.100000	2,159,885.00	
RICHTEK TECHNOLOGY CORP	4,200	175.000000	735,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	55,000	61.900000	3,404,500.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	35,000	74.000000	2,590,000.00	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	19,000	67.900000	1,290,100.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	400,000	8.070000	3,228,000.00	
SILICONWARE PRECISION INDS	175,000	30.400000	5,320,000.00	
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	18,150	136.500000	2,477,475.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	308,800	12.550000	3,875,440.00	
STANDARD FOODS CORP	25,000	80.900000	2,022,500.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	68,137	58.100000	3,958,759.70	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	332,707	11.500000	3,826,130.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	240,000	8.690000	2,085,600.00	
TAIWAN CEMENT	155,706	39.100000	6,088,104.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	320,340	16.250000	5,205,525.00	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	70,000	71.000000	4,970,000.00	
TAIWAN GLASS IND CORP	68,970	27.900000	1,924,263.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,400	107.000000	10,314,800.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,388,000	99.000000	137,412,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	140,000	23.700000	3,318,000.00	
TPK HOLDING CO LTD	11,442	492.500000	5,635,185.00	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	27,750	56.800000	1,576,200.00	
TSRC CORP	33,000	58.600000	1,933,800.00	
TUNG HO STEEL ENTERPRISE COR	60,000	29.200000	1,752,000.00	
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	7,000	47.200000	330,400.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	95,000	28.550000	2,712,250.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	223,574	51.600000	11,536,418.40	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	720,000	11.250000	8,100,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	190,000	9.760000	1,854,400.00	
WINTEK CORP	76,994	13.650000	1,050,968.10	
WISTRON CORP	129,943	35.050000	4,554,502.15	
WPG HOLDINGS LTD	65,400	39.100000	2,557,140.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	436,909	15.150000	6,619,171.35	
YULON MOTOR COMPANY	58,000	52.700000	3,056,600.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,000	69.400000	1,388,000.00	
ニュー台湾ドル 小 計	16,770,033	—	677,091,194.17 (2,098,982,701)	
インドルビー				
ACC LTD	2,200	1,326.750000	2,918,850.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	13,000	258.650000	3,362,450.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	35,000	199.150000	6,970,250.00	
ASIAN PAINTS LTD	2,000	4,405.700000	8,811,400.00	
AXIS BANK LTD	13,000	1,386.250000	18,021,250.00	
BAJAJ AUTO LTD	5,000	2,080.000000	10,400,000.00	
BANK OF BARODA	5,200	882.000000	4,586,400.00	
BANK OF INDIA	10,000	363.750000	3,637,500.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	22,500	229.400000	5,161,500.00	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12,000	419.950000	5,039,400.00	
BHARTI AIRTEL LTD	30,000	360.500000	10,815,000.00	
CAIRN INDIA LTD	16,000	322.800000	5,164,800.00	
CIPLA LTD	25,000	397.900000	9,947,500.00	
COAL INDIA LTD	32,000	341.050000	10,913,600.00	
DABUR INDIA LTD	35,000	129.150000	4,520,250.00	
DLF LTD	30,000	259.750000	7,792,500.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	6,000	1,945.150000	11,670,900.00	
GAIL INDIA LTD	15,000	353.550000	5,303,250.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,000	724.900000	5,799,200.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,500	681.050000	9,194,175.00	
HDFC BANK LIMITED	71,000	665.050000	47,218,550.00	
HERO MOTOCORP LTD	3,500	1,764.900000	6,177,150.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	55,000	116.400000	6,402,000.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	52,000	476.500000	24,778,000.00	

HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	86,000	805.850000	69,303,100.00	
ICICI BANK LTD	25,000	1,172.950000	29,323,750.00	
IDEA CELLULAR LTD	50,000	113.400000	5,670,000.00	
IDFC LTD	50,000	169.650000	8,482,500.00	
INFOSYS LTD	20,100	2,814.650000	56,574,465.00	
ITC LTD	130,000	299.750000	38,967,500.00	
JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD	80,000	86.800000	6,944,000.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	13,000	433.450000	5,634,850.00	
JSW STEEL LTD	5,600	864.950000	4,843,720.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,000	665.200000	8,647,600.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,000	1,611.300000	19,335,600.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	20,000	283.050000	5,661,000.00	
LUPIN LTD	10,000	599.450000	5,994,500.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	18,000	901.500000	16,227,000.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,000	1,599.450000	3,198,900.00	
NTPC LTD	45,000	159.350000	7,170,750.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	48,000	341.100000	16,372,800.00	
POWER FINANCE CORPORATION	20,000	206.200000	4,124,000.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	70,000	111.000000	7,770,000.00	
RANBAXY LABORATORIES LTD	8,000	455.800000	3,646,400.00	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	62,000	912.200000	56,556,400.00	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	7,000	540.150000	3,781,050.00	
RELIANCE POWER LTD	40,000	94.500000	3,780,000.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	23,000	240.800000	5,538,400.00	
SATYAM COMPUTER SERVICES LTD	60,000	120.600000	7,236,000.00	
SESA GOA LTD	17,000	183.200000	3,114,400.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	10,000	758.750000	7,587,500.00	
SIEMENS LTD	6,000	641.500000	3,849,000.00	
STATE BANK OF INDIA	7,800	2,513.700000	19,606,860.00	
STERLITE INDUSTRIES INDIA LT	90,000	112.300000	10,107,000.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,000	728.700000	10,930,500.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	25,500	1,340.500000	34,182,750.00	
TATA MOTORS LTD	45,000	301.000000	13,545,000.00	
TATA POWER CO LTD	75,000	105.950000	7,946,250.00	
TATA STEEL LTD	20,000	406.750000	8,135,000.00	
TITAN INDUSTRIES LTD	17,000	274.450000	4,665,650.00	
ULTRATECH CEMENT LTD	2,300	1,916.650000	4,408,295.00	
UNITECH LTD	110,000	36.450000	4,009,500.00	
UNITED BREWERIES LTD	4,200	722.450000	3,034,290.00	
UNITED SPIRITS LTD	5,700	1,793.650000	10,223,805.00	
WIPRO LTD	32,000	407.650000	13,044,800.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	32,000	227.950000	7,294,400.00	
インドルピー 小 計	1,944,100	—	801,075,160.00 (1,369,838,523)	
チェココルナ				
CEZ AS	10,000	617.000000	6,170,000.00	
KOMERCNI BANKA AS	1,000	3,899.000000	3,899,000.00	
TELEFONICA CZECH REPUBLIC AS	4,600	327.000000	1,504,200.00	
チェココルナ 小 計	15,600	—	11,573,200.00 (55,435,628)	
コロンビアペソ				
ALMACENES EXITO SA	13,000	34,520.000000	448,760,000.00	
BANCO DAVIVIENDA SA	6,500	24,160.000000	157,040,000.00	
BANCOLOMBIA SA	14,000	30,660.000000	429,240,000.00	
BANCOLOMBIA SA-PREF	20,000	31,000.000000	620,000,000.00	
CEMENTOS ARGOS SA	26,000	10,880.000000	282,880,000.00	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	5,000	35,700.000000	178,500,000.00	
ECOPETROL SA	250,000	5,600.000000	1,400,000,000.00	
GRUPO ARGOS SA	18,000	22,300.000000	401,400,000.00	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	50,000	1,285.000000	64,250,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	15,000	37,320.000000	559,800,000.00	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	3,500	38,640.000000	135,240,000.00	
INTERCONEXION ELECTRICA SA	25,000	9,900.000000	247,500,000.00	
ISAGEN SA ESP	60,000	2,550.000000	153,000,000.00	
コロンビアペソ 小 計	506,000	—	5,077,610,000.00 (259,973,632)	
ハンガリーフォリント				
MAGYAR TELEKOM TELECOMMUNICA	35,000	400.000000	14,000,000.00	
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,200	18,600.000000	40,920,000.00	
OTP BANK PLC	13,000	4,590.000000	59,670,000.00	

ハンガリーフォリント 小 計	50,200	—	114,590,000.00 (47,176,703)	
ポーランドズロチ				
ASSECO POLAND SA	5,700	45.010000	256,557.00	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,900	96.250000	279,125.00	
BANK MILLENNIUM SA	45,000	5.170000	232,650.00	
BANK PEKAO SA	6,500	168.700000	1,096,550.00	
BRE BANK SA	1,000	330.000000	330,000.00	
CYFROWY POLSAT SA	16,200	17.100000	277,020.00	
EUROCASH SA	6,500	48.000000	312,000.00	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	3,000	93.000000	279,000.00	
KERNEL HOLDING SA	3,500	66.500000	232,750.00	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,000	187.500000	1,312,500.00	
PGE SA	39,500	18.150000	716,925.00	
PKO BANK POLSKI SA	45,000	34.700000	1,561,500.00	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,500	51.700000	1,008,150.00	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	80,200	5.750000	461,150.00	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,100	404.000000	1,252,400.00	
SYNTHOS SA	40,000	5.200000	208,000.00	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	60,000	4.680000	280,800.00	
TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA	44,000	11.920000	524,480.00	
ポーランドズロチ 小 計	428,600	—	10,621,557.00 (312,486,206)	
南アフリカランド				
ABSA GROUP LTD	15,400	168.000000	2,587,200.00	
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	46,000	31.300000	1,439,800.00	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	201.230000	1,408,610.00	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,400	439.000000	1,931,600.00	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,300	251.400000	5,354,820.00	
ARCELORMITTAL SOUTH AFRICA	18,260	34.700000	633,622.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	16,000	164.260000	2,628,160.00	
ASSORE LTD	3,000	433.000000	1,299,000.00	
AVENG LTD	25,000	29.260000	731,500.00	
BARLOWORLD LTD	15,000	88.770000	1,331,550.00	
BIDVEST GROUP LTD	16,500	220.000000	3,630,000.00	
DISCOVERY HOLDINGS LTD	20,000	66.290000	1,325,800.00	
EXXARO RESOURCES LTD	6,000	169.480000	1,016,880.00	
FIRSTRAND LTD	183,000	33.050000	6,048,150.00	
GOLD FIELDS LTD	46,000	107.000000	4,922,000.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	22,000	64.250000	1,413,500.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	33,000	165.750000	5,469,750.00	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	10,000	202.500000	2,025,000.00	
INVESTEC LTD	13,000	65.200000	847,600.00	
KUMBA IRON ORE LTD	4,500	582.120000	2,619,540.00	
LIBERTY HOLDINGS LTD	10,000	114.500000	1,145,000.00	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	65,000	32.770000	2,130,050.00	
MASSMART HOLDINGS LTD	6,930	187.500000	1,299,375.00	
MMI HOLDINGS LTD	50,000	23.500000	1,175,000.00	
MR PRICE GROUP LTD	15,000	127.850000	1,917,750.00	
MTN GROUP LTD	99,000	176.500000	17,473,500.00	
NASPERS LTD-N SHS	22,600	576.680000	13,032,968.00	
NEDBANK GROUP LTD	11,500	195.420000	2,247,330.00	
NETCARE LTD	55,900	19.940000	1,114,646.00	
NORTHAM PLATINUM LTD	20,000	36.500000	730,000.00	
PICK N PAY STORES LTD	19,000	46.500000	883,500.00	
PPC LTD	24,200	33.190000	803,198.00	
REMGRO LTD	24,000	166.700000	4,000,800.00	
REUNERT LTD	11,000	74.890000	823,790.00	
RMB HOLDINGS LTD	43,000	44.140000	1,898,020.00	
RMI HOLDINGS	56,500	22.350000	1,262,775.00	
SANLAM LTD	100,000	47.050000	4,705,000.00	
SAPPI LIMITED	22,700	32.710000	742,517.00	
SASOL LTD	30,800	379.510000	11,688,908.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	24,500	182.000000	4,459,000.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	8,000	121.950000	975,600.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	71,334	117.210000	8,361,058.14	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	68,147	27.320000	1,861,776.04	
THE FOSCHINI GROUP LTD	11,000	123.830000	1,362,130.00	
TIGER BRANDS LTD	10,300	298.290000	3,072,387.00	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	27,700	105.910000	2,933,707.00	

	VODACOM GROUP LTD	22,400	126.420000	2,831,808.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	41,000	65.890000	2,701,490.00	
	南アフリカランド 小 計	1,496,871	—	146,297,165.18 (1,484,916,226)	
トルコリラ					
	AKBANK T.A.S.	100,666	9.860000	992,566.76	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	13,000	26.800000	348,400.00	
	ARCELİK AS	20,000	12.300000	246,000.00	
	ASYA KATILIM BANKASI AS	55,000	2.490000	136,950.00	
	BİM BİRLİK MİĞAZALAR AS	6,000	89.500000	537,000.00	
	COCA-COLA İÇİCEK AS	4,500	42.800000	192,600.00	
	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ AS	15,554	5.660000	88,035.64	
	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİK	100,604	2.610000	262,576.44	
	FORD OTOMOTİV SANAYİ AS	6,500	21.750000	141,375.00	
	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG	50,000	10.500000	525,000.00	
	KOC HOLDİNG AS	28,350	10.000000	283,500.00	
	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ AS	2,500	45.700000	114,250.00	
	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG AS	16,000	10.300000	164,800.00	
	TUPRAS-TURKİYE PETROL RAFİNE	8,500	52.000000	442,000.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,856	7.380000	50,597.28	
	TURK SİSE VE CAM FABRİKALARI	30,000	3.490000	104,700.00	
	TURK TELEKOMÜNİKASYON AS	18,000	7.840000	141,120.00	
	TURKCELL İLETİŞİM HİZMET AS	46,000	12.000000	552,000.00	
	TURKİYE GARANTİ BANKASI	129,000	9.640000	1,243,560.00	
	TURKİYE HALK BANKASI	39,000	19.150000	746,850.00	
	TURKİYE İS BANKASI -C	92,726	7.160000	663,918.16	
	TURKİYE VAKIFLAR BANKASI T-D	51,000	5.520000	281,520.00	
	YAPI VE KREDİ BANKASI	40,000	5.620000	224,800.00	
	トルコリラ 小 計	879,756	—	8,484,119.28 (436,932,142)	
ユーロ					
	MAROC TELECOM	9,000	9.780000	88,020.00	
	ユーロ 小 計	9,000	—	88,020.00 (10,781,569)	
合 計		96,816,054	—	20,628,179,002 (20,628,179,002)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 42銘柄	100.00%	8.27%
香港ドル	株式 134銘柄	100.00%	18.57%
マレーシアリングット	株式 42銘柄	100.00%	3.34%
タイバーツ	株式 22銘柄	100.00%	2.60%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.00%	0.99%
インドネシアルピア	株式 26銘柄	100.00%	2.67%
メキシコペソ	株式 25銘柄	100.00%	5.41%
ブラジルレアル	株式 80銘柄	100.00%	12.46%
チリペソ	株式 21銘柄	100.00%	1.89%
韓国ウォン	株式 105銘柄	100.00%	14.35%
ニュー台湾ドル	株式 105銘柄	100.00%	10.18%
インドルピー	株式 66銘柄	100.00%	6.64%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.00%	0.27%
コロンビアペソ	株式 13銘柄	100.00%	1.26%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.00%	0.23%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	100.00%	1.51%
南アフリカランド	株式 48銘柄	100.00%	7.20%
トルコリラ	株式 23銘柄	100.00%	2.12%
ユーロ	株式 1銘柄	100.00%	0.05%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	562,278,274	1,832,296,148
国債証券	147,150,201,470	159,190,620,290
地方債証券	12,880,354,661	14,025,688,182
特殊債証券	18,845,185,595	21,470,772,345
社債証券	14,729,096,240	14,639,518,530
派生商品評価勘定	—	5,901,600
未収入金	41,827,200	—
未収利息	723,289,608	759,836,205
前払費用	39,680,716	32,781,086
差入委託証拠金	—	3,120,000
流動資産合計	194,971,913,764	211,960,534,386
資産合計	194,971,913,764	211,960,534,386
負債の部		
流動負債		
前受金	—	7,910,000
未払金	492,705,080	549,186,518
未払解約金	1,088,245	27,540,578
流動負債合計	493,793,325	584,637,096
負債合計	493,793,325	584,637,096
純資産の部		
元本等		
元本	165,752,517,161	176,492,322,675
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	28,725,603,278	34,883,574,615
元本等合計	194,478,120,439	211,375,897,290
純資産合計	194,478,120,439	211,375,897,290
負債純資産合計	194,971,913,764	211,960,534,386

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

(2) 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	有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	166,666,593,489円	165,752,517,161円
期首からの追加設定元本額	7,162,432,122円	28,262,456,754円
期首からの一部解約元本額	8,076,508,450円	17,522,651,240円
元本の内訳＊		
ファンド・マネジャー（国内債券）	333,287,751円	201,140,214円
e M A X I S 国内債券インデックス	1,138,280,497円	1,779,617,439円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	10,721,718円	82,037,215円
e M A X I S バランス（波乗り型）	5,619,996円	9,240,111円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,821,510,227円	54,506,116,734円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,551,251,016円	18,595,979,625円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ２０型（適格機関投資家限定）	3,596,945,069円	3,507,702,721円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	8,645,315,695円	9,190,839,984円
M U A M 日本債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	23,966,278,594円	24,738,924,258円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	19,953,801,860円	20,064,179,474円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	6,152,577,920円	6,395,215,321円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,371,960,448円	4,427,653,979円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	1,017,916,468円	1,117,325,992円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	487,416,262円	484,947,181円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,610,913,891円	7,784,114,750円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,573,639,303円	5,399,803,430円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,553,005円	11,652,726円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	318,163,539円	265,515,738円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	398,280,189円	395,581,444円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	327,691,684円	334,037,581円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	282,582,294円	267,896,360円
三菱ＵＦＪ 日本債券インデックスファンドＶＡ	199,240,964円	126,078,685円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	1,311,724,842円	1,350,638,449円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	2,937,850,064円	3,210,130,255円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	1,334,409,347円	1,403,259,050円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	1,886,423,918円	2,101,323,657円
三菱ＵＦＪ < D C > 日本債券インデックスファンド	1,405,800,511円	1,663,437,764円
三菱ＵＦＪ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	1,602,197,949円	1,751,366,541円
三菱ＵＦＪ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	2,762,611,045円	3,190,120,707円
三菱ＵＦＪ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	1,181,579,869円	1,440,676,228円
三菱ＵＦＪ < D C > インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	556,971,226円	695,769,062円
（合 計）	165,752,517,161円	176,492,322,675円
2 受益権の総数	165,752,517,161口	176,492,322,675口
3 １口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.1733円 (11,733円)	1.1976円 (11,976円)

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	983,168,280	353,888,990
地方債証券	69,353,220	14,222,274
特殊債券	108,268,880	8,203,573
社債券	181,388,960	93,832,450
合 計	979,401,420	237,630,693

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 取引の時価等に関する事項
 債券関連

[平成24年1月26日現在]
 該当事項はありません。

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]			
		契 約 額 等(円)	時 価	評 価 損 益	
			(円)	(円)	
市場取引	債券先物取引 買建	1,148,490,000	—	1,154,400,000	5,910,000
	合 計	1,148,490,000	—	1,154,400,000	5,910,000

（注）時価の算定方法

- 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
 原則として、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、最も近い最終相場値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

（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。

[前へ](#) [次へ](#)

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備 考
国債証券	第３１３回利付国債（２年）	460,000,000	460,119,600	
	第３２１回利付国債（２年）	780,000,000	780,327,600	
	第３２２回利付国債（２年）	1,050,000,000	1,050,462,000	
	第３２３回利付国債（２年）	1,100,000,000	1,100,506,000	
	第８９回利付国債（５年）	620,000,000	624,798,800	
	第９５回利付国債（５年）	330,000,000	335,309,700	
	第９９回利付国債（５年）	120,000,000	121,304,400	
	第１０３回利付国債（５年）	500,000,000	503,595,000	
	第１０５回利付国債（５年）	150,000,000	150,424,500	
	第１０６回利付国債（５年）	1,710,000,000	1,714,326,300	
	第１０７回利付国債（５年）	900,000,000	901,962,000	
	第１回利付国債（４０年）	245,000,000	265,494,250	
	第２回利付国債（４０年）	340,000,000	350,220,400	
	第３回利付国債（４０年）	343,000,000	351,623,020	
	第４回利付国債（４０年）	448,000,000	457,000,320	
	第５回利付国債（４０年）	365,000,000	350,754,050	
	第２５９回利付国債（１０年）	5,415,000,000	5,502,398,100	
	第２６２回利付国債（１０年）	5,420,000,000	5,556,963,400	
	第２６３回利付国債（１０年）	5,328,000,000	5,460,933,600	
	第２６５回利付国債（１０年）	2,988,000,000	3,068,257,680	
	第２６８回利付国債（１０年）	3,562,000,000	3,670,142,320	
	第２７０回利付国債（１０年）	3,089,000,000	3,179,106,130	
	第２７３回利付国債（１０年）	2,388,000,000	2,477,597,760	
	第２７６回利付国債（１０年）	3,490,000,000	3,643,350,600	
	第２７９回利付国債（１０年）	2,555,000,000	2,708,351,100	
	第２８１回利付国債（１０年）	3,543,000,000	3,771,452,640	
	第２８３回利付国債（１０年）	3,532,000,000	3,750,348,240	
	第２８４回利付国債（１０年）	4,146,000,000	4,401,186,300	
	第２８５回利付国債（１０年）	3,818,000,000	4,066,131,820	
	第２８７回利付国債（１０年）	3,300,000,000	3,554,727,000	
	第２８８回利付国債（１０年）	1,796,000,000	1,925,114,440	
	第２８９回利付国債（１０年）	1,533,000,000	1,633,411,500	
	第２９２回利付国債（１０年）	1,794,000,000	1,934,685,480	
	第２９３回利付国債（１０年）	1,441,000,000	1,565,531,220	
	第２９６回利付国債（１０年）	1,300,000,000	1,393,834,000	
	第２９７回利付国債（１０年）	1,836,000,000	1,960,205,400	
	第３００回利付国債（１０年）	1,257,000,000	1,350,696,780	
	第３０１回利付国債（１０年）	1,122,000,000	1,206,744,660	
	第３０３回利付国債（１０年）	1,905,000,000	2,038,064,250	
	第３０５回利付国債（１０年）	1,568,000,000	1,667,050,560	
	第３０６回利付国債（１０年）	1,648,000,000	1,763,524,800	
	第３０８回利付国債（１０年）	2,024,000,000	2,150,823,840	
	第３１０回利付国債（１０年）	2,256,000,000	2,345,879,040	
	第３１２回利付国債（１０年）	1,550,000,000	1,633,560,500	
	第３１３回利付国債（１０年）	1,859,000,000	1,972,157,330	
	第３１５回利付国債（１０年）	1,703,000,000	1,791,726,300	
	第３１７回利付国債（１０年）	1,877,000,000	1,955,665,070	
	第３１８回利付国債（１０年）	100,000,000	103,369,000	
	第３１９回利付国債（１０年）	1,929,000,000	2,006,989,470	
	第３２１回利付国債（１０年）	1,705,000,000	1,755,689,650	
	第３２３回利付国債（１０年）	2,475,000,000	2,520,812,250	
	第３２５回利付国債（１０年）	2,605,000,000	2,623,782,050	
	第３２６回利付国債（１０年）	700,000,000	696,773,000	
	第１回利付国債（３０年）	76,000,000	90,480,280	
	第２回利付国債（３０年）	98,000,000	110,580,260	
	第３回利付国債（３０年）	117,000,000	129,946,050	
	第４回利付国債（３０年）	127,000,000	152,091,390	
	第５回利付国債（３０年）	108,000,000	117,255,600	
	第６回利付国債（３０年）	169,000,000	188,135,870	
	第７回利付国債（３０年）	164,000,000	179,473,400	

