

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年9月11日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	上限 10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）

（以下「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（５）【申込手数料】

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

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

（６）【申込単位】

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

（７）【申込期間】

平成24年9月12日から平成25年9月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前 9 時から午後 5 時までとします。)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込みの方法

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）専用ファンドです。

受益権の取得申込みの受付の中止等

金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第 28 条第 8 項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

スイッチング

当ファンドはスイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

基本的性格

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式 債 券
	海 外	不動産投信
追 加 型	内 外	その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
--------	------	--------	------	-------

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類及び属性区分に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、これ以外の用語の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ<http://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

商品分類

「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

「内外」...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「資産複合」...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分

「その他資産(投資信託証券)」...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

「資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分固定型」...目論見書又は投資信託約款において、複数資産(株式、債券、不動産投信)を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨

の記載があるものをいいます。

当ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて複数資産（株式、債券、不動産投信）に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「資産複合」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産（投資信託証券）」となっています。

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

「グローバル（日本を含む）」…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を含みます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「ファミリーファンド」…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。

「なし」…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

ファンドの特色

● 国内外の株式・債券・不動産投資信託証券へ分散投資します。

日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド、Jリートマザーファンド(M)及び海外リートマザーファンド(以下これらを「マザーファンド」といいます。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式・債券・不動産投資信託証券(以下これらを「各資産」といいます。)へ分散投資します。

Jリートマザーファンド(M)^{*}を除く各マザーファンドは、各資産の代表的な指数と連動する投資成果を目指すインデックス運用を行います。

^{*}Jリートマザーファンド(M)はJリートを代表する指数を上回る投資成果を目指すアクティブ運用を行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則為替ヘッジを行いません。

<投資対象とするマザーファンド>

○各資産の代表的な指数への連動を目指すインデックスファンドを中心に構成します。

国内株式	日本株式マザーファンド	[TOPIX] (東証株価指数、配当込み)に連動する投資成果を目標とします。
国内債券	日本債券マザーファンド	[NOMURA-BPI総合]に連動する投資成果を目標とします。
国内リート	Jリートマザーファンド(M)	[東証REIT指数(配当込み)]を上回る投資成果を目標とします。
海外株式	外国株式マザーファンド	[MSCIコクサイ指数(円ベース)]に連動する投資成果を目標とします。
海外債券	外国債券マザーファンド	[シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし円ベース)]に連動する投資成果を目標とします。
海外リート	海外リートマザーファンド	[S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)]に連動する投資成果を目標とします。

^{*}各マザーファンドの運用に際しては、三井住友信託銀行の運用部門から投資助言を受け活用します。

◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

日本株式マザーファンド「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」

TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所(以下「東証」といいます。)が算出、公表する、東証市場第一部の全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利及びTOPIXの商標に関する全ての権利は東証が有しています。東証は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。東証は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

日本債券マザーファンド「NOMURA-BPI総合」

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、「日本債券マザーファンド」の運用成果に関し、一切責任はありません。

Jリートマザーファンド(M)「東証REIT指数(配当込み)」

東証REIT指数は、東証市場に上場するREIT全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。

東証REIT指数は、東証の知的財産であり、これらの指数の算出、数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は東証が有しています。東証REIT指数の算出において、電子計算機の障害又は天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、その算出を延期又は中止することがあります。また、東証は、東証REIT指数がいかなる場合においても真正であることを保証するものではなく、同指数の算出において、数値に誤謬が発生しても、東証は一切その賠償の責めを負いません。

外国株式マザーファンド「MSCIコクサイ指数(円ベース)」

MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

外国債券マザーファンド「シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。

海外リートマザーファンド「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)」

S&P先進国REIT指数は、S&P(スタンダード・アンド・プアーズ社)が公表する指数で、世界主要国に上場するリート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ています。

S&P先進国REIT指数の所有権及びその他一切の権利は、S&Pが有しています。S&Pは、同指数等の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(2) 【ファンドの沿革】

平成19年8月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンド、中央三井Jリートマザーファンドの名称をJリートマザーファンド(M)に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

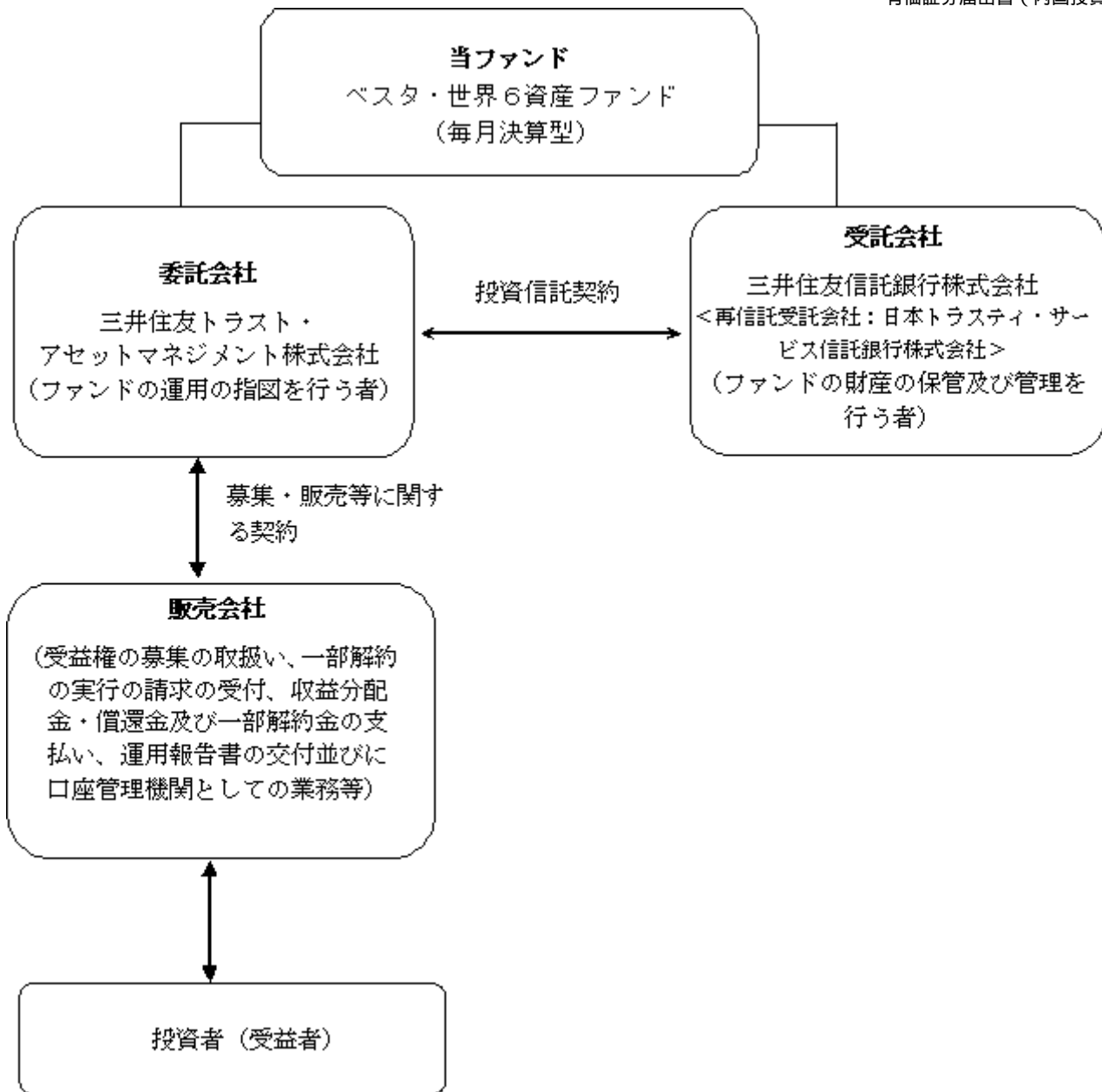
ファミリーファンド方式()で運用します。

ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンド(ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型))とし、その資金をマザーファンド(日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザー

ファンド、Jリートマザーファンド（M）及び海外リートマザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



当ファンドの関係法人



委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年6月29日現在）

B．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和62年2月20日：投資顧問業の登録

昭和62年9月9日：投資一任契約に係る業務の認可

平成2年10月1日：住信投資顧問株式会社に商号変更

平成11年2月15日：住信アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成11年3月25日：証券投資信託委託業の認可

平成19年9月30日：金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

平成24年4月1日：中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

C．大株主の状況（平成24年6月29日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

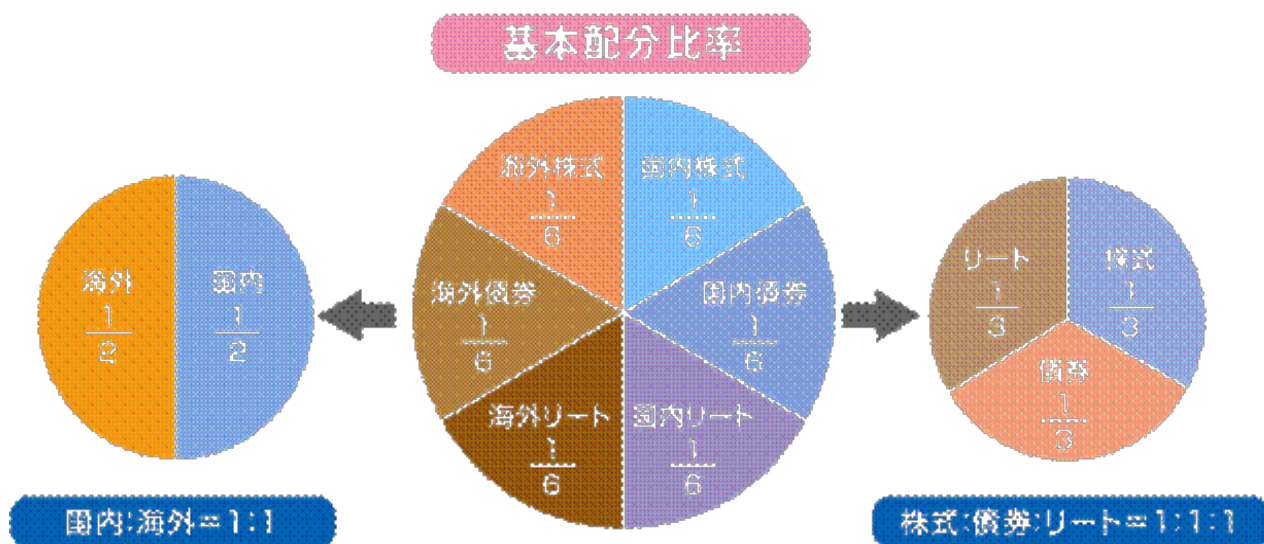
当ファンドは、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

投資対象

日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド、Jリートマザーファンド（M）及び海外リートマザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

投資態度

- A．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式・債券・不動産投資信託証券（以下これらを「各資産」といいます。）へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、6つの資産への均等配分を基本とします。



- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。
- E．信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

- H. 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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。
- I. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記(5) I.、J.及びK.に定めるものに限り、後記(5) I.、J.及びK.に定めるものに限り、後記(5) I.、J.及びK.に定めるものをいいます。)
 3. 金銭債権(上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。)
 4. 約束手形(上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。)
- B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド(M)」及び「海外リートマザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券(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。)に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
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. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券(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. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1.から11.までの証券又は証券の性質を有するもの
13. 投資信託又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、振替受益権を含みます。)
14. 投資証券又は外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

15. 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。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17. 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。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。）
20. 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。）
21. 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
22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1.の証券又は証書並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記1.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記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、上記13.の証券及び上記14.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

- A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、取得時において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、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において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及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

M S C I コクサイ指数に採用されている国の株式に投資を行い、同指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うこ

とができます。

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、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及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「外国債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において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には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「Jリートマザーファンド（M）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資します。なお、不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

東証REIT指数（配当込み）を上回る投資成果を目標として運用を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

3. 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

「海外リートマザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

海外の金融商品取引所等上場（1）の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます）

す。)

(2) を主要投資対象とします。

1 : 上場に準ずるものを含みます。

2 : 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。

(2) 投資態度

主として、REITへの投資を通じて、ベンチマークであるS & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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。

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

3 . 投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、ベンチマークにおける時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、ベンチマークとの連動性を維持するために、当該REITをベンチマークの構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

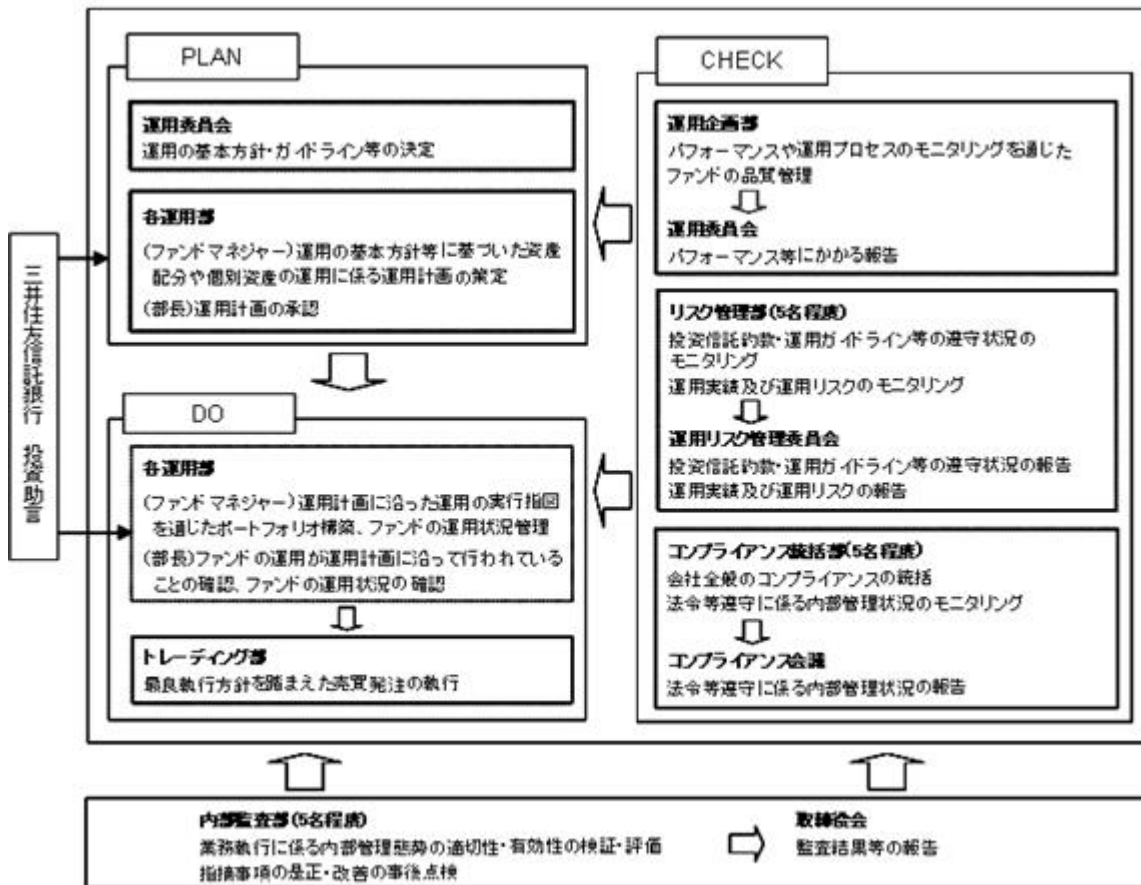
外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

株式への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成24年9月11日現在のものであり、今後変更されることがあります。

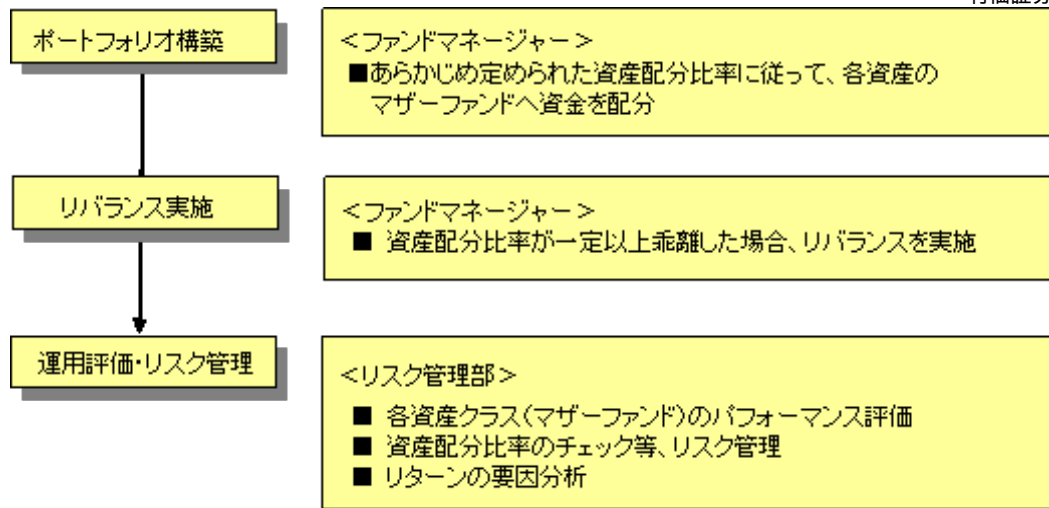


委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

< ポートフォリオ構築プロセス >

- ・当ファンドはファンドマネージャーが基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、当該配分比率が値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。また、運用評価・リスク管理についてはリスク管理部が行います。



(4) 【分配方針】

分配方針

毎決算時（原則として毎月10日ですが、第1計算期間のみ異なります。ただし当日が休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A. 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B. 分配金額については、安定した分配を継続的に行うことを目指して、上記A.の範囲内で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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C. 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
- D. 第1計算期は無分配とし、第2計算期から分配を開始します。

分配収益の計算

- A. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - イ. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、監査費用、当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - ロ. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補った後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- 八. 収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
 - 二. 「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額（ただし、後記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に規定する手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を除きます。以下本項において同じ。）と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、上記八.に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど

当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

B. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

A. 支払時期と場所

イ. 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に対する支払いを開始します。

ロ. 収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B. 時効

受益者が、上記A.イ.に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

（参考）

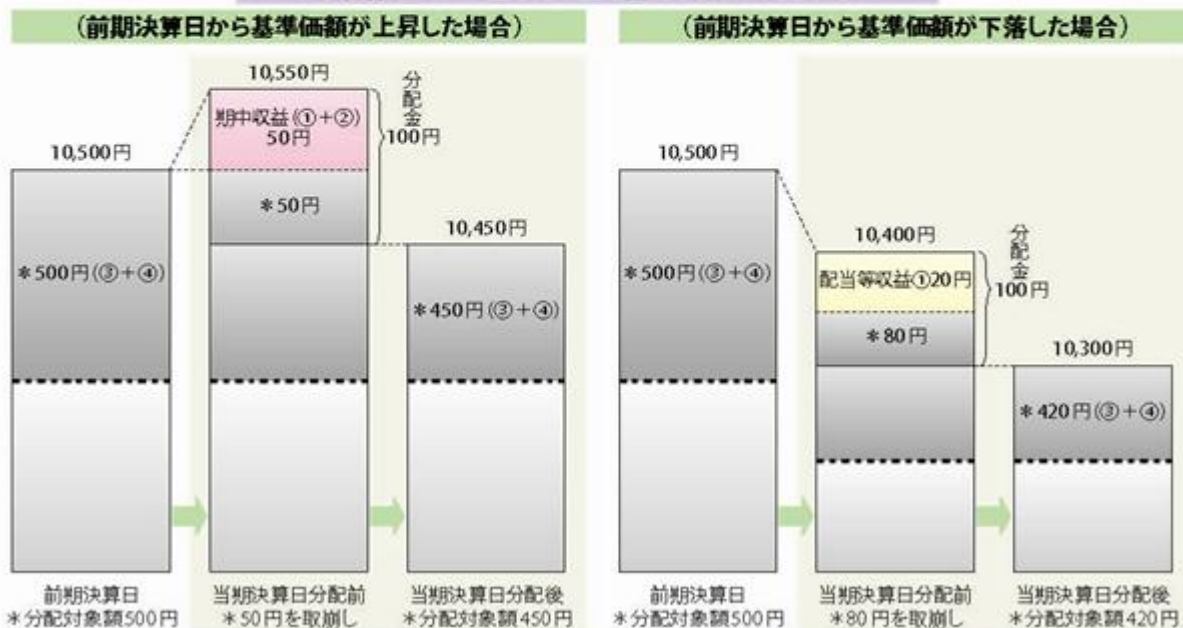
[収益分配金に関する留意事項]

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



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



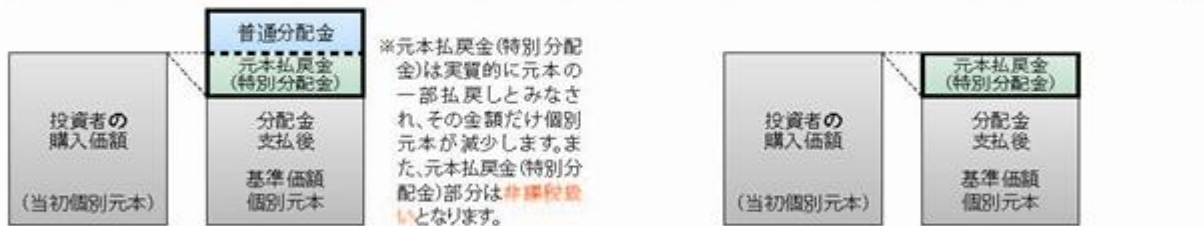
（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

● 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。
 ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、後掲「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご覧ください。

（5）【投資制限】

約款に定める投資制限

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の50%以下とします。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

C．新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D．同一銘柄の株式への投資制限

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

E．同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

F．同一銘柄の転換社債等への投資制限

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

G．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

H．信用取引の運用指図

イ．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、株券の引渡し又は買戻

しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉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。
- I．先物取引等の運用指図
- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- J．スワップ取引の運用指図
- イ．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、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、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。
- ハ．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。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- K．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．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、金利先渡取引及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。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、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。
- ハ．金利先渡取引及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。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．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及び公社債を次のa．及びb．の範囲内で貸付けを行うことの指図をすることができます。
- a．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。
- b．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。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定め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。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

M．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．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公社債又は、下記N．の規定により借入れた公社債を売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、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債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。

N．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債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入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

O．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、制約されることがあります。

P．外国為替予約取引の指図

イ．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。

ロ．上記イ．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うち信託財産に属するとみなした額（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をいいます。）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。

ハ．上記ロ．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。

Q．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

R．再投資の指図

委託会社は、上記Q．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

S．資金の借入れ

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）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。
- ロ．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の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｔ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ｕ．受託会社の自己又は利害関係人等との取引
- イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（２）に定める資産への投資等を行うことができます。
- ロ．上記イ．の取扱いは、上記Ｈ．からＮ．まで、及びＰ．からＲ．までにおける委託会社の指図による取引についても同様とします。

関連法令に基づく投資制限

A．デリバティブ取引に係る投資制限

（金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

B．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

為替変動リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

上記の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「第2 管理及び運営 1 申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.987%（税抜 0.94%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1575%	（税抜 0.15%）
販売会社	年率 0.7875%	（税抜 0.75%）
受託会社	年率 0.042%	（税抜 0.04%）

信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用、組入資産の保管に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等は、受益者の負担とし、取引のつど信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

A．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%、住民税3%）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

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

B．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記A．の表の通りです。

C．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

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

個別元本について

- A．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B．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。
- C．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- D．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があ

ります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

上記は、平成24年6月29日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下の記載事項は、平成24年6月29日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類		国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託 受益証券	日本株式マザーファンド	日本	171,515,355	15.48
	日本債券マザーファンド	日本	187,553,155	16.93
	外国株式マザーファンド	日本	181,499,582	16.38
	外国債券マザーファンド	日本	183,725,206	16.58
	Jリートマザーファンド(M)	日本	190,988,483	17.24
	海外リートマザーファンド	日本	193,225,257	17.44
	親投資信託受益証券合計			1,108,507,038
その他の資産(負債控除後)			540,389	0.05
合計(純資産総額)			1,107,966,649	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。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

(日本株式マザーファンド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	238,957,958,320	97.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,095,799,726	2.49
合計(純資産総額)		245,053,758,046	100.00

(日本債券マザーファンド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
公社債	日本	349,886,712,618	98.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,188,430,101	1.18
合計(純資産総額)		354,075,142,719	100.00

(外国株式マザーファンド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	136,578,065,559	54.22
	イギリス	24,552,372,026	9.75
	カナダ	12,896,506,633	5.12
	スイス	10,167,115,044	4.04
	フランス	8,850,760,677	3.51
	その他	43,462,283,959	17.25
	小計	236,507,103,898	93.89
投資信託受益証券	オーストラリア	95,682,937	0.04
	シンガポール	44,428,668	0.02
	小計	140,111,605	0.06

投資証券	アメリカ	3,770,195,687	1.50
	オーストラリア	715,679,973	0.28
	その他	862,398,760	0.34
	小計	5,348,274,420	2.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,893,128,908	3.93
合計（純資産総額）		251,888,618,831	100.00

（外国債券マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	167,153,794,640	42.49
	フランス	36,515,878,377	9.28
	ドイツ	34,804,354,145	8.85
	イタリア	32,272,240,359	8.20
	イギリス	31,305,174,624	7.96
	その他	81,304,551,986	20.67
	小計	383,355,994,131	97.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,010,229,470	2.54
合計（純資産総額）		393,366,223,601	100.00

（Jリートマザーファンド（M））

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	14,476,696,850	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		448,275,973	3.00
合計（純資産総額）		14,924,972,823	100.00

（海外リートマザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	583,134,688	64.73
	オーストラリア	98,784,232	10.97
	イギリス	49,129,432	5.45
	フランス	39,440,951	4.38
	シンガポール	30,821,695	3.42
	その他	65,294,723	7.25
	小計	866,605,721	96.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,255,355	3.80
合計（純資産総額）		900,861,076	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】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（％）
			単価	金額	単価	金額	

親投資信託 受益証券	日本株式 マザーファンド	242,802,032	0.6691	162,458,840	0.7064	171,515,355	15.48
	日本債券 マザーファンド	154,339,331	1.2137	187,321,647	1.2152	187,553,155	16.93
	外国株式 マザーファンド	195,181,829	0.9314	181,792,356	0.9299	181,499,582	16.38
	外国債券 マザーファンド	121,938,811	1.5293	186,481,024	1.5067	183,725,206	16.58
	Jリート マザーファンド(M)	171,490,063	1.0446	179,138,520	1.1137	190,988,483	17.24
	海外リート マザーファンド	340,605,073	0.5631	191,794,717	0.5673	193,225,257	17.44

(注) 投資比率とは、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をいいます。

【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>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

(日本株式マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,945,900	2,730.83	8,044,755,500	3,190.00	9,397,421,000	3.83
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,974,700	355.03	6,026,581,600	378.00	6,416,436,600	2.62
3	本田技研工業	輸送用機器	1,916,700	2,670.07	5,117,738,900	2,749.00	5,269,008,300	2.15
4	キヤノン	電気機器	1,411,200	3,383.09	4,774,225,500	3,165.00	4,466,448,000	1.82
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,702,500	2,397.93	4,082,488,200	2,612.00	4,446,930,000	1.81
6	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	28,841,200	117.16	3,379,250,724	134.00	3,864,720,800	1.58
7	日本電信電話	情報・通信業	1,032,600	3,825.03	3,949,733,000	3,700.00	3,820,620,000	1.56
8	武田薬品工業	医薬品	891,200	3,249.30	2,895,782,000	3,615.00	3,221,688,000	1.31
9	ファナック	電気機器	236,500	12,956.07	3,064,112,000	12,950.00	3,062,675,000	1.25
10	ソフトバンク	情報・通信業	1,015,800	2,250.93	2,286,501,200	2,953.00	2,999,657,400	1.22
11	日本たばこ産業	食料品	1,128,600	1,911.68	2,157,532,000	2,361.00	2,664,624,600	1.09
12	三菱商事	卸売業	1,632,900	1,693.21	2,764,857,800	1,596.00	2,606,108,400	1.06
13	日立製作所	電気機器	5,234,000	433.00	2,266,343,323	487.00	2,548,958,000	1.04
14	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,474	137,651.94	2,542,982,100	132,700.00	2,451,499,800	1.00
15	三井物産	卸売業	1,935,400	1,262.59	2,443,619,400	1,174.00	2,272,159,600	0.93
16	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	937,900	2,121.86	1,990,096,800	2,397.00	2,248,146,300	0.92
17	三菱地所	不動産業	1,569,000	1,276.94	2,003,524,000	1,418.00	2,224,842,000	0.91