第8回利付国債（30年）	142,000,000	143,043,700	
第9回利付国債（30年）	116,000,000	109,124,680	
第10回利付国債（30年）	185,000,000	164,163,450	
第11回利付国債（30年）	137,000,000	135,258,730	
第12回利付国債（30年）	150,000,000	158,079,000	
第13回利付国債（30年）	205,000,000	212,351,300	
第14回利付国債（30年）	263,000,000	290,717,570	
第15回利付国債（30年）	346,000,000	388,194,700	
第16回利付国債（30年）	232,000,000	260,125,360	
第17回利付国債（30年）	267,000,000	294,463,620	
第18回利付国債（30年）	297,000,000	322,031,160	
第19回利付国債（30年）	203,000,000	220,072,300	
第20回利付国債（30年）	245,000,000	274,348,550	
第21回利付国債（30年）	229,000,000	247,961,200	
第22回利付国債（30年）	220,000,000	246,358,200	
第23回利付国債（30年）	194,000,000	217,064,660	
第24回利付国債（30年）	191,000,000	213,879,890	
第25回利付国債（30年）	352,000,000	380,445,120	
第26回利付国債（30年）	514,000,000	565,410,280	
第27回利付国債（30年）	430,000,000	481,376,400	
第28回利付国債（30年）	561,000,000	628,409,760	
第29回利付国債（30年）	450,000,000	494,757,000	
第30回利付国債（30年）	686,000,000	739,727,520	
第31回利付国債（30年）	638,000,000	674,232,020	
第32回利付国債（30年）	779,000,000	838,538,970	
第33回利付国債（30年）	704,000,000	712,236,800	
第34回利付国債（30年）	796,000,000	838,243,720	
第35回利付国債（30年）	849,000,000	856,012,740	
第36回利付国債（30年）	789,000,000	794,112,720	
第37回利付国債（30年）	517,000,000	507,849,100	
第30回利付国債（20年）	876,000,000	959,701,800	
第32回利付国債（20年）	77,000,000	85,708,700	
第33回利付国債（20年）	36,000,000	40,835,880	
第35回利付国債（20年）	117,000,000	132,305,940	
第36回利付国債（20年）	201,000,000	227,544,060	
第38回利付国債（20年）	400,000,000	451,852,000	
第40回利付国債（20年）	601,000,000	671,365,080	
第42回利付国債（20年）	869,000,000	992,371,930	
第43回利付国債（20年）	74,000,000	86,381,680	
第44回利付国債（20年）	480,000,000	550,104,000	
第47回利付国債（20年）	114,000,000	128,784,660	
第48回利付国債（20年）	209,000,000	241,277,960	
第49回利付国債（20年）	515,000,000	578,993,900	
第51回利付国債（20年）	200,000,000	223,344,000	
第52回利付国債（20年）	214,000,000	240,863,420	
第54回利付国債（20年）	480,000,000	544,800,000	
第55回利付国債（20年）	241,000,000	269,524,760	
第56回利付国債（20年）	449,000,000	502,399,570	
第58回利付国債（20年）	147,000,000	163,147,950	
第59回利付国債（20年）	589,000,000	642,575,440	
第61回利付国債（20年）	289,000,000	295,525,620	
第63回利付国債（20年）	442,000,000	486,014,360	
第64回利付国債（20年）	441,000,000	489,276,270	
第65回利付国債（20年）	318,000,000	352,677,900	
第68回利付国債（20年）	846,000,000	964,126,980	
第70回利付国債（20年）	522,000,000	605,995,020	
第72回利付国債（20年）	454,000,000	512,202,800	
第74回利付国債（20年）	528,000,000	595,399,200	
第75回利付国債（20年）	685,000,000	771,960,750	
第78回利付国債（20年）	60,000,000	66,133,200	
第80回利付国債（20年）	495,000,000	557,157,150	
第82回利付国債（20年）	662,000,000	744,121,100	
第83回利付国債（20年）	813,000,000	912,486,810	
第86回利付国債（20年）	725,000,000	830,081,500	
第88回利付国債（20年）	504,000,000	576,248,400	
第91回利付国債（20年）	968,000,000	1,105,097,840	
第92回利付国債（20年）	742,000,000	826,907,060	
第94回利付国債（20年）	795,000,000	884,135,400	
第95回利付国債（20年）	747,000,000	848,845,980	

	第97回利付国債（20年）	903,000,000	1,012,281,060	
	第99回利付国債（20年）	775,000,000	856,607,500	
	第101回利付国債（20年）	743,000,000	850,118,310	
	第102回利付国債（20年）	900,000,000	1,028,250,000	
	第106回利付国債（20年）	791,000,000	879,512,900	
	第107回利付国債（20年）	1,057,000,000	1,157,668,680	
	第110回利付国債（20年）	856,000,000	935,471,040	
	第111回利付国債（20年）	971,000,000	1,073,100,650	
	第113回利付国債（20年）	822,000,000	893,612,640	
	第115回利付国債（20年）	984,000,000	1,081,908,000	
	第116回利付国債（20年）	1,026,000,000	1,125,429,660	
	第118回利付国債（20年）	916,000,000	974,449,960	
	第121回利付国債（20年）	1,089,000,000	1,138,636,620	
	第123回利付国債（20年）	868,000,000	932,240,680	
	第125回利付国債（20年）	1,024,000,000	1,112,698,880	
	第128回利付国債（20年）	634,000,000	657,280,480	
	第130回利付国債（20年）	922,000,000	939,029,340	
	第132回利付国債（20年）	937,000,000	936,325,360	
	第134回利付国債（20年）	965,000,000	977,516,050	
	第137回利付国債（20年）	1,172,000,000	1,165,202,400	
	第140回利付国債（20年）	1,257,000,000	1,246,893,720	
	第141回利付国債（20年）	360,000,000	356,292,000	
	国債証券 小計	150,461,000,000	159,190,620,290	
地方債証券	第1回東京都公募公債（20年）	20,000,000	21,328,400	
	第8回東京都公募公債（30年）	80,000,000	82,350,400	
	第20回東京都公募公債（20年）	80,000,000	85,935,200	
	第21回東京都公募公債（20年）	80,000,000	86,905,600	
	第22回東京都公募公債（20年）	120,000,000	124,887,600	
	第24回東京都公募公債（20年）	70,000,000	72,644,600	
	第615回東京都公募公債	100,000,000	102,301,000	
	第619回東京都公募公債	230,000,000	236,923,000	
	第624回東京都公募公債	100,000,000	103,286,000	
	第630回東京都公募公債	100,000,000	104,330,000	
	第636回東京都公募公債	120,000,000	127,718,400	
	第638回東京都公募公債	100,000,000	106,381,000	
	第648回東京都公募公債	100,000,000	107,255,000	
	第651回東京都公募公債	142,000,000	151,383,360	
	第666回東京都公募公債	100,000,000	106,963,000	
	第669回東京都公募公債	50,000,000	54,035,500	
	第676回東京都公募公債	100,000,000	106,480,000	
	第678回東京都公募公債	100,000,000	106,534,000	
	第680回東京都公募公債	100,000,000	106,569,000	
	第684回東京都公募公債	200,000,000	211,210,000	
	第693回東京都公募公債	100,000,000	106,341,000	
	第701回東京都公募公債	120,000,000	123,484,800	
	第705回東京都公募公債	70,000,000	72,223,200	
	平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	102,009,000	
	平成17年度第1回北海道公募公債	120,000,000	123,261,600	
	平成18年度第6回北海道公募公債	118,000,000	125,967,360	
	平成19年度第2回北海道公募公債	112,000,000	119,691,040	
	平成19年度第4回北海道公募公債	20,000,000	21,520,600	
	平成20年度第6回北海道公募公債	53,990,000	58,168,826	
	平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	102,775,000	
	第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	116,741,000	
	第2回神奈川県公募公債（20年）	80,000,000	90,642,400	
	第2回神奈川県公募公債（30年）	80,000,000	92,193,600	
	第3回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,561,000	
	第127回神奈川県公募公債	49,000,000	50,229,410	
	第139回神奈川県公募公債	127,700,000	134,913,773	
	第152回神奈川県公募公債	110,000,000	117,382,100	
	第162回神奈川県公募公債	140,450,000	151,649,483	
	第165回神奈川県公募公債	54,660,000	58,289,424	
	第170回神奈川県公募公債	100,000,000	106,465,000	
	第176回神奈川県公募公債	128,900,000	135,060,131	
	第57回大阪府公募公債	100,000,000	100,946,000	
	第271回大阪府公募公債	70,200,000	71,955,000	
	第277回大阪府公募公債	115,500,000	118,662,390	
	第279回大阪府公募公債	20,000,000	20,541,000	
	第281回大阪府公募公債	100,000,000	103,146,000	

第２８５回大阪府公募公債	50,000,000	51,915,500	
第３００回大阪府公募公債	135,000,000	143,802,000	
第３０６回大阪府公募公債	30,000,000	32,199,900	
第３１３回大阪府公募公債	100,000,000	107,203,000	
第３１４回大阪府公募公債	30,000,000	32,406,000	
第３１６回大阪府公募公債	100,000,000	108,448,000	
第３２５回大阪府公募公債	53,000,000	57,164,740	
第３２６回大阪府公募公債	10,000,000	10,788,600	
第３３１回大阪府公募公債	100,000,000	106,355,000	
第３３２回大阪府公募公債	71,600,000	76,958,544	
第３３７回大阪府公募公債	100,000,000	106,497,000	
第３４８回大阪府公募公債	10,000,000	10,540,000	
平成２１年度第５回京都府公募公債	20,000,000	21,254,200	
平成２２年度第５回京都府公募公債	110,000,000	115,990,600	
平成１７年度第８回兵庫県公募公債	100,000,000	103,277,000	
平成１７年度第９回兵庫県公募公債	100,000,000	104,054,000	
平成２０年度第５回兵庫県公募公債	50,000,000	54,411,000	
平成２１年度第１回兵庫県公募公債	20,000,000	21,534,200	
平成２１年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	107,306,000	
平成２１年度第３回兵庫県公募公債	90,000,000	96,920,100	
平成１８年度第２回静岡県公募公債	41,300,000	43,907,682	
平成１９年度第１回静岡県公募公債	66,900,000	71,473,953	
平成２０年度第１回静岡県公募公債	14,500,000	15,650,140	
平成２０年度第４回静岡県公募公債	100,000,000	107,707,000	
平成２０年度第５回静岡県公募公債	11,000,000	11,824,560	
平成２１年度第４回静岡県公募公債	52,920,000	56,969,967	
平成２２年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	104,965,000	
平成２３年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	101,561,000	
平成２３年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	104,423,000	
平成１８年度第４回愛知県公募公債	110,700,000	117,447,165	
平成２３年度第１回愛知県公募公債	100,000,000	102,679,000	
平成２３年度第７回愛知県公募公債	100,000,000	103,952,000	
平成２３年度第１回広島県公募公債	100,000,000	104,633,000	
平成１６年度第５回埼玉県公募公債	45,000,000	46,127,700	
平成１８年度第３回埼玉県公募公債	87,600,000	93,556,800	
平成１８年度第５回埼玉県公募公債	62,100,000	66,222,198	
平成１８年度第７回埼玉県公募公債	112,600,000	120,269,186	
平成１９年度第３回埼玉県公募公債	39,100,000	42,207,668	
平成１９年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	107,060,000	
平成２３年度第１回埼玉県公募公債	100,000,000	106,215,000	
平成２３年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	104,719,000	
平成１７年度第５回福岡県公募公債	63,200,000	65,789,936	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（３０年）	70,000,000	77,290,500	
平成２０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	80,000,000	83,021,600	
平成２１年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	106,895,000	
平成２２年度第３回福岡県公募公債	100,000,000	104,449,000	
第９回千葉県公募公債（２０年）	80,000,000	81,834,400	
平成１６年度第１回千葉県公募公債	80,500,000	82,164,740	
平成１８年度第１回千葉県公募公債	109,490,000	116,220,350	
平成２０年度第２回千葉県公募公債	90,000,000	97,460,100	
平成２０年度第３回千葉県公募公債	80,000,000	86,673,600	
平成２０年度第５回千葉県公募公債	80,000,000	86,000,800	
平成２１年度第５回千葉県公募公債	50,700,000	51,248,574	
平成２２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	102,932,000	
平成２３年度第１回新潟県公募公債	100,000,000	102,874,000	
第１回群馬県公募公債	100,000,000	102,493,000	
第１回共同発行市場公募地方債	129,000,000	130,893,720	
第２回共同発行市場公募地方債	120,100,000	123,000,415	
第２回共同発行市場公募地方債	113,000,000	115,843,080	
第２回共同発行市場公募地方債	110,000,000	113,097,600	
第２回共同発行市場公募地方債	150,000,000	154,363,500	
第３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,778,000	
第３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,508,000	
第３回共同発行市場公募地方債	12,000,000	12,737,640	
第４回共同発行市場公募地方債	37,500,000	39,730,125	
第４回共同発行市場公募地方債	117,000,000	124,716,150	
第５回共同発行市場公募地方債	29,100,000	30,996,156	
第５回共同発行市場公募地方債	102,000,000	109,784,640	
第５回共同発行市場公募地方債	300,000	321,897	

	第 5 8 回共同発行市場公募地方債	21,000,000	22,437,240	
	第 5 9 回共同発行市場公募地方債	100,800,000	107,678,592	
	第 6 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,810,000	
	第 6 5 回共同発行市場公募地方債	90,000,000	96,801,300	
	第 7 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,652,000	
	第 7 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,116,000	
	第 7 7 回共同発行市場公募地方債	10,000,000	10,753,300	
	第 8 1 回共同発行市場公募地方債	109,500,000	116,148,840	
	第 9 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,521,000	
	第 1 0 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,413,000	
	第 1 0 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,040,000	
	第 1 0 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,730,000	
	第 1 0 9 回共同発行市場公募地方債	70,000,000	72,093,000	
	第 1 1 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,483,000	
	平成 1 8 年度第 1 回堺市公募公債	30,000,000	31,933,500	
	平成 1 9 年度第 1 回堺市公募公債	100,000,000	107,307,000	
	平成 1 8 年度第 2 回熊本県公募公債	84,540,000	89,695,249	
	平成 2 3 年度第 1 回浜松市公募公債	38,200,000	39,392,604	
	第 5 回大阪市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	112,865,000	
	平成 1 8 年度第 6 回大阪市公募公債	75,000,000	80,038,500	
	平成 1 9 年度第 4 回大阪市公募公債	30,000,000	32,193,300	
	平成 2 1 年度第 6 回大阪市公募公債	125,000,000	134,353,750	
	平成 2 3 年度第 1 0 回大阪市公募公債	10,000,000	10,194,600	
	第 5 回京都市公募公債（ 2 0 年）	50,000,000	56,673,000	
	平成 1 6 年度第 5 回神戸市公募公債	100,000,000	102,382,000	
	平成 1 7 年度第 1 3 回神戸市公募公債	111,000,000	115,923,960	
	平成 1 8 年度第 3 回神戸市公募公債	120,000,000	138,871,200	
	平成 2 2 年度第 9 回神戸市公募公債	80,000,000	84,240,000	
	第 1 7 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	80,000,000	86,297,600	
	平成 1 7 年度第 4 回横浜市公募公債	17,800,000	18,516,450	
	第 2 0 回横浜市公募公債（ 2 0 年）	80,000,000	85,892,800	
	平成 2 0 年度第 4 回横浜市公募公債	100,000,000	108,205,000	
	平成 2 1 年度第 5 回札幌市公募公債	112,000,000	119,107,520	
	平成 2 2 年度第 8 回札幌市公募公債（ 3 0 年）	80,000,000	82,332,000	
	第 2 3 回川崎市公募公債	152,300,000	153,757,511	
	第 7 7 回川崎市公募公債	64,500,000	66,675,585	
	第 8 2 回川崎市公募公債	100,000,000	107,384,000	
	平成 1 7 年度第 3 回福岡市公募公債	60,000,000	62,476,200	
	平成 1 8 年度第 6 回福岡市公募公債	70,000,000	74,417,000	
	平成 2 0 年度第 5 回福岡市公募公債	91,000,000	97,618,430	
	平成 1 8 年度第 1 回千葉市公募公債	50,000,000	53,034,500	
	平成 2 0 年度第 1 回岡山県公募公債	48,700,000	52,276,528	
	地方債証券 小計	13,270,950,000	14,025,688,182	
特殊債券	第 9 回オーストリア共和国政府保証オーストリア輸出銀行	100,000,000	101,418,000	
	第 8 回政府保証日本政策投資銀行債券	101,000,000	103,688,620	
	第 1 0 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,312,000	
	第 1 1 回政府保証日本政策投資銀行	137,000,000	141,259,330	
	第 1 5 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	100,000,000	100,160,000	
	第 1 6 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	100,000,000	102,159,000	
	第 1 9 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	200,000,000	205,136,000	
	第 2 4 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	100,000,000	103,805,000	
	第 2 7 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	100,000,000	106,381,000	
	第 4 6 回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	50,000,000	53,571,500	
	第 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,119,000	
	第 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,576,000	
	第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	20,000,000	22,772,200	
	第 1 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	57,000,000	60,100,800	
	第 1 3 回道路債券（財投機関債）	100,000,000	113,165,000	
	第 1 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,699,000	
	第 1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	10,000,000	10,477,000	
	第 2 1 回道路債券（財投機関債）	20,000,000	22,204,800	
	第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,268,000	
	第 2 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,054,000	
	第 2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	60,000,000	67,309,200	

第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	214,220,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,684,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	120,823,360	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	90,000,000	96,353,100	
第41回道路債券（財投機関債）	100,000,000	102,802,000	
第42回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	106,000,000	114,125,960	
第42回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	107,297,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,525,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	56,000,000	59,484,320	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	34,000,000	36,737,000	
第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	56,000,000	60,230,240	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	115,000,000	123,863,050	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	168,649,710	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	123,000,000	130,493,160	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	110,000,000	118,082,800	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	50,000,000	49,999,500	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	79,000,000	83,834,800	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,953,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	139,000,000	146,521,290	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	10,000,000	10,605,800	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	50,000,000	53,028,000	
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,419,000	
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	106,028,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	115,197,600	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	71,000,000	74,637,330	
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,004,000	
第135回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	91,000,000	94,797,430	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	60,000,000	62,424,600	
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	122,000,000	125,828,360	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,023,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,990,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	136,000,000	140,033,760	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	114,200,800	
第159回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	173,209,600	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,492,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,271,000	
第326回政府保証道路債券	130,000,000	131,943,500	
第333回政府保証道路債券	100,000,000	102,599,000	
第334回政府保証道路債券	100,000,000	102,542,000	
第335回政府保証道路債券	113,000,000	115,779,800	
第339回政府保証道路債券	116,000,000	119,366,320	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	102,778,000	
第344回政府保証道路債券	100,000,000	108,226,000	
第346回政府保証道路債券	111,000,000	114,690,750	
第30回道路債券（財投機関債）	100,000,000	101,768,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	10,000,000	10,734,200	
第1回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	54,863,500	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	25,000,000	26,681,250	
第2回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	80,000,000	85,089,600	

[前へ](#)

[次へ](#)