18	日産自動車	輸送用機器	2,890,400	717.74	2,074,558,926	748.00	2,162,019,200	0.88
19	小松製作所	機械	1,109,600	2,086.57	2,315,259,600	1,878.00	2,083,828,800	0.85
20	東日本旅客鉄道	陸運業	395,000	4,672.74	1,845,735,000	5,000.00	1,975,000,000	0.81
21	信越化学工業	化学	426,700	3,974.88	1,696,081,500	4,360.00	1,860,412,000	0.76
22	アステラス製薬	医薬品	528,200	3,021.57	1,595,995,000	3,465.00	1,830,213,000	0.75
23	KDDI	情報・通信業	3,480	482,827.15	1,680,238,500	513,000.00	1,785,240,000	0.73
24	東京海上ホールディングス	保険業	851,300	1,859.05	1,582,615,700	1,986.00	1,690,681,800	0.69
25	パナソニック	電気機器	2,595,600	641.66	1,665,504,000	643.00	1,668,970,800	0.68
26	ソニー	電気機器	1,417,300	1,410.82	1,999,561,900	1,123.00	1,591,627,900	0.65
27	三井不動産	不動産業	995,000	1,288.42	1,281,985,000	1,530.00	1,522,350,000	0.62
28	デンソー	輸送用機器	561,300	2,198.25	1,233,878,600	2,693.00	1,511,580,900	0.62
29	三菱電機	電気機器	2,272,000	766.38	1,741,232,000	660.00	1,499,520,000	0.61
30	伊藤忠商事	卸売業	1,788,800	806.09	1,441,936,000	832.00	1,488,281,600	0.61
合計			85,259,254		81,944,705,773		86,651,669,800	35.36

(注1) 投資比率とは、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をいいます。

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て株式です。

B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.64
	建設業	2.45
	食料品	3.85
	繊維製品	0.89
	パルプ・紙	0.32
	化学	5.64
	医薬品	5.06
	石油・石炭製品	0.75
	ゴム製品	0.78
	ガラス・土石製品	0.98
	鉄鋼	1.62
	非鉄金属	1.09
	金属製品	0.70
	機械	4.79
	電気機器	12.52
	輸送用機器	10.28
	精密機器	1.43
	その他製品	1.45
	電気・ガス業	2.81
	陸運業	4.03
	海運業	0.37
	空運業	0.28
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	6.52
	卸売業	5.43
	小売業	4.26
	銀行業	9.58
	証券、商品先物取引業	1.07
	保険業	2.23
	その他金融業	0.84
不動産業	2.60	
サービス業	1.94	
合計	97.51	

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率をいいます。

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

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 買建 TOPIX先物取引	日本	788	5,726,918,250	6,059,720,000	2.47

（注1）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。

（注2）株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しております。

（日本債券マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額 (円)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券(5年)第87回	0.5	2014/12/20	4,400,000,000	100.92	4,440,506,000	100.98	4,443,252,000	1.25
2	利付国庫債券(10年)第285回	1.7	2017/3/20	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	107.05	3,639,768,000	1.03
3	利付国庫債券(2年)第313回	0.1	2014/2/15	3,500,000,000	99.98	3,499,580,000	100.00	3,500,000,000	0.99
4	利付国庫債券(10年)第312回	1.2	2020/12/20	3,200,000,000	102.85	3,291,200,000	104.58	3,346,592,000	0.95
5	利付国庫債券(10年)第284回	1.7	2016/12/20	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.78	3,150,039,500	0.89
6	利付国庫債券(10年)第305回	1.3	2019/12/20	2,900,000,000	104.49	3,030,312,000	105.87	3,070,259,000	0.87
7	利付国庫債券(10年)第321回	1.0	2022/3/20	3,000,000,000	100.45	3,013,798,000	101.75	3,052,680,000	0.86
8	利付国庫債券(5年)第88回	0.5	2015/3/20	2,900,000,000	100.93	2,926,981,000	101.08	2,931,349,000	0.83
9	利付国庫債券(5年)第103回	0.3	2017/3/20	2,900,000,000	100.03	2,900,996,000	100.49	2,914,210,000	0.82
10	利付国庫債券(10年)第315回	1.2	2021/6/20	2,600,000,000	102.33	2,660,658,000	104.21	2,709,642,000	0.77
11	利付国庫債券(10年)第288回	1.7	2017/9/20	2,500,000,000	107.09	2,677,250,000	107.60	2,690,100,000	0.76
12	利付国庫債券(2年)第309回	0.1	2013/10/15	2,600,000,000	99.96	2,598,960,000	100.00	2,600,000,000	0.73
13	利付国庫債券(10年)第296回	1.5	2018/9/20	2,400,000,000	106.44	2,554,782,000	107.09	2,570,256,000	0.73
14	利付国庫債券(5年)第99回	0.4	2016/9/20	2,400,000,000	100.29	2,407,128,000	101.00	2,424,120,000	0.68
15	利付国庫債券(5年)第92回	0.3	2015/9/20	2,400,000,000	100.18	2,404,392,000	100.64	2,415,384,000	0.68
16	利付国庫債券(10年)第318回	1.0	2021/9/20	2,200,000,000	100.26	2,205,720,000	102.24	2,249,346,000	0.64
17	利付国庫債券(5年)第96回	0.5	2016/3/20	2,200,000,000	100.81	2,217,820,000	101.40	2,230,888,000	0.63
18	利付国庫債券(5年)第98回	0.3	2016/6/20	2,200,000,000	99.99	2,199,960,000	100.63	2,213,860,000	0.63
19	利付国庫債券(5年)第102回	0.3	2016/12/20	2,200,000,000	99.92	2,198,442,000	100.55	2,212,166,000	0.62
20	利付国庫債券(2年)第314回	0.1	2014/3/15	2,200,000,000	99.97	2,199,470,000	100.00	2,200,000,000	0.62
21	利付国庫債券(10年)第311回	0.8	2020/9/20	2,100,000,000	99.76	2,095,159,000	101.52	2,132,046,000	0.60
22	利付国庫債券(5年)第82回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	101.36	2,128,707,000	0.60
23	利付国庫債券(5年)第85回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.32	2,127,846,000	0.60
24	利付国庫債券(5年)第86回	0.6	2014/9/20	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	101.10	2,123,205,000	0.60
25	利付国庫債券(10年)第317回	1.1	2021/9/20	2,000,000,000	101.28	2,025,600,000	103.15	2,063,000,000	0.58
26	利付国庫債券(10年)第320回	1.0	2021/12/20	2,000,000,000	100.35	2,007,123,000	102.02	2,040,580,000	0.58
27	利付国庫債券(5年)第94回	0.6	2015/12/20	2,000,000,000	101.23	2,024,680,000	101.70	2,034,180,000	0.57
28	利付国庫債券(10年)第313回	1.3	2021/3/20	1,900,000,000	103.46	1,965,740,000	105.27	2,000,168,000	0.56
29	利付国庫債券(10年)第309回	1.1	2020/6/20	1,900,000,000	102.51	1,947,757,000	104.11	1,978,223,000	0.56
30	利付国庫債券(5年)第95回	0.6	2016/3/20	1,900,000,000	101.24	1,923,731,000	101.77	1,933,706,000	0.55
	合計			75,150,000,000		76,578,602,000		77,125,572,500	21.78

（注1）投資比率とは、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をいいます。

（注2）国/地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

B. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	75.54
地方債証券	6.71
特殊債券	10.27
社債券	6.30
合計	98.82

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

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

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (％)
債券先物取引 買建 長期国債先物	日本	17	2,439,174,990	2,442,730,000	0.69

（注1）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。

（注2）債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しております。

（外国株式マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	国/地域	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（％）
					単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	136,600	37,004.83	5,054,860,590	45,131.35	6,164,943,161	2.45
2	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	690,402	6,799.46	4,694,363,364	6,590.66	4,550,205,535	1.81
3	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,106,091	2,394.01	2,647,992,973	2,372.16	2,623,827,149	1.04
4	アメリカ	GENERAL ELECTRIC	資本財	1,549,945	1,510.83	2,341,717,727	1,602.06	2,483,107,986	0.99
5	アメリカ	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	ソフトウェア・サービス	161,278	15,292.55	2,466,352,556	15,179.93	2,448,189,395	0.97
6	アメリカ	AT&T INC	電気通信サービス	868,452	2,383.03	2,069,552,812	2,806.78	2,437,554,486	0.97
7	アメリカ	CHEVRON CORP	エネルギー	289,542	8,451.33	2,447,016,098	8,205.41	2,375,811,575	0.94
8	スイス	NESTLE SA-REGISTERD	食品・飲料・タバコ	483,370	4,369.04	2,111,866,324	4,599.64	2,223,332,578	0.88
9	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	401,991	5,155.94	2,072,642,722	5,309.01	2,134,174,801	0.85
10	アメリカ	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,103,972	1,661.54	1,834,298,604	1,786.85	1,972,637,115	0.78
11	アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	403,415	5,035.06	2,031,219,829	4,781.59	1,928,969,123	0.77
12	アメリカ	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	733,820	2,397.48	1,759,320,056	2,575.98	1,890,312,101	0.75
13	イギリス	HSBC HLDGS PLC	銀行	2,637,253	684.08	1,804,105,091	687.25	1,812,467,525	0.72
14	アメリカ	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	298,334	5,404.24	1,612,270,275	6,072.76	1,811,712,780	0.72
15	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	252,175	6,101.79	1,538,720,008	6,790.52	1,712,399,935	0.68
16	アメリカ	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	37,800	48,263.19	1,824,348,867	44,755.42	1,691,755,106	0.67

17	イギリス	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	7,299,177	217.86	1,590,237,976	222.60	1,624,803,806	0.65
18	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	556,587	3,016.91	1,679,174,705	2,845.64	1,583,847,789	0.63
19	アメリカ	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	731,365	2,119.16	1,549,881,793	2,048.57	1,498,257,737	0.59
20	アメリカ	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	275,926	4,911.38	1,355,179,800	5,416.87	1,494,656,099	0.59
21	スイス	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	336,933	4,249.76	1,431,884,912	4,336.57	1,461,136,066	0.58
22	アメリカ	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	415,348	3,030.33	1,258,643,317	3,487.26	1,448,426,757	0.58
23	アメリカ	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	445,919	3,044.06	1,357,406,408	3,226.33	1,438,682,204	0.57
24	イギリス	BP PLC	エネルギー	2,779,929	599.83	1,667,502,902	507.74	1,411,500,275	0.56
25	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	537,354	2,770.28	1,488,621,874	2,613.83	1,404,556,089	0.56
26	スイス	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	102,908	12,979.71	1,335,716,845	13,392.00	1,378,144,862	0.55
27	イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	739,523	1,747.00	1,291,948,455	1,780.31	1,316,584,037	0.52
28	アメリカ	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	588,976	2,296.44	1,352,552,129	2,234.16	1,315,868,210	0.52
29	アメリカ	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	230,021	5,278.87	1,214,251,007	5,519.97	1,269,710,399	0.50
30	オーストラリア	BHP BILLITON LTD	素材	472,309	3,032.13	1,432,102,854	2,447.64	1,156,044,526	0.46
合計						58,315,752,873		60,063,619,207	23.85

(注1) 投資比率とは、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をいいます。

(注2) 種類は全て株式です。

B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	エネルギー	10.96
	素材	6.42
	資本財	6.97
	商業・専門サービス	0.80
	運輸	1.73
	自動車・自動車部品	1.13
	耐久消費財・アパレル	1.19
	消費者サービス	1.70
	メディア	2.62
	小売	2.93
	食品・生活必需品小売り	2.31
	食品・飲料・タバコ	7.08
	家庭用品・パーソナル用品	1.74
	ヘルスケア機器・サービス	2.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.96
	銀行	6.97
	各種金融	4.22
	保険	3.80
	不動産	0.69
	ソフトウェア・サービス	5.96
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.67
	電気通信サービス	4.05
	公益事業	3.72
半導体・半導体製造装置	1.55	
小計	93.89	
投資信託受益証券	0.06	
投資証券	2.12	
合計	96.07	

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率をいいます。

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

取引名	国/地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	209	5,427,323,321	5,479,956,174	2.18
	カナダ	S&P/TSX60 IX	買建	43	430,788,828	430,662,810	0.17
	ドイツ	SWISS MKT IX	買建	137	667,998,916	672,950,507	0.27
	ドイツ	DJ EURO STOXX	買建	530	1,113,361,136	1,125,142,300	0.45
	オーストラリア	ASX SPI 200	買建	82	657,795,419	656,395,650	0.26
	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	211	1,411,500,775	1,414,649,415	0.56

（注1）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。

（注2）株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(外国債券マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	国/ 地域	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	40,120,000	8,120.60	3,257,984,908	8,073.51	3,239,092,274	0.82
2	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2021/2/15	31,230,000	9,195.00	2,871,599,475	9,411.86	2,939,325,878	0.75
3	アメリカ	US TREASURY N/B	3.000	2017/2/28	31,550,000	8,800.93	2,776,693,907	8,779.24	2,769,851,883	0.70
4	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2014/7/31	32,650,000	8,390.75	2,739,579,925	8,308.34	2,712,673,711	0.69
5	アメリカ	US TREASURY N/B	3.875	2040/8/15	26,910,000	9,186.32	2,472,041,023	9,942.87	2,675,626,769	0.68
6	アメリカ	US TREASURY N/B	0.500	2013/11/15	32,000,000	7,967.55	2,549,618,237	7,954.54	2,545,454,450	0.65
7	アメリカ	US TREASURY N/B	3.500	2020/5/15	26,650,000	9,119.41	2,430,322,972	9,312.72	2,481,842,252	0.63
8	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2019/1/31	30,050,000	7,887.31	2,370,138,920	8,069.17	2,424,786,465	0.62
9	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2020/2/15	25,030,000	9,193.76	2,301,199,105	9,375.30	2,346,639,965	0.60
10	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2018/1/31	25,250,000	8,662.13	2,187,190,112	8,714.18	2,200,332,028	0.56
11	アメリカ	US TREASURY N/B	2.375	2014/8/31	26,000,000	8,352.33	2,171,606,937	8,279.84	2,152,758,430	0.55
12	アメリカ	US TREASURY N/B	2.125	2021/8/15	25,400,000	8,119.36	2,062,317,757	8,393.22	2,131,880,062	0.54
13	アメリカ	US TREASURY N/B	1.375	2015/11/30	25,000,000	8,201.76	2,050,442,334	8,168.93	2,042,232,500	0.52
14	アメリカ	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	21,870,000	9,044.51	1,978,034,861	9,219.78	2,016,367,526	0.51
15	アメリカ	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	24,320,000	7,997.91	1,945,093,612	8,281.69	2,014,109,174	0.51
16	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2014/2/15	25,000,000	8,064.83	2,016,208,906	8,051.20	2,012,801,054	0.51
17	アメリカ	US TREASURY N/B	1.875	2015/6/30	23,900,000	8,334.36	1,991,913,412	8,271.78	1,976,956,651	0.50
18	アメリカ	US TREASURY N/B	0.375	2015/4/15	23,700,000	7,932.54	1,880,014,118	7,927.28	1,878,765,915	0.48
19	アメリカ	US TREASURY N/B	4.750	2017/8/15	19,000,000	9,538.88	1,812,388,402	9,532.69	1,811,211,152	0.46
20	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2016/6/30	21,960,000	8,235.22	1,808,456,121	8,225.31	1,806,279,062	0.46
21	フランス	FRANCE O.A.T.	3.750	2019/10/25	16,450,000	10,707.36	1,761,361,641	10,930.51	1,798,070,211	0.46
22	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2015/9/30	21,980,000	8,166.45	1,794,986,053	8,129.89	1,786,950,843	0.45
23	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2013/10/31	21,600,000	8,273.64	1,787,107,108	8,190.61	1,769,173,134	0.45
24	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	18,500,000	9,437.89	1,746,009,650	9,357.96	1,731,222,679	0.44
25	アメリカ	US TREASURY N/B	0.125	2013/9/30	21,000,000	7,917.36	1,662,647,404	7,916.12	1,662,387,168	0.42
26	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.000	2014/7/12	15,830,000	10,396.33	1,645,739,767	10,377.57	1,642,769,964	0.42
27	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2040/2/15	14,700,000	10,364.82	1,523,629,366	11,169.69	1,641,945,641	0.42
28	アメリカ	US TREASURY N/B	4.250	2039/5/15	15,510,000	9,774.95	1,516,095,908	10,539.55	1,634,685,052	0.42
29	アメリカ	US TREASURY N/B	0.250	2015/5/15	20,090,000	7,904.97	1,588,109,760	7,896.92	1,586,491,534	0.40
30	アメリカ	US TREASURY N/B	4.250	2040/11/15	14,820,000	9,787.34	1,450,485,223	10,566.81	1,566,002,468	0.40
合計							62,149,016,924		62,998,685,895	16.02

(注1) 投資比率とは、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をいいます。

(注2) 種類は全て国債証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	97.46
合計	97.46

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

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

取引名	国/地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	US 5YR NOTE	買建	68	668,794,477	669,711,002	0.17
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	41	434,066,733	435,475,116	0.11
	アメリカ	US LONG BOND	買建	34	401,562,273	404,059,665	0.10
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	39	426,310,048	425,693,318	0.11
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	37	464,007,697	461,020,022	0.12
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	64	909,860,070	895,516,505	0.23

（注1）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。

（注2）債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

（Jリートマザーファンド（M））

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	数量 (口)	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 (%)
			単価	金額	単価	金額	
1	日本ビルファンド投資法人	2,729	770,599	2,102,967,072	771,000	2,104,059,000	14.10
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,469	740,352	1,827,930,421	731,000	1,804,839,000	12.09
3	日本リテールファンド投資法人	7,830	108,424	848,966,105	126,500	990,495,000	6.64
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,425	89,050	839,296,721	85,900	809,607,500	5.42
5	アドバンス・レジデンス投資法人	5,147	155,158	798,602,498	154,900	797,270,300	5.34
6	森トラスト総合リート投資法人	999	770,924	770,153,585	699,000	698,301,000	4.68
7	日本プライムリアルティ投資法人	2,980	200,762	598,273,620	224,200	668,116,000	4.48
8	フロンティア不動産投資法人	942	677,120	637,847,887	640,000	602,880,000	4.04
9	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,194	488,407	583,158,399	449,500	536,703,000	3.60
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	676	689,764	466,280,484	707,000	477,932,000	3.20
11	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	773	488,101	377,302,598	557,000	430,561,000	2.88
12	日本アコモデーションファンド投資法人	810	605,288	490,283,944	517,000	418,770,000	2.81
13	産業ファンド投資法人	754	417,679	314,930,576	515,000	388,310,000	2.60
14	オリックス不動産投資法人	1,022	394,198	402,870,999	358,000	365,876,000	2.45
15	森ヒルズリート投資法人	1,005	268,647	269,991,169	344,000	345,720,000	2.32
16	アクティブ・プロパティーズ投資法人	725	459,144	332,880,116	458,500	332,412,500	2.23
17	ジャパンエクセレント投資法人	766	381,679	292,366,244	397,000	304,102,000	2.04
18	トップリート投資法人	609	432,177	263,196,316	445,500	271,309,500	1.82
19	東急リアル・エステート投資法人	664	438,480	291,150,733	391,000	259,624,000	1.74

20	ケネディクス不動産投資法人	995	265,855	264,525,943	257,300	256,013,500	1.72
21	福岡リート投資法人	466	566,683	264,074,683	549,000	255,834,000	1.71
22	大和証券オフィス投資法人	1,122	236,713	265,592,838	210,100	235,732,200	1.58
23	プレミアム投資法人	819	300,645	246,228,295	279,900	229,238,100	1.54
24	野村不動産レジデンシャル投資法人	551	388,734	214,192,687	409,000	225,359,000	1.51
25	積水ハウス・S I 投資法人	649	323,457	209,923,742	338,500	219,686,500	1.47
26	グローバル・ワン不動産投資法人	364	662,629	241,197,178	517,000	188,188,000	1.26
27	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,739	17,003	131,592,330	21,250	164,453,750	1.10
28	阪急リート投資法人	264	378,556	99,938,968	361,000	95,304,000	0.64
	合計	54,488		14,445,716,151		14,476,696,850	97.00

(注1) 投資比率とは、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をいいます。

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て投資証券です。

B. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.00
合計	97.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

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。

(海外リートマザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	国/地域	銘柄名	数量 (口)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	5,300	9,187.27	48,692,533	12,031.32	63,766,033	7.08
2	アメリカ	PUBLIC STORAGE INC	2,500	9,569.54	23,923,861	11,180.33	27,950,826	3.10
3	オーストラリア	WESTFIELD GROUP	36,784	618.08	22,735,601	755.87	27,804,234	3.09
4	アメリカ	EQUITY RESIDENTIAL	5,300	4,743.53	25,140,714	4,800.63	25,443,361	2.82
5	アメリカ	HCP INC	7,400	2,771.09	20,506,076	3,434.12	25,412,510	2.82
6	アメリカ	VENTAS INC	5,100	4,042.43	20,616,396	4,905.32	25,017,149	2.78
7	フランス	UNIBAIL	1,608	13,917.40	22,379,184	13,868.03	22,299,797	2.48
8	アメリカ	BOSTON PROPERTIES INC	2,600	7,951.62	20,674,213	8,316.44	21,622,761	2.40
9	アメリカ	VORNADO REALTY TRUST	3,300	6,491.52	21,422,027	6,460.59	21,319,955	2.37
10	アメリカ	PROLOGIS INC	8,100	2,035.09	16,484,266	2,503.02	20,274,491	2.25
11	アメリカ	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,700	10,494.29	17,840,308	10,945.57	18,607,474	2.07
12	アメリカ	HEALTH CARE REIT INC	3,800	3,952.01	15,017,665	4,552.39	17,299,097	1.92
13	アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	12,600	847.82	10,682,581	1,207.09	15,209,437	1.69

14	アメリカ	GENERAL GROWTH PROPERTIES	10,400	956.47	9,947,377	1,394.26	14,500,405	1.61
15	香港	LINK REIT	40,000	279.00	11,160,240	321.41	12,856,760	1.43
16	イギリス	LAND SECURITIES GROUP PLC	13,693	876.61	12,003,480	896.92	12,281,650	1.36
17	オーストラリア	WESTFIELD RETAIL TRUST	49,472	191.15	9,457,067	231.78	11,466,694	1.27
18	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,900	4,524.63	8,596,807	5,838.00	11,092,217	1.23
19	アメリカ	KIMCO REALTY CORP	7,200	1,284.02	9,245,008	1,463.26	10,535,540	1.17
20	アメリカ	MACERICH CO	2,300	3,573.70	8,219,529	4,561.11	10,490,571	1.16
21	アメリカ	SL GREEN REALTY CORP	1,600	5,309.80	8,495,687	6,126.69	9,802,716	1.09
22	オーストラリア	STOCKLAND	39,089	231.78	9,060,107	246.91	9,651,660	1.07
23	イギリス	BRITISH LAND CO PLC	15,653	631.60	9,886,522	615.59	9,635,986	1.07
24	アメリカ	FED REALTY INVS TRUST	1,100	6,865.07	7,551,580	8,100.72	8,910,795	0.99
25	アメリカ	UDR INC	4,400	2,045.40	8,999,781	1,991.47	8,762,486	0.97
26	オーストラリア	GPT GROUP	29,383	247.71	7,278,507	259.65	7,629,560	0.85
27	アメリカ	REALTY INCOME CORP	2,300	2,667.98	6,136,373	3,269.95	7,520,887	0.83
28	アメリカ	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,400	5,139.28	7,195,003	5,260.63	7,364,885	0.82
29	アメリカ	ESSEX PROPERTY TRUST INC	600	11,142.26	6,685,357	11,952.81	7,171,686	0.80
30	オーストラリア	GOODMAN GROUP	24,137	246.91	5,959,787	293.11	7,074,844	0.79
合計					431,993,637		498,776,467	55.37

（注1）投資比率とは、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をいいます。

（注2）種類は全て投資証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	96.20
合計	96.20

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

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】

平成24年6月29日及び同日前1年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次のとおりです。

	純資産総額（円）		1万口当たりの基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間（平成19年12月10日現在）	3,586,283,463	3,589,844,188	9,957	9,967
第2特定期間（平成20年6月10日現在）	3,192,838,387	3,196,433,746	8,877	8,887
第3特定期間（平成20年12月10日現在）	2,013,785,577	2,017,176,994	5,938	5,948
第4特定期間（平成21年6月10日現在）	2,100,580,982	2,103,869,774	6,387	6,397
第5特定期間（平成21年12月10日現在）	2,016,006,579	2,022,240,837	6,467	6,487

第6特定期間（平成22年6月10日現在）	1,808,286,497	1,813,977,919	6,354	6,374
第7特定期間（平成22年12月10日現在）	1,702,409,568	1,710,097,724	6,643	6,673
第8特定期間（平成23年6月10日現在）	1,531,647,646	1,538,702,069	6,514	6,544
第9特定期間（平成23年12月12日現在）	1,212,675,791	1,218,975,235	5,775	5,805
第10特定期間（平成24年6月11日現在）	1,107,710,596	1,113,337,628	5,906	5,936
平成23年6月末日	1,525,585,491		6,576	
平成23年7月末日	1,464,402,058		6,397	
平成23年8月末日	1,369,896,420		6,099	
平成23年9月末日	1,289,730,640		5,836	
平成23年10月末日	1,303,472,406		6,042	
平成23年11月末日	1,211,561,558		5,715	
平成23年12月末日	1,197,576,342		5,769	
平成24年1月末日	1,194,416,628		5,864	
平成24年2月末日	1,258,178,534		6,297	
平成24年3月末日	1,249,655,222		6,422	
平成24年4月末日	1,209,925,983		6,299	
平成24年5月末日	1,106,357,785		5,872	
平成24年6月末日	1,107,966,649		6,008	

特定期間末日における分配付の純資産総額及び基準価額（1万口当たり）を表示しております。

【分配の推移】

特定期間	1万口当たりの収益分配金
第1特定期間（自平成19年8月31日至平成19年12月10日）	20円
第2特定期間（自平成19年12月11日至平成20年6月10日）	60円
第3特定期間（自平成20年6月11日至平成20年12月10日）	60円
第4特定期間（自平成20年12月11日至平成21年6月10日）	60円
第5特定期間（自平成21年6月11日至平成21年12月10日）	90円
第6特定期間（自平成21年12月11日至平成22年6月10日）	120円
第7特定期間（自平成22年6月11日至平成22年12月10日）	140円
第8特定期間（自平成22年12月11日至平成23年6月10日）	180円
第9特定期間（自平成23年6月11日至平成23年12月12日）	180円
第10特定期間（自平成23年12月13日至平成24年6月11日）	180円

（注）収益分配金は、各特定期間中の分配金の累計金額を表示しております。

【収益率の推移】

特定期間	収益率
第1特定期間（自平成19年8月31日至平成19年12月10日）	0.2%
第2特定期間（自平成19年12月11日至平成20年6月10日）	10.2%
第3特定期間（自平成20年6月11日至平成20年12月10日）	32.4%
第4特定期間（自平成20年12月11日至平成21年6月10日）	8.6%
第5特定期間（自平成21年6月11日至平成21年12月10日）	2.7%
第6特定期間（自平成21年12月11日至平成22年6月10日）	0.1%
第7特定期間（自平成22年6月11日至平成22年12月10日）	6.8%
第8特定期間（自平成22年12月11日至平成23年6月10日）	0.8%
第9特定期間（自平成23年6月11日至平成23年12月12日）	8.6%
第10特定期間（自平成23年12月13日至平成24年6月11日）	5.4%

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配落ちの基準価額に当該特定期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数とします。なお、第1特定期間については、前期末基準価額の代わりに当初募集時の発行価額（1万口当たり10,000円）を使用しております。

（4）【設定及び解約の実績】

特定期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間（自平成19年8月31日至平成19年12月10日）	3,613,938,221	12,188,903	3,601,749,318
第2特定期間（自平成19年12月11日至平成20年6月10日）	137,066,455	141,987,767	3,596,828,006
第3特定期間（自平成20年6月11日至平成20年12月10日）	20,837,684	226,248,338	3,391,417,352
第4特定期間（自平成20年12月11日至平成21年6月10日）	1,444,362	103,953,055	3,288,908,659
第5特定期間（自平成21年6月11日至平成21年12月10日）	7,833,268	179,383,448	3,117,358,479
第6特定期間（自平成21年12月11日至平成22年6月10日）	7,973,109	279,620,527	2,845,711,061
第7特定期間（自平成22年6月11日至平成22年12月10日）	154,462	283,146,803	2,562,718,720
第8特定期間（自平成22年12月11日至平成23年6月10日）	1,801,557	213,045,766	2,351,474,511
第9特定期間（自平成23年6月11日至平成23年12月12日）	1,457,958	253,117,712	2,099,814,757
第10特定期間（自平成23年12月13日至平成24年6月11日）	196,582	224,333,874	1,875,677,465

（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1特定期間の設定口数には、当初募集期間中の募集に係る設定口数を含みます。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績



主要な資産の状況								
マザーファンド	持分比率	上位購入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期	割当率(%)
日本株式マザーファンド	15.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.6%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.4%
日本債券マザーファンド	16.9%	利付国庫債券(5年)第87回	日本	国債証券	-	0.500%	2014/12/20	0.2%
		利付国庫債券(10年)第285回	日本	国債証券	-	1.700%	2017/3/20	0.2%
外国株式マザーファンド	16.4%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/機器	-	-	0.4%
		EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	株式	エネルギー	-	-	0.3%
外国債券マザーファンド	16.6%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	-	1.500%	2013/12/31	0.1%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	-	3.625%	2021/2/15	0.1%
リートマザーファンド(M)	17.2%	日本ビルファンド投資法人	日本	不動産投資信託	-	-	-	2.4%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	不動産投資信託	-	-	-	2.1%
海外リートマザーファンド	17.4%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	不動産投資信託	-	-	-	1.2%
		PUBLIC STORAGE INC	アメリカ	不動産投資信託	-	-	-	0.5%



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2007年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2012年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込手続

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。当ファンドには、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）専用ファンドです。

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 申込みの受付

申込期間中において、販売会社の営業日にお申込みいただけます。

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

(3) 申込単位

販売会社が定める単位とします。

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

(4) 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

(5) 申込手数料

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

(6) 申込代金の支払い

販売会社が定める期日までにお支払いください。

(7) 受付不可日

該当事項はありません。

(8) 申込受付の中止等

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があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

(9) その他

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

については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

スイッチング

当ファンドはスイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「（１）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

（１）一部解約手続

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

委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

（２）一部解約の受付

一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後３時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

（３）解約単位

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

（４）解約価額

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします（信託財産留保額の控除はありません。）。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「１申込（販売）手続等（１）申込手続」に記載の照会先にお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

（５）一部解約代金の支払い

一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、５営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

（６）受付不可日

該当事項はありません。

（７）一部解約受付の中止等

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があるときは、上記（２）による一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。

上記により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記（４）の規定に準じて計算された価額とします。

（８）その他

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「１申込（販売）手続等（１）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

基準価額の算出頻度及び照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「1 申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

主要な投資対象資産の評価方法

A．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

B．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

イ．国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

ハ．公社債等

計算日（ ）における次の1．から3．までに掲げるいずれかの価額で評価します。

1．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

2．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

3．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします（平成19年8月31日設定）。

ただし、下記「(5) その他 信託の終了」の事項に該当する場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

原則として、毎月11日から翌月10日までとします。

ただし、第1計算期間は平成19年8月31日から平成19年10月10日までとします。

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

（５）【その他】**信託の終了****A．委託会社の所定の手続きによる終了**

イ．委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ロ．委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ハ．所定の手続き

a．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

b．上記a．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

c．上記b．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記イ．及びロ．の信託契約の解約をしません。

d．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

e．上記b．からd．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b．の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

B．監督官庁の命令に伴う取扱い

委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。

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

信託約款の変更

A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

B．委託会社は、上記A．の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

C．上記B．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

D．上記C．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記A．の信託約款の変更をしません。

E．委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

反対者の買取請求権

信託契約の解約又は信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

運用報告書

委託会社は、毎年6月及び12月の決算時並びに償還時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知っている受益者に対して交付します。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．混蔵寄託

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

B．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き等

A．委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 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10特定期間（平成23年12月13日から平成24年6月11日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9特定期間 （平成23年12月12日現在）	第10特定期間 （平成24年6月11日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,220,030,878	1,114,314,517
未収入金	1,422,529	586,350
流動資産合計	1,221,453,407	1,114,900,867
資産合計		
	1,221,453,407	1,114,900,867
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	6,299,444	5,627,032
未払解約金	1,422,529	586,350
未払受託者報酬	44,683	41,351
未払委託者報酬	1,005,385	930,379
その他未払費用	5,575	5,159
流動負債合計	8,777,616	7,190,271
負債合計		
	8,777,616	7,190,271
純資産の部		
元本等		
元本	2,099,814,757	1,875,677,465
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	887,138,966	767,966,869
純資産合計	1,212,675,791	1,107,710,596
負債純資産合計	1,221,453,407	1,114,900,867

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9特定期間	第10特定期間
	自平成23年6月11日 至平成23年12月12日	自平成23年12月13日 至平成24年6月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	120,189,862	72,111,422
営業収益合計	120,189,862	72,111,422
営業費用		
受託者報酬	287,962	251,351
委託者報酬	6,479,187	5,655,379
その他費用	35,937	31,359
営業費用合計	6,803,086	5,938,089
営業利益又は営業損失（ ）	126,992,948	66,173,333
経常利益又は経常損失（ ）	126,992,948	66,173,333
当期純利益又は当期純損失（ ）	126,992,948	66,173,333
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	188,185	1,004,352
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	819,826,865	887,138,966
剰余金増加額又は欠損金減少額	99,770,481	89,512,594
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	99,770,481	89,512,594
剰余金減少額又は欠損金増加額	522,811	78,115
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	522,811	78,115
分配金	39,755,008	35,431,363
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	887,138,966	767,966,869

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第10特定期間（自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月11日） 第10特定期間は前特定期間末日及び当特定期間末日が休業日のため、平成23年12月13日から平成24年 6月11日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第9特定期間 (平成23年12月12日現在)	第10特定期間 (平成24年 6月11日現在)
1. 当該特定期間の末日における受益権総数	2,099,814,757 口	1,875,677,465 口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 887,138,966 円	元本の欠損 767,966,869 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.5775 円 (5,775 円)	0.5906 円 (5,906 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

1. 分配金の計算過程

		第9特定期間 自 平成23年 6月11日 至 平成23年12月12日	第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月11日
		第46期 自 平成23年 6月11日 至 平成23年 7月11日	第52期 自 平成23年12月13日 至 平成24年 1月10日
費用控除後の配当等収益額	A	4,121,092 円 (4,308,335 円)	2,660,142 円 (3,600,656 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	37,367,236 円	33,661,280 円
分配準備積立金額	D	67,718,493 円	37,906,895 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	109,206,821 円	74,228,317 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,304,913,193 口	2,073,963,421 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	473.80 円	357.90 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,914,739 円	6,221,890 円

		第 47 期 自 平成23年 7 月12日 至 平成23年 8 月10日	第 53 期 自 平成24年 1 月11日 至 平成24年 2 月10日
費用控除後の配当等収益額	A	1,260,756 円 (2,454,710 円)	2,134,626 円 (2,170,712 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	37,057,659 円	32,793,608 円
分配準備積立金額	D	64,290,707 円	33,457,560 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	102,609,122 円	68,385,794 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,283,619,414 口	2,020,431,503 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	449.32 円	338.47 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,850,858 円	6,061,294 円

		第 48 期 自 平成23年 8 月11日 至 平成23年 9 月12日	第 54 期 自 平成24年 2 月11日 至 平成24年 3 月12日
費用控除後の配当等収益額	A	2,349,330 円 (3,567,779 円)	3,005,239 円 (3,046,299 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	36,235,625 円	32,170,812 円
分配準備積立金額	D	57,387,597 円	28,969,580 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	95,972,552 円	64,145,631 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,232,696,815 口	1,982,043,242 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	429.85 円	323.63 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,698,090 円	5,946,129 円
		第 49 期 自 平成23年 9 月13日 至 平成23年10月11日	第 55 期 自 平成24年 3 月13日 至 平成24年 4 月10日
費用控除後の配当等収益額	A	4,126,358 円 (5,143,127 円)	5,067,692 円 (6,058,877 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	35,649,937 円	31,522,377 円
分配準備積立金額	D	52,177,965 円	25,503,264 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	91,954,260 円	62,093,333 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,196,514,554 口	1,942,064,153 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	418.63 円	319.72 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,589,543 円	5,826,192 円

		第 50 期 自 平成23年10月12日 至 平成23年11月10日	第 56 期 自 平成24年 4月11日 至 平成24年 5月10日
費用控除後の配当等収益額	A	1,887,057 円 (2,120,908 円)	2,100,324 円 (3,082,520 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	34,637,123 円	31,104,214 円
分配準備積立金額	D	48,302,382 円	24,415,772 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	84,826,562 円	57,620,310 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,134,111,407 口	1,916,275,462 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	397.47 円	300.68 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,402,334 円	5,748,826 円

		第 51 期 自 平成23年11月11日 至 平成23年12月12日	第 57 期 自 平成24年 5月11日 至 平成24年 6月11日
費用控除後の配当等収益額	A	1,595,704 円 (2,651,347 円)	1,451,087 円 (2,427,976 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	34,080,496 円	30,445,624 円
分配準備積立金額	D	43,083,435 円	20,326,937 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	78,759,635 円	52,223,648 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,099,814,757 口	1,875,677,465 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	375.07 円	278.42 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	6,299,444 円	5,627,032 円

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

	第 9 特定期間 自 平成23年 6月11日 至 平成23年12月12日	第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年 6月11日
2. 剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第9特定期間 自 平成23年6月11日 至 平成23年12月12日	第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9特定期間 (平成23年12月12日現在)	第10特定期間 (平成24年6月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該特定期間における元本額の変動

	第9特定期間 自 平成23年6月11日 至 平成23年12月12日	第10特定期間 自 平成23年12月13日 至 平成24年6月11日
期首元本額	2,351,474,511 円	2,099,814,757 円
期中追加設定元本額	1,457,958 円	196,582 円
期中一部解約元本額	253,117,712 円	224,333,874 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

	第9特定期間 (平成23年12月12日現在)	第10特定期間 (平成24年6月11日現在)
種類	最終の計算期間(自平成23年11月11日至平成23年12月12日)の損益に含まれた評価差額(円)	最終の計算期間(自平成24年5月11日至平成24年6月11日)の損益に含まれた評価差額(円)

親投資信託受益証券	507,417	29,293,524
合計	507,417	29,293,524

3. デリバティブ取引関係

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	日本株式マザーファンド	249,092,408	166,667,730	
	日本債券マザーファンド	157,816,996	191,542,488	
	外国株式マザーファンド	199,721,812	186,020,895	
	外国債券マザーファンド	124,717,666	190,730,726	
	Jリートマザーファンド(M)	175,482,312	183,308,823	
	海外リートマザーファンド	348,151,049	196,043,855	
合計		1,254,982,243	1,114,314,517	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

「ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）」は、「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド（M）」及び「海外リートマザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成24年6月11日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,443,139,676
株式	223,449,393,405
派生商品評価勘定	25,926,375
未収入金	2,127,636
未収配当金	2,422,251,661
未収利息	14,657
前払金	148,411,000
流動資産合計	233,491,264,410
資産合計	233,491,264,410
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	705,200
未払金	59,809,923
未払解約金	218,125,257
流動負債合計	278,640,380
負債合計	278,640,380
純資産の部	
元本等	
元本	348,529,838,430
剰余金	
欠損金	115,317,214,400
純資産合計	233,212,624,030
負債・純資産合計	233,491,264,410

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
--	--------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>（１）受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>（２）派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成24年6月11日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p>株式 2,248,000,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。</p>
2．計算日における受益権総数	348,529,838,430 口
3．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>115,317,214,400 円</p>
4．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	<p>0.6691 円</p> <p>（ 6,691 円）</p>

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

(1) 株式

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1．元本の変動

平成24年6月11日現在

特定期間の期首元本額	349,310,796,680 円
特定期間中の追加設定元本額	23,913,679,461 円
特定期間中の一部解約元本額	24,694,637,711 円
計算日の元本額	348,529,838,430 円

計算日の元本額の内訳

日本株式インデックスファンド	2,466,909,046 円
DC日本株式インデックスファンド	374,444,065 円
DC日本株式インデックスファンドL	47,834,644,221 円
DC日本株式インデックスファンドA	1,574,178,482 円
DCバランスファンド30	518,009,990 円
DCバランスファンド50	1,153,618,562 円
DCバランスファンド70	606,288,836 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	249,092,408 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	163,275,758 円
新生・4分散ファンド	225,504,805 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	962,388,779 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	65,742,395 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	211,219,859 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	88,830,143 円
日本株式インデックスe	1,144,175,814 円
インデックスコレクション(国内株式)	3,245,998,777 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	523,393,943 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,036,764,265 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	845,686,871 円
日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	32,218,347,062 円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	6,775,480,523 円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	51,648,752,640 円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	41,551,738,609 円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	6,563,506,962 円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,028,059,191 円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,456,487,315 円

バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,639,382,569 円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,682,575,811 円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	40,672,782,877 円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	2,707,964,640 円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	21,300,985,120 円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	8,357,726,870 円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	291,597,478 円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	3,583,692,786 円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,906,275,943 円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	8,587,155,283 円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	445,542,900 円
私募日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,217,621,395 円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	359,761,452 円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,802,546,204 円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,852,741,288 円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,314,914,254 円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	152,326,216 円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,005,654,988 円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	24,422,015,421 円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	619,592,106 円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	235,960,420 円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	81,729,789 円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	731,546,472 円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	20,351,283 円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	4,855,544 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	7,886,877,329
合計	7,886,877,329

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成24年1月24日から平成24年6月11日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

. ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,729,978,825		9,755,200,000	25,221,175
	合計	9,729,978,825		9,755,200,000	25,221,175

（注）1. 時価の算定方法

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

評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年 6月11日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A . 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	100,000	179	17,900,000	
日本水産	289,100	203	58,687,300	
マルハニチロホールディングス	496,000	114	56,544,000	
サカタのタネ	37,200	1,058	39,357,600	
ホクト	25,600	1,611	41,241,600	
住石ホールディングス	73,700	78	5,748,600	
日鉄鉱業	65,000	300	19,500,000	
三井松島産業	164,000	133	21,812,000	
国際石油開発帝石	3,050	453,000	1,381,650,000	
日本海洋掘削	6,300	2,255	14,206,500	
関東天然瓦斯開発	25,000	410	10,250,000	
石油資源開発	35,800	3,020	108,116,000	
ショーボンドホールディングス	23,100	2,089	48,255,900	
ミライト・ホールディングス	74,400	532	39,580,800	
ダイセキ環境ソリューション	23	131,800	3,031,400	
間組	110,000	170	18,700,000	
東急建設	112,910	155	17,501,050	
コムシスホールディングス	121,800	876	106,696,800	
ミサワホーム	30,500	1,053	32,116,500	
高松コンストラクショングループ	22,700	1,148	26,059,600	
東建コーポレーション	9,810	2,552	25,035,120	
ヤマウラ	17,000	218	3,706,000	
大成建設	1,269,000	194	246,186,000	
大林組	753,000	319	240,207,000	
清水建設	768,000	257	197,376,000	
長谷工コーポレーション	1,568,500	51	79,993,500	
松井建設	44,000	285	12,540,000	
鹿島建設	1,176,000	204	239,904,000	
鉄建建設	158,000	95	15,010,000	
安藤建設	123,000	87	10,701,000	
太平工業	48,000	351	16,848,000	
西松建設	338,000	136	45,968,000	
三井住友建設	205,400	53	10,886,200	
前田建設工業	167,000	325	54,275,000	
ナカノフード建設	48,000	125	6,000,000	
奥村組	238,000	245	58,310,000	
大和小田急建設	36,500	186	6,789,000	
東鉄工業	35,000	882	30,870,000	
イチケン	58,000	139	8,062,000	
戸田建設	269,000	215	57,835,000	
熊谷組	213,000	75	15,975,000	
青木あすなろ建設	21,500	392	8,428,000	
北野建設	80,000	173	13,840,000	
植木組	42,000	147	6,174,000	
三井ホーム	44,000	385	16,940,000	
矢作建設工業	34,600	328	11,348,800	
ピーエス三菱	21,000	387	8,127,000	
大東建託	95,300	6,850	652,805,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
新日本建設	36,400	180	6,552,000	
N I P P O	60,000	809	48,540,000	
東亜道路工業	56,000	199	11,144,000	
前田道路	74,000	897	66,378,000	
日本道路	81,000	263	21,303,000	
東亜建設工業	232,000	118	27,376,000	
五洋建設	318,000	173	55,014,000	
大林道路	38,000	201	7,638,000	
住友林業	172,700	657	113,463,900	
日本基礎技術	34,500	278	9,591,000	
日成ビルド工業	102,000	112	11,424,000	
巴コーポレーション	37,600	270	10,152,000	
パナホーム	96,000	454	43,584,000	
大和ハウス工業	626,000	1,011	632,886,000	
ライト工業	57,400	309	17,736,600	
積水ハウス	706,000	666	470,196,000	
日特建設	83,000	79	6,557,000	
北陸電気工事	22,000	218	4,796,000	
ユアテック	40,000	312	12,480,000	
西部電気工業	27,000	318	8,586,000	
四電工	27,000	306	8,262,000	
中電工	38,400	775	29,760,000	
関電工	119,000	362	43,078,000	
きんでん	167,000	515	86,005,000	
東京エネシス	26,000	392	10,192,000	
トーエネック	40,000	421	16,840,000	
住友電設	20,500	531	10,885,500	
日本電設工業	48,000	731	35,088,000	
協和エクシオ	84,200	742	62,476,400	
新日本空調	23,600	415	9,794,000	
日本電話施設	49,000	237	11,613,000	
九電工	50,000	465	23,250,000	
三機工業	62,000	381	23,622,000	
日揮	234,000	2,201	515,034,000	
中外炉工業	81,000	213	17,253,000	
ヤマト	29,000	277	8,033,000	
太平電業	33,000	529	17,457,000	
高砂熱学工業	74,200	612	45,410,400	
三晃金属工業	36,000	218	7,848,000	
朝日工業社	32,000	292	9,344,000	
大気社	39,500	1,507	59,526,500	
ダイダン	37,000	490	18,130,000	
日比谷総合設備	32,700	811	26,519,700	
東芝プラントシステム	41,000	856	35,096,000	
東洋エンジニアリング	134,000	332	44,488,000	
千代田化工建設	199,000	1,017	202,383,000	
新興プランテック	51,500	663	34,144,500	
日本製粉	155,000	334	51,770,000	
日清製粉グループ本社	227,500	883	200,882,500	
日東富士製粉	20,000	298	5,960,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
昭和産業	104,000	254	26,416,000	

鳥越製粉	21,900	599	13,118,100	
協同飼料	88,000	83	7,304,000	
中部飼料	22,400	502	11,244,800	
日本配合飼料	78,000	96	7,488,000	
東洋精糖	40,000	87	3,480,000	
日本甜菜製糖	139,000	156	21,684,000	
三井製糖	89,000	240	21,360,000	
森永製菓	246,000	175	43,050,000	
中村屋	59,000	372	21,948,000	
江崎グリコ	91,000	893	81,263,000	
名糖産業	11,200	999	11,188,800	
不二家	144,000	188	27,072,000	
山崎製パン	184,000	1,106	203,504,000	
モロゾフ	39,000	272	10,608,000	
亀田製菓	14,000	1,967	27,538,000	
カルビー	18,200	4,700	85,540,000	
森永乳業	212,000	285	60,420,000	
ヤクルト本社	134,500	2,805	377,272,500	
明治ホールディングス	74,300	3,405	252,991,500	
雪印メグミルク	54,100	1,325	71,682,500	
プリマハム	141,000	126	17,766,000	
日本ハム	191,000	988	188,708,000	
伊藤ハム	138,000	317	43,746,000	
丸大食品	120,000	280	33,600,000	
米久	22,200	796	17,671,200	
S Foods	16,000	680	10,880,000	
サッポロホールディングス	411,000	247	101,517,000	
アサヒグループホールディングス	470,800	1,683	792,356,400	
キリンホールディングス	1,006,000	912	917,472,000	
宝ホールディングス	212,000	481	101,972,000	
オエノンホールディングス	65,000	188	12,220,000	
養命酒製造	19,000	689	13,091,000	
三国コカ・コーラボトリング	26,300	698	18,357,400	
コカ・コーラウエスト	85,000	1,346	114,410,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	28,300	1,040	29,432,000	
ダイトードリンク	11,600	3,285	38,106,000	
伊藤園	69,800	1,406	98,138,800	
キーコーヒー	22,000	1,438	31,636,000	
ユニカフェ	6,200	365	2,263,000	
ジャパンフーズ	3,400	821	2,791,400	
日清オイリオグループ	97,000	316	30,652,000	
不二製油	60,900	1,007	61,326,300	
J - オイルミルズ	94,000	238	22,372,000	
キッコーマン	205,000	949	194,545,000	
味の素	661,000	1,096	724,456,000	
キューピー	127,700	1,112	142,002,400	
ハウス食品	89,100	1,256	111,909,600	
カゴメ	97,000	1,557	151,029,000	
焼津水産化学工業	11,900	745	8,865,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アリアケジャパン	22,900	1,641	37,578,900	
ニチレイ	281,000	363	102,003,000	
東洋水産	108,000	2,069	223,452,000	
日清食品ホールディングス	98,000	2,924	286,552,000	

永谷園	24,000	751	18,024,000	
フジッコ	27,000	993	26,811,000	
ロック・フィールド	13,100	1,437	18,824,700	
日本たばこ産業	5,563	433,000	2,408,779,000	
ケンコーマヨネーズ	7,600	600	4,560,000	
わらべや日洋	14,000	1,297	18,158,000	
なとり	11,700	818	9,570,600	
ミヨシ油脂	80,000	97	7,760,000	
片倉工業	31,000	686	21,266,000	
グンゼ	176,000	204	35,904,000	
東洋紡績	991,000	105	104,055,000	
ユニチカ	528,000	44	23,232,000	
富士紡ホールディングス	99,000	166	16,434,000	
日清紡ホールディングス	149,000	604	89,996,000	
倉敷紡績	242,000	138	33,396,000	
シキボウ	155,000	94	14,570,000	
日本毛織	80,000	560	44,800,000	
トーア紡コーポレーション	111,000	52	5,772,000	
ダイドーリミテッド	29,300	540	15,822,000	
帝国繊維	25,000	605	15,125,000	
帝人	959,000	242	232,078,000	
東レ	1,702,000	528	898,656,000	
サカイオーベックス	69,000	103	7,107,000	
住江織物	59,000	142	8,378,000	
日本フェルト	13,000	395	5,135,000	
イチカワ	16,000	147	2,352,000	
日本バイリーン	30,000	330	9,900,000	
芦森工業	55,000	97	5,335,000	
アツギ	186,000	95	17,670,000	
ダイニック	48,000	136	6,528,000	
セーレン	58,500	547	31,999,500	
東海染工	36,000	84	3,024,000	
小松精練	37,000	374	13,838,000	
ワコールホールディングス	140,000	899	125,860,000	
ホギメディカル	14,800	3,270	48,396,000	
レナウン	53,100	116	6,159,600	
クラウディア	3,200	988	3,161,600	
T S Iホールディングス	105,400	391	41,211,400	
三陽商会	115,000	234	26,910,000	
オンワードホールディングス	144,000	598	86,112,000	
ルック	40,000	404	16,160,000	
ゴールドウイン	54,000	482	26,028,000	
デサント	59,000	419	24,721,000	
ヤマトインターナショナル	14,800	375	5,550,000	
特種東海製紙	148,000	178	26,344,000	
王子製紙	1,036,000	269	278,684,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三菱製紙	333,000	73	24,309,000	
北越紀州製紙	145,500	386	56,163,000	
中越パルプ工業	89,000	137	12,193,000	
巴川製紙所	41,000	146	5,986,000	
大王製紙	99,000	409	40,491,000	
日本製紙グループ本社	113,200	1,146	129,727,200	
レンゴー	188,000	438	82,344,000	

トーモク	74,000	209	15,466,000	
ザ・パック	13,800	1,326	18,298,800	
クラレ	372,700	1,019	379,781,300	
旭化成	1,365,000	417	569,205,000	
共和レザー	13,900	271	3,766,900	
コープケミカル	35,000	97	3,395,000	
昭和電工	1,457,000	156	227,292,000	
住友化学	1,612,000	241	388,492,000	
日本化成	44,000	115	5,060,000	
住友精化	44,000	284	12,496,000	
日産化学工業	178,400	689	122,917,600	
ラサ工業	94,000	82	7,708,000	
クレハ	152,000	316	48,032,000	
テイカ	39,000	252	9,828,000	
石原産業	394,000	69	27,186,000	
片倉チッカリン	17,000	212	3,604,000	
日本曹達	140,000	296	41,440,000	
東ソー	627,000	204	127,908,000	
トクヤマ	365,000	185	67,525,000	
セントラル硝子	224,000	303	67,872,000	
東亜合成	294,000	297	87,318,000	
ダイソー	93,000	220	20,460,000	
関東電化工業	52,000	247	12,844,000	
電気化学工業	492,000	277	136,284,000	
信越化学工業	420,600	4,170	1,753,902,000	
日本カーバイド工業	74,000	109	8,066,000	
堺化学工業	73,000	259	18,907,000	
エア・ウォーター	193,000	889	171,577,000	
大陽日酸	308,000	455	140,140,000	
日本化学工業	93,000	112	10,416,000	
日本パーカライジング	55,000	1,125	61,875,000	
高压ガス工業	35,000	482	16,870,000	
チタン工業	25,000	258	6,450,000	
四国化成工業	34,000	439	14,926,000	
戸田工業	30,000	372	11,160,000	
ステラ ケミファ	11,100	1,308	14,518,800	
保土谷化学工業	47,000	224	10,528,000	
日本触媒	170,000	918	156,060,000	
大日精化工業	84,000	313	26,292,000	
カネカ	292,000	429	125,268,000	
三菱瓦斯化学	403,000	463	186,589,000	
三井化学	995,000	196	195,020,000	
J S R	213,500	1,375	293,562,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京応化工業	42,100	1,728	72,748,800	
大阪有機化学工業	14,400	402	5,788,800	
三菱ケミカルホールディングス	1,466,500	343	503,009,500	
日本合成化学工業	48,000	447	21,456,000	
ダイセル	305,000	464	141,520,000	
住友ベークライト	201,000	395	79,395,000	
積水化学工業	488,000	686	334,768,000	
日本ゼオン	219,000	576	126,144,000	
アイカ工業	61,100	1,135	69,348,500	
宇部興産	982,000	172	168,904,000	