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評 価 額	備 考
特殊債券	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,394,000	
	第3回公営企業債券（20年）（財投機関債）	20,000,000	20,289,200	
	第5回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	113,322,000	
	第5回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	100,000,000	101,090,000	
	第6回公営企業債券（20年）（財投機関債）	100,000,000	110,931,000	
	第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,699,000	
	第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	48,000,000	51,512,640	
	第9回公営企業債券（20年）（財投機関債）	50,000,000	57,002,000	
	第10回地方公共団体金融機構債券（5年）（財投機関債）	200,000,000	200,552,000	
	第12回公営企業債券（財投機関債）	150,000,000	153,378,000	
	第12回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,017,000	
	第14回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	85,247,200	
	第16回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,516,000	
	第16回地方公共団体金融機構債券（20年）（財投機関債）	80,000,000	80,623,200	
	第18回公営企業債券（財投機関債）	100,000,000	103,922,000	
	第19回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	50,000,000	52,602,500	
	第20回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	105,227,000	
	F22回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,044,000	
	F24回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	75,431,300	
	第28回公営企業債券（財投機関債）	100,000,000	107,759,000	
	第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	11,000,000	11,336,160	
	第31回政府保証地方公共団体金融機構債券	50,000,000	51,909,000	
	第35回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,166,000	
	第841回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,534,090	
	第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,314,000	
	第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,979,000	
	第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,753,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,866,000	
	第860回政府保証公営企業債券	73,000,000	76,320,770	
	第861回政府保証公営企業債券	129,000,000	134,997,210	
	第864回政府保証公営企業債券	14,000,000	14,840,700	
	第866回政府保証公営企業債券	63,000,000	67,178,790	
	第870回政府保証公営企業債券	52,000,000	55,143,400	
	第879回政府保証公営企業債券	102,000,000	109,161,420	
	第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,155,000	
	第884回政府保証公営企業債券	114,000,000	121,082,820	
	第885回政府保証公営企業債券	104,000,000	112,179,600	
	第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	112,187,000	
	第14回公営企業債券（財投機関債）	50,000,000	51,377,000	
	第2回政府保証首都高速道路債券	24,000,000	25,459,680	
	第3回政府保証首都高速道路債券	9,000,000	9,574,650	
	第4回政府保証首都高速道路債券	79,000,000	84,566,340	
	第9回首都高速道路債券（財投機関債）	100,000,000	101,847,000	
	第10回首都高速道路	100,000,000	100,141,000	
	第13回首都高速道路債券（財投機関債）	200,000,000	205,390,000	
	第190回政府保証首都高速道路債券	81,000,000	82,172,070	
	第193回政府保証首都高速道路債券	55,000,000	56,262,250	
	第195回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,557,000	
	第200回政府保証首都高速道路債券	8,000,000	8,252,240	
	第1回政府保証阪神高速道路債券	5,000,000	5,233,600	
	第5回阪神高速道路	50,000,000	50,185,500	
	第6回阪神高速道路債券（財投機関債）	100,000,000	102,695,000	
	第137回政府保証阪神高速道路債券	50,000,000	50,732,000	
	第1回水資源債券（財投機関債）	100,000,000	102,288,000	
	第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	85,700,800	
	第14回日本政策金融公庫（財投機関債）	100,000,000	100,448,000	
	第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	82,060,000	
	第190回政府保証中小企業債券	13,000,000	13,850,590	
	第191回政府保証中小企業債券	111,000,000	118,775,550	
	第21回都市再生債券（財投機関債）	100,000,000	107,524,000	
	第23回政府保証都市再生債券	100,000,000	100,557,000	
	第29回都市再生債券（財投機関債）	100,000,000	101,199,000	
	第54回都市再生債券（財投機関債）	100,000,000	100,664,000	

第65回都市再生債券（財投機関債）	100,000,000	99,989,000	
第4回本州四国連絡橋債券（財投機関債）	50,000,000	51,209,000	
第27回政府保証本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,330,000	
第53回政府保証関西国際空港債券	151,000,000	160,775,740	
第10回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,531,000	
第11回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,205,000	
第185回政府保証預金保険機構債券	200,000,000	200,524,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,760,000	56,232,663	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,248,000	39,678,432	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,208,000	56,854,876	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	38,562,000	41,414,816	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,361,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,042,000	56,963,395	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,414,000	34,150,093	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,663,000	36,216,001	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,103,000	55,527,209	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,399,000	46,853,820	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,143,000	36,719,772	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,929,000	58,115,980	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	70,000,000	74,687,900	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,145,000	37,683,874	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	50,710,000	54,140,024	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,100,000	28,024,652	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,072,000	38,599,204	
第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,754,000	63,770,066	
第14回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,118,000	33,545,966	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	60,967,000	64,247,024	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,194,000	64,098,267	
第19回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,851,000	38,669,596	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,377,000	41,903,822	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,812,000	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,514,000	51,641,121	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,730,000	55,002,663	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,311,000	57,655,633	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,534,000	83,579,099	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,994,000	87,289,769	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,208,000	88,271,036	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,272,000	56,058,125	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,385,000	54,990,106	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,144,000	57,560,486	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,285,000	55,251,894	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,501,000	93,578,034	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,839,000	95,088,448	
第45回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,014,000	
第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,040,000	96,199,236	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,108,000	193,113,020	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,427,000	96,500,257	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,874,000	96,288,976	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,015,000	54,525,852	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,327,000	96,614,910	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,538,000	96,603,655	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,865,000	97,698,897	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,625,000	98,428,022	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,018,000	97,807,261	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,379,000	97,323,393	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	80,000,000	82,937,600	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	128,780,600	
第12回政府保証国民生活債券	102,000,000	103,493,280	
第15回政府保証国民生活債券	98,000,000	100,900,800	
第17回政府保証国民生活債券	41,000,000	42,899,530	
第21回政府保証国民生活債券	2,000,000	2,127,400	
第2回政府保証成田国際空港債券	38,000,000	39,726,720	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	55,034,000	
い第709号商工債券	100,000,000	101,456,000	
い第721号商工債券	100,000,000	100,898,000	
い第723号商工債券	100,000,000	100,820,000	
い第724号商工債券	50,000,000	50,423,000	
い第729号商工債券	100,000,000	101,611,000	
い第735号商工債券	100,000,000	100,763,000	

	い第736号商工債券	100,000,000	100,944,000	
	い第712号農林債券	50,000,000	50,574,500	
	い第713号農林債券	100,000,000	101,043,000	
	い第715号農林債券	130,000,000	131,210,300	
	い第716号農林債券	50,000,000	50,542,000	
	い第720号農林債券	100,000,000	101,029,000	
	い第721号農林債券	100,000,000	100,945,000	
	い第725号農林債券	80,000,000	80,414,400	
	い第728号農林債券	100,000,000	101,020,000	
	い第731号農林債券	100,000,000	101,739,000	
	い第734号農林債券	50,000,000	50,658,500	
	い第741号農林債券	100,000,000	101,030,000	
	い第744号農林債券	100,000,000	100,618,000	
	第234回信金中金債	50,000,000	50,647,500	
	第237回信金中金債	100,000,000	101,305,000	
	第240回信金中金債	100,000,000	101,322,000	
	第244回信金中金債	50,000,000	50,511,000	
	第249回信金中金債	100,000,000	100,820,000	
	第255回信金中金債	150,000,000	152,622,000	
	第257回信金中金債	50,000,000	50,838,000	
	第269回信金中金債	50,000,000	50,367,000	
	第270回信金中金債	50,000,000	50,266,500	
	第271回信金中金債	100,000,000	100,521,000	
	第8号商工債券（10年）	100,000,000	107,532,000	
	第138号商工債券（3年）	100,000,000	100,273,000	
	第7回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	72,094,400	
	第1回オランダ開発金融公庫	100,000,000	101,233,000	
	第4回政府保証東日本高速道路債券	75,000,000	79,521,750	
	第6回政府保証東日本高速道路債券	62,000,000	65,903,520	
	第7回政府保証東日本高速道路債券	34,000,000	36,659,140	
	第10回政府保証東日本高速道路債券	89,000,000	94,679,090	
	第13回政府保証東日本高速道路債券	28,000,000	30,130,520	
	第18回東日本高速道路	100,000,000	100,375,000	
	第2回中日本高速道路	50,000,000	51,260,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	27,000,000	28,224,720	
	第20回政府保証中日本高速道路債券	10,000,000	10,611,800	
	第20回中日本高速道路	100,000,000	100,385,000	
	第21回中日本高速道路	100,000,000	101,128,000	
	第23回政府保証中日本高速道路債券	46,000,000	49,219,080	
	第37回中日本高速道路	100,000,000	100,338,000	
	第42回中日本高速道路	100,000,000	100,730,000	
	第5回政府保証西日本高速道路債券	41,000,000	43,684,680	
	第6回政府保証西日本高速道路債券	51,000,000	54,403,740	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,559,000	
	第11回政府保証西日本高速道路債券	31,000,000	33,249,980	
	第34回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	200,940,000	
	第5回東京都住宅供給公社債券	100,000,000	107,118,000	
	特殊債券 小計	20,654,692,000	21,470,772,345	
社債券	第344回東京交通債券	100,000,000	107,438,000	
	第347回東京交通債券	100,000,000	110,675,000	
	第24回関西国際空港	100,000,000	100,653,000	
	第38回関西国際空港	50,000,000	50,954,000	
	第1回成田国際空港	20,000,000	20,502,200	
	第9回GEキャピタルコーポレーション	100,000,000	101,595,000	
	第7回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,827,000	
	第8回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,632,000	
	第5回パークレイズ・バンク	100,000,000	101,493,000	
	第5回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	101,642,000	
	第8回ナショナル・オーストラリア銀行	100,000,000	103,029,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行	100,000,000	101,405,000	
	第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	100,000,000	101,570,000	
	第8回ウエストバック・バンキング・コーポレーション	100,000,000	101,850,000	
	第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行	100,000,000	101,633,000	
	第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行	100,000,000	101,535,000	
	第3回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	101,054,000	
	第9回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	104,571,000	
	第17回ラボバンク・ネダーランド	100,000,000	100,134,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク	100,000,000	101,694,000	
	第2回エイチエスピーシー・バンク・ビーエルシー	100,000,000	101,558,000	

第32回アサヒビール	100,000,000	100,906,000	
第4回サントリーホールディングス	100,000,000	101,903,000	
第1回コカ・コーラウエスト	100,000,000	100,857,000	
第8回旭化成	100,000,000	106,090,000	
第33回三菱化学	100,000,000	105,124,000	
第1回第一三共	100,000,000	101,191,000	
第2回第一三共	100,000,000	108,214,000	
第3回富士フィルムホールディングス	100,000,000	99,702,000	
第67回新日本製鐵	100,000,000	101,374,000	
第16回ジェイ エフ イー ホールディングス	100,000,000	101,003,000	
第18回豊田自動織機	100,000,000	110,113,000	
第8回小松製作所	100,000,000	101,126,000	
第11回クボタ	100,000,000	102,669,000	
第1回日本電産	100,000,000	100,134,000	
第7回デンソー	100,000,000	101,087,000	
第1回日東電工	100,000,000	101,336,000	
第3回松下電工	100,000,000	100,887,000	
第1回日本生命2010基金	100,000,000	100,963,000	
第1回B号日本生命2011基金	100,000,000	102,126,000	
第1回明治安田生命2011基金	100,000,000	101,442,000	
第5回アイシン精機	100,000,000	102,275,000	
第7回リコー	100,000,000	101,258,000	
第5回凸版印刷	100,000,000	105,396,000	
第3回大日本印刷	100,000,000	105,138,000	
第48回伊藤忠商事	100,000,000	107,220,000	
第59回三井物産	100,000,000	109,921,000	
第30回住友商事	100,000,000	104,413,000	
第69回三菱商事	100,000,000	108,442,000	
第78回三菱商事	100,000,000	102,737,000	
第7回みずほコーポレート銀行（同順位特約付）	100,000,000	107,937,000	
第20回みずほコーポレート銀行	100,000,000	101,036,000	
第23回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,492,000	
第25回みずほコーポレート銀行	100,000,000	101,632,000	
第27回みずほコーポレート銀行	200,000,000	201,868,000	
第29回みずほコーポレート銀行	100,000,000	100,713,000	
第7回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,304,000	
第8回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	103,258,000	
第9回三菱東京ＵＦＪ銀行	200,000,000	230,278,000	
第28回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	105,180,000	
第30回三菱東京ＵＦＪ銀行（劣後特約付）	100,000,000	106,575,000	
第87回三菱東京ＵＦＪ銀行	100,000,000	106,929,000	
第121回三菱東京ＵＦＪ銀行	100,000,000	101,135,000	
第1回三菱ＵＦＪ信託銀行（特定社債間限定同順位）	100,000,000	100,540,000	
第5回住友信託銀行（劣後特約付）	100,000,000	105,654,000	
第6回住友信託銀行（劣後特約付）	100,000,000	113,848,000	
第3回中央三井信託銀行（劣後特約付）	100,000,000	103,037,000	
第6回セブン銀行	100,000,000	100,533,000	
第9回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	103,571,000	
第20回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,666,000	
第23回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	105,521,000	
第25回三井住友銀行（劣後特約付）	100,000,000	107,962,000	
第48回三井住友銀行	100,000,000	101,021,000	
第53回三井住友銀行	100,000,000	101,619,000	
第54回三井住友銀行	100,000,000	101,015,000	
第57回三井住友銀行	200,000,000	200,400,000	
第2回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	102,973,000	
第6回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	106,443,000	
第9回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	109,101,000	
第40回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	100,000,000	101,058,000	
第21回日産フィナンシャルサービス	100,000,000	99,929,000	
第17回ホンダファイナンス	200,000,000	201,404,000	
第40回トヨタファイナンス	100,000,000	101,751,000	
第152回オリックス	100,000,000	101,297,000	
第3回三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	101,059,000	
第13回三菱ＵＦＪリース	100,000,000	101,473,000	
第15回野村ホールディングス	100,000,000	102,049,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	99,854,000	
第2回財政融資マスタートラスト特定目的会社第1回	100,000,000	107,390,000	
第5回三井住友海上火災保険	100,000,000	100,952,000	

第 3 1 回三井不動産	100,000,000	102,277,000	
第 9 8 回三菱地所	100,000,000	103,994,000	
第 7 回エヌ・ティ・ティ都市開発	100,000,000	105,895,000	
第 5 4 回小田急電鉄	100,000,000	103,091,000	
第 2 5 回京王電鉄	100,000,000	106,662,000	
第 5 6 回東日本旅客鉄道	100,000,000	107,763,000	
第 5 6 回東海旅客鉄道	100,000,000	104,186,000	
第 1 1 回東京地下鉄	100,000,000	103,533,000	
第 5 回日本通運	100,000,000	108,427,000	
第 5 回関西高速鉄道	100,000,000	104,295,000	
第 5 2 回日本電信電話	100,000,000	106,281,000	
第 5 9 回日本電信電話	100,000,000	107,939,000	
第 1 9 回ＫＤＤＩ	100,000,000	103,382,000	
第 1 5 回エヌ・ティ・ティ・ドコモ	100,000,000	108,721,000	
第 4 2 8 回東京電力	100,000,000	102,957,000	
第 5 1 9 回東京電力	120,000,000	115,384,800	
第 5 2 4 回東京電力	100,000,000	94,896,000	
第 5 2 8 回東京電力	20,000,000	18,187,200	
第 5 3 2 回東京電力	50,000,000	46,779,000	
第 5 3 4 回東京電力	100,000,000	91,090,000	
第 5 3 6 回東京電力	100,000,000	92,290,000	
第 5 4 4 回東京電力	100,000,000	93,063,000	
第 5 4 6 回東京電力	100,000,000	98,306,000	
第 5 6 7 回東京電力	80,000,000	58,005,600	
第 4 0 7 回中部電力	50,000,000	53,598,000	
第 4 6 7 回中部電力	100,000,000	102,089,000	
第 4 7 3 回中部電力	100,000,000	103,051,000	
第 4 7 8 回中部電力	100,000,000	104,947,000	
第 4 8 4 回中部電力	100,000,000	101,604,000	
第 4 8 9 回中部電力	100,000,000	100,761,000	
第 4 9 8 回中部電力	100,000,000	99,958,000	
第 4 4 8 回関西電力	100,000,000	103,211,000	
第 4 5 6 回関西電力	100,000,000	103,118,000	
第 4 7 3 回関西電力	100,000,000	99,587,000	
第 4 8 5 回関西電力	100,000,000	95,139,000	
第 3 4 6 回中国電力	100,000,000	105,305,000	
第 2 7 7 回北陸電力	60,000,000	61,127,400	
第 2 8 8 回北陸電力	100,000,000	106,068,000	
第 3 8 3 回東北電力	100,000,000	108,887,000	
第 4 4 5 回東北電力	100,000,000	103,392,000	
第 4 4 8 回東北電力	100,000,000	102,189,000	
第 4 0 8 回九州電力	100,000,000	103,479,000	
第 2 5 6 回北海道電力	80,000,000	87,587,200	
第 2 6 1 回北海道電力	24,000,000	26,316,960	
第 3 1 0 回北海道電力	50,000,000	50,670,000	
第 3 1 4 回北海道電力	100,000,000	99,937,000	
第 9 回沖縄電力	31,000,000	31,764,770	
第 1 9 回沖縄電力	80,000,000	84,518,400	
第 2 1 回電源開発	100,000,000	104,941,000	
第 2 9 回電源開発	100,000,000	103,283,000	
第 3 0 回東京ガス	100,000,000	103,394,000	
第 9 回大阪ガス	100,000,000	113,018,000	
第 1 0 回西部瓦斯	100,000,000	101,949,000	
第 2 5 回エヌ・ティ・ティ・データ	100,000,000	106,276,000	
社債券 小計	14,215,000,000	14,639,518,530	
合計	198,601,642,000	209,326,599,347	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	388,537,206	338,216,978
コール・ローン	91,465,725	46,898,505
国債証券	152,054,999,729	173,702,997,666
派生商品評価勘定	114,405	1,554
未収利息	1,758,465,721	1,984,541,604
前払費用	109,915,659	32,439,588
流動資産合計	154,403,498,445	176,105,095,895
資産合計	154,403,498,445	176,105,095,895
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,300	98,132
未払金	135,818,208	—
未払解約金	5,502,819	23,497,703
流動負債合計	141,327,327	23,595,835
負債合計	141,327,327	23,595,835
純資産の部		
元本等		
元本	120,750,418,705	110,512,512,784
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	33,511,752,413	65,568,987,276
元本等合計	154,262,171,118	176,081,500,060
純資産合計	154,262,171,118	176,081,500,060
負債純資産合計	154,403,498,445	176,105,095,895

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年5月13日から翌年5月12日までであります。

（２）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	有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 （１）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （２）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （３）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	119,138,695,196円	120,750,418,705円
期首からの追加設定元本額	4,308,218,526円	6,486,345,942円
期首からの一部解約元本額	2,696,495,017円	16,724,251,863円
元本の内訳＊		
ファンド・マネジャー（海外債券）	119,275,809円	87,553,562円
e M A X I S 先進国債券インデックス	1,415,956,829円	1,729,671,184円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	10,864,308円	68,964,529円
e M A X I S バランス（波乗り型）	4,143,647円	35,732,257円
三菱ＵＦＪ ＤＣ海外債券インデックスファンド	3,810,912,138円	4,159,381,968円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	38,453,881,735円	35,852,839,252円
三菱ＵＦＪ バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,737,706,145円	5,092,618,020円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４０型（適格機関投資家限定）	4,019,382,534円	3,608,115,101円
M U A M 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	2,920,365,302円	2,968,051,345円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ５０型（適格機関投資家限定）	37,702,945,515円	31,862,993,686円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ７５型（適格機関投資家限定）	8,735,468,208円	7,674,158,013円
三菱ＵＦＪ バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,024,976,409円	1,747,398,685円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ４５型（適格機関投資家限定）	539,254,562円	491,939,224円
三菱ＵＦＪ バランスファンドＶＡ ３０型（適格機関投資家限定）	302,050,616円	267,346,405円
三菱ＵＦＪ バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,334,179,822円	4,258,161,335円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,878,580円	16,090,185円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	52,553,035円	35,947,389円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	88,473,418円	71,854,674円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	95,155,536円	80,620,415円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	48,571,347円	38,407,386円
三菱ＵＦＪ 外国債券インデックスファンドＶＡ	2,633,496,894円	2,168,139,636円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	491,477,910円	418,899,506円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	917,080,096円	834,376,765円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	935,103,534円	825,432,369円
三菱ＵＦＪ バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	1,060,058,461円	993,286,388円
外国債券インデックスファンドｉ（適格機関投資家限定）	2,042,985,077円	1,831,117,758円
三菱ＵＦＪ < ＤＣ > 外国債券インデックスファンド	1,928,042,193円	2,023,528,127円
三菱ＵＦＪ < ＤＣ > インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）	261,734,004円	236,896,573円
三菱ＵＦＪ < ＤＣ > インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）	608,580,995円	588,370,449円
三菱ＵＦＪ < ＤＣ > インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）	343,282,145円	345,187,327円
三菱ＵＦＪ < ＤＣ > インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）	96,581,901円	99,433,271円
（合 計）	120,750,418,705円	110,512,512,784円
2 受益権の総数	120,750,418,705口	110,512,512,784口
3 １口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.2775円 （12,775円）	1.5933円 （15,933円）

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,847,847,844	1,707,930,136
合 計	5,847,847,844	1,707,930,136

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	[平成24年1月26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	24,892,340	—	24,886,400	5,940
	オーストラリアドル	2,472,960	—	2,472,600	360
	イギリスポンド	3,644,010	—	3,652,500	8,490
	ユーロ	23,317,285	—	23,423,200	105,915
	合 計	54,326,595	—	54,434,700	108,105

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価	評 価 損 益
			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカドル	19,998,692	—	20,024,400	25,708
	イギリスポンド	2,872,130	—	2,872,000	130
	ユーロ	24,427,000	—	24,498,000	71,000
	合 計	47,297,822	—	47,394,400	96,578

(注) 時価の算定方法

1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

[前へ](#)[次へ](#)

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

通 貨		券面総額	評 価 額	備 考
種 類	銘 柄			
アメリカドル				
国債証券	0.125 T-NOTE 131231	3,500,000.00	3,498,769.52	
	0.125 T-NOTE 140731	5,500,000.00	5,490,117.18	
	0.25 T-NOTE 140131	5,000,000.00	5,003,320.31	
	0.25 T-NOTE 140228	6,000,000.00	6,004,218.75	
	0.25 T-NOTE 140331	5,800,000.00	5,803,398.43	
	0.25 T-NOTE 140430	5,000,000.00	5,001,953.12	
	0.25 T-NOTE 140531	7,000,000.00	7,001,914.05	
	0.25 T-NOTE 140630	5,500,000.00	5,501,503.90	
	0.25 T-NOTE 140831	4,000,000.00	4,000,000.00	
	0.25 T-NOTE 140915	5,400,000.00	5,401,476.55	
	0.25 T-NOTE 141215	5,000,000.00	4,998,046.87	
	0.25 T-NOTE 150115	5,000,000.00	4,996,679.68	
	0.25 T-NOTE 150215	5,000,000.00	4,995,117.18	
	0.25 T-NOTE 150515	4,200,000.00	4,192,617.18	
	0.25 T-NOTE 150715	5,300,000.00	5,286,957.02	
	0.25 T-NOTE 150815	5,100,000.00	5,086,054.68	
	0.25 T-NOTE 150915	4,800,000.00	4,784,250.00	
	0.25 T-NOTE 151015	5,400,000.00	5,380,593.75	
	0.25 T-NOTE 151215	4,800,000.00	4,778,812.49	
	0.375 T-NOTE 141115	5,000,000.00	5,009,960.93	
	0.375 T-NOTE 150315	6,000,000.00	6,008,906.25	
	0.375 T-NOTE 150415	5,200,000.00	5,207,109.37	
	0.375 T-NOTE 150615	4,200,000.00	4,203,937.50	
	0.375 T-NOTE 151115	4,700,000.00	4,697,613.27	
	0.5 T-NOTE 140815	4,300,000.00	4,316,796.87	
	0.5 T-NOTE 141015	5,300,000.00	5,321,738.27	
	0.5 T-NOTE 170731	5,500,000.00	5,438,339.84	
	0.625 T-NOTE 140715	5,000,000.00	5,028,320.31	
	0.625 T-NOTE 170531	5,300,000.00	5,280,125.00	
	0.625 T-NOTE 170831	3,200,000.00	3,179,124.99	
	0.75 T-NOTE 140615	4,900,000.00	4,935,218.75	
	0.75 T-NOTE 171031	7,000,000.00	6,980,585.93	
	0.75 T-NOTE 171231	2,800,000.00	2,787,312.50	
	0.875 T-NOTE 161130	6,000,000.00	6,061,875.00	
	0.875 T-NOTE 161231	4,000,000.00	4,038,750.00	
	0.875 T-NOTE 170131	3,400,000.00	3,431,343.75	
	0.875 T-NOTE 170228	4,300,000.00	4,337,121.09	
	0.875 T-NOTE 170430	5,300,000.00	5,339,128.90	
	1 T-NOTE 140115	3,500,000.00	3,527,890.62	
	1 T-NOTE 140515	4,600,000.00	4,645,820.31	
	1 T-NOTE 160831	4,500,000.00	4,572,246.09	
	1 T-NOTE 160930	5,000,000.00	5,078,906.25	
	1 T-NOTE 161031	5,200,000.00	5,280,031.25	
	1 T-NOTE 170331	5,200,000.00	5,268,453.12	
	1 T-NOTE 191130	2,500,000.00	2,447,167.96	
	1.125 T-NOTE 190531	1,600,000.00	1,593,500.00	
	1.25 T-NOTE 140215	4,000,000.00	4,044,687.50	
	1.25 T-NOTE 140315	3,700,000.00	3,743,792.96	
	1.25 T-NOTE 140415	3,500,000.00	3,543,886.71	
	1.25 T-NOTE 150831	4,300,000.00	4,397,757.81	
	1.25 T-NOTE 150930	5,000,000.00	5,116,406.25	
	1.25 T-NOTE 151031	4,600,000.00	4,708,710.93	
	1.25 T-NOTE 191031	3,200,000.00	3,190,500.00	
	1.375 T-NOTE 151130	4,300,000.00	4,417,746.09	
	1.375 T-NOTE 180930	3,000,000.00	3,057,656.25	
	1.375 T-NOTE 181130	3,000,000.00	3,052,382.81	
	1.375 T-NOTE 181231	2,500,000.00	2,541,601.56	
	1.375 T-NOTE 190228	4,100,000.00	4,160,859.37	

1.5 T-NOTE 131231	2,700,000.00	2,733,117.18	
1.5 T-NOTE 160630	3,900,000.00	4,031,320.31	
1.5 T-NOTE 160731	4,300,000.00	4,445,628.90	
1.5 T-NOTE 180831	2,200,000.00	2,259,296.87	
1.5 T-NOTE 190331	1,800,000.00	1,837,968.75	
1.625 T-NOTE 221115	1,900,000.00	1,845,968.75	
1.75 T-NOTE 140131	3,100,000.00	3,149,164.06	
1.75 T-NOTE 140331	4,300,000.00	4,377,769.52	
1.75 T-NOTE 150731	5,700,000.00	5,897,941.39	
1.75 T-NOTE 160531	2,700,000.00	2,812,746.09	
1.75 T-NOTE 181031	4,500,000.00	4,680,000.00	
1.75 T-NOTE 220515	6,000,000.00	5,949,140.62	
1.875 T-NOTE 140228	4,800,000.00	4,887,937.49	
1.875 T-NOTE 140430	3,900,000.00	3,981,199.21	
1.875 T-NOTE 150630	3,800,000.00	3,941,164.06	
1.875 T-NOTE 170831	4,000,000.00	4,200,312.49	
1.875 T-NOTE 170930	2,700,000.00	2,834,156.25	
1.875 T-NOTE 171031	2,500,000.00	2,625,195.31	
11.25 T-BOND 150215	940,000.00	1,150,031.25	
2 T-NOTE 160131	3,100,000.00	3,244,949.21	
2 T-NOTE 160430	2,500,000.00	2,623,144.53	
2 T-NOTE 211115	6,900,000.00	7,046,085.93	
2 T-NOTE 220215	10,000,000.00	10,173,437.50	
2.125 T-NOTE 141130	5,800,000.00	5,997,109.37	
2.125 T-NOTE 150531	5,100,000.00	5,312,167.96	
2.125 T-NOTE 151231	2,300,000.00	2,414,011.71	
2.125 T-NOTE 160229	1,000,000.00	1,051,640.62	
2.125 T-NOTE 210815	6,200,000.00	6,417,484.37	
2.25 T-NOTE 140531	4,800,000.00	4,929,562.49	
2.25 T-NOTE 150131	6,400,000.00	6,650,999.99	
2.25 T-NOTE 160331	2,500,000.00	2,641,210.93	
2.25 T-NOTE 171130	3,000,000.00	3,202,968.75	
2.25 T-NOTE 180731	2,300,000.00	2,457,585.93	
2.375 T-NOTE 140831	5,500,000.00	5,685,839.84	
2.375 T-NOTE 140930	5,200,000.00	5,383,421.87	
2.375 T-NOTE 141031	6,100,000.00	6,325,175.77	
2.375 T-NOTE 150228	5,300,000.00	5,528,769.52	
2.375 T-NOTE 160331	2,100,000.00	2,226,410.15	
2.375 T-NOTE 170731	3,200,000.00	3,431,250.00	
2.375 T-NOTE 180531	1,700,000.00	1,827,300.78	
2.375 T-NOTE 180630	3,000,000.00	3,224,531.25	
2.5 T-NOTE 150331	6,300,000.00	6,600,480.46	
2.5 T-NOTE 150430	5,400,000.00	5,664,937.50	
2.5 T-NOTE 170630	3,000,000.00	3,231,445.31	
2.625 T-NOTE 140630	5,100,000.00	5,273,121.09	
2.625 T-NOTE 140731	4,700,000.00	4,869,089.84	
2.625 T-NOTE 141231	5,200,000.00	5,434,000.00	
2.625 T-NOTE 160229	1,800,000.00	1,920,796.87	
2.625 T-NOTE 160430	2,000,000.00	2,138,828.12	
2.625 T-NOTE 180131	1,000,000.00	1,086,796.87	
2.625 T-NOTE 180430	1,600,000.00	1,740,875.00	
2.625 T-NOTE 200815	5,500,000.00	5,958,476.56	
2.625 T-NOTE 201115	6,300,000.00	6,812,859.37	
2.75 T-BOND 420815	2,400,000.00	2,226,562.49	
2.75 T-NOTE 161130	3,700,000.00	4,000,335.93	
2.75 T-NOTE 170531	3,700,000.00	4,022,593.75	
2.75 T-NOTE 171231	1,700,000.00	1,856,585.93	
2.75 T-NOTE 180228	1,000,000.00	1,093,710.93	
2.75 T-NOTE 190215	5,900,000.00	6,470,871.09	
2.875 T-NOTE 180331	3,000,000.00	3,301,406.25	
3 T-NOTE 160831	3,000,000.00	3,260,625.00	
3 T-NOTE 160930	3,500,000.00	3,807,890.62	
3 T-NOTE 170228	3,400,000.00	3,720,875.00	
3.125 T-BOND 411115	2,700,000.00	2,717,929.68	
3.125 T-NOTE 161031	4,500,000.00	4,925,039.06	
3.125 T-NOTE 170131	3,800,000.00	4,173,171.87	
3.125 T-NOTE 170430	2,100,000.00	2,313,937.50	
3.125 T-NOTE 190515	6,300,000.00	7,056,492.18	
3.125 T-NOTE 210515	7,100,000.00	7,931,753.90	

3.25 T-NOTE 160531	2,100,000.00	2,292,281.25	
3.25 T-NOTE 160630	3,100,000.00	3,388,445.31	
3.25 T-NOTE 160731	4,000,000.00	4,378,125.00	
3.25 T-NOTE 161231	3,800,000.00	4,187,125.00	
3.25 T-NOTE 170331	3,400,000.00	3,761,515.62	
3.375 T-NOTE 191115	5,300,000.00	6,020,675.77	
3.5 T-BOND 390215	2,700,000.00	2,943,632.81	
3.5 T-NOTE 180215	4,400,000.00	4,970,625.00	
3.5 T-NOTE 200515	5,600,000.00	6,420,750.00	
3.625 T-NOTE 190815	5,800,000.00	6,680,195.30	
3.625 T-NOTE 200215	7,300,000.00	8,426,367.18	
3.625 T-NOTE 210215	6,800,000.00	7,867,812.50	
3.75 T-BOND 410815	3,700,000.00	4,188,226.56	
3.75 T-NOTE 181115	4,900,000.00	5,651,652.34	
3.875 T-BOND 400815	6,400,000.00	7,417,000.00	
3.875 T-NOTE 180515	2,000,000.00	2,305,703.12	
4 T-NOTE 140215	5,000,000.00	5,200,000.00	
4 T-NOTE 150215	4,200,000.00	4,517,296.87	
4 T-NOTE 180815	3,000,000.00	3,494,062.50	
4.125 T-NOTE 150515	3,400,000.00	3,694,976.56	
4.25 T-BOND 390515	2,800,000.00	3,450,562.50	
4.25 T-BOND 401115	6,300,000.00	7,759,828.12	
4.25 T-NOTE 140815	3,600,000.00	3,823,171.87	
4.25 T-NOTE 141115	3,000,000.00	3,213,398.43	
4.25 T-NOTE 150815	3,500,000.00	3,844,531.25	
4.25 T-NOTE 171115	2,700,000.00	3,136,218.75	
4.375 T-BOND 380215	1,800,000.00	2,255,484.37	
4.375 T-BOND 391115	3,900,000.00	4,898,156.25	
4.375 T-BOND 400515	6,000,000.00	7,537,031.25	
4.375 T-BOND 410515	5,700,000.00	7,161,515.62	
4.5 T-BOND 360215	2,000,000.00	2,546,328.12	
4.5 T-BOND 380515	2,100,000.00	2,680,863.28	
4.5 T-BOND 390815	1,900,000.00	2,431,925.78	
4.5 T-NOTE 151115	2,800,000.00	3,119,046.87	
4.5 T-NOTE 160215	2,500,000.00	2,806,835.93	
4.5 T-NOTE 170515	1,900,000.00	2,206,226.56	
4.625 T-BOND 400215	4,900,000.00	6,392,968.75	
4.625 T-NOTE 161115	3,300,000.00	3,797,062.50	
4.625 T-NOTE 170215	2,700,000.00	3,129,257.81	
4.75 T-BOND 370215	800,000.00	1,055,625.00	
4.75 T-BOND 410215	5,500,000.00	7,317,148.43	
4.75 T-NOTE 140515	4,200,000.00	4,445,601.56	
4.75 T-NOTE 170815	2,900,000.00	3,419,507.81	
4.875 T-NOTE 160815	2,900,000.00	3,342,023.43	
5 T-BOND 370515	700,000.00	955,281.25	
5.125 T-NOTE 160515	2,000,000.00	2,301,875.00	
5.25 T-BOND 281115	1,400,000.00	1,884,640.62	
5.25 T-BOND 290215	1,400,000.00	1,888,359.37	
5.375 T-BOND 310215	2,200,000.00	3,051,296.87	
5.5 T-BOND 280815	1,000,000.00	1,377,812.50	
6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,698,656.25	
6.125 T-BOND 271115	1,900,000.00	2,756,039.06	
6.125 T-BOND 290815	1,000,000.00	1,475,625.00	
6.25 T-BOND 230815	2,300,000.00	3,238,867.18	
6.25 T-BOND 300515	1,100,000.00	1,655,414.06	
6.5 T-BOND 261115	600,000.00	890,906.25	
6.875 T-BOND 250815	1,100,000.00	1,659,625.00	
7.125 T-BOND 230215	800,000.00	1,185,625.00	
7.25 T-BOND 160515	2,600,000.00	3,173,828.12	
7.25 T-BOND 220815	1,200,000.00	1,777,031.25	
7.5 T-BOND 161115	2,100,000.00	2,644,195.31	
7.5 T-BOND 241115	1,000,000.00	1,561,875.00	
8 T-BOND 211115	1,700,000.00	2,584,531.25	
8.125 T-BOND 190815	1,600,000.00	2,302,375.00	
8.75 T-BOND 170515	1,300,000.00	1,743,117.18	
8.75 T-BOND 200815	1,700,000.00	2,597,281.25	
8.875 T-BOND 170815	1,400,000.00	1,908,921.87	
8.875 T-BOND 190215	2,300,000.00	3,354,585.93	
		789,490,272.66	
国債証券 小 計	733,640,000.00	(71,867,299,520)	

アメリカドル 小 計		733,640,000.00	789,490,272.66 (71,867,299,520)	
カナダドル				
国債証券	1 CAN GOVT 140201	1,000,000.00	999,250.00	
	1 CAN GOVT 141101	800,000.00	798,288.00	
	1 CAN GOVT 150201	1,500,000.00	1,496,205.00	
	1.5 CAN GOVT 150801	800,000.00	805,752.00	
	1.5 CAN GOVT 170301	1,900,000.00	1,907,334.00	
	1.5 CAN GOVT 170901	500,000.00	501,210.00	
	2 CAN GOVT 140301	1,100,000.00	1,110,945.00	
	2 CAN GOVT 141201	2,100,000.00	2,133,264.00	
	2 CAN GOVT 160601	1,100,000.00	1,124,596.00	
	2.25 CAN GOVT 140801	2,800,000.00	2,847,516.00	
	2.5 CAN GOVT 150601	1,400,000.00	1,443,078.00	
	2.75 CAN GOVT 160901	1,400,000.00	1,468,432.00	
	2.75 CAN GOVT 220601	1,600,000.00	1,710,800.00	
	3 CAN GOVT 140601	2,300,000.00	2,357,776.00	
	3 CAN GOVT 151201	1,500,000.00	1,573,245.00	
	3.25 CAN GOVT 210601	1,500,000.00	1,662,945.00	
	3.5 CAN GOVT 200601	1,700,000.00	1,904,442.00	
	3.5 CAN GOVT 451201	600,000.00	731,418.00	
	3.75 CAN GOVT 190601	2,400,000.00	2,706,672.00	
	4 CAN GOVT 160601	1,800,000.00	1,957,878.00	
	4 CAN GOVT 170601	1,750,000.00	1,939,717.50	
	4 CAN GOVT 410601	2,000,000.00	2,596,500.00	
	4.25 CAN GOVT 180601	1,600,000.00	1,825,584.00	
	4.5 CAN GOVT 150601	1,800,000.00	1,938,456.00	
	5 CAN GOVT 140601	1,800,000.00	1,892,934.00	
	5 CAN GOVT 370601	2,300,000.00	3,319,314.00	
	5.75 CAN GOVT 290601	1,600,000.00	2,332,880.00	
	5.75 CAN GOVT 330601	2,000,000.00	3,038,980.00	
	8 CAN GOVT 270601	900,000.00	1,532,988.00	
	9 CAN GOVT 250601	450,000.00	783,729.00	
国債証券 小 計		46,000,000.00	52,442,128.50 (4,737,097,467)	
カナダドル 小 計		46,000,000.00	52,442,128.50 (4,737,097,467)	
オーストラリアドル				
国債証券	2.75 AUST GOVT 240421	500,000.00	467,825.00	
	3.25 AUST GOVT 290421	500,000.00	464,265.00	
	4.25 AUST GOVT 170721	1,400,000.00	1,485,232.00	
	4.5 AUST GOVT 141021	1,600,000.00	1,648,720.00	
	4.5 AUST GOVT 200415	2,300,000.00	2,511,646.00	
	4.75 AUST GOVT 151021	1,100,000.00	1,158,949.00	
	4.75 AUST GOVT 160615	2,000,000.00	2,129,900.00	
	4.75 AUST GOVT 270421	800,000.00	894,264.00	
	5.25 AUST GOVT 190315	2,100,000.00	2,366,343.00	
	5.5 AUST GOVT 180121	1,600,000.00	1,794,480.00	
	5.5 AUST GOVT 230421	1,500,000.00	1,781,220.00	
	5.75 AUST GOVT 210515	2,600,000.00	3,086,226.00	
	5.75 AUST GOVT 220715	1,800,000.00	2,161,188.00	
	6 AUST GOVT 170215	2,200,000.00	2,472,998.00	
	6.25 AUST GOVT 140615	1,800,000.00	1,886,652.00	
	6.25 AUST GOVT 150415	1,800,000.00	1,936,728.00	
国債証券 小 計		25,600,000.00	28,246,636.00 (2,678,910,958)	
オーストラリアドル 小 計		25,600,000.00	28,246,636.00 (2,678,910,958)	
イギリスポンド				
国債証券	1 GILT 170907	3,000,000.00	3,004,200.00	
	1.75 GILT 170122	2,200,000.00	2,281,840.00	
	1.75 GILT 220907	1,800,000.00	1,752,210.00	
	2 GILT 160122	3,200,000.00	3,335,040.00	
	2.25 GILT 140307	3,600,000.00	3,675,600.00	
	2.75 GILT 150122	3,200,000.00	3,347,840.00	
	3.75 GILT 190907	2,100,000.00	2,411,430.00	
	3.75 GILT 200907	2,700,000.00	3,108,780.00	
	3.75 GILT 210907	2,900,000.00	3,342,540.00	
	3.75 GILT 520722	1,500,000.00	1,604,250.00	
	4 GILT 160907	2,900,000.00	3,245,825.00	

	4 GILT 220307	1,900,000.00	2,232,215.00	
	4 GILT 600122	1,800,000.00	2,054,880.00	
	4.25 GILT 271207	1,800,000.00	2,164,410.00	
	4.25 GILT 320607	2,400,000.00	2,862,480.00	
	4.25 GILT 360307	2,435,000.00	2,875,369.75	
	4.25 GILT 390907	1,700,000.00	1,998,860.00	
	4.25 GILT 401207	2,300,000.00	2,702,960.00	
	4.25 GILT 461207	2,100,000.00	2,470,755.00	
	4.25 GILT 491207	2,000,000.00	2,359,200.00	
	4.25 GILT 551207	2,100,000.00	2,499,630.00	
	4.5 GILT 190307	2,300,000.00	2,734,125.00	
	4.5 GILT 340907	2,100,000.00	2,573,340.00	
	4.5 GILT 421207	2,500,000.00	3,066,000.00	
	4.75 GILT 150907	2,850,000.00	3,168,487.50	
	4.75 GILT 200307	2,600,000.00	3,166,280.00	
	4.75 GILT 301207	2,100,000.00	2,663,955.00	
	4.75 GILT 381207	2,200,000.00	2,796,860.00	
	5 GILT 140907	3,500,000.00	3,759,350.00	
	5 GILT 180307	2,500,000.00	2,988,125.00	
	5 GILT 250307	2,000,000.00	2,574,000.00	
	6 GILT 281207	1,300,000.00	1,870,245.00	
	8 GILT 151207	500,000.00	607,550.00	
	8 GILT 210607	1,800,000.00	2,682,540.00	
	8.75 GILT 170825	1,050,000.00	1,419,810.00	
	国債証券 小 計	78,935,000.00	91,400,982.25 (13,126,095,060)	
	イギリスポンド 小 計	78,935,000.00	91,400,982.25 (13,126,095,060)	
	スイスフラン			
国債証券	2.25 SWISS GOVT 200706	600,000.00	677,040.00	
	2.5 SWISS GOVT 160312	1,000,000.00	1,074,400.00	
	3 SWISS GOVT 180108	1,000,000.00	1,132,850.00	
	3 SWISS GOVT 190512	800,000.00	931,000.00	
	3.75 SWISS GOVT 150610	200,000.00	217,500.00	
	4 SWISS GOVT 230211	600,000.00	787,632.00	
	4 SWISS GOVT 280408	700,000.00	984,214.00	
	4.25 SWISS GOVT 140106	600,000.00	623,640.00	
	4.25 SWISS GOVT 170605	800,000.00	939,560.00	
	国債証券 小 計	6,300,000.00	7,367,836.00 (723,226,781)	
	スイスフラン 小 計	6,300,000.00	7,367,836.00 (723,226,781)	
	シンガポールドル			
国債証券	0.25 SINGAPORGOVT 140201	200,000.00	200,040.00	
	1.125SINGAPORGOVT 160401	200,000.00	205,180.00	
	1.375SINGAPORGOVT 141001	500,000.00	509,250.00	
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	200,000.00	215,740.00	
	2.375 SINGAPORGOV 170401	700,000.00	758,800.00	
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	700,000.00	772,940.00	
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	300,000.00	306,300.00	
	2.875SINGAPORGOVT 150701	800,000.00	850,000.00	
	2.875SINGAPORGOVT 300901	400,000.00	437,880.00	
	3 SINGAPORGOVT 240901	500,000.00	568,100.00	
	3.125SINGAPORGOVT 220901	600,000.00	694,500.00	
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	700,000.00	807,170.00	
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	600,000.00	706,380.00	
	3.625SINGAPORGOVT 140701	800,000.00	838,800.00	
	3.75 SINGAPORGOVT 160901	750,000.00	841,425.00	
	4 SINGAPORGOVT 180901	400,000.00	474,600.00	
	国債証券 小 計	8,350,000.00	9,187,105.00 (677,181,509)	
	シンガポールドル 小 計	8,350,000.00	9,187,105.00 (677,181,509)	
	マレーシアリンギット			
国債証券	3.418MALAYSIAGOV 220815	1,100,000.00	1,093,686.00	
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	900,000.00	905,913.00	
	3.502MALAYSIAGOV 270531	1,000,000.00	972,010.00	
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	400,000.00	404,476.00	
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	1,700,000.00	1,722,712.00	
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3,600,000.00	3,679,056.00	