積水樹脂	35,000	772	27,020,000	
タキロン	55,000	251	13,805,000	
旭有機材工業	83,000	198	16,434,000	
日立化成工業	101,400	1,248	126,547,200	
ニチバン	23,000	243	5,589,000	
リケンテクノス	38,000	211	8,018,000	
大倉工業	56,000	195	10,920,000	
積水化成品工業	61,000	252	15,372,000	
群栄化学工業	63,000	207	13,041,000	
タイガースポリマー	12,100	312	3,775,200	
日本カーリット	18,700	382	7,143,400	
日本化薬	165,000	699	115,335,000	
日本精化	19,500	524	10,218,000	
A D E K A	100,900	660	66,594,000	
日油	183,000	392	71,736,000	
ハリマ化成	20,000	396	7,920,000	
花王	622,000	2,046	1,272,612,000	
第一工業製薬	42,000	220	9,240,000	
三洋化成工業	74,000	453	33,522,000	
大日本塗料	135,000	85	11,475,000	
日本ペイント	221,000	608	134,368,000	
関西ペイント	265,000	813	215,445,000	
中国塗料	72,000	349	25,128,000	
日本特殊塗料	18,200	292	5,314,400	
藤倉化成	29,600	395	11,692,000	
太陽ホールディングス	19,100	1,931	36,882,100	
D I C	895,000	141	126,195,000	
サカタインクス	44,000	371	16,324,000	
東洋インキ S Cホールディングス	211,000	272	57,392,000	
富士フィルムホールディングス	501,000	1,499	750,999,000	
資生堂	389,400	1,199	466,890,600	
ライオン	270,000	435	117,450,000	
高砂香料工業	77,000	385	29,645,000	
マンダム	23,500	1,918	45,073,000	
ミルボン	12,500	2,361	29,512,500	
ファンケル	58,900	949	55,896,100	
コーセー	37,900	1,769	67,045,100	
ドクターシーラボ	159	224,000	35,616,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	23,900	2,281	54,515,900	
エステー	14,400	892	12,844,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コニシ	17,000	1,075	18,275,000	
長谷川香料	29,700	1,009	29,967,300	
星光 P M C	9,700	304	2,948,800	
小林製薬	32,500	4,155	135,037,500	
荒川化学工業	18,300	637	11,657,100	
メック	16,900	235	3,971,500	
日本高純度化学	66	179,700	11,860,200	
荏原ユーザライト	3,200	2,220	7,104,000	
アース製薬	16,900	2,863	48,384,700	
イハラケミカル工業	40,000	324	12,960,000	
北興化学工業	23,000	205	4,715,000	
大成ラミック	6,800	2,302	15,653,600	
クミアイ化学工業	55,000	316	17,380,000	

日本農薬	54,000	342	18,468,000	
アキレス	195,000	101	19,695,000	
有沢製作所	38,900	226	8,791,400	
日東電工	193,300	3,295	636,923,500	
レック	7,000	981	6,867,000	
きもと	19,800	406	8,038,800	
藤森工業	16,900	1,421	24,014,900	
前澤化成工業	21,900	789	17,279,100	
JSP	15,800	1,059	16,732,200	
エフピコ	10,400	4,765	49,556,000	
天馬	18,900	828	15,649,200	
信越ポリマー	46,000	361	16,606,000	
東リ	90,000	143	12,870,000	
ニフコ	52,300	1,827	95,552,100	
日本バルカー工業	92,000	205	18,860,000	
ユニ・チャーム	129,500	4,240	549,080,000	
協和発酵キリン	321,000	792	254,232,000	
武田薬品工業	878,500	3,325	2,921,012,500	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	520,600	3,120	1,624,272,000	
大日本住友製薬	166,000	752	124,832,000	
塩野義製薬	366,200	990	362,538,000	
田辺三菱製薬	234,200	1,058	247,783,600	
わかもと製薬	27,000	179	4,833,000	
あすか製薬	28,000	445	12,460,000	
日本新薬	49,000	896	43,904,000	
中外製薬	272,400	1,425	388,170,000	
科研製薬	92,000	1,026	94,392,000	
エーザイ	288,700	3,255	939,718,500	
ロート製薬	98,000	903	88,494,000	
小野薬品工業	114,700	4,445	509,841,500	
久光製薬	72,800	3,560	259,168,000	
有機合成薬品工業	17,000	188	3,196,000	
持田製薬	81,000	848	68,688,000	
参天製薬	78,800	2,867	225,919,600	
扶桑薬品工業	79,000	209	16,511,000	
日本ケミファ	36,000	382	13,752,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ツムラ	64,000	1,863	119,232,000	
日医工	39,600	1,439	56,984,400	
キッセイ薬品工業	43,500	1,311	57,028,500	
生化学工業	44,800	779	34,899,200	
栄研化学	18,200	1,030	18,746,000	
日水製薬	9,400	758	7,125,200	
鳥居薬品	16,000	1,546	24,736,000	
東和薬品	11,900	4,280	50,932,000	
沢井製薬	15,400	8,600	132,440,000	
ゼリア新薬工業	34,000	1,269	43,146,000	
第一三共	788,800	1,264	997,043,200	
キョーリン製薬ホールディングス	57,000	1,600	91,200,000	
大幸薬品	10,900	697	7,597,300	
ダイト	6,500	1,028	6,682,000	
大塚ホールディングス	465,500	2,436	1,133,958,000	
大正製薬ホールディングス	56,400	6,210	350,244,000	

日本コークス工業	189,000	99	18,711,000	
昭和シェル石油	209,600	474	99,350,400	
コスモ石油	648,000	196	127,008,000	
ニチレキ	35,000	380	13,300,000	
東燃ゼネラル石油	354,000	723	255,942,000	
ユシロ化学工業	12,700	780	9,906,000	
ピーピー・カストロール	9,600	331	3,177,600	
AOCホールディングス	54,400	333	18,115,200	
MORESCO	4,900	810	3,969,000	
出光興産	27,800	6,820	189,596,000	
JXホールディングス	2,602,800	385	1,002,078,000	
横浜ゴム	286,000	551	157,586,000	
東洋ゴム工業	177,000	229	40,533,000	
ブリヂストン	735,000	1,712	1,258,320,000	
住友ゴム工業	182,900	963	176,132,700	
藤倉ゴム工業	15,300	261	3,993,300	
オカモト	85,000	301	25,585,000	
フコク	9,800	733	7,183,400	
ニッタ	23,300	1,280	29,824,000	
東海ゴム工業	43,600	794	34,618,400	
三ツ星ベルト	62,000	359	22,258,000	
バンドー化学	83,000	293	24,319,000	
日東紡績	173,000	231	39,963,000	
旭硝子	1,155,000	540	623,700,000	
日本板硝子	1,005,000	83	83,415,000	
石塚硝子	32,000	131	4,192,000	
日本山村硝子	94,000	164	15,416,000	
日本電気硝子	450,000	473	212,850,000	
オハラ	9,200	754	6,936,800	
住友大阪セメント	476,000	226	107,576,000	
太平洋セメント	1,377,000	159	218,943,000	
デイ・シイ	22,700	256	5,811,200	
日本ヒューム	28,000	335	9,380,000	
日本コンクリート工業	43,000	232	9,976,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東海カーボン	203,000	344	69,832,000	
日本カーボン	108,000	187	20,196,000	
東洋炭素	11,600	2,343	27,178,800	
ノリタケカンパニーリミテド	122,000	199	24,278,000	
TOTO	362,000	533	192,946,000	
日本碍子	305,000	835	254,675,000	
日本特殊陶業	202,000	1,025	207,050,000	
MARUWA	6,900	2,406	16,601,400	
品川リフラクトリーズ	60,000	177	10,620,000	
黒崎播磨	52,000	177	9,204,000	
東京窯業	30,000	170	5,100,000	
ニッカトー	8,800	474	4,171,200	
フジミインコーポレーテッド	21,600	1,135	24,516,000	
ニチアス	114,000	379	43,206,000	
ニチハ	31,200	784	24,460,800	
新日本製鐵	6,153,000	172	1,058,316,000	
住友金属工業	4,344,000	125	543,000,000	
神戸製鋼所	3,249,000	92	298,908,000	
日新製鋼	830,000	98	81,340,000	

合同製鐵	132,000	160	21,120,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	555,400	1,291	717,021,400	
東京製鐵	118,600	449	53,251,400	
共英製鋼	25,100	1,345	33,759,500	
大和工業	53,300	2,228	118,752,400	
東京鐵鋼	46,000	226	10,396,000	
大阪製鐵	14,800	1,401	20,734,800	
淀川製鋼所	167,000	286	47,762,000	
東洋鋼鈑	57,000	269	15,333,000	
住友鋼管	13,900	695	9,660,500	
丸一鋼管	71,900	1,617	116,262,300	
モリ工業	36,000	228	8,208,000	
大同特殊鋼	393,000	461	181,173,000	
日本高周波鋼業	94,000	85	7,990,000	
日本金属工業	184,000	54	9,936,000	
日本冶金工業	174,000	104	18,096,000	
山陽特殊製鋼	117,000	327	38,259,000	
愛知製鋼	125,000	301	37,625,000	
日立金属	153,000	923	141,219,000	
日本金属	57,000	125	7,125,000	
大太平洋金属	163,000	319	51,997,000	
日本電工	85,000	284	24,140,000	
栗本鐵工所	113,000	181	20,453,000	
日本鑄鉄管	26,000	148	3,848,000	
三菱製鋼	142,000	196	27,832,000	
日亜鋼業	37,000	192	7,104,000	
日本精線	16,000	357	5,712,000	
シンニッタン	20,600	375	7,725,000	
新家工業	89,000	107	9,523,000	
日本軽金属	531,000	108	57,348,000	
大紀アルミニウム工業所	37,000	220	8,140,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三井金属鉱業	637,000	177	112,749,000	
東邦亜鉛	133,000	296	39,368,000	
三菱マテリアル	1,463,000	224	327,712,000	
住友金属鉱山	607,000	889	539,623,000	
DOWAホールディングス	280,000	471	131,880,000	
古河機械金属	397,000	67	26,599,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,000	2,468	56,764,000	
東邦チタニウム	38,200	856	32,699,200	
住友軽金属工業	569,000	82	46,658,000	
古河スカイ	96,000	219	21,024,000	
古河電気工業	737,000	179	131,923,000	
住友電気工業	828,100	924	765,164,400	
フジクラ	351,000	229	80,379,000	
昭和電線ホールディングス	326,000	67	21,842,000	
タツタ電線	48,000	480	23,040,000	
日立電線	192,000	182	34,944,000	
沖電線	36,000	136	4,896,000	
カナレ電気	2,900	1,333	3,865,700	
平河ヒューテック	4,600	693	3,187,800	
リョービ	131,000	223	29,213,000	
アサヒホールディングス	32,900	1,485	48,856,500	
稲葉製作所	11,600	1,047	12,145,200	

三協・立山ホールディングス	334,000	128	42,752,000	
トーカロ	13,300	1,217	16,186,100	
アルファＣο	7,800	872	6,801,600	
SUMCO	143,400	790	113,286,000	
川田テクノロジーズ	6,900	1,033	7,127,700	
東洋製罐	165,700	894	148,135,800	
ホッカンホールディングス	57,000	234	13,338,000	
コロナ	11,200	967	10,830,400	
横河ブリッジホールディングス	51,000	498	25,398,000	
駒井ハルテック	53,000	223	11,819,000	
高田機工	30,000	165	4,950,000	
三和ホールディングス	245,000	313	76,685,000	
文化シャッター	78,000	323	25,194,000	
東洋シャッター	19,600	384	7,526,400	
住生活グループ	304,700	1,528	465,581,600	
日本ファイルコン	17,400	388	6,751,200	
ノーリツ	45,900	1,454	66,738,600	
長府製作所	24,900	1,827	45,492,300	
リンナイ	37,700	4,990	188,123,000	
ダイニチ工業	12,700	649	8,242,300	
日東精工	31,000	215	6,665,000	
三洋工業	57,000	149	8,493,000	
岡部	56,200	446	25,065,200	
東プレ	45,100	675	30,442,500	
高周波熱錬	31,400	613	19,248,200	
東京製綱	160,000	142	22,720,000	
パイオラックス	10,000	1,758	17,580,000	
日本発條	169,700	850	144,245,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
中央発條	31,000	271	8,401,000	
三益半導体工業	19,700	644	12,686,800	
アタカ大機	15,000	237	3,555,000	
日本製鋼所	362,000	404	146,248,000	
日立ツール	14,200	750	10,650,000	
三浦工業	34,800	2,023	70,400,400	
タクマ	79,000	351	27,729,000	
ツガミ	63,000	613	38,619,000	
オークマ	142,000	527	74,834,000	
東芝機械	129,000	394	50,826,000	
アマダ	331,000	463	153,253,000	
アイダエンジニアリング	61,800	454	28,057,200	
牧野フライス製作所	118,000	483	56,994,000	
オーエスジー	103,200	1,129	116,512,800	
ダイジェット工業	31,000	150	4,650,000	
旭ダイヤモンド工業	58,400	836	48,822,400	
森精機製作所	123,600	666	82,317,600	
ディスコ	23,600	4,410	104,076,000	
日東工器	14,000	1,602	22,428,000	
豊和工業	131,000	67	8,777,000	
大阪機工	96,000	98	9,408,000	
東洋機械金属	20,100	197	3,959,700	
津田駒工業	61,000	142	8,662,000	
島精機製作所	31,000	1,274	39,494,000	
日阪製作所	30,000	758	22,740,000	

やまびこ	9,200	1,012	9,310,400	
ペガサスミシン製造	24,900	167	4,158,300	
ナブテスコ	97,300	1,795	174,653,500	
三井海洋開発	19,400	1,405	27,257,000	
レオン自動機	25,000	175	4,375,000	
S M C	70,000	13,140	919,800,000	
新川	18,100	399	7,221,900	
ホソカワミクロン	40,000	390	15,600,000	
ユニオンツール	13,300	1,201	15,973,300	
オイレス工業	25,600	1,595	40,832,000	
サトーホールディングス	24,800	1,085	26,908,000	
日本エアーテック	8,600	333	2,863,800	
日精樹脂工業	20,400	318	6,487,200	
ワイエイシー	9,400	567	5,329,800	
小松製作所	1,093,800	1,913	2,092,439,400	
住友重機械工業	598,000	333	199,134,000	
日立建機	119,700	1,491	178,472,700	
日工	32,000	287	9,184,000	
巴工業	8,900	1,510	13,439,000	
井関農機	240,000	174	41,760,000	
T O W A	20,900	548	11,453,200	
丸山製作所	52,000	147	7,644,000	
北川鉄工所	107,000	121	12,947,000	
クボタ	1,073,000	686	736,078,000	
荏原実業	5,500	1,225	6,737,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三菱化工機	72,000	123	8,856,000	
月島機械	35,000	687	24,045,000	
帝国電機製作所	8,300	1,503	12,474,900	
新東工業	51,900	746	38,717,400	
澁谷工業	15,300	855	13,081,500	
アイチ コーポレーション	38,700	342	13,235,400	
小森コーポレーション	67,500	561	37,867,500	
鶴見製作所	18,000	616	11,088,000	
住友精密工業	35,000	419	14,665,000	
酒井重工業	44,000	249	10,956,000	
荏原製作所	382,000	280	106,960,000	
石井鐵工所	34,000	149	5,066,000	
西島製作所	27,700	807	22,353,900	
ダイキン工業	285,300	2,100	599,130,000	
オルガノ	44,000	474	20,856,000	
トーヨーカネツ	125,000	151	18,875,000	
栗田工業	129,300	1,772	229,119,600	
椿本チエイン	120,000	444	53,280,000	
大同工業	50,000	137	6,850,000	
日本コンベヤ	72,000	73	5,256,000	
木村化工機	21,500	327	7,030,500	
アネスト岩田	38,000	367	13,946,000	
ダイフク	103,000	485	49,955,000	
加藤製作所	53,000	390	20,670,000	
油研工業	45,000	153	6,885,000	
タダノ	108,000	587	63,396,000	
フジテック	65,000	479	31,135,000	
シーケーディ	63,100	568	35,840,800	

キトー	104	59,500	6,188,000	
平和	48,600	1,399	67,991,400	
理想科学工業	16,300	1,352	22,037,600	
SANKYO	67,900	3,770	255,983,000	
日本金銭機械	20,600	645	13,287,000	
マースエンジニアリング	12,600	1,608	20,260,800	
福島工業	6,100	1,040	6,344,000	
オーイズミ	7,800	222	1,731,600	
ダイコク電機	10,300	1,470	15,141,000	
アマノ	68,300	659	45,009,700	
サンデン	117,000	295	34,515,000	
マックス	36,000	895	32,220,000	
グローリー	66,800	1,513	101,068,400	
大和冷機工業	32,000	388	12,416,000	
セガサミーホールディングス	240,700	1,490	358,643,000	
日本ピストンリング	82,000	153	12,546,000	
リケン	82,000	306	25,092,000	
T P R	24,800	1,294	32,091,200	
ホシザキ電機	45,100	1,945	87,719,500	
大豊工業	15,800	887	14,014,600	
日本精工	498,000	499	248,502,000	
N T N	518,000	249	128,982,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ジェイテクト	214,100	801	171,494,100	
不二越	225,000	347	78,075,000	
日本トムソン	72,000	372	26,784,000	
T H K	148,900	1,529	227,668,100	
ユーシン精機	11,500	1,576	18,124,000	
前澤給装工業	12,800	1,013	12,966,400	
イーグル工業	28,000	714	19,992,000	
前澤工業	16,400	204	3,345,600	
日本ピラー工業	23,000	663	15,249,000	
キッツ	92,600	305	28,243,000	
日立工機	60,800	632	38,425,600	
マキタ	146,000	2,850	416,100,000	
日立造船	885,500	90	79,695,000	
三菱重工業	3,753,000	326	1,223,478,000	
I H I	1,530,000	162	247,860,000	
イビデン	146,900	1,451	213,151,900	
コニカミノルタホールディングス	591,500	592	350,168,000	
ブラザー工業	289,500	885	256,207,500	
ミネベア	333,000	328	109,224,000	
日立製作所	5,160,000	464	2,394,240,000	
東芝	4,714,000	300	1,414,200,000	
三菱電機	2,240,000	634	1,420,160,000	
富士電機	675,000	184	124,200,000	
東洋電機製造	44,000	243	10,692,000	
安川電機	263,000	597	157,011,000	
シンフォニアテクノロジー	135,000	152	20,520,000	
明電舎	222,000	272	60,384,000	
オリジン電気	33,000	307	10,131,000	
デンヨー	20,800	1,021	21,236,800	
東芝テック	141,000	271	38,211,000	
芝浦メカトロニクス	40,000	169	6,760,000	

マブチモーター	30,500	3,160	96,380,000	
日本電産	121,100	6,650	805,315,000	
高岳製作所	89,000	162	14,418,000	
ダイヘン	132,000	225	29,700,000	
ヤーマン	1,800	1,106	1,990,800	
JVCケンウッド	136,500	256	34,944,000	
第一精工	7,000	1,428	9,996,000	
日新電機	45,000	422	18,990,000	
大崎電気工業	32,000	696	22,272,000	
オムロン	249,400	1,638	408,517,200	
日東工業	33,100	1,203	39,819,300	
I D E C	29,500	690	20,355,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	431,000	344	148,264,000	
サクサホールディングス	59,000	139	8,201,000	
メルコホールディングス	12,600	1,666	20,991,600	
テクノメディカ	17	321,000	5,457,000	
日本電気	3,079,000	116	357,164,000	
富士通	2,159,000	365	788,035,000	
沖電気工業	868,000	113	98,084,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
岩崎通信機	103,000	68	7,004,000	
電気興業	70,000	387	27,090,000	
サンケン電気	113,000	314	35,482,000	
ナカヨ通信機	23,000	302	6,946,000	
アイホン	13,200	1,565	20,658,000	
ルネサスエレクトロニクス	58,000	285	16,530,000	
セイコーエプソン	152,800	795	121,476,000	
ワコム	443	162,000	71,766,000	
アルバック	46,000	620	28,520,000	
アクセル	10,300	1,460	15,038,000	
ナナオ	19,000	1,602	30,438,000	
日本信号	52,100	515	26,831,500	
京三製作所	48,000	321	15,408,000	
能美防災	30,000	455	13,650,000	
ホーチキ	20,000	380	7,600,000	
日本無線	50,000	159	7,950,000	
パナソニック	2,558,500	569	1,455,786,500	
シャープ	1,081,000	424	458,344,000	
アンリツ	116,000	819	95,004,000	
富士通ゼネラル	54,000	597	32,238,000	
日立国際電気	51,000	647	32,997,000	
ソニー	1,397,100	1,047	1,462,763,700	
T D K	117,100	3,640	426,244,000	
帝国通信工業	53,000	123	6,519,000	
ミツミ電機	79,700	573	45,668,100	
タムラ製作所	75,000	192	14,400,000	
アルプス電気	176,700	611	107,963,700	
パイオニア	317,400	299	94,902,600	
日本電波工業	17,300	940	16,262,000	
日本トリム	2,850	1,841	5,246,850	
ローランド ディー . ジー .	10,300	851	8,765,300	
フォスター電機	21,200	1,236	26,203,200	
クラリオン	139,000	173	24,047,000	
S M K	71,000	244	17,324,000	

ヨコオ	17,500	407	7,122,500	
東光	102,000	197	20,094,000	
ホシデン	60,700	477	28,953,900	
ヒロセ電機	39,000	7,490	292,110,000	
日本航空電子工業	51,000	707	36,057,000	
TOA	25,000	618	15,450,000	
ユニデン	67,000	202	13,534,000	
アルパイン	44,100	894	39,425,400	
スミダコーポレーション	13,900	400	5,560,000	
アイコム	12,600	1,904	23,990,400	
リオン	4,900	533	2,611,700	
船井電機	20,400	1,115	22,746,000	
横河電機	242,800	754	183,071,200	
新電元工業	79,000	263	20,777,000	
アズビル	57,500	1,564	89,930,000	
日本光電工業	44,600	2,238	99,814,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
チノー	40,000	206	8,240,000	
共和電業	23,000	230	5,290,000	
日本電子材料	8,800	364	3,203,200	
堀場製作所	41,400	2,685	111,159,000	
アドバンテスト	166,500	1,143	190,309,500	
小野測器	24,000	305	7,320,000	
エスベック	23,200	765	17,748,000	
パナソニック電工SUNX	19,600	345	6,762,000	
キーエンス	55,000	18,580	1,021,900,000	
日置電機	10,700	1,479	15,825,300	
シスメックス	78,800	3,030	238,764,000	
メガチップス	18,400	1,722	31,684,800	
OBARA GROUP	16,600	922	15,305,200	
日本電産コバル電子	23,100	436	10,071,600	
ミヤチテクノス	11,200	556	6,227,200	
東京電波	6,500	321	2,086,500	
澤藤電機	12,000	217	2,604,000	
コーセル	32,600	883	28,785,800	
日立メディコ	16,000	1,054	16,864,000	
新日本無線	14,000	171	2,394,000	
オプテックス	15,400	979	15,076,600	
千代田インテグレ	10,800	910	9,828,000	
東光電気	14,000	308	4,312,000	
スタンレー電気	150,200	1,137	170,777,400	
岩崎電気	82,000	137	11,234,000	
ウシオ電機	135,900	893	121,358,700	
岡谷電機産業	12,000	286	3,432,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	23,700	150	3,555,000	
日本セラミック	14,600	1,356	19,797,600	
日本デジタル研究所	18,900	834	15,762,600	
古河電池	16,000	436	6,976,000	
双信電機	10,800	301	3,250,800	
山一電機	22,700	152	3,450,400	
図研	15,200	601	9,135,200	
日本電子	83,000	184	15,272,000	
カシオ計算機	213,400	479	102,218,600	
ファナック	233,200	13,700	3,194,840,000	

日本シイエムケイ	48,200	314	15,134,800	
エンプラス	11,300	2,060	23,278,000	
ローム	110,400	2,932	323,692,800	
浜松ホトニクス	87,400	2,646	231,260,400	
三井ハイテック	29,500	359	10,590,500	
新光電気工業	75,200	639	48,052,800	
京セラ	186,200	6,580	1,225,196,000	
太陽誘電	100,500	809	81,304,500	
村田製作所	234,900	4,365	1,025,338,500	
ユーシン	31,200	462	14,414,400	
双葉電子工業	38,800	1,165	45,202,000	
北陸電気工業	90,000	86	7,740,000	
ニチコン	70,500	794	55,977,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本ケミコン	129,000	235	30,315,000	
K O A	28,100	730	20,513,000	
市光工業	54,000	129	6,966,000	
小糸製作所	112,000	1,067	119,504,000	
ミツバ	41,000	574	23,534,000	
スター精密	36,700	791	29,029,700	
大日本スクリーン製造	212,000	611	129,532,000	
キヤノン電子	20,500	1,684	34,522,000	
キヤノン	1,391,100	3,240	4,507,164,000	
リコー	673,000	602	405,146,000	
日本電産サンキョー	53,000	449	23,797,000	
M U T O Hホールディングス	24,000	220	5,280,000	
東京エレクトロン	188,400	3,710	698,964,000	
トヨタ紡織	78,300	886	69,373,800	
鬼怒川ゴム工業	52,000	490	25,480,000	
ユニプレス	35,900	2,122	76,179,800	
豊田自動織機	203,900	2,148	437,977,200	
モリタホールディングス	36,000	520	18,720,000	
三櫻工業	28,400	625	17,750,000	
デンソー	553,200	2,452	1,356,446,400	
東海理化電機製作所	52,400	1,326	69,482,400	
三井造船	867,000	106	91,902,000	
佐世保重工業	146,000	91	13,286,000	
川崎重工業	1,628,000	215	350,020,000	
日本車輛製造	82,000	262	21,484,000	
日本輸送機	29,000	227	6,583,000	
近畿車輛	34,000	250	8,500,000	
日産自動車	2,849,200	773	2,202,431,600	
いすゞ自動車	1,416,000	416	589,056,000	
トヨタ自動車	2,903,800	3,070	8,914,666,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	320,000	527	168,640,000	
三菱自動車工業	5,006,000	79	395,474,000	
エフテック	7,800	1,211	9,445,800	
武蔵精密工業	21,700	1,550	33,635,000	
日産車体	66,000	822	54,252,000	
新明和工業	100,000	360	36,000,000	
極東開発工業	38,600	704	27,174,400	
日信工業	41,000	1,066	43,706,000	
トピー工業	168,000	218	36,624,000	