	3.835MALAYSIAGOV 150812	1,900,000.00	1,933,573.00	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	100,000.00	101,721.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	2,300,000.00	2,373,416.00	
	4.127 MALAYSIA 320415	1,700,000.00	1,748,722.00	
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	1,400,000.00	1,468,334.00	
	4.24 MALAYSIAGOV 180207	1,000,000.00	1,041,990.00	
	4.262MALAYSIAGOV 160915	4,000,000.00	4,147,480.00	
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4,200,000.00	4,444,062.00	
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	1,200,000.00	1,287,456.00	
	5.094MALAYSIAGOV 140430	3,000,000.00	3,076,320.00	
	5.734MALAYSIAGOV 190730	1,000,000.00	1,133,580.00	
	国債証券 小 計	30,500,000.00	31,534,507.00 (939,728,308)	
	マレーシアリンギット 小 計	30,500,000.00	31,534,507.00 (939,728,308)	
	スウェーデンクローネ			
国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	3,000,000.00	2,866,080.00	
	3 SWD GOVT 160712	6,400,000.00	6,798,848.00	
	3.5 SWD GOVT 220601	9,900,000.00	11,284,515.00	
	3.5 SWD GOVT 390330	6,000,000.00	6,996,780.00	
	3.75 SWD GOVT 170812	7,500,000.00	8,306,550.00	
	4.25 SWD GOVT 190312	8,900,000.00	10,304,331.00	
	4.5 SWD GOVT 150812	8,700,000.00	9,459,336.00	
	5 SWD GOVT 201201	6,600,000.00	8,183,340.00	
	6.75 SWD GOVT 140505	10,000,000.00	10,748,200.00	
	国債証券 小 計	67,000,000.00	74,947,980.00 (1,055,267,558)	
	スウェーデンクローネ 小 計	67,000,000.00	74,947,980.00 (1,055,267,558)	
	ノルウェークローネ			
国債証券	3.75 NORWE GOVT 210525	5,200,000.00	5,763,160.00	
	4.25 NORWE GOVT 170519	6,100,000.00	6,681,025.00	
	4.5 NORWE GOVT 190522	5,200,000.00	5,929,560.00	
	5 NORWE GOVT 150515	8,400,000.00	9,018,660.00	
	国債証券 小 計	24,900,000.00	27,392,405.00 (450,331,138)	
	ノルウェークローネ 小 計	24,900,000.00	27,392,405.00 (450,331,138)	
	デンマーククローネ			
国債証券	2 DMK GOVT 141115	7,900,000.00	8,152,405.00	
	3 DMK GOVT 211115	12,100,000.00	13,721,400.00	
	4 DMK GOVT 151115	12,400,000.00	13,667,280.00	
	4 DMK GOVT 171115	7,800,000.00	9,018,360.00	
	4 DMK GOVT 191115	11,400,000.00	13,625,280.00	
	4.5 DMK GOVT 391115	15,000,000.00	21,775,500.00	
	7 DMK GOVT 241110	3,200,000.00	5,045,760.00	
	国債証券 小 計	69,800,000.00	85,005,985.00 (1,395,798,273)	
	デンマーククローネ 小 計	69,800,000.00	85,005,985.00 (1,395,798,273)	
	メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	11,600,000.00	16,541,484.00	
	10 MEXICAN BONOS 361120	9,600,000.00	14,343,360.00	
	5 MEXICAN BONOS 170615	5,000,000.00	5,042,650.00	
	6 MEXICAN BONOS 150618	11,000,000.00	11,363,880.00	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	14,800,000.00	15,513,804.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	13,900,000.00	15,273,320.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	9,700,000.00	10,682,222.00	
	7 MEXICAN BONOS 140619	10,700,000.00	11,058,878.00	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	8,700,000.00	9,474,387.00	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	11,000,000.00	13,112,880.00	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	9,700,000.00	10,952,076.00	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	9,600,000.00	11,582,304.00	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	2,000,000.00	2,440,180.00	

（単位：円）

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
メキシコペソ				
国債証券	8 MEXICAN BONOS 151217	8,700,000.00	9,482,826.00	
	8 MEXICAN BONOS 200611	10,500,000.00	12,508,230.00	
	8 MEXICAN BONOS 231207	3,600,000.00	4,447,656.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	6,100,000.00	7,233,929.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	14,100,000.00	18,258,654.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	14,200,000.00	18,618,046.00	
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	16,900,000.00	18,420,662.00	
国債証券 小 計		201,400,000.00	236,351,428.00 (1,697,003,253)	
メキシコペソ 小 計		201,400,000.00	236,351,428.00 (1,697,003,253)	
ポーランドズロチ				
国債証券	4.75 POLAND 161025	3,300,000.00	3,457,080.00	
	4.75 POLAND 170425	2,500,000.00	2,634,750.00	
	5 POLAND 160425	3,200,000.00	3,359,680.00	
	5.25 POLAND 171025	3,400,000.00	3,670,640.00	
	5.25 POLAND 201025	3,700,000.00	4,081,100.00	
	5.5 POLAND 150425	5,100,000.00	5,334,600.00	
	5.5 POLAND 191025	3,800,000.00	4,240,610.00	
	5.75 POLAND 140425	4,900,000.00	5,042,100.00	
	5.75 POLAND 211025	1,900,000.00	2,168,470.00	
	5.75 POLAND 220923	4,200,000.00	4,833,570.00	
	5.75 POLAND 290425	1,000,000.00	1,198,100.00	
	6.25 POLAND 151024	4,600,000.00	4,945,460.00	
国債証券 小 計		41,600,000.00	44,966,160.00 (1,322,904,427)	
ポーランドズロチ 小 計		41,600,000.00	44,966,160.00 (1,322,904,427)	
南アフリカランド				
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	16,000,000.00	20,309,280.00	
	13.5 SOUTH AFRICA 150915	9,000,000.00	10,763,190.00	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	9,000,000.00	7,208,640.00	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	5,500,000.00	4,467,870.00	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	11,100,000.00	11,277,711.00	
	7 SOUTH AFRICA 310228	6,000,000.00	5,483,760.00	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	11,800,000.00	12,392,596.00	
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	2,000,000.00	2,130,500.00	
	8 SOUTH AFRICA 181221	10,900,000.00	11,909,122.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	11,000,000.00	12,061,940.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 141221	4,000,000.00	4,257,320.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	2,400,000.00	2,496,672.00	
国債証券 小 計		98,700,000.00	104,758,601.00 (1,063,299,800)	
南アフリカランド 小 計		98,700,000.00	104,758,601.00 (1,063,299,800)	
ユーロ				
国債証券	0 SCHATS 140613	1,400,000.00	1,395,870.00	
	0 SCHATS 140912	1,200,000.00	1,195,440.00	
	0.25 SCHATS 140314	1,600,000.00	1,601,360.00	
	0.5 OBL 170407	2,600,000.00	2,593,890.00	
	0.5 OBL 171013	500,000.00	496,450.00	
	0.75 BTAN 140925	1,500,000.00	1,511,400.00	
	0.75 NETH GOVT 150415	1,300,000.00	1,311,570.00	
	0.75 OBL 170224	2,200,000.00	2,218,810.00	
	1 BTAN 170725	500,000.00	500,350.00	
	1 NETH GOVT 140115	1,900,000.00	1,915,295.00	
	1.25 NETH GOVT 180115	800,000.00	812,200.00	
	1.25 OBL 161014	2,300,000.00	2,367,620.00	
	1.5 BUND 220904	1,000,000.00	993,400.00	
	1.625 FINNISH GOV 220915	500,000.00	493,175.00	
	1.75 BTAN 170225	3,200,000.00	3,313,760.00	
	1.75 BUND 220704	2,400,000.00	2,444,160.00	
	1.75 FINNISH GOVT 160415	1,100,000.00	1,145,320.00	
	1.75 OBL 151009	2,400,000.00	2,492,160.00	
	1.875 FINNISH GOV 170415	300,000.00	314,565.00	
	2 BTAN 150712	4,000,000.00	4,150,800.00	

2 BUND 220104	2,800,000.00	2,926,980.00	
2 OBL 160226	2,000,000.00	2,100,400.00	
2.25 BTAN 160225	3,100,000.00	3,257,480.00	
2.25 BUND 200904	2,300,000.00	2,475,605.00	
2.25 BUND 210904	2,300,000.00	2,461,690.00	
2.25 NETH GOVT 220715	1,500,000.00	1,561,500.00	
2.25 O.A.T 221025	1,500,000.00	1,503,300.00	
2.25 OBL 140411	2,400,000.00	2,458,800.00	
2.25 OBL 150410	2,800,000.00	2,921,240.00	
2.5 BTAN 140112	3,100,000.00	3,167,735.00	
2.5 BTAN 150115	3,000,000.00	3,126,450.00	
2.5 BTAN 160725	3,500,000.00	3,716,300.00	
2.5 BUND 210104	2,800,000.00	3,061,380.00	
2.5 BUND 440704	600,000.00	611,460.00	
2.5 ITALY GOVT 150301	2,000,000.00	2,032,100.00	
2.5 NETH GOVT 170115	2,100,000.00	2,248,680.00	
2.5 NETH GOVT 330115	700,000.00	707,980.00	
2.5 O.A.T 201025	3,900,000.00	4,105,920.00	
2.5 OBL 141010	2,500,000.00	2,595,500.00	
2.5 OBL 150227	2,500,000.00	2,616,250.00	
2.75 BEL GOVT 160328	1,200,000.00	1,277,760.00	
2.75 FINNISH GOVT 280704	400,000.00	424,480.00	
2.75 NETH GOVT 150115	2,300,000.00	2,409,825.00	
2.75 OBL 160408	2,400,000.00	2,580,600.00	
3 BEL GOVT 190928	600,000.00	651,450.00	
3 BTAN 140712	4,400,000.00	4,574,680.00	
3 BUND 200704	3,300,000.00	3,729,990.00	
3 ITALY GOVT 140401	2,200,000.00	2,244,990.00	
3 ITALY GOVT 150415	3,100,000.00	3,177,810.00	
3 ITALY GOVT 150615	2,700,000.00	2,769,390.00	
3 ITALY GOVT 151101	2,500,000.00	2,567,625.00	
3 O.A.T 151025	4,500,000.00	4,804,425.00	
3 O.A.T 220425	3,900,000.00	4,189,380.00	
3 SPAIN GOVT 150430	2,700,000.00	2,728,890.00	
3.125 FINNISHGOVT 140915	1,000,000.00	1,046,900.00	
3.15 AUSTRIA GOVT 440620	300,000.00	324,030.00	
3.15 SPAIN GOVT 160131	2,800,000.00	2,816,100.00	
3.2 AUSTRIA GOVT 170220	1,300,000.00	1,427,075.00	
3.25 BEL GOVT 160928	1,850,000.00	2,013,447.50	
3.25 BUND 150704	3,100,000.00	3,321,185.00	
3.25 BUND 200104	3,200,000.00	3,664,320.00	
3.25 BUND 210704	2,800,000.00	3,222,240.00	
3.25 BUND 420704	2,200,000.00	2,604,140.00	
3.25 NETH GOVT 150715	2,400,000.00	2,568,960.00	
3.25 NETH GOVT 210715	2,300,000.00	2,596,815.00	
3.25 O.A.T 160425	3,700,000.00	4,008,950.00	
3.25 O.A.T 211025	3,900,000.00	4,290,780.00	
3.25 SPAIN GOVT 160430	2,900,000.00	2,916,385.00	
3.3 SPAIN GOVT 141031	2,900,000.00	2,956,405.00	
3.375 FINNISH GOV 200415	1,000,000.00	1,138,200.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 141020	1,500,000.00	1,580,250.00	
3.4 AUSTRIA GOVT 221122	400,000.00	451,720.00	
3.4 SPAIN GOVT 140430	2,000,000.00	2,039,600.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 150715	1,700,000.00	1,828,605.00	
3.5 AUSTRIA GOVT 210915	2,000,000.00	2,280,200.00	
3.5 BEL GOVT 150328	1,500,000.00	1,597,800.00	
3.5 BEL GOVT 170628	1,200,000.00	1,326,120.00	
3.5 BUND 160104	3,000,000.00	3,275,400.00	
3.5 BUND 190704	3,000,000.00	3,471,450.00	
3.5 FINNISH GOVT 210415	800,000.00	919,160.00	
3.5 ITALY GOVT 140601	2,900,000.00	2,982,215.00	
3.5 NETH GOVT 200715	2,300,000.00	2,637,295.00	
3.5 O.A.T 150425	3,500,000.00	3,740,625.00	
3.5 O.A.T 200425	3,900,000.00	4,389,645.00	
3.5 O.A.T 260425	4,600,000.00	5,040,450.00	
3.65 AUSTRIA GOVT 220420	1,100,000.00	1,267,255.00	
3.75 BEL GOVT 150928	1,150,000.00	1,246,945.00	
3.75 BEL GOVT 200928	2,300,000.00	2,611,650.00	
3.75 BUND 150104	2,900,000.00	3,095,315.00	

3.75 BUND 170104	3,000,000.00	3,378,600.00	
3.75 BUND 190104	3,100,000.00	3,612,275.00	
3.75 ITALY GOVT 150801	3,800,000.00	3,964,540.00	
3.75 ITALY GOVT 160415	2,300,000.00	2,413,275.00	
3.75 ITALY GOVT 160801	4,100,000.00	4,300,695.00	
3.75 ITALY GOVT 210301	3,500,000.00	3,523,625.00	
3.75 ITALY GOVT 210801	4,100,000.00	4,122,140.00	
3.75 NETH GOVT 140715	2,200,000.00	2,312,530.00	
3.75 NETH GOVT 230115	1,600,000.00	1,876,800.00	
3.75 NETH GOVT 420115	1,700,000.00	2,141,660.00	
3.75 O.A.T 170425	4,400,000.00	4,921,620.00	
3.75 O.A.T 191025	3,800,000.00	4,337,320.00	
3.75 O.A.T 210425	4,100,000.00	4,681,995.00	
3.75 SPAIN GOVT 151031	1,300,000.00	1,331,330.00	
3.8 SPAIN GOVT 170131	2,700,000.00	2,738,610.00	
3.875 FINNISH GOVT170915	800,000.00	911,560.00	
3.9 AUSTRIA GOVT 200715	1,800,000.00	2,097,630.00	
4 AUSTRIA GOVT 160915	1,400,000.00	1,567,370.00	
4 BEL GOVT 140328	1,700,000.00	1,773,100.00	
4 BEL GOVT 170328	1,700,000.00	1,909,015.00	
4 BEL GOVT 180328	1,400,000.00	1,594,810.00	
4 BEL GOVT 190328	1,500,000.00	1,723,275.00	
4 BEL GOVT 220328	1,900,000.00	2,192,220.00	
4 BEL GOVT 320328	300,000.00	341,490.00	
4 BUND 160704	3,500,000.00	3,924,550.00	
4 BUND 180104	2,700,000.00	3,130,785.00	
4 BUND 370104	2,900,000.00	3,770,725.00	
4 FINNISH GOVT 250704	900,000.00	1,091,160.00	
4 IRISH GOVT 140115	1,500,000.00	1,539,225.00	
4 ITALY GOVT 170201	3,600,000.00	3,797,280.00	
4 ITALY GOVT 200901	3,900,000.00	4,011,735.00	
4 ITALY GOVT 370201	3,200,000.00	2,857,120.00	
4 NETH GOVT 160715	1,700,000.00	1,899,665.00	
4 NETH GOVT 180715	2,000,000.00	2,312,300.00	
4 NETH GOVT 190715	2,000,000.00	2,342,600.00	
4 NETH GOVT 370115	1,800,000.00	2,297,790.00	
4 O.A.T 140425	3,450,000.00	3,609,907.50	
4 O.A.T 141025	3,000,000.00	3,191,850.00	
4 O.A.T 180425	3,400,000.00	3,887,560.00	
4 O.A.T 381025	3,150,000.00	3,633,997.50	
4 O.A.T 550425	2,050,000.00	2,367,032.50	
4 O.A.T 600425	1,200,000.00	1,387,080.00	
4 SPAIN GOVT 150730	2,800,000.00	2,890,440.00	
4 SPAIN GOVT 200430	2,900,000.00	2,826,050.00	
4.1 SPAIN GOVT 180730	2,500,000.00	2,527,125.00	
4.15 AUSTRIA GOVT 370315	1,650,000.00	2,073,720.00	
4.2 SPAIN GOVT 370131	2,000,000.00	1,610,000.00	
4.25 BEL GOVT 140928	1,700,000.00	1,809,565.00	
4.25 BEL GOVT 210928	1,900,000.00	2,230,220.00	
4.25 BEL GOVT 220928	1,800,000.00	2,107,080.00	
4.25 BEL GOVT 410328	1,600,000.00	1,900,720.00	
4.25 BUND 140104	3,200,000.00	3,321,920.00	
4.25 BUND 140704	3,700,000.00	3,912,380.00	
4.25 BUND 170704	2,900,000.00	3,362,115.00	
4.25 BUND 180704	2,700,000.00	3,194,640.00	
4.25 BUND 390704	2,000,000.00	2,739,600.00	
4.25 FINNISH GOVT 150704	600,000.00	656,520.00	
4.25 ITALY GOVT 140701	2,100,000.00	2,184,525.00	
4.25 ITALY GOVT 140801	4,000,000.00	4,167,400.00	
4.25 ITALY GOVT 150201	2,500,000.00	2,629,125.00	
4.25 ITALY GOVT 190201	3,100,000.00	3,272,050.00	
4.25 ITALY GOVT 190901	3,500,000.00	3,686,725.00	
4.25 ITALY GOVT 200301	3,500,000.00	3,661,175.00	
4.25 O.A.T 171025	3,600,000.00	4,132,800.00	
4.25 O.A.T 181025	3,300,000.00	3,838,230.00	
4.25 O.A.T 190425	4,100,000.00	4,792,490.00	
4.25 O.A.T 231025	4,400,000.00	5,186,060.00	
4.25 SPAIN GOVT 140131	1,700,000.00	1,746,070.00	
4.25 SPAIN GOVT 161031	2,700,000.00	2,787,615.00	