ティラド	81,000	264	21,384,000	
曙ブレーキ工業	113,600	374	42,486,400	
タチエス	29,200	1,391	40,617,200	
NOK	108,300	1,676	181,510,800	
フタバ産業	63,400	374	23,711,600	
カヤバ工業	155,000	335	51,925,000	
シロキ工業	50,000	209	10,450,000	
大同メタル工業	34,000	789	26,826,000	
プレス工業	103,000	376	38,728,000	
カルソニックカンセイ	133,000	447	59,451,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
太平洋工業	46,000	473	21,758,000	
ケーヒン	46,300	1,169	54,124,700	
河西工業	28,000	457	12,796,000	
アイシン精機	184,400	2,512	463,212,800	
富士機工	26,000	268	6,968,000	
マツダ	3,004,000	102	306,408,000	
ダイハツ工業	208,000	1,337	278,096,000	
今仙電機製作所	16,500	1,098	18,117,000	
本田技研工業	1,889,300	2,562	4,840,386,600	
スズキ	468,100	1,630	763,003,000	
富士重工業	708,000	614	434,712,000	
ヤマハ発動機	364,800	769	280,531,200	
ショーワ	47,600	629	29,940,400	
T B K	23,000	434	9,982,000	
エクセディ	30,400	1,616	49,126,400	
豊田合成	63,300	1,632	103,305,600	
愛三工業	23,200	666	15,451,200	
ヨロズ	13,400	1,222	16,374,800	
エフ・シー・シー	36,600	1,365	49,959,000	
シマノ	83,800	4,940	413,972,000	
タカタ	40,500	1,651	66,865,500	
テイ・エス テック	47,300	1,416	66,976,800	
日本電産トーソク	10,800	646	6,976,800	
テルモ	158,400	2,949	467,121,600	
クリエートメディック	6,700	800	5,360,000	
日機装	73,000	812	59,276,000	
島津製作所	268,000	663	177,684,000	
J M S	34,000	253	8,602,000	
クボテック	48	17,050	818,400	
モリテックス	4,800	250	1,200,000	
長野計器	15,700	585	9,184,500	
バイ・テクノロジー	40	187,500	7,500,000	
東京計器	77,000	129	9,933,000	
愛知時計電機	41,000	287	11,767,000	
東京精密	40,200	1,404	56,440,800	
ニコン	390,200	2,263	883,022,600	
トプコン	51,600	628	32,404,800	
オリンパス	264,100	1,244	328,540,400	
理研計器	18,100	481	8,706,100	
タムロン	19,300	2,319	44,756,700	
HOYA	544,500	1,718	935,451,000	
ノーリツ鋼機	21,100	356	7,511,600	
エー・アンド・デイ	21,800	286	6,234,800	

日本電産コバル	17,500	792	13,860,000	
シチズンホールディングス	268,000	471	126,228,000	
リズム時計工業	105,000	126	13,230,000	
大研医器	2,800	957	2,679,600	
松風	10,900	875	9,537,500	
セイコーホールディングス	132,000	237	31,284,000	
ニプロ	116,100	449	52,128,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
パラマウントベッドホールディングス	19,200	2,316	44,467,200	
SHO-BI	4,800	461	2,212,800	
永大産業	42,000	324	13,608,000	
ダンロップスポーツ	14,600	952	13,899,200	
バンダイナムコホールディングス	235,600	941	221,699,600	
共立印刷	27,100	249	6,747,900	
フランスベッドホールディングス	153,000	170	26,010,000	
パイロットコーポレーション	195	143,300	27,943,500	
トッパン・フォームズ	48,400	616	29,814,400	
フジシールインターナショナル	25,100	1,396	35,039,600	
タカラトミー	74,600	500	37,300,000	
廣済堂	20,500	312	6,396,000	
タカノ	9,900	401	3,969,900	
プロネクサス	25,200	506	12,751,200	
ホクシン	20,400	238	4,855,200	
ウッドワン	53,000	254	13,462,000	
大建工業	109,000	208	22,672,000	
凸版印刷	681,000	489	333,009,000	
大日本印刷	682,000	604	411,928,000	
図書印刷	38,000	127	4,826,000	
共同印刷	77,000	193	14,861,000	
日本写真印刷	37,900	813	30,812,700	
光村印刷	22,000	245	5,390,000	
宝印刷	13,000	560	7,280,000	
アシックス	208,600	897	187,114,200	
ツツミ	11,400	1,912	21,796,800	
ローランド	23,900	636	15,200,400	
小松ウオール工業	8,900	967	8,606,300	
ヤマハ	164,600	746	122,791,600	
河合楽器製作所	86,000	178	15,308,000	
クリナップ	33,800	489	16,528,200	
ピジョン	19,700	3,255	64,123,500	
兼松日産農林	43,000	140	6,020,000	
キングジム	19,100	677	12,930,700	
リンテック	42,700	1,400	59,780,000	
イトーキ	48,300	393	18,981,900	
任天堂	128,100	8,730	1,118,313,000	
三菱鉛筆	18,400	1,311	24,122,400	
タカラスタANDARD	110,000	576	63,360,000	
コクヨ	116,400	555	64,602,000	
ナカバヤシ	47,000	167	7,849,000	
グローブライド	114,000	90	10,260,000	
岡村製作所	79,000	518	40,922,000	
美津濃	112,000	407	45,584,000	
アデランス	28,500	973	27,730,500	

東京電力	1,787,900	160	286,064,000	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	737,900	1,200	885,480,000	
関西電力	913,800	1,061	969,541,800	
中国電力	309,600	1,209	374,306,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
北陸電力	219,400	1,152	252,748,800	
東北電力	559,500	727	406,756,500	
四国電力	202,500	1,672	338,580,000	
九州電力	494,600	919	454,537,400	
北海道電力	209,600	935	195,976,000	
沖縄電力	13,400	2,476	33,178,400	
電源開発	139,000	1,961	272,579,000	
東京瓦斯	2,702,000	376	1,015,952,000	
大阪瓦斯	2,173,000	308	669,284,000	
東邦瓦斯	569,000	458	260,602,000	
北海道瓦斯	40,000	246	9,840,000	
西部瓦斯	252,000	195	49,140,000	
静岡瓦斯	58,500	503	29,425,500	
東武鉄道	1,271,000	371	471,541,000	
相鉄ホールディングス	358,000	251	89,858,000	
東京急行電鉄	1,318,000	349	459,982,000	
京浜急行電鉄	575,000	685	393,875,000	
小田急電鉄	717,000	736	527,712,000	
京王電鉄	626,000	535	334,910,000	
京成電鉄	360,000	633	227,880,000	
富士急行	61,000	448	27,328,000	
新京成電鉄	29,000	344	9,976,000	
東日本旅客鉄道	389,400	4,635	1,804,869,000	
西日本旅客鉄道	194,700	3,080	599,676,000	
東海旅客鉄道	1,943	626,000	1,216,318,000	
西日本鉄道	290,000	333	96,570,000	
ハマキョウレックス	6,500	2,664	17,316,000	
サカイ引越センター	4,200	1,594	6,694,800	
近畿日本鉄道	2,023,000	297	600,831,000	
阪急阪神ホールディングス	1,503,000	387	581,661,000	
南海電気鉄道	467,000	335	156,445,000	
京阪電気鉄道	502,000	362	181,724,000	
名糖運輸	9,500	572	5,434,000	
名古屋鉄道	782,000	212	165,784,000	
日本通運	886,000	310	274,660,000	
ヤマトホールディングス	455,600	1,232	561,299,200	
山九	272,000	278	75,616,000	
丸運	13,000	192	2,496,000	
丸全昭和運輸	76,000	233	17,708,000	
センコー	90,000	371	33,390,000	
トナミホールディングス	47,000	150	7,050,000	
日本梱包運輸倉庫	67,300	916	61,646,800	
日本石油輸送	26,000	187	4,862,000	
福山通運	136,000	404	54,944,000	
セイノーホールディングス	173,000	524	90,652,000	
神奈川中央交通	26,000	417	10,842,000	
日立物流	46,800	1,341	62,758,800	
日本郵船	1,774,000	211	374,314,000	

商船三井	1,174,000	280	328,720,000	
川崎汽船	692,000	148	102,416,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NSユニテッド海運	98,000	109	10,682,000	
乾汽船	25,300	246	6,223,800	
飯野海運	108,600	343	37,249,800	
共栄タンカー	20,000	182	3,640,000	
第一中央汽船	149,000	89	13,261,000	
全日本空輸	2,985,000	218	650,730,000	
パスコ	22,000	223	4,906,000	
日新	85,000	199	16,915,000	
三菱倉庫	159,000	807	128,313,000	
三井倉庫	104,000	280	29,120,000	
住友倉庫	164,000	334	54,776,000	
澁澤倉庫	54,000	237	12,798,000	
東陽倉庫	37,000	175	6,475,000	
日本トランスシティ	47,000	250	11,750,000	
ケイヒン	43,000	92	3,956,000	
安田倉庫	17,800	494	8,793,200	
東洋埠頭	66,000	135	8,910,000	
宇徳	15,900	231	3,672,900	
上組	248,000	625	155,000,000	
サンリツ	6,200	499	3,093,800	
キムラユニティー	5,300	702	3,720,600	
キューソー流通システム	7,300	857	6,256,100	
郵船ロジスティクス	17,800	997	17,746,600	
近鉄エクスプレス	20,100	2,582	51,898,200	
東海運	14,900	216	3,218,400	
エーアイティー	2,000	1,171	2,342,000	
NECネットエスアイ	22,300	1,214	27,072,200	
システナ	262	60,200	15,772,400	
新日鉄ソリューションズ	14,800	1,376	20,364,800	
コア	8,300	669	5,552,700	
ソフトクリエイト	2,400	1,084	2,601,600	
デジタルハーツ	24	155,000	3,720,000	
ITホールディングス	67,200	890	59,808,000	
ネオス	50	49,100	2,455,000	
グリー	113,400	1,470	166,698,000	
コーエーテクモホールディングス	43,700	643	28,099,100	
三菱総合研究所	8,600	1,677	14,422,200	
ボルテージ	3,500	829	2,901,500	
ネクソン	150,400	1,387	208,604,800	
ダウンゴ	114	101,000	11,514,000	
ベリサーブ	13	118,500	1,540,500	
マクロミル	21,500	822	17,673,000	
ティーガイア	143	141,700	20,263,100	
GMOペイメントゲートウェイ	48	277,500	13,320,000	
ザッパラス	123	70,600	8,683,800	
インターネットイニシアティブ	129	306,000	39,474,000	
ソネットエンタテインメント	125	269,100	33,637,500	
SRAホールディングス	11,700	834	9,757,800	
朝日ネット	18,000	348	6,264,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,200	1,907	9,916,400	
フェイス	757	8,120	6,146,840	
野村総合研究所	125,200	1,688	211,337,600	
サイバネットシステム	181	20,100	3,638,100	
インテージ	6,700	1,444	9,674,800	
シンプレクス・ホールディングス	379	23,180	8,785,220	
クレスコ	5,500	627	3,448,500	
フジ・メディア・ホールディングス	2,302	125,000	287,750,000	
オービック	6,930	14,960	103,672,800	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,400	759	3,339,600	
ヤフー	16,186	23,470	379,885,420	
トレンドマイクロ	97,500	2,173	211,867,500	
日本オラクル	44,200	2,910	128,622,000	
アルファシステムズ	7,200	1,083	7,797,600	
フューチャーアーキテクト	266	31,000	8,246,000	
シーエーシー	15,000	646	9,690,000	
ソフトバンク・テクノロジー	5,300	733	3,884,900	
トーセ	5,400	512	2,764,800	
オービックビジネスコンサルタント	5,600	3,720	20,832,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,100	3,485	90,958,500	
アイティフォー	24,600	272	6,691,200	
東計電算	3,900	1,018	3,970,200	
エクスネット	20	115,600	2,312,000	
大塚商会	17,600	6,200	109,120,000	
サイボウズ	404	22,230	8,980,920	
ソフトブレーン	326	6,990	2,278,740	
アグレックス	5,900	719	4,242,100	
電通国際情報サービス	13,600	666	9,057,600	
ウェザーニューズ	5,900	2,326	13,723,400	
C I J	22,000	325	7,150,000	
WOWOW	68	168,000	11,424,000	
ネットワンシステムズ	99,800	1,009	100,698,200	
アルゴグラフィックス	8,300	1,060	8,798,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	42,200	1,146	48,361,200	
日本ユニシス	53,400	514	27,447,600	
兼松エレクトロニクス	14,300	870	12,441,000	
東京放送ホールディングス	132,400	903	119,557,200	
日本テレビ放送網	19,400	11,250	218,250,000	
テレビ朝日	560	113,200	63,392,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,677	30,600	51,316,200	
テレビ東京ホールディングス	14,100	901	12,704,100	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,700	554	10,359,800	
イー・アクセス	1,692	13,650	23,095,800	
NECモバイリング	8,100	3,030	24,543,000	
日本電信電話	1,017,800	3,350	3,409,630,000	
K D D I	3,430	492,000	1,687,560,000	
光通信	20,400	3,275	66,810,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,211	124,300	2,263,627,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
GMOインターネット	65,700	358	23,520,600	

学研ホールディングス	67,000	153	10,251,000	
ゼンリン	32,000	745	23,840,000	
昭文社	12,200	526	6,417,200	
角川グループホールディングス	20,900	1,960	40,964,000	
インプレスホールディングス	18,800	126	2,368,800	
アイネット	9,600	496	4,761,600	
松竹	145,000	743	107,735,000	
東宝	157,700	1,250	197,125,000	
東映	94,000	346	32,524,000	
葵プロモーション	10,500	511	5,365,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,365	227,000	309,855,000	
D T S	22,800	968	22,070,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,200	1,225	88,445,000	
シーイーシー	13,100	397	5,200,700	
カプコン	42,400	1,609	68,221,600	
ジャステック	14,000	451	6,314,000	
S C S K	45,100	1,075	48,482,500	
日本システムウエア	7,300	302	2,204,600	
アイネス	26,700	505	13,483,500	
T K C	20,500	1,570	32,185,000	
富士ソフト	29,000	1,256	36,424,000	
N S D	42,200	642	27,092,400	
コナミ	99,800	1,730	172,654,000	
福井コンピュータ	3,100	394	1,221,400	
J B C Cホールディングス	17,300	525	9,082,500	
ソフトバンク	1,001,300	2,556	2,559,322,800	
ハウスイ	19,000	100	1,900,000	
インターニックス	9,000	345	3,105,000	
高千穂交易	9,200	834	7,672,800	
伊藤忠食品	5,500	2,800	15,400,000	
エレマテック	15,700	1,033	16,218,100	
J A L U X	8,600	810	6,966,000	
あらた	50,000	375	18,750,000	
トーメンデバイス	3,300	1,916	6,322,800	
東京エレクトロン デバイス	44	137,700	6,058,800	
双日	1,479,300	125	184,912,500	
アルフレッサ ホールディングス	57,800	3,850	222,530,000	
横浜冷凍	55,000	565	31,075,000	
神栄	29,000	114	3,306,000	
山下医科器械	1,800	968	1,742,400	
ラサ商事	13,800	399	5,506,200	
アルコニックス	6,800	1,454	9,887,200	
あい ホールディングス	36,200	413	14,950,600	
ダイワボウホールディングス	217,000	144	31,248,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	41,500	715	29,672,500	
八洲電機	14,500	331	4,799,500	
U K Cホールディングス	13,100	965	12,641,500	
T O K A Iホールディングス	107,900	333	35,930,700	
ミタチ産業	5,100	371	1,892,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
シップヘルスケアホールディングス	28,700	1,722	49,421,400	
富士興産	79,000	62	4,898,000	
協栄産業	27,000	136	3,672,000	
小野建	19,500	633	12,343,500	

佐島電機	16,200	392	6,350,400	
エコトレーディング	5,500	695	3,822,500	
伯東	13,400	759	10,170,600	
コンドーテック	24,100	464	11,182,400	
中山福	13,500	623	8,410,500	
ナガイレーベン	29,500	1,171	34,544,500	
三菱食品	20,300	1,804	36,621,200	
松田産業	17,400	1,119	19,470,600	
メディカルホールディングス	238,000	1,020	242,760,000	
アドヴァン	19,600	789	15,464,400	
S P K	5,200	1,371	7,129,200	
アズワン	14,600	1,512	22,075,200	
スズデン	8,400	470	3,948,000	
尾家産業	7,300	761	5,555,300	
シモジマ	13,500	911	12,298,500	
ドウシシャ	11,100	2,052	22,777,200	
高速	13,100	643	8,423,300	
黒田電気	27,300	850	23,205,000	
丸文	17,600	331	5,825,600	
ハピネット	12,400	753	9,337,200	
トーメンエレクトロニクス	10,100	1,103	11,140,300	
エクセル	10,100	722	7,292,200	
マルカキカイ	7,900	875	6,912,500	
ガリバーインターナショナル	6,700	2,496	16,723,200	
日本エム・ディ・エム	18,400	219	4,029,600	
進和	13,700	909	12,453,300	
エスケイジャパン	7,300	246	1,795,800	
ダイトエレクトロン	10,100	347	3,504,700	
シークス	14,000	978	13,692,000	
田中商事	18,000	467	8,406,000	
オーハシテクニカ	12,400	546	6,770,400	
マクニカ	11,300	1,660	18,758,000	
白銅	7,400	682	5,046,800	
伊藤忠商事	1,763,200	831	1,465,219,200	
丸紅	1,934,000	500	967,000,000	
高島	39,000	357	13,923,000	
F & A アクアホールディングス	17,100	968	16,552,800	
長瀬産業	125,100	900	112,590,000	
蝶理	142,000	98	13,916,000	
豊田通商	246,200	1,457	358,713,400	
三共生興	38,600	258	9,958,800	
兼松	470,000	83	39,010,000	
ツカモトコーポレーション	42,000	122	5,124,000	
三井物産	1,907,800	1,129	2,153,906,200	
日本紙パルプ商事	115,000	269	30,935,000	
日立ハイテクノロジーズ	67,000	1,878	125,826,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
カメイ	29,000	782	22,678,000	
東都水産	37,000	123	4,551,000	
スターゼン	74,000	224	16,576,000	
山善	86,500	641	55,446,500	
椿本興業	23,000	227	5,221,000	
住友商事	1,304,400	1,066	1,390,490,400	
内田洋行	50,000	234	11,700,000	

三菱商事	1,609,600	1,544	2,485,222,400	
第一実業	51,000	367	18,717,000	
キヤノンマーケティングジャパン	73,500	934	68,649,000	
西華産業	81,000	231	18,711,000	
佐藤商事	20,100	507	10,190,700	
菱洋エレクトロ	24,400	813	19,837,200	
東京産業	22,000	254	5,588,000	
ユアサ商事	237,000	128	30,336,000	
神鋼商事	66,000	168	11,088,000	
阪和興業	221,000	289	63,869,000	
カナデン	25,000	488	12,200,000	
菱電商事	36,000	463	16,668,000	
フルサト工業	13,700	803	11,001,100	
岩谷産業	248,000	303	75,144,000	
すてきナイスグループ	102,000	201	20,502,000	
昭光通商	93,000	113	10,509,000	
ニチモウ	41,000	162	6,642,000	
極東貿易	34,000	139	4,726,000	
イワキ	33,000	168	5,544,000	
三愛石油	53,000	344	18,232,000	
稲畑産業	61,700	461	28,443,700	
G S I クレオス	57,000	100	5,700,000	
明和産業	22,700	714	16,207,800	
J F E 商事	151,000	343	51,793,000	
東邦ホールディングス	70,800	1,500	106,200,000	
サンゲツ	39,100	1,887	73,781,700	
ミツウロコグループホールディングス	35,500	513	18,211,500	
シナネン	47,000	337	15,839,000	
伊藤忠エネクス	48,800	425	20,740,000	
サンリオ	55,700	2,477	137,968,900	
サンワテクノス	10,800	658	7,106,400	
リョーサン	36,000	1,444	51,984,000	
新光商事	24,200	612	14,810,400	
トーヨー	46,000	307	14,122,000	
三信電気	31,600	523	16,526,800	
東陽テクニカ	32,000	808	25,856,000	
モスフードサービス	29,000	1,539	44,631,000	
加賀電子	23,900	804	19,215,600	
ソーダニッカ	23,000	333	7,659,000	
立花エレテック	14,200	707	10,039,400	
P a l t a c	23,300	1,036	24,138,800	
ヤマタネ	112,000	101	11,312,000	
丸紅建材リース	23,000	130	2,990,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日鐵商事	50,000	198	9,900,000	
トラスコ中山	28,400	1,616	45,894,400	
オートバックスセブン	26,200	3,910	102,442,000	
加藤産業	31,900	1,493	47,626,700	
イノテック	17,700	390	6,903,000	
イエローハット	20,900	1,353	28,277,700	
富士エレクトロニクス	11,300	1,025	11,582,500	
J K ホールディングス	31,800	340	10,812,000	
日伝	9,200	2,006	18,455,200	
北沢産業	48,000	151	7,248,000	

杉本商事	12,700	755	9,588,500	
因幡電機産業	26,000	2,122	55,172,000	
住金物産	112,000	188	21,056,000	
ミスミグループ本社	81,900	1,798	147,256,200	
江守商事	4,400	923	4,061,200	
アルテック	13,500	223	3,010,500	
タキヒヨー	34,000	435	14,790,000	
スズケン	84,900	2,497	211,995,300	
ジェコス	28,200	370	10,434,000	
ローソン	69,700	5,400	376,380,000	
サンエー	7,700	2,982	22,961,400	
キリン堂	10,500	528	5,544,000	
ダイユーエイト	4,000	617	2,468,000	
カワチ薬品	15,700	1,628	25,559,600	
エービーシー・マート	31,400	2,754	86,475,600	
ハードオフコーポレーション	10,800	503	5,432,400	
アスクル	15,200	922	14,014,400	
ゲオホールディングス	341	87,600	29,871,600	
ポイント	18,660	2,719	50,736,540	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	34,000	83	2,822,000	
くらコーポレーション	11,600	1,122	13,015,200	
キャンドゥ	122	95,700	11,675,400	
パル	6,450	3,710	23,929,500	
エディオン	88,300	372	32,847,600	
サーラコーポレーション	19,000	476	9,044,000	
あみやき亭	34	183,400	6,235,600	
ひらまつ	94	72,500	6,815,000	
ゲンキー	2,400	2,020	4,848,000	
ハニーズ	19,440	1,629	31,667,760	
アルペン	16,900	1,499	25,333,100	
ビックカメラ	840	37,450	31,458,000	
D C Mホールディングス	114,400	512	58,572,800	
MonotaRO	12,700	1,534	19,481,800	
J・フロントリテイリング	522,000	372	194,184,000	
ドトール・日レスホールディングス	35,200	987	34,742,400	
マツモトキヨシホールディングス	41,300	1,734	71,614,200	
スタートトゥデイ	40,200	1,039	41,767,800	
物語コーポレーション	2,900	1,468	4,257,200	
ココカラファイン	23,200	2,520	58,464,000	
三越伊勢丹ホールディングス	439,200	791	347,407,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
グローウェルホールディングス	7,900	2,506	19,797,400	
クリエイトSDホールディングス	9,600	2,125	20,400,000	
丸善CHIホールディングス	7,400	199	1,472,600	
ブックオフコーポレーション	12,300	628	7,724,400	
あさひ	12,800	1,106	14,156,800	
日本調剤	2,960	2,858	8,459,680	
コスモス薬品	9,900	4,545	44,995,500	
セブン&アイ・ホールディングス	924,600	2,316	2,141,373,600	
ツルハホールディングス	18,200	4,490	81,718,000	
サンマルクホールディングス	6,400	2,912	18,636,800	
フェリシモ	6,400	1,016	6,502,400	
トリドール	19,100	1,126	21,506,600	
クスリのアオキ	3,500	2,239	7,836,500	

メディカルシステムネットワーク	16,000	504	8,064,000	
総合メディカル	5,400	2,731	14,747,400	
はるやま商事	9,500	455	4,322,500	
カップ・クリエイト	16,250	1,694	27,527,500	
ライトオン	16,600	651	10,806,600	
良品計画	23,400	4,075	95,355,000	
三城ホールディングス	27,400	438	12,001,200	
コナカ	26,000	1,061	27,586,000	
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,211	3,148,600	
G - 7ホールディングス	6,900	383	2,642,700	
イオン北海道	15,400	342	5,266,800	
コジマ	29,900	292	8,730,800	
コーナン商事	24,200	997	24,127,400	
エコス	8,500	503	4,275,500	
ワタミ	26,400	1,602	42,292,800	
マルシェ	5,600	714	3,998,400	
ドン・キホーテ	59,000	2,747	162,073,000	
メガネトップ	31,700	828	26,247,600	
西松屋チェーン	48,500	671	32,543,500	
ゼンショーホールディングス	84,200	977	82,263,400	
幸楽苑	13,600	1,182	16,075,200	
ハークスレイ	5,700	550	3,135,000	
サイゼリヤ	32,800	1,169	38,343,200	
ポプラ	6,700	496	3,323,200	
ユナイテッドアローズ	23,800	1,899	45,196,200	
ハイデイ日高	11,700	1,216	14,227,200	
京都きもの友禅	14,700	928	13,641,600	
コロワイド	73,500	601	44,173,500	
壱番屋	8,900	2,287	20,354,300	
トップカルチャー	8,400	357	2,998,800	
スギホールディングス	39,600	2,514	99,554,400	
スクロール	28,800	280	8,064,000	
ファミリーマート	67,900	3,455	234,594,500	
木曽路	25,300	1,548	39,164,400	
千趣会	39,900	521	20,787,900	
タカキュー	18,000	143	2,574,000	
ケーヨー	41,500	483	20,044,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
上新電機	48,000	780	37,440,000	
日本瓦斯	21,100	882	18,610,200	
ベスト電器	69,500	135	9,382,500	
マルエツ	47,000	288	13,536,000	
ロイヤルホールディングス	36,900	944	34,833,600	
東天紅	17,000	126	2,142,000	
いなげや	25,200	928	23,385,600	
島忠	50,000	1,604	80,200,000	
チヨダ	29,000	1,613	46,777,000	
ライフコーポレーション	14,400	1,550	22,320,000	
カスミ	46,200	529	24,439,800	
リンガーハット	20,000	1,048	20,960,000	
MrMax	22,300	300	6,690,000	
テンアライド	17,200	261	4,489,200	
AOKIホールディングス	19,800	1,548	30,650,400	
オークワ	32,000	987	31,584,000	

コメリ	30,300	1,996	60,478,800	
青山商事	60,900	1,598	97,318,200	
しまむら	25,700	8,960	230,272,000	
C F S コーポレーション	15,900	362	5,755,800	
高島屋	299,000	554	165,646,000	
松屋	45,400	583	26,468,200	
エイチ・ツー・オー リテイリング	115,000	714	82,110,000	
ニッセンホールディングス	44,200	363	16,044,600	
パルコ	40,900	766	31,329,400	
丸井グループ	288,000	552	158,976,000	
原信ナルスホールディングス	12,600	1,355	17,073,000	
ダイエー	139,050	200	27,810,000	
イズミヤ	79,000	399	31,521,000	
イオン	779,200	948	738,681,600	
ユニー	165,700	804	133,222,800	
イズミ	66,200	1,612	106,714,400	
東武ストア	31,000	272	8,432,000	
平和堂	41,200	1,048	43,177,600	
フジ	25,200	1,716	43,243,200	
ヤオコー	9,900	2,754	27,264,600	
ゼビオ	26,700	1,828	48,807,600	
ケーズホールディングス	55,200	1,920	105,984,000	
O l y m p i c	15,300	854	13,066,200	
日産東京販売ホールディングス	33,000	212	6,996,000	
アインファーマシーズ	12,300	4,600	56,580,000	
元気寿司	6,900	987	6,810,300	
ヤマダ電機	107,520	3,765	404,812,800	
アークランドサカモト	14,400	1,193	17,179,200	
ニトリホールディングス	43,750	6,910	302,312,500	
グルメ杵屋	16,000	472	7,552,000	
愛眼	17,900	282	5,047,800	
吉野家ホールディングス	599	100,900	60,439,100	
松屋フーズ	10,600	1,463	15,507,800	
サガミチェーン	26,000	650	16,900,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
プレナス	24,700	1,418	35,024,600	
ミニストップ	16,700	1,310	21,877,000	
アークス	30,700	1,584	48,628,800	
パロー	44,400	1,296	57,542,400	
ベルク	11,400	1,074	12,243,600	
大庄	10,400	1,012	10,524,800	
ファーストリテイリング	44,300	15,500	686,650,000	
サンドラッグ	42,000	2,375	99,750,000	
東京デリカ	7,300	707	5,161,100	
ヤマザワ	6,100	1,340	8,174,000	
やまや	3,900	1,346	5,249,400	
ペルーナ	27,650	613	16,949,450	
島根銀行	4,900	1,013	4,963,700	
新生銀行	1,721,000	84	144,564,000	
あおぞら銀行	688,000	162	111,456,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,732,000	351	5,872,932,000	
りそなホールディングス	1,923,600	295	567,462,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	4,335,000	206	893,010,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,678,200	2,374	3,984,046,800	

第四銀行	285,000	221	62,985,000	
北越銀行	226,000	146	32,996,000	
西日本シティ銀行	776,000	179	138,904,000	
札幌北洋ホールディングス	333,300	228	75,992,400	
千葉銀行	872,000	442	385,424,000	
横浜銀行	1,406,000	354	497,724,000	
常陽銀行	845,000	330	278,850,000	
群馬銀行	499,000	343	171,157,000	
武蔵野銀行	35,600	2,182	77,679,200	
千葉興業銀行	42,300	410	17,343,000	
筑波銀行	91,800	257	23,592,600	
東京都民銀行	41,800	727	30,388,600	
七十七銀行	346,000	299	103,454,000	
青森銀行	165,000	226	37,290,000	
秋田銀行	152,000	204	31,008,000	
山形銀行	135,000	320	43,200,000	
岩手銀行	14,900	3,130	46,637,000	
東邦銀行	187,000	228	42,636,000	
東北銀行	119,000	110	13,090,000	
みちのく銀行	110,000	153	16,830,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	897,000	286	256,542,000	
静岡銀行	667,000	760	506,920,000	
十六銀行	277,000	238	65,926,000	
スルガ銀行	215,000	738	158,670,000	
八十二銀行	408,000	368	150,144,000	
山梨中央銀行	135,000	299	40,365,000	
大垣共立銀行	295,000	239	70,505,000	
福井銀行	190,000	179	34,010,000	
北國銀行	259,000	302	78,218,000	
清水銀行	7,500	2,215	16,612,500	
滋賀銀行	208,000	410	85,280,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
南都銀行	206,000	311	64,066,000	
百五銀行	200,000	298	59,600,000	
京都銀行	396,000	566	224,136,000	
三重銀行	91,000	174	15,834,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,548,000	117	181,116,000	
広島銀行	652,000	265	172,780,000	
山陰合同銀行	130,000	500	65,000,000	
中国銀行	178,000	934	166,252,000	
鳥取銀行	70,000	145	10,150,000	
伊予銀行	236,000	597	140,892,000	
百十四銀行	243,000	283	68,769,000	
四国銀行	160,000	198	31,680,000	
阿波銀行	194,000	474	91,956,000	
鹿児島銀行	143,000	449	64,207,000	
大分銀行	143,000	244	34,892,000	
宮崎銀行	147,000	188	27,636,000	
肥後銀行	170,000	392	66,640,000	
佐賀銀行	134,000	186	24,924,000	
十八銀行	141,000	193	27,213,000	
沖縄銀行	16,700	3,660	61,122,000	
琉球銀行	46,500	965	44,872,500	
八千代銀行	11,300	1,543	17,435,900	

セブン銀行	828,100	184	152,370,400	
みずほフィナンシャルグループ	28,429,100	121	3,439,921,100	
紀陽ホールディングス	881,000	107	94,267,000	
山口フィナンシャルグループ	221,000	634	140,114,000	
長野銀行	72,000	146	10,512,000	
名古屋銀行	200,000	222	44,400,000	
愛知銀行	8,000	3,700	29,600,000	
第三銀行	125,000	148	18,500,000	
中京銀行	91,000	183	16,653,000	
東日本銀行	106,000	164	17,384,000	
大光銀行	78,000	183	14,274,000	
愛媛銀行	139,000	203	28,217,000	
トマト銀行	85,000	136	11,560,000	
みなと銀行	200,000	133	26,600,000	
京葉銀行	182,000	343	62,426,000	
関西アーバン銀行	308,000	107	32,956,000	
栃木銀行	111,000	246	27,306,000	
北日本銀行	6,900	1,992	13,744,800	
東和銀行	222,000	69	15,318,000	
福島銀行	256,000	52	13,312,000	
大東銀行	140,000	56	7,840,000	
トモニホールディングス	169,600	296	50,201,600	
フィデアホールディングス	127,200	148	18,825,600	
池田泉州ホールディングス	911,900	98	89,366,200	
S B Iホールディングス	23,417	5,460	127,856,820	
ジャフコ	28,900	1,520	43,928,000	
大和証券グループ本社	2,190,000	263	575,970,000	
野村ホールディングス	4,784,300	271	1,296,545,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
岡三証券グループ	190,000	289	54,910,000	
丸三証券	76,000	259	19,684,000	
東洋証券	85,000	161	13,685,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	255,000	266	67,830,000	
水戸証券	67,000	180	12,060,000	
いちよし証券	50,400	420	21,168,000	
松井証券	132,000	421	55,572,000	
だいこう証券ビジネス	13,900	274	3,808,600	
マネックスグループ	1,751	12,820	22,447,820	
カブドットコム証券	91,900	225	20,677,500	
極東証券	30,300	577	17,483,100	
岩井コスモホールディングス	22,100	336	7,425,600	
N K S Jホールディングス	462,100	1,505	695,460,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	660,500	1,227	810,433,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	211,700	1,179	249,594,300	
第一生命保険	11,821	83,400	985,871,400	
東京海上ホールディングス	839,100	1,815	1,522,966,500	
T & Dホールディングス	805,600	776	625,145,600	
クレディセゾン	180,500	1,549	279,594,500	
芙蓉総合リース	22,400	2,262	50,668,800	
興銀リース	32,400	1,821	59,000,400	
東京センチュリーリース	59,300	1,341	79,521,300	
日本証券金融	99,200	381	37,795,200	
大阪証券金融	46,300	151	6,991,300	

ポケットカード	32,000	309	9,888,000	
リコーリース	16,900	1,740	29,406,000	
イオンクレジットサービス	96,500	1,334	128,731,000	
アコム	46,370	1,431	66,355,470	
ジャックス	148,000	224	33,152,000	
オリエントコーポレーション	460,000	93	42,780,000	
日立キャピタル	46,100	1,167	53,798,700	
オリックス	114,990	6,930	796,880,700	
三菱UFJリース	56,060	2,973	166,666,380	
アサックス	68	85,800	5,834,400	
NECキャピタルソリューション	10,600	937	9,932,200	
日本駐車場開発	2,709	4,055	10,984,995	
昭栄	44,100	311	13,715,100	
東京建物不動産販売	13,700	242	3,315,400	
野村不動産ホールディングス	105,900	1,285	136,081,500	
常和ホールディングス	4,800	1,345	6,456,000	
ヒューリック	72,900	953	69,473,700	
パーク24	114,900	1,080	124,092,000	
三井不動産	981,000	1,377	1,350,837,000	
三菱地所	1,547,000	1,283	1,984,801,000	
平和不動産	216,000	169	36,504,000	
東京建物	422,000	269	113,518,000	
ダイビル	67,000	569	38,123,000	
東急不動産	445,000	356	158,420,000	
京阪神ビルディング	29,600	355	10,508,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
住友不動産	530,000	1,689	895,170,000	
東宝不動産	26,100	417	10,883,700	
大京	347,000	177	61,419,000	
テオーシー	88,500	423	37,435,500	
東京楽天地	40,000	296	11,840,000	
フジ住宅	31,200	405	12,636,000	
空港施設	26,300	351	9,231,300	
明和地所	13,900	386	5,365,400	
住友不動産販売	8,290	3,595	29,802,550	
ゴールドクレスト	20,890	1,133	23,668,370	
東栄住宅	16,500	732	12,078,000	
リロ・ホールディング	7,700	2,364	18,202,800	
日本エスリード	10,400	631	6,562,400	
東急リバブル	21,500	765	16,447,500	
飯田産業	22,900	539	12,343,100	
日神不動産	15,600	442	6,895,200	
アーネストワン	37,800	879	33,226,200	
タカラレーベン	27,400	581	15,919,400	
サンヨーハウジング名古屋	129	75,500	9,739,500	
イオンモール	100,800	1,580	159,264,000	
フージャースコーポレーション	363	48,950	17,768,850	
タクトホーム	135	64,100	8,653,500	
トーセイ	329	27,400	9,014,600	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,373	56,100	77,025,300	
サンフロンティア不動産	259	15,050	3,897,950	
ランドビジネス	223	16,010	3,570,230	
グランディハウス	7,100	477	3,386,700	
日本空港ビルデング	70,500	875	61,687,500	

日本工営	79,000	257	20,303,000	
ネクスト	9,300	362	3,366,600	
日本M&Aセンター	9,400	2,245	21,103,000	
ノバレーゼ	70	51,200	3,584,000	
アコーディア・ゴルフ	945	47,450	44,840,250	
パソナグループ	236	51,700	12,201,200	
リンクアンドモチベーション	52	58,000	3,016,000	
エス・エム・エス	45	132,300	5,953,500	
テンプホールディングス	32,200	927	29,849,400	
クックパッド	4,600	1,924	8,850,400	
学情	8,300	399	3,311,700	
スタジオアリス	11,100	1,271	14,108,100	
シミックホールディングス	9,100	1,188	10,810,800	
NECフィールディング	19,000	941	17,879,000	
総合警備保障	85,100	1,020	86,802,000	
カカクコム	36,400	2,582	93,984,800	
ルネサンス	11,500	445	5,117,500	
ツクイ	7,600	1,035	7,866,000	
エムスリー	184	346,500	63,756,000	
ベストプライダル	57	82,600	4,708,200	
ディー・エヌ・エー	104,900	1,721	180,532,900	
博報堂DYホールディングス	29,720	4,815	143,101,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ぐるなび	16,900	820	13,858,000	
一休	168	33,650	5,653,200	
ジャパンベストレスキューシステム	37	75,400	2,789,800	
ジェイコムホールディングス	4,500	620	2,790,000	
PGMホールディングス	338	62,500	21,125,000	
JPホールディングス	7,600	750	5,700,000	
イーピーエス	140	191,600	26,824,000	
アミューズ	7,000	1,005	7,035,000	
ドリームインキュベータ	77	63,800	4,912,600	
ケネディクス	2,657	10,330	27,446,810	
電通	212,800	2,214	471,139,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,067	7,240	7,725,080	
ぴあ	7,300	873	6,372,900	
イオンファンタジー	8,100	1,148	9,298,800	
みらかホールディングス	61,000	3,005	183,305,000	
アルプス技研	10,600	589	6,243,400	
サニックス	36,300	223	8,094,900	
ダイオーズ	4,700	504	2,368,800	
日本空調サービス	6,100	702	4,282,200	
オリエンタルランド	63,200	8,570	541,624,000	
ダスキン	69,100	1,464	101,162,400	
明光ネットワークジャパン	21,900	727	15,921,300	
ファルコSDホールディングス	13,200	981	12,949,200	
秀英予備校	6,000	295	1,770,000	
田谷	4,300	666	2,863,800	
ラウンドワン	74,200	410	30,422,000	
リゾートトラスト	36,800	1,329	48,907,200	
ビー・エム・エル	15,400	1,875	28,875,000	
ワタベウェディング	7,600	702	5,335,200	
もしもしホットライン	39,000	731	28,509,000	
東急コミュニティー	6,200	2,447	15,171,400	

リソー教育	2,470	5,200	12,844,000	
ウェアハウス	6,100	206	1,256,600	
ユー・エス・エス	30,490	7,750	236,297,500	
東京個別指導学院	15,100	148	2,234,800	
テー・オー・ダブリュー	8,100	514	4,163,400	
セントラルスポーツ	7,700	1,067	8,215,900	
フルキャストホールディングス	238	15,080	3,589,040	
リゾートソリューション	23,000	158	3,634,000	
エイチ・アイ・エス	24,000	2,500	60,000,000	
共立メンテナンス	11,900	1,591	18,932,900	
イチネンホールディングス	25,100	405	10,165,500	
建設技術研究所	13,300	488	6,490,400	
燦ホールディングス	5,400	1,332	7,192,800	
スバル興業	25,000	252	6,300,000	
東京テアトル	94,000	104	9,776,000	
よみうりランド	49,000	237	11,613,000	
東京都競馬	185,000	109	20,165,000	
カナモト	30,000	785	23,550,000	
東京ドーム	189,000	216	40,824,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トランス・コスモス	30,600	1,087	33,262,200	
乃村工藝社	47,000	235	11,045,000	
藤田観光	61,000	262	15,982,000	
日本管財	8,800	1,447	12,733,600	
トーカイ	9,700	1,730	16,781,000	
白洋舎	27,000	207	5,589,000	
セコム	227,100	3,415	775,546,500	
セントラル警備保障	10,600	780	8,268,000	
丹青社	42,000	240	10,080,000	
メイテック	36,300	1,623	58,914,900	
アサツー ディ・ケイ	40,100	2,135	85,613,500	
応用地質	24,900	840	20,916,000	
船井総合研究所	24,400	526	12,834,400	
進学会	13,000	282	3,666,000	
ベネッセホールディングス	72,400	3,470	251,228,000	
イオンディライト	26,500	1,729	45,818,500	
ナック	6,600	1,605	10,593,000	
ニチイ学館	46,300	725	33,567,500	
ダイセキ	37,800	1,301	49,177,800	
合計	341,902,678		223,449,393,405	

（注）代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

B．株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,598,980,050
国債証券	266,112,276,100
地方債証券	23,737,943,248
特殊債券	36,535,008,396
社債券	22,375,930,000
未収利息	1,417,545,399
前払費用	60,702,152
流動資産合計	354,838,385,345
資産合計	354,838,385,345
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,339,400
前受金	2,690,000
未払解約金	379,686,300
流動負債合計	383,715,700
負債合計	383,715,700
純資産の部	
元本等	
元本	292,037,306,349
剰余金	
剰余金	62,417,363,296
純資産合計	354,454,669,645
負債・純資産合計	354,838,385,345

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別 法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示す る価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が 公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成24年6月11日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p>国債証券 51,586,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。</p>
2．計算日における受益権総数	292,037,306,349 口
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>1.2137 円</p> <p>(12,137 円)</p>

(金融商品に関する注記)

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在	
1．金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「(その他の注記)」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 元本の変動

平成24年6月11日現在

特定期間の期首元本額	293,753,774,081 円
特定期間中の追加設定元本額	43,120,469,427 円
特定期間中の一部解約元本額	44,836,937,159 円
計算日の元本額	292,037,306,349 円
計算日の元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	4,151,344,313 円
DC日本債券インデックスファンド	2,068,733,683 円
DC日本債券インデックスファンドL	22,665,235,259 円
DCバランスファンド30	840,921,627 円
DCバランスファンド50	841,197,966 円
DCバランスファンド70	205,799,440 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	157,816,996 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	98,528,722 円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	5,438,273,628 円
新生・4分散ファンド	127,016,625 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	36,905,409 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	117,080,813 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	385,428,748 円
日本債券インデックスe	501,084,282 円
インデックスコレクション(国内債券)	1,843,106,090 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	845,564,097 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	766,445,156 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	289,478,356 円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	10,019,644,044 円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	32,545,891,634 円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	27,212,255,446 円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,432,742,563 円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	6,926,045,863 円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	10,833,442,857 円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,396,066,410 円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	24,176,761,042 円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	239,268,901 円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	29,071,708,606 円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	6,927,327,697 円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	636,734,557 円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,299,328,735 円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,670,849,642 円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,105,091,211 円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	973,147,120 円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,767,500,015 円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,633,808,369 円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	4,216,959,506 円
バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	6,597,117,242 円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	614,507,230 円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	4,044,751,032 円
バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	48,795,166,651 円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,256,347,712 円

国内バランスV A 3 0 (適格機関投資家専用)	305,107,657 円
国内バランスV A 2 5 (適格機関投資家専用)	137,128,054 円
V A バランス 2 0 - 8 0 (適格機関投資家専用)	1,198,153,618 円
私募日本債券インデックスファンドA L (適格機関投資家専用)	10,693,432 円
私募日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	13,591,608,933 円
世界バランスV A 2 0 (適格機関投資家専用)	22,189,360 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,116,011,300
地方債証券	143,432,346
特殊債券	190,574,852
社債券	189,690,000
合計	2,639,708,498

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年1月24日から平成24年6月11日まで)に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

. ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,868,939,400		2,867,600,000	1,339,400
	合計	2,868,939,400		2,867,600,000	1,339,400

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年6月11日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（2年）第306回	600,000,000	600,648,000	
	利付国庫債券（2年）第307回	2,400,000,000	2,402,808,000	
	利付国庫債券（2年）第308回	600,000,000	600,000,000	
	利付国庫債券（2年）第309回	2,600,000,000	2,600,000,000	
	利付国庫債券（2年）第310回	1,200,000,000	1,201,704,000	
	利付国庫債券（2年）第311回	1,300,000,000	1,301,950,000	
	利付国庫債券（2年）第312回	400,000,000	400,000,000	
	利付国庫債券（2年）第313回	3,500,000,000	3,500,000,000	
	利付国庫債券（2年）第314回	2,200,000,000	2,200,000,000	
	利付国庫債券（2年）第315回	600,000,000	600,000,000	
	利付国庫債券（2年）第316回	700,000,000	700,000,000	
	利付国庫債券（5年）第75回	600,000,000	607,614,000	
	利付国庫債券（5年）第76回	1,800,000,000	1,825,128,000	
	利付国庫債券（5年）第77回	1,100,000,000	1,112,562,000	
	利付国庫債券（5年）第78回	700,000,000	708,498,000	
	利付国庫債券（5年）第79回	1,700,000,000	1,715,470,000	
	利付国庫債券（5年）第80回	1,300,000,000	1,313,806,000	
	利付国庫債券（5年）第81回	1,700,000,000	1,720,978,000	
	利付国庫債券（5年）第82回	2,100,000,000	2,129,631,000	
	利付国庫債券（5年）第83回	1,200,000,000	1,219,344,000	
	利付国庫債券（5年）第84回	1,800,000,000	1,821,762,000	
	利付国庫債券（5年）第85回	2,100,000,000	2,128,539,000	
	利付国庫債券（5年）第86回	2,100,000,000	2,123,793,000	
	利付国庫債券（5年）第87回	4,400,000,000	4,444,220,000	
	利付国庫債券（5年）第88回	2,700,000,000	2,729,781,000	
	利付国庫債券（5年）第89回	1,500,000,000	1,513,545,000	
	利付国庫債券（5年）第90回	1,900,000,000	1,911,438,000	
	利付国庫債券（5年）第91回	1,000,000,000	1,009,780,000	
	利付国庫債券（5年）第92回	2,400,000,000	2,415,648,000	
	利付国庫債券（5年）第93回	1,500,000,000	1,520,505,000	
	利付国庫債券（5年）第94回	2,000,000,000	2,034,360,000	
	利付国庫債券（5年）第95回	1,900,000,000	1,933,459,000	
	利付国庫債券（5年）第96回	2,200,000,000	2,230,514,000	
	利付国庫債券（5年）第97回	1,600,000,000	1,615,968,000	
	利付国庫債券（5年）第98回	2,000,000,000	2,011,980,000	
	利付国庫債券（5年）第99回	2,400,000,000	2,423,400,000	
	利付国庫債券（5年）第100回	1,400,000,000	1,407,714,000	
	利付国庫債券（5年）第101回	1,800,000,000	1,816,938,000	
	利付国庫債券（5年）第102回	2,200,000,000	2,210,846,000	
	利付国庫債券（5年）第103回	2,900,000,000	2,912,296,000	
第104回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,399,328,000		
利付国庫債券（40年）第1回	400,000,000	445,436,000		
利付国庫債券（40年）第2回	500,000,000	528,465,000		
利付国庫債券（40年）第3回	600,000,000	631,248,000		
利付国庫債券（40年）第4回	800,000,000	837,680,000		
第5回利付国債（40年）	200,000,000	198,026,000		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
----	----	---------	--------	----

国債 証券	利付国庫債券(10年)第253回	1,350,000,000	1,375,704,000	
	利付国庫債券(10年)第254回	520,000,000	528,580,000	
	利付国庫債券(10年)第255回	710,000,000	722,616,700	
	利付国庫債券(10年)第256回	1,040,000,000	1,060,519,200	
	利付国庫債券(10年)第257回	400,000,000	407,284,000	
	利付国庫債券(10年)第258回	480,000,000	490,156,800	
	利付国庫債券(10年)第259回	1,180,000,000	1,209,134,200	
	利付国庫債券(10年)第260回	860,000,000	885,989,200	
	利付国庫債券(10年)第261回	790,000,000	817,057,500	
	利付国庫債券(10年)第262回	730,000,000	756,477,100	
	利付国庫債券(10年)第263回	750,000,000	775,492,500	
	利付国庫債券(10年)第264回	1,330,000,000	1,372,187,600	(注)
	利付国庫債券(10年)第265回	730,000,000	755,688,700	
	利付国庫債券(10年)第266回	560,000,000	578,300,800	
	利付国庫債券(10年)第267回	410,000,000	422,369,700	
	利付国庫債券(10年)第268回	1,200,000,000	1,246,356,000	
	利付国庫債券(10年)第269回	840,000,000	867,812,400	
	利付国庫債券(10年)第270回	1,600,000,000	1,657,792,000	
	利付国庫債券(10年)第271回	1,400,000,000	1,446,354,000	
	利付国庫債券(10年)第272回	1,500,000,000	1,563,570,000	
	利付国庫債券(10年)第273回	1,400,000,000	1,463,896,000	
	利付国庫債券(10年)第274回	900,000,000	943,866,000	
	利付国庫債券(10年)第275回	1,200,000,000	1,254,276,000	
	利付国庫債券(10年)第276回	800,000,000	841,800,000	
	利付国庫債券(10年)第277回	1,300,000,000	1,372,150,000	
	利付国庫債券(10年)第278回	700,000,000	743,960,000	
	利付国庫債券(10年)第279回	700,000,000	749,350,000	
	利付国庫債券(10年)第280回	1,500,000,000	1,605,180,000	
	利付国庫債券(10年)第281回	1,000,000,000	1,074,120,000	
	利付国庫債券(10年)第282回	1,600,000,000	1,704,160,000	
	利付国庫債券(10年)第283回	1,400,000,000	1,497,076,000	
	利付国庫債券(10年)第284回	2,950,000,000	3,150,334,500	
	利付国庫債券(10年)第285回	3,400,000,000	3,639,938,000	
	利付国庫債券(10年)第286回	1,400,000,000	1,509,802,000	
	利付国庫債券(10年)第287回	1,700,000,000	1,841,780,000	
	利付国庫債券(10年)第288回	2,500,000,000	2,689,975,000	
	利付国庫債券(10年)第289回	2,800,000,000	2,988,132,000	
	利付国庫債券(10年)第290回	600,000,000	637,596,000	
	利付国庫債券(10年)第291回	1,300,000,000	1,374,087,000	
	利付国庫債券(10年)第292回	1,300,000,000	1,403,571,000	
	利付国庫債券(10年)第293回	1,200,000,000	1,304,484,000	
	利付国庫債券(10年)第294回	900,000,000	973,053,000	
	利付国庫債券(10年)第295回	700,000,000	748,335,000	
利付国庫債券(10年)第296回	1,800,000,000	1,925,838,000		
利付国庫債券(10年)第297回	1,200,000,000	1,277,472,000		
利付国庫債券(10年)第298回	1,000,000,000	1,058,200,000		
利付国庫債券(10年)第299回	1,300,000,000	1,375,270,000		
利付国庫債券(10年)第300回	1,400,000,000	1,499,974,000		
利付国庫債券(10年)第301回	900,000,000	964,296,000		
利付国庫債券(10年)第302回	1,800,000,000	1,916,352,000		
利付国庫債券(10年)第303回	1,200,000,000	1,278,012,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債 証券	利付国庫債券(10年)第304回	1,400,000,000	1,481,172,000	
	利付国庫債券(10年)第305回	2,900,000,000	3,065,909,000	
	利付国庫債券(10年)第306回	1,400,000,000	1,489,194,000	

利付国庫債券（10年）第307回	900,000,000	950,634,000	
利付国庫債券（10年）第308回	1,400,000,000	1,476,664,000	
利付国庫債券（10年）第309回	1,900,000,000	1,974,195,000	
利付国庫債券（10年）第310回	1,300,000,000	1,337,804,000	
利付国庫債券（10年）第311回	2,100,000,000	2,127,216,000	
利付国庫債券（10年）第312回	3,200,000,000	3,338,048,000	
利付国庫債券（10年）第313回	1,900,000,000	1,994,164,000	
利付国庫債券（10年）第314回	1,400,000,000	1,445,654,000	
利付国庫債券（10年）第315回	2,600,000,000	2,702,258,000	
利付国庫債券（10年）第316回	1,400,000,000	1,443,218,000	
利付国庫債券（10年）第317回	2,000,000,000	2,057,100,000	
利付国庫債券（10年）第318回	2,200,000,000	2,242,812,000	
利付国庫債券（10年）第319回	1,800,000,000	1,846,944,000	
利付国庫債券（10年）第320回	2,000,000,000	2,033,580,000	
利付国庫債券（10年）第321回	3,000,000,000	3,043,320,000	
第322回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,708,432,000	
利付国庫債券（30年）第1回	50,000,000	59,611,000	
利付国庫債券（30年）第2回	100,000,000	112,819,000	
利付国庫債券（30年）第3回	330,000,000	367,306,500	
利付国庫債券（30年）第4回	190,000,000	229,413,600	
利付国庫債券（30年）第5回	180,000,000	196,837,200	
利付国庫債券（30年）第6回	270,000,000	303,374,700	
利付国庫債券（30年）第7回	390,000,000	430,934,400	
利付国庫債券（30年）第8回	270,000,000	275,138,100	
利付国庫債券（30年）第9回	180,000,000	171,003,600	
利付国庫債券（30年）第10回	170,000,000	152,240,100	
利付国庫債券（30年）第11回	310,000,000	309,280,800	
利付国庫債券（30年）第12回	370,000,000	394,971,300	
利付国庫債券（30年）第13回	450,000,000	472,014,000	
利付国庫債券（30年）第14回	350,000,000	392,038,500	
利付国庫債券（30年）第15回	340,000,000	386,988,000	
利付国庫債券（30年）第16回	250,000,000	284,607,500	
利付国庫債券（30年）第17回	430,000,000	480,976,500	
利付国庫債券（30年）第18回	660,000,000	726,191,400	
利付国庫債券（30年）第19回	270,000,000	296,800,200	
利付国庫債券（30年）第20回	140,000,000	159,339,600	
利付国庫債券（30年）第21回	820,000,000	901,901,600	
利付国庫債券（30年）第22回	300,000,000	341,202,000	
利付国庫債券（30年）第23回	400,000,000	455,352,000	
利付国庫債券（30年）第24回	200,000,000	227,686,000	
利付国庫債券（30年）第25回	700,000,000	769,356,000	
利付国庫債券（30年）第26回	700,000,000	783,349,000	
利付国庫債券（30年）第27回	700,000,000	797,580,000	
利付国庫債券（30年）第28回	800,000,000	912,224,000	
利付国庫債券（30年）第29回	1,100,000,000	1,233,111,000	
利付国庫債券（30年）第30回	900,000,000	989,325,000	
利付国庫債券（30年）第31回	1,200,000,000	1,293,708,000	
利付国庫債券（30年）第32回	1,200,000,000	1,319,628,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（30年）第33回	1,400,000,000	1,447,026,000	
	利付国庫債券（30年）第34回	1,300,000,000	1,401,205,000	
	利付国庫債券（30年）第35回	1,300,000,000	1,340,846,000	
	利付国庫債券（30年）第36回	900,000,000	927,693,000	
	利付国庫債券（20年）第23回	130,000,000	138,911,500	
	利付国庫債券（20年）第24回	160,000,000	172,982,400	