4.3 AUSTRIA GOVT 140715	1,300,000.00	1,376,440.00	
4.3 AUSTRIA GOVT 170915	1,000,000.00	1,154,450.00	
4.3 SPAIN GOVT 191031	2,400,000.00	2,409,480.00	
4.35 AUSTRIA GOVT 190315	1,700,000.00	2,007,870.00	
4.375 FINNISH GOV 190704	600,000.00	718,410.00	
4.4 IRISH GOVT 190618	1,100,000.00	1,136,520.00	
4.4 SPAIN GOVT 150131	2,700,000.00	2,810,970.00	
4.5 BEL GOVT 260328	900,000.00	1,080,270.00	
4.5 IRISH GOVT 181018	1,350,000.00	1,427,220.00	
4.5 IRISH GOVT 200418	1,700,000.00	1,749,300.00	
4.5 ITALY GOVT 150715	500,000.00	530,525.00	
4.5 ITALY GOVT 180201	3,200,000.00	3,433,920.00	
4.5 ITALY GOVT 180801	3,200,000.00	3,430,400.00	
4.5 ITALY GOVT 190301	3,100,000.00	3,308,320.00	
4.5 ITALY GOVT 200201	2,900,000.00	3,082,120.00	
4.5 ITALY GOVT 260301	2,100,000.00	2,131,080.00	
4.5 NETH GOVT 170715	1,800,000.00	2,090,160.00	
4.5 O.A.T 410425	3,100,000.00	3,872,830.00	
4.6 IRISH GOVT 160418	1,300,000.00	1,394,445.00	
4.6 SPAIN GOVT 190730	2,300,000.00	2,357,615.00	
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	1,700,000.00	2,000,900.00	
4.65 SPAIN GOVT 250730	1,900,000.00	1,768,615.00	
4.7 SPAIN GOVT 410730	1,600,000.00	1,373,600.00	
4.75 BUND 280704	1,400,000.00	1,884,120.00	
4.75 BUND 340704	2,800,000.00	3,946,180.00	
4.75 BUND 400704	2,000,000.00	2,958,700.00	
4.75 ITALY GOVT 160915	2,200,000.00	2,381,170.00	
4.75 ITALY GOVT 170501	2,300,000.00	2,486,185.00	
4.75 ITALY GOVT 170601	1,400,000.00	1,512,770.00	
4.75 ITALY GOVT 210901	3,600,000.00	3,857,220.00	
4.75 ITALY GOVT 230801	3,300,000.00	3,477,375.00	
4.75 O.A.T 350425	2,700,000.00	3,431,295.00	
4.75 SPAIN GOVT 140730	2,200,000.00	2,288,550.00	
4.8 SPAIN GOVT 240131	1,900,000.00	1,825,520.00	
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	1,100,000.00	1,424,665.00	
4.85 SPAIN GOVT 201031	2,600,000.00	2,639,390.00	
4.9 SPAIN GOVT 400730	1,750,000.00	1,545,862.50	
5 BEL GOVT 350328	2,400,000.00	3,116,640.00	
5 IRISH GOVT 201018	1,000,000.00	1,057,350.00	
5 ITALY GOVT 220301	2,500,000.00	2,703,875.00	
5 ITALY GOVT 250301	3,000,000.00	3,185,250.00	
5 ITALY GOVT 340801	2,800,000.00	2,872,520.00	
5 ITALY GOVT 390801	2,500,000.00	2,567,375.00	
5 ITALY GOVT 400901	2,800,000.00	2,868,600.00	
5 O.A.T 161025	4,200,000.00	4,854,780.00	
5.25 ITALY GOVT 170801	3,300,000.00	3,642,540.00	
5.25 ITALY GOVT 291101	3,600,000.00	3,835,260.00	
5.4 IRISH GOVT 250313	1,700,000.00	1,785,340.00	
5.5 BEL GOVT 170928	1,300,000.00	1,559,220.00	
5.5 BEL GOVT 280328	2,400,000.00	3,198,720.00	
5.5 BUND 310104	2,500,000.00	3,696,375.00	
5.5 IRISH GOVT 171018	400,000.00	443,180.00	
5.5 ITALY GOVT 220901	2,600,000.00	2,897,960.00	
5.5 NETH GOVT 280115	1,800,000.00	2,546,640.00	
5.5 O.A.T 290425	2,800,000.00	3,774,120.00	
5.5 SPAIN GOVT 170730	2,600,000.00	2,806,050.00	
5.5 SPAIN GOVT 210430	3,200,000.00	3,358,240.00	
5.625 BUND 280104	1,800,000.00	2,616,210.00	
5.75 ITALY GOVT 330201	1,750,000.00	1,964,462.50	
5.75 O.A.T 321025	3,150,000.00	4,472,685.00	
5.75 SPAIN GOVT 320730	1,900,000.00	1,930,875.00	
5.85 SPAIN GOVT 220131	1,200,000.00	1,277,460.00	
5.9 IRISH GOVT 191018	700,000.00	783,160.00	
5.9 SPAIN GOVT 260730	800,000.00	830,520.00	
6 BUND 160620	140,000.00	166,089.00	
6 ITALY GOVT 141115	1,700,000.00	1,834,980.00	
6 ITALY GOVT 310501	4,000,000.00	4,603,000.00	
6 O.A.T 251025	2,300,000.00	3,164,340.00	
6 SPAIN GOVT 290131	2,500,000.00	2,620,500.00	

6.25 AUSTRIA GOVT 270715	1,100,000.00	1,628,275.00	
6.25 BUND 240104	1,300,000.00	1,889,810.00	
6.25 BUND 300104	1,200,000.00	1,885,320.00	
6.5 BUND 270704	1,400,000.00	2,188,340.00	
6.5 ITALY GOVT 271101	3,400,000.00	4,079,660.00	
7.25 ITALY GOVT 261101	1,400,000.00	1,783,530.00	
8 BEL GOVT 150328	900,000.00	1,045,485.00	
8.5 O.A.T 191025	1,400,000.00	2,026,010.00	
8.5 O.A.T 230425	1,300,000.00	2,042,235.00	
9 ITALY GOVT 231101	1,300,000.00	1,821,885.00	
国債証券 小 計	533,040,000.00	587,548,809.00 (71,968,853,614)	
ユーロ 小 計	533,040,000.00	587,548,809.00 (71,968,853,614)	
合 計	—	173,702,997,666 (173,702,997,666)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

（注２）合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 195銘柄	100.00%	41.37%
カナダドル	国債証券 30銘柄	100.00%	2.73%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.00%	1.54%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.00%	7.56%
スイスフラン	国債証券 9銘柄	100.00%	0.42%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	100.00%	0.39%
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.00%	0.54%
スウェーデンクローネ	国債証券 9銘柄	100.00%	0.61%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.00%	0.26%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.00%	0.80%
メキシコペソ	国債証券 20銘柄	100.00%	0.98%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.00%	0.76%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.00%	0.61%
ユーロ	国債証券 237銘柄	100.00%	41.43%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「新興国債券インデックスマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	7,183,675	63,612,461
コール・ローン	8,942,440	11,260,093
国債証券	1,563,948,285	2,470,791,691
特殊債券	139,044,130	114,455,483
未収利息	25,996,780	40,817,188
前払費用	5,741,801	4,244,583
流動資産合計	1,750,857,111	2,705,181,499
資産合計	1,750,857,111	2,705,181,499
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,400	32,070
未払金	—	13,883,585
未払解約金	6,685,191	11,642,957
流動負債合計	6,696,591	25,558,612
負債合計	6,696,591	25,558,612
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,754,755,192
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2	10,594,672
元本等合計		1,744,160,520
純資産合計		1,744,160,520
負債純資産合計		1,750,857,111
		2,705,181,499

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

（２）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	有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 （１）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （２）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （３）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	1,636,208,683円	1,754,755,192円
期首からの追加設定元本額	223,028,870円	1,260,986,036円
期首からの一部解約元本額	104,482,361円	918,419,898円
元本の内訳＊		
e M A X I S バランス（８資産均等型）	14,106,559円	86,062,180円
e M A X I S バランス（波乗り型）	5,371,521円	44,587,378円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	—	365,795円
e M A X I S 新興国債券インデックス	590,946,234円	1,071,007,128円
三菱ＵＦＪ ＤＣ新興国債券インデックスファンド	62,791,817円	252,519,524円
新興国債券インデックスオープン	—	13,322,672円
新興国債券インデックスファンド	907,525,400円	434,224,652円
三菱ＵＦＪ グローバル型バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,237,971円	8,035,392円
三菱ＵＦＪ 新興国債券ファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	165,775,690円	187,196,609円
（合 計）	1,754,755,192円	2,097,321,330円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額であります。	10,594,672円	—
3 受益権の総数	1,754,755,192口	2,097,321,330口
4 １口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.9940円 (9,940円)	1.2776円 (12,776円)

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債を実質的な主要投資対象としております。公社債の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスクおよびカントリーリスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	43,155,269	85,296,028
特殊債券	3,332,962	4,085,213
合 計	39,822,307	89,381,241

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区 分	種 類	[平成24年1月26日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	マレーシアリングット	2,554,700	—	2,551,000	3,700
	メキシコペソ	1,673,700	—	1,666,000	7,700
	合 計	4,228,400	—	4,217,000	11,400

区 分	種 類	[平成25年1月28日現在]			
		契 約 額 等 (円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	メキシコペソ	2,866,210	—	2,868,000	1,790
	南アフリカランド	1,296,620	—	1,318,200	21,580
	トルコリラ	1,536,000	—	1,544,700	8,700
	合 計	5,698,830	—	5,730,900	32,070

（注）時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。
 （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨		券面総額	評価額	備考
種類	銘柄			
マレーシアリングット				
国債証券	3.314 MALAYSIA 171031	400,000.00	401,712.00	
	3.418MALAYSIAGOVT 220815	700,000.00	695,982.00	
	3.434 MALAYSIAGOV 140815	400,000.00	402,628.00	
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	400,000.00	401,520.00	
	3.58 MALAYSIAGOVT 180928	400,000.00	404,476.00	
	3.741 MALAYSIAGOV 150227	700,000.00	709,352.00	
	3.835MALAYSIAGOVT 150812	600,000.00	610,602.00	
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	500,000.00	508,605.00	
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	900,000.00	928,728.00	
	4.127 MALAYSIA 320415	200,000.00	205,732.00	
	4.16 MALAYSIAGOVT 210715	400,000.00	419,524.00	
	4.232MALAYSIAGOVT 310630	200,000.00	209,288.00	
	4.24 MALAYSIAGOVT 180207	200,000.00	208,398.00	
	4.262MALAYSIAGOVT 160915	900,000.00	933,183.00	
	4.378MALAYSIAGOVT 191129	800,000.00	846,488.00	
4.392 MALAYSIAGOV 260415	400,000.00	429,152.00		

	5.094MALAYSIAGOV 140430	800,000.00	820,352.00	
	国債証券 小 計	8,900,000.00	9,135,722.00 (272,244,515)	
	マレーシアリンギット 小 計	8,900,000.00	9,135,722.00 (272,244,515)	
	タイパーツ			
国債証券	2.8 THAILAND 171010	3,600,000.00	3,535,308.00	
	3.125 THAILAND 151211	6,200,000.00	6,232,116.00	
	3.25 THAILAND 170616	2,300,000.00	2,310,304.00	
	3.58 THAILAND 271217	1,900,000.00	1,807,109.00	
	3.625 THAILAND 150522	6,000,000.00	6,093,720.00	
	3.625 THAILAND 230616	2,000,000.00	1,986,440.00	
	3.65 THAILAND 211217	6,600,000.00	6,623,430.00	
	3.85 THAILAND 251212	2,800,000.00	2,760,380.00	
	3.875 THAILAND 190613	13,000,000.00	13,350,350.00	
	4.125 THAILAND 161118	3,000,000.00	3,106,800.00	
	4.75 THAILAND 241220	2,800,000.00	3,030,188.00	
	5.125 THAILAND 180313	4,000,000.00	4,341,920.00	
	5.25 THAILAND 140512	7,000,000.00	7,213,290.00	
	国債証券 小 計	61,200,000.00	62,391,355.00 (189,669,719)	
	タイパーツ 小 計	61,200,000.00	62,391,355.00 (189,669,719)	
	フィリピンペソ			
国債証券	4.95 PHILIPPI(GL) 210115	5,000,000.00	5,750,935.00	
	国債証券 小 計	5,000,000.00	5,750,935.00 (12,882,094)	
	フィリピンペソ 小 計	5,000,000.00	5,750,935.00 (12,882,094)	
	インドネシアルピア			
国債証券	10 INDONESIA 170715	1,000,000,000.00	1,206,840,000.00	
	10 INDONESIA 240915	700,000,000.00	944,062,000.00	
	10 INDONESIA 280215	1,050,000,000.00	1,433,670,000.00	
	10.25 INDONESIA 270715	780,000,000.00	1,082,936,400.00	
	10.5 INDONESIA 300815	1,650,000,000.00	2,378,904,000.00	
	10.75 INDONESIA 160515	700,000,000.00	829,892,000.00	
	11 INDONESIA 201115	1,000,000,000.00	1,370,770,000.00	
	11 INDONESIA 250915	1,450,000,000.00	2,094,786,000.00	
	11.5 INDONESIA 190915	530,000,000.00	720,217,000.00	
	12.8 INDONESIA 210615	540,000,000.00	816,388,200.00	
	7 INDONESIA 220515	1,850,000,000.00	2,090,759,000.00	
	7 INDONESIA 270515	1,600,000,000.00	1,737,568,000.00	
	7.375 INDONESIA 160915	900,000,000.00	980,217,000.00	
	8.25 INDONESIA 210715	800,000,000.00	963,704,000.00	
	8.25 INDONESIA 320615	2,300,000,000.00	2,762,139,000.00	
	8.375 INDONESIA 260915	930,000,000.00	1,127,625,000.00	
	9.5 INDONESIA 150615	1,220,000,000.00	1,353,541,200.00	
	9.5 INDONESIA 310715	1,650,000,000.00	2,215,884,000.00	
	9.5 INDONESIA 410515	550,000,000.00	753,604,500.00	
	国債証券 小 計	21,200,000,000.00	26,863,507,300.00 (252,516,968)	
	インドネシアルピア 小 計	21,200,000,000.00	26,863,507,300.00 (252,516,968)	
	メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	2,200,000.00	3,137,178.00	
	10 MEXICAN BONOS 361120	1,100,000.00	1,643,510.00	
	5 MEXICAN BONOS 170615	1,400,000.00	1,411,942.00	
	6 MEXICAN BONOS 150618	1,900,000.00	1,962,852.00	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	2,100,000.00	2,201,283.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	2,100,000.00	2,307,480.00	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	1,600,000.00	1,762,016.00	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	1,100,000.00	1,197,911.00	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	1,500,000.00	1,788,120.00	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	1,400,000.00	1,580,712.00	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	1,600,000.00	1,930,384.00	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	1,100,000.00	1,342,099.00	
	8 MEXICAN BONOS 151217	2,700,000.00	2,942,946.00	
	8 MEXICAN BONOS 200611	2,000,000.00	2,382,520.00	
	8 MEXICAN BONOS 231207	500,000.00	617,730.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	800,000.00	948,712.00	

	8.5 MEXICAN BONOS 290531	1,900,000.00	2,460,386.00	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	2,200,000.00	2,884,486.00	
	9.5 MEXICAN BONOS 141218	2,100,000.00	2,288,958.00	
国債証券 小 計		31,300,000.00	36,791,225.00 (264,160,995)	
メキシコペソ 小 計		31,300,000.00	36,791,225.00 (264,160,995)	
ブラジルレアル				
国債証券	10(IN)BRAZIL NTN-F150101	100,000.00	104,367.30	
	10(IN)BRAZIL NTN-F170101	1,000,000.00	1,049,264.00	
	10(IN)BRAZIL NTN-F210101	500,000.00	522,792.00	
	12.5 BRAZIL (GL) 160105	750,000.00	909,412.50	
	12.5 BRAZIL (GL) 220105	500,000.00	728,300.00	
	BRAZIL-LTN 140401	700,000.00	643,519.10	
	BRAZIL-LTN 150101	1,100,000.00	947,097.80	
	BRAZIL-LTN 160101	1,500,000.00	1,179,633.00	
国債証券 小 計		6,150,000.00	6,084,385.70 (272,823,854)	
ブラジルレアル 小 計		6,150,000.00	6,084,385.70 (272,823,854)	
コロンビアペソ				
国債証券	12 COLOMBIA (GL) 151022	1,020,000,000.00	1,231,888,680.00	
	7.75 COLOMBI (GL) 210414	420,000,000.00	529,724,580.00	
	9.85 COLOMBI (GL) 270628	80,000,000.00	124,667,520.00	
国債証券 小 計		1,520,000,000.00	1,886,280,780.00 (96,577,575)	
コロンビアペソ 小 計		1,520,000,000.00	1,886,280,780.00 (96,577,575)	
ハンガリーフォリント				
国債証券	5.5 HUNGARY 140212	21,000,000.00	21,041,370.00	
	5.5 HUNGARY 160212	31,000,000.00	30,870,730.00	
	6 HUNGARY 231124	14,000,000.00	13,450,500.00	
	6.5 HUNGARY 190624	28,800,000.00	29,216,736.00	
	6.75 HUNGARY 140822	30,000,000.00	30,624,300.00	
	6.75 HUNGARY 170224	40,000,000.00	41,068,000.00	
	6.75 HUNGARY 171124	49,000,000.00	50,428,350.00	
	7 HUNGARY 220624	26,000,000.00	26,874,380.00	
	7.5 HUNGARY 201112	27,000,000.00	28,928,070.00	
	7.75 HUNGARY 150824	23,000,000.00	24,151,840.00	
	8 HUNGARY 150212	37,000,000.00	38,828,170.00	
			335,482,446.00 (138,118,123)	
国債証券 小 計		326,800,000.00	335,482,446.00 (138,118,123)	
ハンガリーフォリント 小 計		326,800,000.00	335,482,446.00 (138,118,123)	
ペルーヌエボソル				
国債証券	6.9 PERU 370812	300,000.00	385,095.00	
	7.84 PERU 200812	650,000.00	820,423.50	
	8.2 PERU 260812	400,000.00	562,768.00	
国債証券 小 計		1,350,000.00	1,768,286.50 (62,915,633)	
ペルーヌエボソル 小 計		1,350,000.00	1,768,286.50 (62,915,633)	
ポーランドズロチ				
国債証券	4.75 POLAND 161025	600,000.00	628,560.00	
	4.75 POLAND 170425	600,000.00	632,340.00	
	5 POLAND 160425	600,000.00	629,940.00	
	5.25 POLAND 171025	600,000.00	647,760.00	
	5.25 POLAND 201025	700,000.00	772,100.00	
	5.5 POLAND 150425	800,000.00	836,800.00	
	5.5 POLAND 191025	900,000.00	1,004,355.00	
	5.75 POLAND 140425	700,000.00	720,300.00	
	5.75 POLAND 211025	800,000.00	913,040.00	
	5.75 POLAND 220923	800,000.00	920,680.00	
	6.25 POLAND 151024	700,000.00	752,570.00	
	POLAND 140725	200,000.00	190,640.00	
			8,649,085.00 (254,456,080)	
国債証券 小 計		8,000,000.00	8,649,085.00 (254,456,080)	
ポーランドズロチ 小 計		8,000,000.00	8,649,085.00 (254,456,080)	
南アフリカランド				

国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	3,800,000.00	4,823,454.00	
	13.5 SOUTH AFRICA 150915	2,200,000.00	2,631,002.00	
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	2,300,000.00	1,842,208.00	
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	1,300,000.00	1,056,042.00	
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	2,700,000.00	2,743,227.00	
	7 SOUTH AFRICA 310228	1,500,000.00	1,370,940.00	
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	2,800,000.00	2,940,616.00	
	8 SOUTH AFRICA 181221	2,600,000.00	2,840,708.00	
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	2,700,000.00	2,960,658.00	
	8.75 SOUTH AFRICA 141221	800,000.00	851,464.00	
国債証券 小 計		22,700,000.00	24,060,319.00 (244,212,237)	
南アフリカランド 小 計		22,700,000.00	24,060,319.00 (244,212,237)	
ロシアルーブル				
国債証券	7.85 RUSSIA (GL) 180310	45,000,000.00	49,162,500.00	
	国債証券 小 計	45,000,000.00	49,162,500.00 (149,454,000)	
特殊債券	4.875 INTL BK(GL) 130916	17,300,000.00	17,223,880.00	
	7.5 INTL BK(GL) 170302	19,000,000.00	20,425,950.00	
特殊債券 小 計		36,300,000.00	37,649,830.00 (114,455,483)	
ロシアルーブル 小 計		81,300,000.00	86,812,330.00 (263,909,483)	
トルコリラ				
国債証券	10 TURKEY GOVT 150617	400,000.00	434,468.00	
	10.5 TURKEY GOVT 200115	500,000.00	612,770.00	
	11 TURKEY GOVT 140806	300,000.00	321,504.00	
	7.5 TURKEY GOVT 140924	500,000.00	512,570.00	
	8 TURKEY GOVT 140604	500,000.00	513,290.00	
	8.5 TURKEY GOVT 220914	300,000.00	341,406.00	
	9 TURKEY GOVT 140305	400,000.00	413,020.00	
	9 TURKEY GOVT 160127	500,000.00	537,625.00	
	9 TURKEY GOVT 170308	600,000.00	659,040.00	
	9.5 TURKEY GOVT 220112	600,000.00	717,606.00	
国債証券 小 計		4,600,000.00	5,063,299.00 (260,759,898)	
トルコリラ 小 計		4,600,000.00	5,063,299.00 (260,759,898)	
合 計		—	2,585,247,174 (2,585,247,174)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
マレーシアリングgit	国債証券 17銘柄	100.00%	10.53%
タイバーツ	国債証券 13銘柄	100.00%	7.34%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.00%	0.50%
インドネシアルピア	国債証券 19銘柄	100.00%	9.77%
メキシコペソ	国債証券 19銘柄	100.00%	10.22%
ブラジルリアル	国債証券 8銘柄	100.00%	10.55%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.00%	3.74%
ハンガリーフォリント	国債証券 11銘柄	100.00%	5.34%
ペルーヌエボソル	国債証券 3銘柄	100.00%	2.43%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.00%	9.84%
南アフリカランド	国債証券 10銘柄	100.00%	9.45%
ロシアルーブル	国債証券 1銘柄	56.63%	5.78%
	特殊債券 2銘柄	43.37%	4.43%
トルコリラ	国債証券 10銘柄	100.00%	10.09%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)[次へ](#)

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,410,414	28,654,087
投資証券	991,018,460	2,424,674,890
未収入金	—	34,445,850
未収配当金	9,897,408	18,716,118
未収利息	63	75
流動資産合計	1,028,326,345	2,506,491,020
資産合計	1,028,326,345	2,506,491,020
負債の部		
流動負債		
未払金	17,274,290	19,765,770
未払解約金	2,092,870	37,435,210
流動負債合計	19,367,160	57,200,980
負債合計	19,367,160	57,200,980
純資産の部		
元本等		
元本	1 976,937,045	1,612,905,435
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	32,022,140	836,384,605
元本等合計	1,008,959,185	2,449,290,040
純資産合計	1,008,959,185	2,449,290,040
負債純資産合計	1,028,326,345	2,506,491,020

（注1）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月27日から翌年1月26日までであります。

（２）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	投資証券は移動平均法、投資証券以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 （１）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 （２）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （３）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	859,668,732円	976,937,045円
期首からの追加設定元本額	186,869,305円	1,209,536,628円
期首からの一部解約元本額	69,600,992円	573,568,238円
元本の内訳＊		
e M A X I S 国内リートインデックス	957,604,809円	1,501,923,288円
e M A X I S バランス（８資産均等型）	13,310,941円	72,257,064円
e M A X I S バランス（波乗り型）	5,056,211円	37,534,607円
三菱ＵＦＪ＜ＤＣ＞Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド	965,084円	959,334円
三菱ＵＦＪプライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	—	231,142円
（合 計）	976,937,045円	1,612,905,435円
2 受益権の総数	976,937,045口	1,612,905,435口
3 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0328円 (10,328円)	1.5186円 (15,186円)

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券を実質的な主要投資対象としております。投資証券の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	228,445,922	474,507,677
合 計	228,445,922	474,507,677

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

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。

(3) 附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	100.00	67,000,000	
	M I D リート投資法人	94.00	20,153,600	
	森ヒルズリート投資法人	119.00	57,536,500	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	78.00	38,415,000	
	産業ファンド投資法人	72.00	51,120,000	
	大和ハウスリート投資法人	63.00	36,540,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	565.00	102,717,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	39.00	7,515,300	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	105.00	63,945,000	
	日本ビルファンド投資法人	353.00	324,760,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	305.00	272,975,000	
	日本リテールファンド投資法人	1,068.00	174,831,600	
	オリックス不動産投資法人	146.00	71,540,000	
	日本ブライムリアルティ投資法人	424.00	107,356,800	
	プレミア投資法人	101.00	36,865,000	
	東急リアル・エステート投資法人	87.00	41,847,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	50.00	27,350,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	157.00	81,954,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,081.00	112,964,500	
	森トラスト総合リート投資法人	124.00	92,504,000	
	インヴィンシブル投資法人	693.00	5,218,290	
	フロンティア不動産投資法人	117.00	92,781,000	
	平和不動産リート投資法人	409.00	25,112,600	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	76.00	60,192,000	
	福岡リート投資法人	63.00	42,462,000	
	ケネディクス不動産投資法人	147.00	48,951,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	70.00	29,400,000	
	いちご不動産投資法人	433.00	22,516,000	
	大和証券オフィス投資法人	203.00	66,482,500	
	阪急リート投資法人	44.00	19,096,000	
	スターツプロシード投資法人	55.00	7,947,500	
	トップリート投資法人	80.00	31,840,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	83.00	59,096,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,085.00	30,097,900	
	日本賃貸住宅投資法人	684.00	45,964,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	97.00	47,627,000	
	投資証券 小計	9,470.00	2,424,674,890	
	合計	9,470.00	2,424,674,890	

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

「MUAM G - REITマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	18,771,186	77,034,662
コール・ローン	10,957,128	29,765,381
投資証券	3,417,940,324	5,063,437,288
派生商品評価勘定	—	113,820
未収入金	6,373	14,476,859
未収配当金	6,641,465	9,916,778
未収利息	25	78
流動資産合計	3,454,316,501	5,194,744,866
資産合計	3,454,316,501	5,194,744,866
負債の部		
流動負債		
未払金	—	56,039,647
未払解約金	5,374,209	1,524,355
流動負債合計	5,374,209	57,564,002
負債合計	5,374,209	57,564,002
純資産の部		
元本等		
元本	1 5,067,809,441	5,385,267,955
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	2 1,618,867,149	248,087,091
元本等合計	3,448,942,292	5,137,180,864
純資産合計	3,448,942,292	5,137,180,864
負債純資産合計	3,454,316,501	5,194,744,866

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月6日から翌年1月5日までであります。

(2) 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	投資証券および株式は移動平均法、投資証券および株式以外の有価証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所における最終相場（外貨建証券の場合は知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 期首	平成23年10月31日	平成24年1月27日
期首元本額	5,138,115,055円	5,067,809,441円
期首からの追加設定元本額	252,229,172円	1,433,300,437円
期首からの一部解約元本額	322,534,786円	1,115,841,923円
元本の内訳＊		
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）	742,391,377円	517,714,459円
三菱ＵＦＪ 6資産バランスファンド（成長型）	474,590,106円	346,891,166円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（分配型）	143,673,770円	97,353,958円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（バランス型）	242,279,965円	172,312,986円
三菱ＵＦＪ 資産設計ファンド（株式重視型）	99,425,029円	72,863,603円
ファンド・マネジャー（海外リート）	69,994,218円	8,705,511円
F Pバランスファンド（安定型）	17,789,643円	14,538,244円
F Pバランスファンド（安定成長型）	39,248,551円	26,547,255円
e M A X I S 先進国リートインデックス	3,208,079,395円	3,946,023,565円
e M A X I S バランス（8資産均等型）	20,844,807円	115,738,281円
e M A X I S バランス（波乗り型）	7,926,136円	59,965,288円
三菱ＵＦＪ < D C > 先進国 R E I T インデックスファン ド	1,566,444円	6,232,854円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（8資産）（確定拠出年 金）	—	380,785円
（合 計）	5,067,809,441円	5,385,267,955円
2 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回っており、その差額でありま す。	1,618,867,149円	248,087,091円
3 受益権の総数	5,067,809,441口	5,385,267,955口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6806円 （6,806円）	0.9539円 （9,539円）

＊ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（ 自 平成23年10月31日 至 平成24年 1月26日 ）	（ 自 平成24年 1月27日 至 平成25年 1月28日 ）
1 金融商品に対する取組 方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当 該金融商品に係るリス ク	当ファンドは、投資証券および新株予約権証券を実質的な主要投資対象としております。投資証券および新株予約権証券の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 デリバティブ取引については、当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	当ファンドは、投資証券および株式を実質的な主要投資対象としております。投資証券および株式の投資に係る価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 同 左
3 金融商品に係るリスク 管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
1 貸借対照表計上額、時 価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引 該当事項はありません。 （3）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 （2）デリバティブ取引 （デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。 同 左
3 金融商品の時価等に関 する事項についての補 足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	[平成24年1月26日現在]	[平成25年1月28日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	182,242,716	111,194,679
合計	182,242,716	111,194,679

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

[平成24年1月26日現在]

該当事項はありません。

区 分	種 類	〔 平成25年1月28日現在 〕			
		契 約 額 等(円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 オーストラリアドル	6,524,280	—	6,638,100	113,820
	合 計	6,524,280	—	6,638,100	113,820

(注) 時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。
 （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

（単位：円）

通貨		口数	評価額	備考
種類	銘柄			
アメリカドル				
投資証券	ACADIA REALTY TRUST	4,316.00	112,518.12	
	AGREE REALTY CORP	700.00	19,971.00	
	ALEXANDER'S INC	165.00	53,695.95	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,790.00	351,298.60	
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,500.00	71,475.00	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,990.00	381,282.80	
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	11,165.00	312,508.35	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	5,140.00	60,395.00	
	ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	3,910.00	64,241.30	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,697.00	1,203,838.74	
	BIOMED REALTY TRUST INC	11,770.00	239,048.70	
	BOSTON PROPERTIES INC	11,670.00	1,277,398.20	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	10,890.00	144,074.70	
	BRE PROPERTIES INC	5,910.00	302,887.50	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,590.00	464,199.60	
	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	2,700.00	33,129.00	
	CAPLEASE INC	4,510.00	23,632.40	
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	12,803.00	273,087.99	
	CEDAR REALTY TRUST INC	4,060.00	21,924.00	
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,100.00	67,487.00	
	COLONIAL PROPERTIES TRUST	6,210.00	139,662.90	
	COMMONWEALTH REIT	6,265.00	105,502.60	
	CORESITE REALTY CORP	1,600.00	47,712.00	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	6,140.00	166,639.60	
	COUSINS PROPERTIES INC	7,254.00	64,705.68	
	CUBESMART	9,300.00	138,012.00	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	20,680.00	145,587.20	
	DDR CORP	18,318.00	298,033.86	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	15,266.00	143,805.72	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,570.00	692,293.80	
	DOUGLAS EMMETT INC	10,080.00	239,803.20	
	DUKE REALTY CORP	23,880.00	364,886.40	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	4,910.00	119,362.10	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	2,220.00	124,608.60	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	8,620.00	94,216.60	
	EPR PROPERTIES	3,500.00	165,795.00	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,910.00	208,501.50	
	EQUITY ONE INC	4,850.00	108,785.50	
	EQUITY RESIDENTIAL	24,840.00	1,442,955.60	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,740.00	422,699.80	
	EXCEL TRUST INC	3,700.00	46,028.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,620.00	299,618.40	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,867.00	513,225.15	
	FELCOR LODGING TRUST INC	9,150.00	50,782.50	
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	7,150.00	108,608.50	
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	3,760.00	51,737.60	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,770.00	75,644.70	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	34,998.00	688,760.64	
	GETTY REALTY CORP	2,370.00	44,058.30	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	970.00	17,877.10	
	GLIMCHER REALTY TRUST	10,880.00	119,136.00	
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	3,450.00	85,767.00	
	HCP INC	34,830.00	1,637,010.00	
	HEALTH CARE REIT INC	19,730.00	1,242,003.50	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,540.00	166,770.00	
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	5,300.00	55,279.00	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,190.00	76,342.20	
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,960.00	211,222.40	

	HOME PROPERTIES INC	3,870.00	242,842.50	
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	9,360.00	242,985.60	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,332.00	951,157.08	
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	1,750.00	37,047.50	
	INLAND REAL ESTATE CORP	6,480.00	58,125.60	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,560.00	60,876.80	
	KILROY REALTY CORP	5,740.00	287,631.40	
	KIMCO REALTY CORP	31,190.00	645,633.00	
	KITE REALTY GROUP TRUST	4,550.00	26,845.00	
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	7,101.00	196,484.67	
	LEXINGTON REALTY TRUST	11,698.00	128,561.02	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	8,970.00	348,215.40	
	LTC PROPERTIES INC	2,410.00	88,808.50	
	MACERICH CO/THE	10,456.00	620,459.04	
	MACK-CALI REALTY CORP	6,320.00	173,484.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,520.00	138,969.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,210.00	212,502.00	
	MONMOUTH REIT-CLASS A	2,500.00	26,325.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,470.00	272,056.40	
	NATL HEALTH INVESTORS INC	1,890.00	118,692.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,579.00	223,826.11	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,200.00	26,544.00	
	PARKWAY PROPERTIES INC	2,910.00	45,861.60	
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,650.00	116,854.50	
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	4,650.00	86,908.50	
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,700.00	247,650.00	
	POST PROPERTIES INC	4,190.00	211,008.40	
	PROLOGIS INC	35,613.00	1,447,312.32	
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,320.00	93,165.60	
	PUBLIC STORAGE	11,104.00	1,695,580.80	
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	3,960.00	59,281.20	
	REALTY INCOME CORP	13,620.00	592,197.60	
	REGENCY CENTERS CORP	6,920.00	347,799.20	
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3,100.00	40,641.00	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	2,800.00	35,700.00	
	RLJ LODGING TRUST	8,800.00	187,088.00	
	ROUSE PROPERTIES INC	1,670.00	30,811.50	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,500.00	141,155.00	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	2,800.00	68,964.00	
	SAUL CENTERS INC	1,080.00	46,861.20	
	SELECT INCOME REIT	1,400.00	34,986.00	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	13,920.00	338,395.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,733.00	3,853,052.55	
	SL GREEN REALTY CORP	7,050.00	574,152.00	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	2,260.00	145,747.40	
	STAG INDUSTRIAL INC	2,800.00	55,104.00	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	13,000.00	93,730.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,000.00	28,290.00	
	SUN COMMUNITIES INC	2,100.00	91,035.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,249.00	120,528.24	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7,160.00	254,251.60	
	TAUBMAN CENTERS INC	4,630.00	378,919.20	
	UDR INC	18,896.00	467,864.96	
	UMH PROPERTIES INC	1,500.00	15,525.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,040.00	56,981.60	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,540.00	30,461.20	
	VENTAS INC	22,446.00	1,496,025.90	
	VORNADO REALTY TRUST	12,918.00	1,103,843.10	
	WASHINGTON REIT	5,260.00	148,226.80	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	8,300.00	234,641.00	
	WHITESTONE REIT	1,650.00	23,232.00	
	WINTHROP REALTY TRUST	2,490.00	28,386.00	
	WP CAREY INC	4,570.00	251,441.40	
	投資証券 小 計	999,219.00	36,649,266.99 (3,336,182,774)	
	アメリカドル 小 計	999,219.00	36,649,266.99 (3,336,182,774)	
	カナダドル			
投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,600.00	88,400.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,390.00	70,942.40	

	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,010.00	131,313.30	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PRO	1,100.00	31,944.00	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	4,100.00	123,082.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,780.00	97,221.60	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	2,670.00	119,001.90	
	CHARTWELL RETIREMENT RESIDEN	6,700.00	73,097.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	4,770.00	106,514.10	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2,030.00	30,145.50	
	DUNDEE INTERNATIONAL REAL ES	2,700.00	30,348.00	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTM-A	3,710.00	144,430.30	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	6,960.00	165,787.20	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	3,480.00	14,511.60	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	2,000.00	38,660.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	1,250.00	39,475.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	900.00	12,060.00	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	3,730.00	101,456.00	
	RETROCOM MID-MARKET REIT	2,500.00	14,025.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11,570.00	310,423.10	
	投資証券 小 計	72,950.00	1,742,838.00 (157,430,556)	
	カナダドル 小 計	72,950.00	1,742,838.00 (157,430,556)	
	オーストラリアドル			
投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	20,672.00	44,031.36	
	ALE PROPERTY GROUP	16,500.00	37,950.00	
	ASPEN GROUP	114,000.00	25,650.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	3,000.00	10,470.00	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	19,000.00	64,790.00	
	BWP TRUST	33,020.00	76,276.20	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GR	176,400.00	358,092.00	
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPE	6,570.00	16,227.90	
	CHARTER HALL GROUP	17,172.00	57,697.92	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	21,416.00	80,524.16	
	COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	186,050.00	207,445.75	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	86,930.00	74,325.15	
	DEXUS PROPERTY GROUP	373,220.00	395,613.20	
	FEDERATION CENTRES	107,000.00	245,030.00	
	GOODMAN GROUP	117,356.00	528,102.00	
	GPT GROUP	127,100.00	468,999.00	
	INVESTA OFFICE FUND	47,335.00	145,318.45	
	MIRVAC GROUP	265,770.00	414,601.20	
	STOCKLAND	169,500.00	594,945.00	
	WESTFIELD GROUP	159,200.00	1,746,424.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	213,900.00	678,063.00	
	投資証券 小 計	2,281,111.00	6,270,576.29 (594,701,455)	
	オーストラリアドル 小 計	2,281,111.00	6,270,576.29 (594,701,455)	
	イギリスポンド			
投資証券	BIG YELLOW GROUP PLC	9,700.00	35,783.30	
	BRITISH LAND CO PLC	68,115.00	384,509.17	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GRO	45,430.00	163,139.13	
	DERWENT LONDON PLC	6,600.00	143,748.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	25,750.00	127,514.00	
	HAMMERSON PLC	55,920.00	274,623.12	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	47,000.00	39,550.50	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,490.00	484,248.60	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY P	57,000.00	64,695.00	
	METRIC PROPERTY INVESTMENT P	15,000.00	15,150.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	4,200.00	14,868.00	
	SEGRO PLC	56,341.00	140,007.38	
	SHAFTESBURY PLC	18,400.00	103,592.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	8,979.00	29,540.91	
	投資証券 小 計	477,925.00	2,020,969.11 (290,231,373)	
	イギリスポンド 小 計	477,925.00	2,020,969.11 (290,231,373)	
	香港ドル			
投資証券	CHAMPION REIT	225,000.00	906,750.00	
	FORTUNE REIT	94,000.00	632,620.00	

	LINK REIT	173,500.00	6,887,950.00	
	PROSPERITY REIT	62,000.00	153,760.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	75,000.00	168,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	92,000.00	314,640.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	134,000.00	530,640.00	
			9,594,360.00	
	投資証券 小 計	855,500.00	(112,637,786)	
	香港ドル 小 計	855,500.00	9,594,360.00	
	シンガポールドル		(112,637,786)	
投資証券	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	32,000.00	50,560.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	34,000.00	33,320.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	140,000.00	354,200.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	52,000.00	73,580.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	45,000.00	56,475.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	99,000.00	70,290.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	152,900.00	258,401.00	
	CAPITAMALL TRUST	200,000.00	424,000.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	35,000.00	60,025.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	52,000.00	103,480.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	52,000.00	53,820.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	40,000.00	43,200.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	42,000.00	83,790.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	29,200.00	39,858.00	
	KEPPEL REIT	53,000.00	71,020.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	108,000.00	55,080.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	80,000.00	98,400.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	87,000.00	124,410.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114,000.00	132,810.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	26,000.00	59,800.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	45,000.00	53,100.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	114,000.00	94,620.00	
	SUNTEC REIT	164,000.00	277,980.00	
			2,672,219.00	
	投資証券 小 計	1,796,100.00	(196,969,262)	
	シンガポールドル 小 計	1,796,100.00	2,672,219.00	
	ニュージーランドドル		(196,969,262)	
投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	68,690.00	69,720.35	
	KIWI INCOME PROPERTY TRUST	83,000.00	95,035.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	28,000.00	34,440.00	
			199,195.35	
	投資証券 小 計	179,690.00	(15,156,774)	
	ニュージーランドドル 小 計	179,690.00	199,195.35	
	ユーロ		(15,156,774)	
投資証券	AEDIFICA	780.00	34,093.80	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5,200.00	48,656.40	
	ALTAREA	220.00	25,685.00	
	ANF IMMOBILIER	1,120.00	25,177.60	
	BEFIMMO S.C.A.	1,200.00	61,200.00	
	BENI STABILI SPA	65,000.00	32,500.00	
	COFINIMMO	1,110.00	98,856.60	
	CORIO NV	7,170.00	260,486.10	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	2,820.00	84,332.10	
	FONCIERE DES REGIONS	2,963.00	186,935.67	
	GECINA SA	1,990.00	173,130.00	
	HAMBORNER REIT AG	2,500.00	18,500.00	
	ICADE	1,690.00	111,540.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,890.00	5,994.30	
	KLEPIERRE	7,450.00	220,222.00	
	MERCIALYS	4,041.00	66,838.14	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	3,746.00	24,401.44	
	SILIC	650.00	52,981.50	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	482.00	22,225.02	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,940.00	1,212,765.00	
	VASTNED RETAIL NV	1,440.00	48,888.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	870.00	38,445.30	
	WERELDHAVE NV	1,680.00	86,200.80	

投資証券 小 計	127,952.00	2,940,054.77 (360,127,308)	
ユーロ 小 計	127,952.00	2,940,054.77 (360,127,308)	
合 計	—	5,063,437,288 (5,063,437,288)	

（注１）通貨の種類ごとの小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘 柄 数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 121銘柄	100.00%	65.89%
カナダドル	投資証券 20銘柄	100.00%	3.11%
オーストラリアドル	投資証券 21銘柄	100.00%	11.75%
イギリスポンド	投資証券 14銘柄	100.00%	5.73%
香港ドル	投資証券 7銘柄	100.00%	2.22%
シンガポールドル	投資証券 23銘柄	100.00%	3.89%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.00%	0.30%
ユーロ	投資証券 23銘柄	100.00%	7.11%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。

[前へ](#)

２【ファンドの現況】
【純資産額計算書】

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	630,639,407
負 債 総 額	6,715,982
純資産総額（ - ）	623,923,425
発 行 済 口 数	468,560,517 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3316 （ 1万口当たり 13,316 ）

<参考>

「ＴＯＰＩＸマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	228,258,031,960
負 債 総 額	18,193,806,253
純資産総額（ - ）	210,064,225,707
発 行 済 口 数	226,996,183,698 口
1口当たり純資産価額（ / ）	0.9254 （ 1万口当たり 9,254 ）

<参考>

「外国株式インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	166,402,831,251
負 債 総 額	92,656,829
純資産総額（ - ）	166,310,174,422
発 行 済 口 数	125,911,257,460 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.3209 （ 1万口当たり 13,209 ）

<参考>

「新興国株式インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	21,812,963,852
負 債 総 額	321,590,342
純資産総額（ - ）	21,491,373,510
発 行 済 口 数	12,029,903,660 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.7865 （ 1万口当たり 17,865 ）

<参考>

「日本債券インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	226,269,140,198
負 債 総 額	4,812,016,707
純資産総額（ - ）	221,457,123,491
発 行 済 口 数	183,415,768,177 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.2074 （ 1万口当たり 12,074 ）

<参考>

「外国債券インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書

平成25年2月28日現在
（単位：円）

資 産 総 額	174,676,202,626
負 債 総 額	90,960,287
純資産総額（ - ）	174,585,242,339
発 行 済 口 数	109,136,719,561 口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.5997 （ 1万口当たり 15,997 ）

< 参考 >

「新興国債券インデックスマザーファンド」の現況
純資産額計算書平成25年2月28日現在
(単位：円)

資 産 総 額	2,892,991,490
負 債 総 額	44,161,368
純資産総額 (-)	2,848,830,122
発 行 済 口 数	2,194,305,837 口
1 口当たり純資産価額 (/)	1.2983 (1 万口当たり 12,983)

< 参考 >

「東証ＲＥＩＴ指数マザーファンド」の現況
純資産額計算書平成25年2月28日現在
(単位：円)

資 産 総 額	3,481,277,603
負 債 総 額	57,294,954
純資産総額 (-)	3,423,982,649
発 行 済 口 数	1,998,922,275 口
1 口当たり純資産価額 (/)	1.7129 (1 万口当たり 17,129)

< 参考 >

「MUAM G - REITマザーファンド」の現況
純資産額計算書平成25年2月28日現在
(単位：円)