利付国庫債券(20年)第25回	80,000,000	85,644,800	
利付国庫債券(20年)第26回	50,000,000	54,991,000	
利付国庫債券(20年)第27回	410,000,000	455,579,700	
利付国庫債券(20年)第28回	110,000,000	124,873,100	
利付国庫債券(20年)第29回	100,000,000	113,379,000	
利付国庫債券(20年)第30回	200,000,000	223,532,000	
利付国庫債券(20年)第31回	280,000,000	315,515,200	
利付国庫債券(20年)第32回	80,000,000	90,748,000	
利付国庫債券(20年)第33回	430,000,000	496,396,300	
利付国庫債券(20年)第34回	70,000,000	80,964,800	
利付国庫債券(20年)第35回	270,000,000	309,741,300	
利付国庫債券(20年)第37回	410,000,000	471,159,700	
利付国庫債券(20年)第39回	640,000,000	724,057,600	
利付国庫債券(20年)第40回	450,000,000	504,157,500	
利付国庫債券(20年)第41回	620,000,000	663,623,200	
利付国庫債券(20年)第42回	380,000,000	434,936,600	
利付国庫債券(20年)第43回	340,000,000	398,650,000	
利付国庫債券(20年)第44回	370,000,000	424,689,700	
利付国庫債券(20年)第45回	470,000,000	535,964,500	
利付国庫債券(20年)第46回	290,000,000	326,273,200	
利付国庫債券(20年)第47回	470,000,000	529,064,900	
利付国庫債券(20年)第48回	230,000,000	264,681,700	
利付国庫債券(20年)第49回	280,000,000	313,174,400	
利付国庫債券(20年)第50回	590,000,000	649,590,000	
利付国庫債券(20年)第51回	240,000,000	266,248,800	
利付国庫債券(20年)第52回	430,000,000	480,748,600	
利付国庫債券(20年)第53回	350,000,000	391,289,500	
利付国庫債券(20年)第54回	280,000,000	315,655,200	
利付国庫債券(20年)第55回	490,000,000	542,787,700	
利付国庫債券(20年)第56回	410,000,000	454,161,100	
利付国庫債券(20年)第57回	360,000,000	395,445,600	
利付国庫債券(20年)第58回	250,000,000	274,537,500	
利付国庫債券(20年)第59回	440,000,000	474,284,800	
利付国庫債券(20年)第60回	570,000,000	597,388,500	
利付国庫債券(20年)第61回	390,000,000	392,094,300	
利付国庫債券(20年)第62回	250,000,000	245,522,500	
利付国庫債券(20年)第63回	670,000,000	727,894,700	
利付国庫債券(20年)第64回	410,000,000	449,425,600	
利付国庫債券(20年)第65回	370,000,000	405,235,100	
利付国庫債券(20年)第66回	640,000,000	693,964,800	
利付国庫債券(20年)第67回	760,000,000	831,569,200	
利付国庫債券(20年)第68回	230,000,000	259,329,600	
利付国庫債券(20年)第69回	260,000,000	290,261,400	
利付国庫債券(20年)第70回	400,000,000	459,592,000	
利付国庫債券(20年)第71回	400,000,000	450,532,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	利付国庫債券(20年)第72回	1,020,000,000	1,136,422,800	
	利付国庫債券(20年)第73回	440,000,000	484,642,400	
	利付国庫債券(20年)第74回	310,000,000	344,871,900	
	利付国庫債券(20年)第75回	360,000,000	400,075,200	
	利付国庫債券(20年)第76回	530,000,000	576,496,900	
	利付国庫債券(20年)第77回	410,000,000	451,053,300	
	利付国庫債券(20年)第78回	200,000,000	217,354,000	
	利付国庫債券(20年)第79回	300,000,000	329,622,000	
	利付国庫債券(20年)第80回	350,000,000	388,752,000	

利付国庫債券（20年）第81回	720,000,000	790,005,600	
利付国庫債券（20年）第82回	510,000,000	565,783,800	
利付国庫債券（20年）第83回	530,000,000	587,197,600	
利付国庫債券（20年）第84回	500,000,000	547,805,000	
利付国庫債券（20年）第85回	550,000,000	608,481,500	
利付国庫債券（20年）第86回	270,000,000	305,451,000	
利付国庫債券（20年）第87回	500,000,000	559,075,000	
利付国庫債券（20年）第88回	400,000,000	451,984,000	
利付国庫債券（20年）第89回	900,000,000	1,005,588,000	
利付国庫債券（20年）第90回	900,000,000	1,003,545,000	
利付国庫債券（20年）第91回	600,000,000	677,112,000	
利付国庫債券（20年）第92回	1,100,000,000	1,210,440,000	
利付国庫債券（20年）第93回	800,000,000	868,296,000	
利付国庫債券（20年）第94回	800,000,000	879,288,000	
利付国庫債券（20年）第95回	500,000,000	562,475,000	
利付国庫債券（20年）第96回	600,000,000	658,656,000	
利付国庫債券（20年）第97回	700,000,000	777,301,000	
利付国庫債券（20年）第98回	600,000,000	657,804,000	
利付国庫債券（20年）第99回	1,100,000,000	1,205,083,000	
利付国庫債券（20年）第100回	800,000,000	886,096,000	
利付国庫債券（20年）第101回	500,000,000	567,880,000	
利付国庫債券（20年）第102回	400,000,000	453,820,000	
利付国庫債券（20年）第103回	400,000,000	447,984,000	
利付国庫債券（20年）第104回	700,000,000	764,113,000	
利付国庫債券（20年）第105回	900,000,000	980,883,000	
利付国庫債券（20年）第106回	300,000,000	331,365,000	
利付国庫債券（20年）第107回	500,000,000	544,400,000	
利付国庫債券（20年）第108回	700,000,000	741,482,000	
利付国庫債券（20年）第109回	700,000,000	740,488,000	
利付国庫債券（20年）第110回	700,000,000	761,369,000	
利付国庫債券（20年）第111回	600,000,000	660,522,000	
利付国庫債券（20年）第112回	1,400,000,000	1,520,064,000	
利付国庫債券（20年）第113回	1,100,000,000	1,193,808,000	
利付国庫債券（20年）第114回	1,400,000,000	1,516,536,000	
利付国庫債券（20年）第115回	900,000,000	988,776,000	
利付国庫債券（20年）第116回	600,000,000	658,914,000	
利付国庫債券（20年）第117回	1,200,000,000	1,299,180,000	
利付国庫債券（20年）第118回	800,000,000	852,504,000	
利付国庫債券（20年）第119回	400,000,000	413,792,000	
利付国庫債券（20年）第120回	600,000,000	601,680,000	
利付国庫債券（20年）第121回	800,000,000	838,672,000	
利付国庫債券（20年）第122回	1,300,000,000	1,342,445,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（20年）第123回	600,000,000	647,016,000	
	利付国庫債券（20年）第124回	600,000,000	637,014,000	
	利付国庫債券（20年）第125回	900,000,000	983,610,000	
	利付国庫債券（20年）第126回	800,000,000	848,632,000	
	利付国庫債券（20年）第127回	800,000,000	835,840,000	
	利付国庫債券（20年）第128回	900,000,000	938,682,000	
	利付国庫債券（20年）第129回	700,000,000	718,837,000	
	利付国庫債券（20年）第130回	1,100,000,000	1,127,423,000	
	利付国庫債券（20年）第131回	500,000,000	504,020,000	
	利付国庫債券（20年）第132回	600,000,000	603,978,000	
	利付国庫債券（20年）第133回	1,600,000,000	1,637,840,000	
	利付国庫債券（20年）第134回	500,000,000	511,175,000	

	利付国庫債券(20年)第135回	300,000,000	301,785,000	
	第136回利付国債(20年)	600,000,000	593,754,000	
	国債証券 小計	253,560,000,000	266,112,276,100	
地方債 証券	東京都公募公債第602回	200,000,000	203,408,000	
	東京都公募公債第605回	100,000,000	102,012,000	
	東京都公募公債第608回	100,000,000	102,527,000	
	東京都公募公債第609回	200,000,000	204,842,000	
	東京都公募公債第613回	100,000,000	103,195,000	
	東京都公募公債第616回	100,000,000	103,154,000	
	東京都公募公債第617回	100,000,000	103,129,000	
	東京都公募公債第619回	100,000,000	103,810,000	
	東京都公募公債第624回	100,000,000	104,061,000	
	東京都公募公債第625回	100,000,000	104,084,000	
	東京都公募公債第626回	100,000,000	104,703,000	
	東京都公募公債第627回	100,000,000	104,442,000	
	東京都公募公債第628回	100,000,000	105,006,000	
	東京都公募公債第637回	180,000,000	192,168,000	
	東京都公募公債第642回	100,000,000	107,189,000	
	東京都公募公債第646回	100,000,000	108,501,000	
	東京都公募公債第647回	100,000,000	108,402,000	
	東京都公募公債第656回	100,000,000	106,593,000	
	東京都公募公債第657回	100,000,000	108,291,000	
	東京都公募公債第659回	100,000,000	107,301,000	
	東京都公募公債第668回	100,000,000	107,056,000	
	東京都公募公債第681回	100,000,000	105,940,000	
	東京都公募公債第682回	100,000,000	105,345,000	
	東京都公募公債第692回	100,000,000	105,099,000	
	東京都公募公債第700回	100,000,000	101,635,000	
	東京都公募公債(20年)第3回	100,000,000	112,440,000	
	東京都公募公債(20年)第11回	200,000,000	220,608,000	
	東京都公募公債(20年)第18回	200,000,000	218,422,000	
	東京都公募公債(20年)第20回	100,000,000	107,072,000	
	東京都公募公債(20年)第21回	100,000,000	108,444,000	
	北海道平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,317,000	
	北海道平成19年度第14回公募公債(10年)	100,000,000	107,005,000	
	北海道平成20年度第14回公募公債	100,000,000	107,738,000	
	北海道平成20年度第15回公募公債(5年)	100,000,000	101,672,000	
北海道平成21年度第6回公募公債	100,000,000	106,841,000		
北海道平成22年度第8回公募公債	100,000,000	101,295,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	北海道平成22年度第1回公募公債	100,000,000	105,714,000	
	北海道平成23年度第4回公募公債	100,000,000	102,720,000	
	神奈川県第126回公募公債	100,000,000	102,517,000	
	神奈川県第127回公募公債	100,000,000	103,488,000	
	神奈川県第130回公募公債	100,000,000	103,251,000	
	神奈川県第134回公募公債	100,000,000	103,941,000	
	神奈川県第135回公募公債	100,000,000	104,807,000	
	神奈川県第143回公募公債	150,000,000	160,240,500	
	神奈川県第144回公募公債	100,000,000	107,096,000	
	神奈川県第162回公募公債	100,000,000	107,490,000	
	神奈川県第168回公募公債	100,000,000	105,656,000	
	神奈川県第173回公募公債	100,000,000	104,955,000	
	神奈川県第174回公募公債	100,000,000	103,963,000	
	神奈川県第175回公募公債	100,000,000	103,353,000	
	神奈川県第16回20年公募公債	100,000,000	106,112,000	

第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,787,000	
第275回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,881,000	
第285回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,421,000	
第286回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,511,000	
第293回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,545,000	
第298回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,222,000	
第305回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,985,000	
第309回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,782,000	
第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,171,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,538,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,882,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,936,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,945,000	
第50回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,403,000	
京都府平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,668,000	
京都府平成20年度第6回公募公債	100,000,000	106,568,000	
京都府平成21年度第4回公募公債	100,000,000	101,071,000	
京都府平成21年度第5回公募公債	100,000,000	105,554,000	
京都府平成22年度第4回公募公債	100,000,000	101,104,000	
兵庫県平成16年度第10回公募公債	100,000,000	103,128,000	
兵庫県平成17年度第3回公募公債	100,000,000	103,171,000	
兵庫県平成18年度第3回公募公債	110,000,000	117,494,300	
兵庫県平成18年度第8回公募公債	100,000,000	107,583,000	
兵庫県平成18年度第10回公募公債	100,000,000	107,505,000	
兵庫県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	107,099,000	
兵庫県平成21年度第35回公募公債	100,000,000	105,912,000	
静岡県平成15年度第3回公募公債	100,000,000	101,707,000	
静岡県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	105,681,000	
静岡県平成19年度第4回公募公債	100,000,000	108,416,000	
静岡県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	107,975,000	
静岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	105,615,000	
静岡県平成22年度第3回公募公債	100,000,000	105,633,000	
静岡県平成23年度1回公募公債	100,000,000	105,056,000	
静岡県平成23年度第5回公募公債	100,000,000	102,973,000	
愛知県平成17年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	103,550,000	
愛知県平成18年度第4回公募公債(10年)	129,000,000	137,725,560	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	愛知県平成20年度第6回公募公債(10年)	100,000,000	107,980,000	
	愛知県平成20年度第10回公募公債(10年)	100,000,000	106,572,000	
	愛知県平成21年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	107,442,000	
	愛知県平成22年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	105,952,000	
	愛知県平成22年度第5回公募公債(10年)	100,000,000	104,612,000	
	愛知県平成22年度第14回公募公債(20年)	100,000,000	106,115,000	
	愛知県平成23年度第4回公募公債(10年)	100,000,000	103,176,000	
	広島県平成16年度第1回公募公債	100,000,000	103,047,000	
	広島県平成20年度第6回公募公債	100,000,000	106,498,000	
	広島県平成20年第1回公募公債(20年)	100,000,000	110,923,000	
	埼玉県平成15年度第5回公募公債	100,000,000	102,021,000	
	埼玉県平成19年度第2回公募公債	100,000,000	108,185,000	
	埼玉県平成19年度第5回公募公債	100,000,000	107,979,000	
	埼玉県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	107,283,000	
	埼玉県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	108,102,000	
	埼玉県平成21年度第1回公募公債	200,000,000	213,786,000	
	埼玉県平成21年度第2回公募公債	100,000,000	107,167,000	
	埼玉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	103,895,000	

埼玉県平成23年度第9回公募公債	100,000,000	101,022,000	
福岡県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	107,703,000	
福岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	105,776,000	
福岡県平成22年度第2回15年公募公債	100,000,000	105,493,000	
福岡県平成19年度第1回30年公募公債	100,000,000	112,390,000	
福岡県平成20年度第1回30年公募公債	200,000,000	211,086,000	
千葉県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	104,678,000	
千葉県平成18年度第6回公募公債	175,000,000	186,413,500	
千葉県平成18年度第7回公募公債	100,000,000	107,162,000	
千葉県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	106,897,000	
千葉県平成21年度第3回公募公債	100,000,000	107,640,000	
千葉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	103,890,000	
千葉県平成22年度第9回公募公債	100,000,000	103,937,000	
千葉県第8回20年公募公債	100,000,000	107,977,000	
新潟県平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,503,000	
新潟県平成20年度第2回公募公債	100,000,000	106,763,000	
岐阜県平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,753,000	
第5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,886,000	
第6回共同発行市場公募地方債	155,700,000	158,575,779	
第9回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,096,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,942,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,925,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	131,401,820	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,604,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,286,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,399,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,267,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,220,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,075,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,717,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,351,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,446,000	
第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,937,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,714,000	
	第31回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,678,000	
	第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,402,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,340,800	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,065,000	
	第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,418,000	
	第43回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,774,000	
	第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,779,000	
	第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,370,000	
	第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,259,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,476,000	
	第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,182,000	
	第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,820,000	
	第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,315,000	
	第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,598,000	
	第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,160,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,640,000	
	第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,010,000	
	第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,926,000	
	第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,558,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,973,000		

第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,050,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,189,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,685,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,113,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,889,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,890,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,178,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,052,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,289,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,320,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,017,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,258,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,072,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,350,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,880,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,636,000	
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,301,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,806,000	
静岡市平成18年度第1回公募公債	100,000,000	107,285,000	
大阪市平成16年度第5回公募公債	100,000,000	103,219,000	
大阪市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,191,000	
大阪市平成18年度第3回公募公債	200,000,000	214,760,000	
大阪市平成21年度第7回公募公債	100,000,000	105,803,000	
名古屋市第12回し号公募公債	100,000,000	103,709,000	
名古屋市第12回せ号公募公債	100,000,000	104,051,000	
名古屋市第12回ゆ号公募公債	100,000,000	102,204,000	
名古屋市第12回す号公募公債	100,000,000	105,654,000	
名古屋市第455回10年公募公債	186,700,000	199,333,989	
名古屋市第463回10年公募公債	100,000,000	109,390,000	
名古屋市第464回10年公募公債	100,000,000	107,273,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	名古屋市第1回20年公募公債	100,000,000	109,437,000	
	京都市平成19年度第2回公募公債	100,000,000	107,503,000	
	京都市平成21年度第5回公募公債	100,000,000	106,028,000	
	京都市平成22年度第3回公募公債	100,000,000	100,590,000	
	京都市第2回20年公募公債	100,000,000	109,711,000	
	横浜市平成20年度第1回公募公債	100,000,000	108,655,000	
	横浜市平成20年度第6回公募公債	100,000,000	106,769,000	
	横浜市平成21年度第6回公募公債	100,000,000	105,656,000	
	横浜市平成22年度第1回公募公債	100,000,000	105,489,000	
	横浜市平成22年度第3回公募公債	100,000,000	103,743,000	
	横浜市平成22年度第4回公募公債	100,000,000	101,874,000	
	横浜市平成23年度第1回公募公債	100,000,000	103,332,000	
	横浜市平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,684,000	
	横浜市第5回20年公募公債	100,000,000	110,739,000	
	札幌市平成18年度第4回公募公債	100,000,000	106,627,000	
	札幌市平成23年度第4回公募公債(10年)	100,000,000	101,718,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	108,015,000	
	福岡市平成19年度第3回公募公債	100,000,000	108,095,000	
	福岡市平成19年度第5回公募公債	100,000,000	106,289,000	
	福岡市平成20年度第5回公募公債	100,000,000	106,930,000	
広島市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	104,558,000		
地方債証券 小計		22,523,400,000	23,737,943,248	
特殊債券	政府保証第7回日本政策投資銀行債券	102,000,000	104,013,480	
	政府保証第8回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,647,000	

政府保証第10回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,991,000	
政府保証第15回日本政策投資銀行債券	210,000,000	231,613,200	
政府保証第16回日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,506,000	
政府保証第21回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,067,000	
第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,381,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,883,000	
第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,194,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,559,000	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,847,000	
第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,951,000	
第47回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,346,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,137,000	
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,125,000	
政府保証第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,595,000	
政府保証第319回道路債券	100,000,000	100,908,000	
政府保証第323回道路債券	100,000,000	102,061,000	
政府保証第325回道路債券	101,000,000	102,984,650	
政府保証第327回道路債券	100,000,000	102,537,000	
政府保証第328回道路債券	100,000,000	102,660,000	
政府保証第329回道路債券	150,000,000	154,447,500	
政府保証第330回道路債券	100,000,000	103,516,000	
政府保証第333回道路債券	100,000,000	103,452,000	
政府保証第334回道路債券	100,000,000	103,329,000	
政府保証第335回道路債券	100,000,000	103,185,000	
政府保証第336回道路債券	131,000,000	135,329,550	
政府保証第338回道路債券	100,000,000	103,782,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第343回道路債券	100,000,000	103,525,000	
	政府保証第346回道路債券	115,000,000	119,608,050	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,621,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,850,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,885,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	168,076,500	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,948,000	
	第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,417,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,703,000	
	第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,215,000	
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,615,000	
	第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,841,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,457,000	
	第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,232,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,521,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,870,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,276,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,537,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,506,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,292,000	
	第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,551,000	
	第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,867,000	
	第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,863,000	
	政府保証第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,733,000	
	政府保証第14回日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	167,771,770	
	政府保証第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	108,467,940	
	政府保証第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,973,000	
	政府保証第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,982,500	

政府保証第33回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,953,000	
政府保証第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,047,000	
政府保証第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,670,000	
政府保証第43回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,509,000	
政府保証第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,014,000	
政府保証第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,509,000	
政府保証第54回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,007,000	
政府保証第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,045,000	
政府保証第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,666,000	
政府保証第62回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,913,000	
政府保証第66回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,720,000	
政府保証第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,742,000	
政府保証第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,389,000	
政府保証第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,262,000	
政府保証第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,502,000	
政府保証第77回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,512,000	
政府保証第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,298,000	
政府保証第80回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,813,000	
政府保証第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,199,000	
政府保証第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,452,000	
政府保証第91回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,686,000	
政府保証第93回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,093,000	
政府保証第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,626,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第98回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,303,000	
	政府保証第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,017,000	
	政府保証第103回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,236,000	
	政府保証第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,984,000	
	政府保証第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,322,000	
	政府保証第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,135,000	
	政府保証第111回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,599,000	
	政府保証第133回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,536,000	
	第21回道路債券	100,000,000	112,520,000	
	第26回道路債券	100,000,000	102,187,000	
	第27回道路債券	100,000,000	112,759,000	
	第30回道路債券	100,000,000	102,682,000	
	第33回道路債券	100,000,000	114,355,000	
	第37回道路債券	100,000,000	103,346,000	
	第38回道路債券	100,000,000	110,817,000	
	第41回道路債券	100,000,000	103,525,000	
	第42回道路債券	100,000,000	110,078,000	
	20年第17回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,803,000	
	政府保証第20回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,932,000	
	政府保証第22回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,644,000	
	政府保証第26回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,628,000	
	政府保証第27回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,664,000	
	政府保証第829回公営企業債券	100,000,000	101,065,000	
	政府保証第830回公営企業債券	100,000,000	100,902,000	
	政府保証第832回公営企業債券	100,000,000	101,722,000	
	政府保証第833回公営企業債券	100,000,000	101,962,000	
	政府保証第838回公営企業債券	100,000,000	102,528,000	
政府保証第839回公営企業債券	100,000,000	102,642,000		
政府保証第841回公営企業債券	100,000,000	103,498,000		
政府保証第843回公営企業債券	100,000,000	103,108,000		

政府保証第847回公営企業債券	100,000,000	103,301,000	
政府保証第848回公営企業債券	100,000,000	103,128,000	
政府保証第850回公営企業債券	100,000,000	103,589,000	
政府保証第851回公営企業債券	100,000,000	103,411,000	
政府保証第852回公営企業債券	100,000,000	103,506,000	
政府保証第855回公営企業債券	100,000,000	103,743,000	
政府保証第857回公営企業債券	100,000,000	104,995,000	
政府保証第859回公営企業債券	100,000,000	104,838,000	
政府保証第860回公営企業債券	100,000,000	105,269,000	
政府保証第862回公営企業債券	100,000,000	106,236,000	
政府保証第864回公営企業債券	100,000,000	106,840,000	
政府保証第871回公営企業債券	100,000,000	107,161,000	
政府保証第874回公営企業債券	100,000,000	106,930,000	
政府保証第876回公営企業債券	200,000,000	216,216,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第877回公営企業債券	200,000,000	216,348,000	
	政府保証第879回公営企業債券	200,000,000	214,696,000	
	政府保証第884回公営企業債券	100,000,000	106,038,000	
	政府保証第885回公営企業債券	100,000,000	107,808,000	
	政府保証第886回公営企業債券	100,000,000	108,454,000	
	政府保証15年第2回公営企業債券	100,000,000	111,342,000	
	政府保証第2回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	214,772,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	108,004,000	
	政府保証第3回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	212,274,000	
	政府保証第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,524,000	
	第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,951,000	
	第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,412,000	
	20年第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	109,389,000	
	政府保証第8回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,834,000	
	第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,036,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,411,000	
	政府保証第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,858,000	
	政府保証第5回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,703,000	
	政府保証第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,108,000	
	20年第4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,609,000	
	政府保証第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,320,000	
	政府保証第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,264,000	
	政府保証第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,998,000	
	20年第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,617,000	
	第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,287,000	
	政府保証第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,144,000	
	政府保証第14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,502,000	
	20年第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,521,000	
	20年第5回公営企業債券	100,000,000	110,364,000	
	20年第9回公営企業債券	100,000,000	112,412,000	
	20年第11回公営企業債券	100,000,000	109,659,000	
	20年第15回公営企業債券	100,000,000	109,811,000	
	20年第17回公営企業債券	200,000,000	224,948,000	
	20年第24回公営企業債券	100,000,000	110,059,000	
	第12回公営企業債券	200,000,000	206,056,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	103,764,000	
	第17回公営企業債券	200,000,000	208,914,000	
	第19回公営企業債券	200,000,000	213,454,000	
	第23回公営企業債券	100,000,000	107,262,000	
	第24回公営企業債券	100,000,000	107,396,000	

政府保証第187回首都高速道路債券	200,000,000	204,100,000	
政府保証第189回首都高速道路債券	100,000,000	101,937,000	
政府保証第190回首都高速道路債券	100,000,000	102,197,000	
政府保証第197回首都高速道路債券	100,000,000	103,752,000	
首都高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	101,015,000	
第9回首都高速道路債券	100,000,000	102,823,000	
政府保証第144回阪神高速道路債券	100,000,000	103,730,000	
政府保証第148回阪神高速道路債券	100,000,000	103,763,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	103,415,000	
政府保証第176回中小企業債券	100,000,000	101,835,000	
政府保証第178回中小企業債券	100,000,000	102,042,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	政府保証第184回中小企業債券	100,000,000	103,172,000	
	政府保証第187回中小企業債券	100,000,000	104,698,000	
	政府保証第191回中小企業債券	200,000,000	214,610,000	
	株式会社日本政策金融公庫第7回社債（一般担保付）	100,000,000	100,960,000	
	政府保証第1回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,580,000	
	政府保証第4回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,103,000	
	第12回国際協力銀行債券	100,000,000	102,417,000	
	第15回国際協力銀行債券	100,000,000	103,043,000	
	第16回国際協力銀行債券	100,000,000	110,253,000	
	第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,347,000	
	第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,366,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,654,000	
	第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,755,000	
	第29回国際協力銀行債券	100,000,000	107,265,000	
	第49回都市再生債券	100,000,000	104,691,000	
	第16回都市再生債券	100,000,000	106,830,000	
	第24回都市再生債券	100,000,000	108,364,000	
	第34回都市再生債券	100,000,000	104,995,000	
	第35回都市再生債券	100,000,000	101,059,000	
	第43回都市再生債券	100,000,000	103,682,000	
	政府保証第27回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,008,000	
	第2回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,431,000	
	第322回東京交通債券	100,000,000	110,306,000	
	第323回東京交通債券	100,000,000	113,637,000	
	第324回東京交通債券	100,000,000	114,066,000	
	第344回東京交通債券	100,000,000	105,758,000	
	政府保証第174回預金保険機構債券	100,000,000	100,419,000	
	政府保証第177回預金保険機構債券	100,000,000	100,309,000	
	貸付債権担保第18回住宅金融公庫債券	41,494,000	43,385,296	
	貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	98,519,000	100,299,238	
	一般担保第67回住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,170,000	
	貸付債権担保S種第1回住宅金融支援機構債券	85,362,000	90,418,844	
	貸付債権担保第1回住宅金融支援機構債券	295,585,000	313,207,777	
	一般担保第2回住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,692,000	
	貸付債権担保S種第2回住宅金融支援機構債券	44,285,000	47,243,680	
	一般担保第6回住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,033,000	
	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	124,996,000	131,424,544	
	一般担保第11回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,755,000	
	一般担保第14回住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,054,000	
	一般担保第17回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,224,000	
	一般担保第21回住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,340,000	
	一般担保第23回住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,359,000	
	貸付債権担保S種第12回住宅金融支援機構債券	63,682,000	67,394,660	