資 産 総 額	5,450,540,373
負 債 総 額	6,037,808
純資産総額 (-)	5,444,502,565
発 行 済 口 数	5,615,536,908 口
1 口当たり純資産価額 (/)	0.9695 (1 万口当たり 9,695)

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換

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

したがって、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）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（４）受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、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または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

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

（６）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（７）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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）資本金の額等

平成25年２月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近５年間に於ける資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング１

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング２

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（５名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱ＵＦＪ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は平成25年２月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

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）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25年２月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	408	6,534,457
追加型公社債投資信託	18	623,363
単位型株式投資信託	6	18,002
単位型公社債投資信託	3	82,958
合 計	435	7,258,781

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

（１）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪ投信株式会社（以下「当社」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条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度に係る中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)		第27期 (平成24年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	17,056,128	2	14,298,590
有価証券	2	10,000,000	2	8,000,000
前払費用		156,230		154,925
未収入金	2	19,641		13,813
未収委託者報酬		4,517,987		3,977,324
未収収益	2	63,656	2	42,563
繰延税金資産		429,080		339,052
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		28,070		27,621
流動資産合計		32,300,796		26,883,891
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	306,543	1	281,399
器具備品	1	184,985	1	177,757
土地		1,205,031		1,205,031
有形固定資産合計		1,696,560		1,664,188
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		909,905		881,368
ソフトウェア仮勘定		146,761		402,721
その他		68		24
無形固定資産合計		1,072,557		1,299,937
投資その他の資産				
投資有価証券		9,405,012		14,456,313
関係会社株式		431,812		320,136
長期性預金	2	7,000,000	2	8,500,000
長期差入保証金	2	797,041	2	837,456
長期前払費用		52		—
繰延税金資産		442,254		139,650
その他		15,035		15,035
投資その他の資産合計		18,091,208		24,268,591
固定資産合計		20,860,326		27,232,718
資産合計		53,161,123		54,116,609

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,528	79,079
未払金		
未払収益分配金	245,085	185,817
未払償還金	1,328,820	1,159,445
未払手数料	2 1,768,519	2 1,557,726
その他未払金	104,042	50,899
未払費用	2 1,240,586	2 1,174,572
未払消費税等	184,873	63,602
未払法人税等	2,228,870	1,532,874
賞与引当金	550,000	520,000
その他	227,518	278,521
流動負債合計	7,925,844	6,602,539
固定負債		
退職給付引当金	105,461	119,902
役員退職慰労引当金	76,024	49,735
時効後支払損引当金	196,123	195,228
固定負債合計	377,609	364,866
負債合計	8,303,454	6,967,405
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	222,096	222,096
資本剰余金合計	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計	42,243,903	44,203,921
株主資本合計	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券	391,537	723,054
評価差額金		
評価・換算差額等合計	391,537	723,054
純資産合計	44,857,668	47,149,203
負債純資産合計	53,161,123	54,116,609

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		48,411,622		47,476,170
投資顧問料		16,400		15,335
その他営業収益		236,596		153,305
営業収益合計		48,664,618		47,644,812
営業費用				
支払手数料	2	19,778,797	2	19,292,904
広告宣伝費		696,640		516,886
公告費		7,795		7,961
調査費				
調査費		895,558		909,999
委託調査費		8,991,373		9,975,300
事務委託費		243,109		306,137
営業雑経費				
通信費		98,144		90,066
印刷費		569,763		400,552
協会費		37,616		40,636
諸会費		6,248		7,593
事務機器関連費		880,509		958,507
その他営業雑経費		—		16,396
営業費用合計		32,205,558		32,522,943
一般管理費				
給料				
役員報酬		199,168		202,812
給料・手当		3,576,037		3,623,556
賞与引当金繰入		550,000		520,000
福利厚生費		492,032		520,897
交際費		23,412		26,743
旅費交通費		156,920		153,892
租税公課		108,850		102,255
不動産賃借料		655,939		698,539
退職給付費用		163,440		142,883
役員退職慰労引当金繰入		18,106		22,805
固定資産減価償却費		406,176		481,601
諸経費		369,603		247,162
一般管理費合計		6,719,689		6,743,148
営業利益		9,739,370		8,378,719

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	29,543	153,215
有価証券利息	2 11,040	2 8,160
受取利息	2 20,465	2 25,661
投資有価証券償還益	371,171	1,876
収益分配金等時効完成分	438,693	318,285
その他	8,257	7,856
営業外収益合計	879,170	515,056
営業外費用		
投資有価証券償還損	192,004	—
時効後支払損引当金繰入	666	15,288
事務過誤費	32,187	7,845
その他	7,757	82
営業外費用合計	232,615	23,216
経常利益	10,385,925	8,870,559
特別利益		
投資有価証券売却益	351,930	150,103
特別利益合計	351,930	150,103
特別損失		
投資有価証券売却損	127,114	153,276
関係会社株式売却損	—	13,563
投資有価証券評価損	—	1,925
過年度時効後支払損引当金繰入	204,138	—
固定資産除却損	1 3,431	1 17,034
資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額	37,264	—
その他	2,429	412
特別損失合計	374,378	186,212
税引前当期純利益	10,363,477	8,834,449
法人税、住民税及び事業税	4,027,373	3,510,046
法人税等調整額	25,800	175,067
法人税等合計	4,001,573	3,685,113
当期純利益	6,361,903	5,149,336

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,131	2,000,131
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	222,096	222,096
資本剰余金合計		
当期首残高	222,096	222,096
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	222,096	222,096
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	342,589	342,589
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	6,998,000	6,998,000
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	31,383,254	34,903,313
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	34,903,313	36,863,331
利益剰余金合計		
当期首残高	38,723,843	42,243,903
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	42,243,903	44,203,921
株主資本合計		
当期首残高	40,946,071	44,466,131
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
当期変動額合計	3,520,059	1,960,017
当期末残高	44,466,131	46,426,148
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	1,277,237	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	885,699	331,516
当期変動額合計	885,699	331,516
当期末残高	391,537	723,054
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	62,258	—

当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	62,258	—
当期変動額合計	62,258	—
当期末残高	—	—
評価・換算差額等合計		
当期首残高	1,214,979	391,537
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	823,441	331,516
当期末残高	391,537	723,054
純資産合計		
当期首残高	42,161,050	44,857,668
当期変動額		
剰余金の配当	2,841,844	3,189,318
当期純利益	6,361,903	5,149,336
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	823,441	331,516
当期変動額合計	2,696,617	2,291,534
当期末残高	44,857,668	47,149,203

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額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)によっております。

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
建物	181,085千円	208,976千円
器具備品	227,109千円	294,294千円

2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
預金	13,335,700千円	11,773,728千円
有価証券	10,000,000千円	8,000,000千円
未収入金	1,500千円	-
未収収益	63,656千円	42,563千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
長期性預金	7,000,000千円	8,500,000千円
長期差入保証金	788,590千円	828,908千円
未払手数料	986,786千円	851,491千円
未払費用	134,713千円	135,926千円

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
器具備品	3,431千円	1,144千円
ソフトウェア	-	15,890千円
計	3,431千円	17,034千円

2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
支払手数料	11,685,424千円	10,760,427千円
有価証券利息	8,718千円	6,532千円
受取利息	20,465千円	25,661千円

（株主資本等変動計算書関係）

第26期（自平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成22年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,841,844千円
1株当たり配当額	22,900円
基準日	平成22年3月31日
効力発生日	平成22年7月1日

(2) 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23年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	3,189,318千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30日

第27期（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

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成23年6月30日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	3,189,318千円
1株当たり配当額	25,700円
基準日	平成23年3月31日
効力発生日	平成23年6月30日

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

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

（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

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

第26期（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	17,056,128	17,056,128	-
(2) 有価証券	10,000,000	10,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	4,517,987	4,517,987	-
(4) 長期性預金	7,000,000	7,010,576	10,576
(5) 投資有価証券	9,140,755	9,140,755	-
資産計	47,714,871	47,725,447	10,576
(1) 未払手数料	1,768,519	1,768,519	-
(2) 未払法人税等	2,228,870	2,228,870	-
負債計	3,997,389	3,997,389	-

第27期（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	14,298,590	14,298,590	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,977,324	3,977,324	-
(4) 長期性預金	8,500,000	8,509,886	9,886
(5) 投資有価証券	14,417,413	14,417,413	-
資産計	49,193,328	49,203,214	9,886
(1) 未払手数料	1,557,726	1,557,726	-
(2) 未払法人税等	1,532,874	1,532,874	-
負債計	3,090,600	3,090,600	-

（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

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 有価証券、(3) 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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4) 長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5) 投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

(注２) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
非上場株式	264,257	38,900
子会社株式	431,812	160,600
関連会社株式	-	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注３) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第26期（平成23年3月31日現在）

(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	17,056,128	-	-	-
未収委託者報酬	4,517,987	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	10,000,000	-	-	-
投資信託	-	2,032,211	1,152,101	-
長期性預金	-	7,000,000	-	-
合計	31,574,115	9,032,211	1,152,101	-

第27期（平成24年3月31日現在）

(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	14,298,590	-	-	-
未収委託者報酬	3,977,324	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
譲渡性預金	8,000,000	-	-	-
投資信託	-	3,168,056	4,412,092	2,183,060
長期性預金	-	8,500,000	-	-
合計	26,275,914	11,668,056	4,412,092	2,183,060

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式431,812千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第26期（平成23年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	4,026,733	3,476,499	550,234
	小 計	4,026,733	3,476,499	550,234
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,114,022	5,236,164	122,142
	小 計	5,114,022	5,236,164	122,142
合 計		9,140,755	8,712,663	428,091

第27期（平成24年3月31日現在）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,092,127	9,993,766	1,098,361
	小 計	11,092,127	9,993,766	1,098,361
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	3,325,285	3,446,474	121,188
	小 計	3,325,285	3,446,474	121,188
合 計		14,417,413	13,440,240	977,173

3. 売却したその他有価証券

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,283,999	392,809	127,114
合 計	4,283,999	392,809	127,114

第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額(千円)	売却益の合計額(千円)	売却損の合計額(千円)
株式	158,639	-	64,792
債券	-	-	-
その他	3,036,630	150,103	88,484
合 計	3,195,269	150,103	153,276

（デリバティブ取引関係）
重要な取引はありません。

（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、従業員に対して確定拠出年金制度、退職一時金制度及び確定給付年金制度を設けております。なお、平成23年10月に適格退職年金制度を廃止し、確定給付年金制度へ移行しました。

2. 退職給付債務に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
(1)退職給付債務	567,377	475,564
(2)年金資産	309,065	198,994
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	258,311	276,569
(4)未認識数理計算上の差異	152,850	156,666
(5)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)	105,461	119,902
(6)退職給付引当金	105,461	119,902

3. 退職給付費用に関する事項

(単位：千円)

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
(1)勤務費用	28,585	27,806
(2)利息費用	9,774	8,420
(3)期待運用収益	6,248	4,635
(4)数理計算上の差異の費用処理額	37,969	13,599
(5)退職給付費用	70,080	45,191
(6)その他	93,360	97,692
(7)合計	163,440	142,883

（注）「(6)その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

（１）退職給付見込額の期間配分方法
期間定額基準

（２）割引率

第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
1.5%	1.5%

（３）期待運用収益率

第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
1.5%	1.5%

（４）数理計算上の差異の処理年数

8年（各事業年度の発生時における従業員の平均支払期間以内の一定の年数による定額法により、翌事業年度より費用処理しております。）

（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

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	651,260 千円	557,868 千円
投資有価証券評価損	408,754	362,665
ゴルフ会員権評価損	9,710	8,505
未払事業税	172,269	109,608
賞与引当金	223,795	197,652
役員退職慰労引当金	30,934	17,725
退職給付引当金	42,912	42,783
減価償却超過額	39,127	19,890
委託者報酬	92,577	99,265
長期差入保証金	20,080	21,895
時効後支払損引当金	79,802	69,579
その他	34,708	39,304
繰延税金資産 小計	1,805,934	1,546,744
評価性引当額	898,045	813,923
繰延税金資産 合計	907,888	732,821
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	36,553	254,118
繰延税金負債 合計	36,553	254,118
繰延税金資産(負債)の純額	871,334	478,702

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第26期 (平成23年3月31日現在)	第27期 (平成24年3月31日現在)
法定実効税率	40.7 %	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担税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。
（調整）		
投資有価証券評価損認容	2.9	
その他	0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	38.6	

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引き下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は39,177千円減少し、法人税等調整額が75,184千円、その他有価証券評価差額金が36,007千円、それぞれ増加しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）及び第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
当社は、資産運用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26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）及び第27期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、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

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[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

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
主要株主	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 30.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,481,369 千円	未払手数料	294,093 千円
						事務所の賃借	事務所賃借料	631,409 千円	長期差入保証金	783,794 千円
						投資の助言	投資助言料	189,915 千円	未払費用	88,454 千円
主要株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,204,055 千円	未払手数料	692,693 千円
						取引銀行	譲渡性預金の預入	41,000,000 千円	有価証券	10,000,000 千円
							譲渡性預金に係る受取利息	8,718 千円	未収利息	675 千円
							マルチコーラブル預金の預入	9,000,000 千円	現金及び預金	6,000,000 千円
									長期性預金	7,000,000 千円
							マルチコーラブル預金に係る受取利息	18,499 千円	未収利息	3,069 千円

第27期（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	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	--------	-----	-----	-------	------------------------	---------------	-------	------	----	------

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 50.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	4,404,897 千円	未払手数料	285,119 千円
						事務所の賃借	事務所賃借 料	667,780 千円	長期差入保 証金	812,027 千円
						投資の助言	投資助言料	168,292 千円	未払費用	81,330 千円
							株式の売却	98,112 千円		
主要株主	(株)三菱東京 UFJ銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 25.0%	当社投資信託の募 集の取扱及び投資 信託に係る事務代 行の委託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払	6,371,303 千円	未払手数料	566,371 千円
						取引銀行	譲渡性預金 の預入	36,000,000 千円	有価証券	8,000,000 千円
							譲渡性預金 に係る受取 利息	6,532 千円	未収利息	544 千円
							マルチコー ラブル預金 の預入	7,000,000 千円	現金及び 預金	5,500,000 千円
									長期性預金	8,500,000 千円
						マルチコー ラブル預金 に係る受取 利息		24,415 千円	未収利息	2,886 千円

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

事務所敷金及び賃借料については、市場実勢等を勘案して決定しております。

投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。

売却価額については、第三者機関による企業価値評価をもとに決定しております。

預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は3ヶ月～3年であります。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等
第26期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	3,000 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	4,447,569 千円	未払手数料	408,084 千円

第27期（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	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	3,914,481 千円	未払手数料	285,874 千円

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
１株当たり純資産額	361,469.71円	379,935.23円
１株当たり当期純利益金額	51,265.16円	41,494.11円

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益金額（千円）	6,361,903	5,149,336
普通株主に帰属しない金額（千円）	-	-
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	6,361,903	5,149,336
期中平均株式数（株）	124,098	124,098

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表
(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)		
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		16,996,643
有価証券		8,000,000
前払費用		336,791
未収入金		221,616
未収委託者報酬		3,698,009
未収収益		39,360
繰延税金資産		374,925
金銭の信託		30,000
その他		27,966
流動資産合計		29,725,313
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	269,044
器具備品	1	174,256
土地		1,205,031
有形固定資産合計		1,648,332
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		874,592
ソフトウェア仮勘定		414,462
その他		9
無形固定資産合計		1,304,887
投資その他の資産		
投資有価証券		13,875,312
関係会社株式		320,136
長期性預金		5,500,000
長期差入保証金		831,857
繰延税金資産		297,670
その他		15,035
投資その他の資産合計		20,840,011
固定資産合計		23,793,231
資産合計		53,518,545

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金	66,078
未払金	
未払収益分配金	33,785
未払償還金	1,070,895
未払手数料	1,435,205
その他未払金	72,465
未払費用	1,101,885
未払消費税等	2 104,706
未払法人税等	1,639,933
賞与引当金	561,000
その他	314,314
流動負債合計	6,400,270

固定負債

退職給付引当金	120,928
役員退職慰労引当金	53,934
時効後支払損引当金	197,702
固定負債合計	372,564
負債合計	6,772,834

(純資産の部)

株主資本

資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	222,096
資本剰余金合計	222,096

利益剰余金

利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	36,823,991
利益剰余金合計	44,164,581
株主資本合計	46,386,809

評価・換算差額等

その他有価証券	358,901
評価差額金	
評価・換算差額等合計	358,901

純資産合計	46,745,710
-------	------------

負債純資産合計	53,518,545
---------	------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	22,860,446
投資顧問料	5,548
その他営業収益	64,404
営業収益合計	22,930,399
営業費用	
支払手数料	9,329,547
広告宣伝費	253,610
公告費	1,748
調査費	
調査費	465,037
委託調査費	4,927,785
事務委託費	118,017
営業雑経費	
通信費	44,970
印刷費	216,082
協会費	19,981
諸会費	3,788
事務機器関連費	479,500
その他営業雑経費	8,157
営業費用合計	15,868,227
一般管理費	
給料	
役員報酬	97,198
給料・手当	1,581,710
賞与引当金繰入	561,000
福利厚生費	296,584
交際費	11,132
旅費交通費	66,127
租税公課	57,963
不動産賃借料	349,740
退職給付費用	80,723
役員退職慰労引当金繰入	7,838
固定資産減価償却費	1 223,128
諸経費	135,324
一般管理費合計	3,468,471
営業利益	3,593,700

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	104,164
有価証券利息	3,543
受取利息	12,662
収益分配金等時効完成分	328,544
その他	1,102
営業外収益合計	450,017
営業外費用	
投資有価証券償還損	8,428
時効後支払損引当金繰入	6,591
その他	46
営業外費用合計	15,067
経常利益	4,028,650
特別利益	
投資有価証券売却益	141,172
特別利益合計	141,172
特別損失	
投資有価証券売却損	32,155
特別損失合計	32,155
税引前中間純利益	4,137,667
法人税、住民税及び事業税	1,626,136
法人税等調整額	30,367
法人税等合計	1,595,768
中間純利益	2,541,898

(3)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24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,131
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	—
当中間期末残高	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	—
当中間期末残高	222,096
資本剰余金合計	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	—
当中間期末残高	222,096
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	342,589
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	—
当中間期末残高	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	6,998,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	—
当中間期末残高	6,998,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	36,863,331
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	36,823,991
利益剰余金合計	
当期首残高	44,203,921
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	44,164,581
株主資本合計	
当期首残高	46,426,148
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	46,386,809
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	723,054
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)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
評価・換算差額等合計	
当期首残高	723,054

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)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
純資産合計	
当期首残高	47,149,203
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	403,492
当中間期末残高	46,745,710

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(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)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、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。

数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数（8年）による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 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

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

[会計方針の変更]

第28期中間会計期間
(自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30日)

(減価償却方法の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)	
建物	221,331千円
器具備品	322,980千円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
有形固定資産	41,040千円
無形固定資産	182,088千円

(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24年4月1日至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

(金融商品関係)

第28期中間会計期間(平成24年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計 上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	16,996,643	16,996,643	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,698,009	3,698,009	-
(4) 長期性預金	5,500,000	5,506,492	6,492
(5) 投資有価証券	13,875,312	13,875,312	-
資産計	48,069,965	48,076,457	6,492
(1) 未払手数料	1,435,205	1,435,205	-
(2) 未払法人税等	1,639,933	1,639,933	-
負債計	3,075,139	3,075,139	-

（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

資 産

(1)現金及び預金、(2)有価証券、(3)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。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4)長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5)投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注３）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,899,973	6,184,088	715,884
	小 計	6,899,973	6,184,088	715,884
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,936,438	7,202,827	266,389
	小 計	6,936,438	7,202,827	266,389
合 計		13,836,412	13,386,916	449,495

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

重要な取引はありません。

（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24年4月1日 至 平成24年9月30日）

当社は、資産運用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24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客へ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

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[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。

（１株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)
1株当たり純資産額	376,683.83円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	46,745,710
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	46,745,710
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	124,098

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	20,482.99円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株式の期中平均株式数(株)	124,098

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

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。

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

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

通常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

において同じ。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の特別決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）

資本金の額：324,279百万円（平成24年９月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

名称	資本金の額 (平成24年９月末現在)	事業の内容
株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
株式会社ジャパンネット銀行	37,250 百万円	銀行業務を営んでいます。
三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
カブドットコム証券株式会社	7,196 百万円	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ＳＢＩ証券	47,937 百万円	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 百万円	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 百万円	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。
野村證券株式会社	10,000 百万円	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。
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

（２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

３【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成25年２月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の50.0%（62,050株）、株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行は25.0%（31,023株）を所有しています。

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

第３【参考情報】

当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成24年10月25日	半期報告書、有価証券届出書
平成24年 9 月14日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年 8 月 1 日	有価証券届出書の訂正届出書
平成24年 4 月25日	有価証券報告書、有価証券届出書の訂正届出書
平成24年 3 月 1 日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成25年3月6日

三菱ＵＦＪ投信株式会社 取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

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eMAXIS バランス（波乗り型）の平成24年1月27日から平成25年1月28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、eMAXIS バランス（波乗り型）の平成25年1月28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

三菱ＵＦＪ投信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

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成２４年６月２６日

三菱ＵＦＪ投信株式会社

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

長島 拓也 印

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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ投信株式会社の平成２３年４月１日から平成２４年３月３１日までの第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、三菱ＵＦＪ投信株式会社の平成２４年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成２４年１２月６日

三菱ＵＦＪ投信株式会社

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

長島 拓也

印

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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪ投信株式会社の平成２４年４月１日から平成２５年３月３１日までの第２８期事業年度の中間会計期間（平成２４年４月１日から平成２４年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱ＵＦＪ投信株式会社の平成２４年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成２４年４月１日から平成２４年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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、その原本は委託会社が別途保管しております。

[前へ](#)