一般担保第25回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,219,000	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	73,259,000	78,522,659	
一般担保第29回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,080,000	
一般担保第30回住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,185,000	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	71,724,000	76,578,997	
貸付債権担保第26回住宅金融支援機構債券	144,068,000	152,542,079	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	202,140,000	212,079,223	
貸付債権担保S種第18回住宅金融支援機構債券	67,602,000	70,491,985	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	一般担保第41回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,054,000	
	一般担保第43回住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,315,000	
	貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	83,357,000	87,220,596	
	貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	87,144,000	91,096,851	
	貸付債権担保第36回住宅金融支援機構債券	88,055,000	91,738,340	
	貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	181,240,000	185,002,542	
	貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	92,809,000	94,205,775	
	貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	93,213,000	95,789,407	
	貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	93,663,000	97,663,346	
	貸付債権担保第49回住宅金融支援機構債券	95,408,000	99,091,702	
	貸付債権担保第50回住宅金融支援機構債券	95,835,000	98,855,719	
	貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	96,321,000	99,198,108	
	貸付債権担保第53回住宅金融支援機構債券	97,155,000	98,864,928	
	貸付債権担保第54回住宅金融支援機構債券	97,453,000	99,194,485	
	貸付債券担保第55回住宅金融支援機構債券	97,911,000	99,256,297	
	貸付債権担保S種第1回住宅金融公庫債券	33,102,000	34,168,546	
	貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	102,396,000	107,255,714	
	貸付債権担保S種第5回住宅金融公庫債券	35,828,000	37,378,635	
	貸付債権担保S種第6回住宅金融公庫債券	37,436,000	39,986,140	
	貸付債権担保S種第7回住宅金融公庫債券	152,136,000	162,449,299	
	貸付債権担保S種第8回住宅金融公庫債券	38,793,000	41,209,415	
	貸付債権担保S種第9回住宅金融公庫債券	38,753,000	41,242,105	
	貸付債権担保S種第10回住宅金融公庫債券	39,996,000	42,481,351	
	貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	26,680,000	27,808,830	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	64,664,000	66,373,069	
	貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券	35,426,000	35,395,179	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	38,618,000	40,025,626	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	87,070,000	92,074,783	
	貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券	46,632,000	48,438,057	
	貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券	50,910,000	52,930,617	
	貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券	164,940,000	171,743,775	
	貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券	57,730,000	59,722,839	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	180,300,000	186,541,986	
	貸付債権担保第34回住宅金融公庫債券	61,897,000	64,451,489	
	貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券	58,019,000	60,617,090	
	貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券	58,846,000	61,469,354	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	173,973,000	181,288,564	
	貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	117,062,000	122,532,307	
	貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券	59,453,000	62,829,335	
	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	56,840,000	60,924,522	
	貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券	54,970,000	58,339,111	
	貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券	172,515,000	183,354,117	
	貸付債権担保第53回住宅金融公庫債券	58,763,000	62,020,233	
政府保証第12回国民生活債券	100,000,000	102,214,000		
政府保証第15回国民生活債券	100,000,000	103,734,000		
政府保証第19回国民生活債券	125,000,000	133,226,250		

政府保証第20回国民生活債券	100,000,000	102,841,000	
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,802,000	
い第704号商工債	200,000,000	203,668,000	
い第705号商工債	100,000,000	102,015,000	
い第707号商工債	200,000,000	204,210,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	い第710号商工債	200,000,000	203,080,000	
	い第713号商工債	100,000,000	101,372,000	
	い第714号商工債	100,000,000	101,665,000	
	い第715号商工債	100,000,000	101,200,000	
	い第716号商工債	100,000,000	101,241,000	
	い第717号商工債	100,000,000	101,281,000	
	い第726号商工債	100,000,000	100,738,000	
	い第733号商工債	100,000,000	101,120,000	
	い第701号農林債	100,000,000	101,633,000	
	い第704号農林債	100,000,000	101,703,000	
	い第708号農林債	100,000,000	101,754,000	
	い第715号農林債	200,000,000	202,248,000	
	い第717号農林債	100,000,000	101,348,000	
	い第718号農林債	100,000,000	101,233,000	
	い第720号農林債	100,000,000	101,159,000	
	い第721号農林債	100,000,000	101,041,000	
	い第724号農林債	100,000,000	100,783,000	
	い第725号農林債	100,000,000	100,468,000	
	い第728号農林債	100,000,000	100,996,000	
	い第729号農林債	100,000,000	101,745,000	
	い第730号農林債	100,000,000	101,566,000	
	い第732号農林債	100,000,000	101,196,000	
	第224回信金中金債（5年）	100,000,000	101,429,000	
	第225回信金中金債（5年）	100,000,000	101,292,000	
	第228回信金中金債（5年）	100,000,000	101,777,000	
	第230回信金中金債（5年）	200,000,000	203,310,000	
	第231回信金中金債（5年）	100,000,000	101,912,000	
	第234回信金中金債（5年）	100,000,000	101,793,000	
	第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,693,000	
	第238回信金中金債（5年）	100,000,000	101,402,000	
	第243回信金中金債（5年）	100,000,000	101,254,000	
	第246回信金中金債（5年）	100,000,000	101,219,000	
	第248回信金中金債（5年）	100,000,000	100,977,000	
	第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,368,000	
	第259回信金中金債（5年）	100,000,000	101,079,000	
	第265回信金中金債（5年）	100,000,000	100,783,000	
	政府保証第5回東日本高速道路債券	100,000,000	107,485,000	
	政府保証第8回中日本高速道路債券	100,000,000	107,444,000	
	政府保証第10回中日本高速道路債券	172,000,000	183,905,840	
	政府保証第20回中日本高速道路債券	100,000,000	105,989,000	
中日本高速道路株式会社第2回社債	100,000,000	103,359,000		
中日本高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	108,173,000		
中日本高速道路株式会社第6回社債	100,000,000	107,462,000		
中日本高速道路株式会社第14回社債	100,000,000	100,985,000		
政府保証第3回西日本高速道路債券	100,000,000	106,964,000		
政府保証第20回西日本高速道路債券	100,000,000	106,123,000		
特殊債券 小計		34,755,028,000	36,535,008,396	
社債券	フランス電力第1回円貨社債（2009）	100,000,000	99,918,000	
	ジーディーエフ・スエズ第1回円貨社債（2009）	100,000,000	99,267,000	

第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券(2009)	100,000,000	100,528,000	
---------------------------	-------------	-------------	--

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	203,808,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	103,497,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	98,122,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	102,368,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	99,720,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第8回円貨社債(2012)	100,000,000	101,556,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第4回円貨社債(2010)	100,000,000	101,061,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第6回円貨社債(2011)	100,000,000	100,593,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第2回円貨社債2009	100,000,000	102,145,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第5回円貨社債2010	200,000,000	202,276,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第7回円貨社債2010	100,000,000	100,822,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第1回円貨社債2009	100,000,000	102,002,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第5回円貨社債2010	100,000,000	101,047,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第6回円貨社債2011	100,000,000	100,387,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第3回円貨社債(2009)	100,000,000	102,025,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第4回円貨社債(2010)	100,000,000	101,037,000	
	エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー第1回円貨社債(2009)	100,000,000	100,871,000	
	キリンホールディングス株式会社第3回無担保社債	100,000,000	106,852,000	
	キリンホールディングス株式会社第8回無担保社債	100,000,000	100,755,000	
	日本たばこ産業株式会社第5回社債	100,000,000	101,728,000	
	株式会社セブン&アイ・ホールディングス第5回無担保社債	100,000,000	101,832,000	
	住友化学株式会社第23回無担保社債	100,000,000	101,415,000	
	住友化学株式会社第43回無担保社債	100,000,000	105,505,000	
	三菱化学株式会社第37回無担保社債	100,000,000	108,558,000	
	エーザイ株式会社第7回無担保社債	100,000,000	104,608,000	
	第一三共株式会社第2回無担保社債	100,000,000	107,844,000	
	新日本石油株式会社第26回無担保社債	100,000,000	107,407,000	
	新日本製鐵株式会社第52回無担保社債	100,000,000	102,504,000	
	新日本製鐵株式会社第56回無担保社債	100,000,000	102,292,000	
	新日本製鐵株式会社第62回無担保社債	100,000,000	101,837,000	
	新日本製鐵株式会社第67回無担保社債	100,000,000	103,276,000	
	ジェイエフイーホールディングス株式会社第13回無担保社債	100,000,000	101,402,000	
株式会社豊田自動織機第15回無担保社債	100,000,000	104,558,000		
株式会社東芝第50回無担保社債	100,000,000	101,191,000		
三菱電機株式会社第42回無担保社債	100,000,000	101,860,000		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	パナソニック株式会社第7回無担保社債	100,000,000	101,963,000	
	シャープ株式会社第22回無担保社債	100,000,000	99,771,000	
	シャープ株式会社第24回無担保社債	100,000,000	98,423,000	
	ソニー株式会社第17回無担保社債	100,000,000	103,200,000	
	ソニー株式会社第25回無担保社債	100,000,000	101,905,000	
	ソニー株式会社第26回無担保社債	100,000,000	106,377,000	
	松下電工株式会社第3回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,768,000	
	三菱重工業株式会社第22回無担保社債	100,000,000	108,162,000	
	トヨタ自動車株式会社第7回無担保社債	200,000,000	203,340,000	
	トヨタ自動車株式会社第9回無担保社債	100,000,000	101,678,000	
	トヨタ自動車株式会社第10回無担保社債	100,000,000	107,753,000	
	アイシン精機株式会社第5回無担保社債	100,000,000	102,890,000	
	大日本印刷株式会社第1回無担保社債	200,000,000	203,638,000	
	伊藤忠商事株式会社第60回無担保社債	100,000,000	102,365,000	
	伊藤忠商事株式会社第62回無担保社債	100,000,000	102,125,000	
	三井物産株式会社第58回無担保社債	100,000,000	106,942,000	
	住友商事株式会社第39回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	106,049,000	
	三菱商事株式会社第46回無担保社債	100,000,000	102,508,000	
	三菱商事株式会社第53回無担保社債	100,000,000	101,837,000	
	三菱商事株式会社第70回無担保社債	100,000,000	108,115,000	
	三菱商事株式会社第75回無担保社債	100,000,000	103,294,000	
	三菱商事株式会社第76回無担保社債	100,000,000	103,120,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第15回無担保社債	100,000,000	101,765,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第16回無担保社債	300,000,000	305,568,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第17回無担保社債	100,000,000	101,409,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第18回無担保社債	100,000,000	101,255,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第19回無担保社債	200,000,000	202,180,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第21回無担保社債	100,000,000	100,822,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第23回無担保社債	100,000,000	100,419,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第25回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,576,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第35回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,881,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第57回無担保社債	200,000,000	221,904,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債	200,000,000	213,742,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第87回無担保社債	100,000,000	107,363,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第104回無担保社債	200,000,000	204,118,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第106回無担保社債	300,000,000	304,290,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第107回無担保社債	100,000,000	106,564,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第109回無担保社債	100,000,000	101,284,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第116回無担保社債	100,000,000	100,814,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第28回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,329,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第32回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	103,404,000	
株式会社三井住友銀行第44回無担保社債	100,000,000	101,305,000		
株式会社三井住友銀行第45回無担保社債	200,000,000	203,206,000		
株式会社三井住友銀行第47回無担保社債	100,000,000	101,419,000		
株式会社三井住友銀行第48回無担保社債	100,000,000	101,262,000		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	株式会社三井住友銀行第50回無担保社債	100,000,000	100,805,000	
	株式会社三井住友銀行第51回無担保社債	100,000,000	100,353,000	
	株式会社三井住友銀行第52回無担保社債	100,000,000	101,110,000	

株式会社三井住友銀行第22回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	102,549,000	
株式会社三井住友銀行第23回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	207,538,000	
株式会社三井住友銀行第24回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	206,218,000	
株式会社みずほ銀行第3回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,204,000	
株式会社みずほ銀行第8回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,668,000	
NTTファイナンス株式会社第37回無担保社債	100,000,000	101,184,000	
トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債	100,000,000	107,018,000	
トヨタファイナンス株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,434,000	
野村ホールディングス株式会社第22回無担保社債	100,000,000	100,263,000	
野村ホールディングス株式会社第23回無担保社債	100,000,000	102,247,000	
大和証券キャピタル・マーケット株式会社第2回無担保社債	100,000,000	99,225,000	
三井住友海上火災保険株式会社第5回無担保社債	100,000,000	100,985,000	
三井不動産株式会社第40回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,894,000	
三菱地所株式会社第48回無担保社債	100,000,000	113,400,000	
三菱地所株式会社第70回無担保社債	100,000,000	102,549,000	
三菱地所株式会社第79回無担保社債	100,000,000	106,759,000	
三菱地所株式会社第83回無担保社債	100,000,000	110,465,000	
東日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	200,000,000	229,866,000	
東日本旅客鉄道株式会社第13回社債（一般担保付）	100,000,000	114,152,000	
東日本旅客鉄道株式会社第15回社債（一般担保付）	100,000,000	114,829,000	
東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債	100,000,000	109,352,000	
東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債	100,000,000	101,539,000	
東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債	100,000,000	103,263,000	
東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債	100,000,000	103,109,000	
東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債	100,000,000	108,457,000	
東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債	100,000,000	107,596,000	
東日本旅客鉄道株式会社第52回無担保普通社債	100,000,000	106,635,000	
西日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	100,000,000	111,879,000	
西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債	100,000,000	110,931,000	
東海旅客鉄道株式会社第5回普通社債（一般担保付）	100,000,000	114,099,000	
東海旅客鉄道株式会社第10回無担保普通社債	100,000,000	105,293,000	
東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債	200,000,000	214,206,000	
東海旅客鉄道株式会社第25回無担保普通社債	100,000,000	106,782,000	
東海旅客鉄道株式会社第51回無担保普通社債	100,000,000	107,307,000	
東京地下鉄株式会社第3回社債（一般担保付）	100,000,000	106,734,000	
東京地下鉄株式会社第8回社債（一般担保付）	100,000,000	109,914,000	
日本郵船株式会社第27回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	107,343,000	
日本電信電話株式会社第48回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	103,086,000	
日本電信電話株式会社第50回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	104,332,000	
日本電信電話株式会社第51回電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	214,126,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	日本電信電話株式会社第52回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,705,000	
	日本電信電話株式会社第53回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,107,000	
	日本電信電話株式会社第59回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	107,418,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第15回無担保社債	100,000,000	108,725,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第16回無担保社債	100,000,000	101,580,000	
	東京電力株式会社第457回社債	100,000,000	81,080,000	

東京電力株式会社第507回社債	100,000,000	95,211,000	
東京電力株式会社第511回社債	100,000,000	93,384,000	
東京電力株式会社第513回社債	100,000,000	93,319,000	
東京電力株式会社第514回社債	100,000,000	91,939,000	
東京電力株式会社第515回社債	100,000,000	90,719,000	
東京電力株式会社第516回社債	100,000,000	90,010,000	
東京電力株式会社第518回社債	100,000,000	88,895,000	
東京電力株式会社第519回社債	100,000,000	88,389,000	
東京電力株式会社第521回社債	100,000,000	88,170,000	
東京電力株式会社第522回社債	100,000,000	87,996,000	
東京電力株式会社第539回社債	100,000,000	80,785,000	
東京電力株式会社第542回社債	100,000,000	80,585,000	
東京電力株式会社第544回社債	100,000,000	81,909,000	
中部電力株式会社第405回社債	100,000,000	110,290,000	
中部電力株式会社第406回社債	200,000,000	219,290,000	
中部電力株式会社第426回社債	100,000,000	111,913,000	
中部電力株式会社第466回社債	100,000,000	102,513,000	
中部電力株式会社第478回社債	100,000,000	105,301,000	
中部電力株式会社第480回社債	100,000,000	105,142,000	
中部電力株式会社第484回社債	100,000,000	102,060,000	
関西電力株式会社第433回社債（一般担保付）	100,000,000	101,670,000	
関西電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	101,415,000	
関西電力株式会社第443回社債（一般担保付）	100,000,000	102,351,000	
関西電力株式会社第448回社債（一般担保付）	100,000,000	106,406,000	
関西電力株式会社第454回社債（一般担保付）	100,000,000	101,664,000	
関西電力株式会社第463回社債（一般担保付）	100,000,000	103,419,000	
中国電力株式会社第298回社債（一般担保付）	100,000,000	110,429,000	
中国電力株式会社第306回社債（一般担保付）	100,000,000	112,784,000	
中国電力株式会社第311回社債（一般担保付）	100,000,000	111,389,000	
中国電力株式会社第350回社債（一般担保付）	100,000,000	102,506,000	
中国電力株式会社第354回社債（一般担保付）	100,000,000	106,406,000	
北陸電力株式会社第277回社債（一般担保付）	100,000,000	102,381,000	
北陸電力株式会社第283回社債（一般担保付）	100,000,000	106,064,000	
北陸電力株式会社第288回社債（一般担保付）	100,000,000	105,912,000	
東北電力株式会社第383回社債（一般担保付）	100,000,000	110,876,000	
東北電力株式会社第414回社債（一般担保付）	100,000,000	100,648,000	
東北電力株式会社第416回社債（一般担保付）	100,000,000	99,336,000	
東北電力株式会社第420回社債（一般担保付）	100,000,000	101,250,000	
東北電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	104,806,000	
四国電力株式会社第253回社債（一般担保付）	100,000,000	95,029,000	
四国電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	102,324,000	
九州電力株式会社第371回社債（一般担保付）	100,000,000	99,400,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	九州電力株式会社第376回社債（一般担保付）	100,000,000	101,526,000	
	九州電力株式会社第384回社債（一般担保付）	100,000,000	103,617,000	
	九州電力株式会社第387回社債（一般担保付）	100,000,000	104,067,000	
	九州電力株式会社第391回社債（一般担保付）	100,000,000	105,182,000	
	九州電力株式会社第399回社債（一般担保付）	100,000,000	101,807,000	
	九州電力株式会社第405回社債（一般担保付）	100,000,000	105,462,000	
	北海道電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	112,306,000	
	北海道電力株式会社第282回社債（一般担保付）	100,000,000	101,403,000	
	北海道電力株式会社第284回社債（一般担保付）	100,000,000	103,193,000	
	北海道電力株式会社第285回社債（一般担保付）	100,000,000	104,172,000	
	沖縄電力株式会社第9回社債（一般担保付）	100,000,000	101,503,000	
	電源開発株式会社第14回無担保社債	100,000,000	103,183,000	

電源開発株式会社第16回無担保社債	100,000,000	105,376,000	
電源開発株式会社第17回無担保社債	100,000,000	105,607,000	
電源開発株式会社第19回無担保社債	100,000,000	105,693,000	
電源開発株式会社第21回無担保社債	100,000,000	104,563,000	
電源開発株式会社第29回無担保社債	100,000,000	102,458,000	
電源開発株式会社第30回無担保社債	100,000,000	101,964,000	
東京瓦斯株式会社第30回無担保社債	100,000,000	104,173,000	
大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債	100,000,000	114,346,000	
大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債	100,000,000	113,724,000	
大阪瓦斯株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,763,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第21回無担保社債	100,000,000	106,439,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第24回無担保社債	100,000,000	101,229,000	
社債券 小計	21,700,000,000	22,375,930,000	
合計	332,538,428,000	348,761,157,744	

(注) 代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,923,229,999
コール・ローン	2,111,014,368
株式	237,277,395,301
投資信託受益証券	137,841,123
投資証券	5,307,802,918
派生商品評価勘定	23,064,805
未収入金	4,552,065
未収配当金	732,616,535
未収利息	4,157
差入委託証拠金	1,349,773,014
流動資産合計	252,867,294,285
資産合計	252,867,294,285
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	231,938,998
未払解約金	305,885,178
流動負債合計	537,824,176
負債合計	537,824,176
純資産の部	
元本等	
元本	270,920,058,283
剰余金	
欠損金	18,590,588,174
純資産合計	252,329,470,109
負債・純資産合計	252,867,294,285

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1. 有価証券の評価 基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
<p>2 . デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
<p>3 . 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>4 . 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1) 受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2) 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
<p>5 . その他</p>	<p>外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年 6月11日現在
<p>1 . 計算日における受益権総数</p>	<p>270,920,058,283 口</p>
<p>2 . 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額</p>	<p>元本の欠損 18,590,588,174 円</p>
<p>3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)</p>	<p>0.9314 円 (9,314 円)</p>

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在

1．金融商品に対する取組方針

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

2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

3．金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．時価の算定方法

(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「3．デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1．元本の変動

平成24年6月11日現在

特定期間の期首元本額	291,582,705,391 円
特定期間中の追加設定元本額	15,390,970,174 円
特定期間中の一部解約元本額	36,053,617,282 円
計算日の元本額	270,920,058,283 円
計算日の元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	4,533,112,679 円
DC外国株式インデックスファンド	4,004,152,215 円
DC外国株式インデックスファンドL	18,490,555,851 円
DCバランスファンド30	183,386,851 円
DCバランスファンド50	548,560,840 円
DCバランスファンド70	318,330,471 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	199,721,812 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	125,142,151 円
新生・4分散ファンド	163,122,192 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	691,347,930 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	47,926,280 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	152,427,992 円
外国株式インデックスe	4,360,346,646 円
インデックスコレクション(外国株式)	2,093,857,529 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	191,977,994 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	499,498,134 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	444,510,675 円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	20,100,458,567 円

バランスVA30（適格機関投資家専用）	5,107,857,774 円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	38,341,543,402 円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	29,700,669,246 円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	4,691,935,988 円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	387,978,051 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,951,962,435 円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	30,227,138,529 円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	3,267,279,976 円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,730,769,219 円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	29,375,847,158 円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	2,292,696,451 円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	45,679,458,065 円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	5,975,226,200 円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	208,499,461 円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	2,706,802,095 円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,154,488,147 円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	955,353,802 円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	2,314,789,634 円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,545,669,455 円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	2,754,511,124 円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	110,022,179 円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	653,021,520 円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,569,755,613 円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	68,345,950 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	11,192,337,899
投資信託受益証券	6,096,101
投資証券	80,744,314
合計	11,117,689,686

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成24年2月8日から平成24年6月11日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

. ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,710,252,378		9,523,018,193	187,234,185
	合計	9,710,252,378		9,523,018,193	187,234,185

（注）1. 時価の算定方法

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

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

通貨関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年 超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買 建				
	米ドル	1,302,911,305		1,297,555,770	5,355,535
	ユーロ	268,211,299		260,878,580	7,332,719
	英ポンド	233,014,095		223,688,530	9,325,565
	スウェーデンクローナ	10,612,296		10,591,920	20,376
	オーストラリアドル	61,955,635		62,379,970	424,335
	計	1,876,704,630		1,855,094,770	21,609,860
	売 建				
	米ドル	21,088,700		21,091,350	2,650
	英ポンド	78,950,522		78,978,020	27,498
計	100,039,222		100,069,370	30,148	
合計	1,976,743,852		1,955,164,140	21,640,008	

(注) 時価の算定方法

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

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

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

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年6月11日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A . 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	32,900	9.32	306,628.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	73,000	63.84	4,660,320.00	
	APACHE CORP	56,312	82.97	4,672,206.64	
	BAKER HUGHES INC	64,059	39.25	2,514,315.75	
	CABOT OIL & GAS CORP	30,100	32.99	992,999.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	36,100	45.97	1,659,517.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	97,000	18.36	1,780,920.00	
	CHEVRON CORP	289,542	100.84	29,197,415.28	
	CIMAREX ENERGY CO	12,800	49.42	632,576.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	26,900	22.73	611,437.00	
	CONCHO RESOURCES INC	14,200	92.26	1,310,092.00	
	CONOCOPHILLIPS	178,100	53.97	9,612,057.00	
	CONSOL ENERGY INC	32,600	28.25	920,950.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,800	70.21	477,428.00	
	CORE LABORATORIES N.V.	7,000	122.44	857,080.00	
	DENBURY RESOURCES INC	56,300	15.00	844,500.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	56,200	58.71	3,299,502.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,000	60.10	601,000.00	
	ENERGEN CORP	10,400	44.31	460,824.00	
	EOG RESOURCES INC	39,400	93.88	3,698,872.00	
	EQT CORP	21,900	46.16	1,010,904.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	690,402	80.84	55,812,097.68	
	FMC TECHNOLOGIES INC	35,000	40.67	1,423,450.00	
	HALLIBURTON CO	134,800	27.96	3,769,008.00	
	HELMERICH & PAYNE	15,400	46.09	709,786.00	
	HESS CORP	44,800	44.72	2,003,456.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	30,100	31.35	943,635.00	
	KINDER MORGAN INC	62,879	31.53	1,982,574.87	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	12,965	70.30	911,439.50	
	MARATHON OIL CORP	103,100	25.03	2,580,593.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	51,300	37.36	1,916,568.00	
	MURPHY OIL CORP	26,500	45.80	1,213,700.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	41,300	13.37	552,181.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	62,121	66.59	4,136,637.39	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	19,400	29.20	566,480.00	
	NOBLE CORP	37,600	31.88	1,198,688.00	
	NOBLE ENERGY INC	25,900	84.88	2,198,392.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	118,780	85.05	10,102,239.00	
	PEABODY ENERGY CORP	39,000	24.27	946,530.00	
	PHILLIPS 66	92,400	32.12	2,967,888.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,200	94.29	1,621,788.00		
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	20,300	35.53	721,259.00		
QEP RESOURCES INC	25,500	26.29	670,395.00		
RANGE RESOURCES CORP	23,700	56.60	1,341,420.00		
ROWAN COMPANIES PLC	18,700	31.33	585,871.00		
SCHLUMBERGER LIMITED	195,434	64.54	12,613,310.36		
SOUTHWESTERN ENERGY CO	51,100	27.09	1,384,299.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
----	----	-----	-----------	-----------	----

米ドル	SPECTRA ENERGY CORP	95,378	27.81	2,652,462.18	
	SUNOCO INC	16,000	46.75	748,000.00	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	23,500	20.13	473,055.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	22,000	18.64	410,080.00	
	VALERO ENERGY CORP	80,464	21.27	1,711,469.28	
	WEATHERFORD INTL LTD	111,048	12.16	1,350,343.68	
	WHITING PETROLEUM CORP	16,900	42.17	712,673.00	
	WILLIAMS COS INC	86,720	29.37	2,546,966.40	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,800	79.62	2,452,296.00	
	AIRGAS INC	9,600	86.14	826,944.00	
	ALBEMARLE CORP	13,000	60.83	790,790.00	
	ALCOA INC	156,200	8.52	1,330,824.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,600	30.30	442,380.00	
	BALL CORP	22,200	41.15	913,530.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	22,500	38.41	864,225.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,600	170.52	1,636,992.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	20,600	48.77	1,004,662.00	
	CROWN HOLDINGS INC	21,800	34.31	747,958.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	173,602	32.11	5,574,360.22	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	136,546	49.50	6,759,027.00	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	19,800	47.72	944,856.00	
	ECOLAB INC	43,200	66.54	2,874,528.00	
	FMC CORP	20,400	51.93	1,059,372.00	
	FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	138,876	33.83	4,698,175.08	
	INTERNATIONAL PAPER CO	60,800	29.27	1,779,616.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,636	56.49	657,317.64	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	46,200	38.23	1,766,226.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,900	67.53	465,957.00	
	MEADWESTVACO CORP	24,600	27.99	688,554.00	
	MONSANTO CO	78,400	79.40	6,224,960.00	
	MOSAIC CO/THE	44,000	48.49	2,133,560.00	
	NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	72,550	50.28	3,647,814.00	
	NUCOR CORP	46,400	37.22	1,727,008.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	24,800	19.38	480,624.00	
	PPG INDUSTRIES INC.	22,200	103.68	2,301,696.00	
	PRAXAIR INC	43,714	105.91	4,629,749.74	
	ROCK-TENN COMPANY-CL A	10,200	53.14	542,028.00	
	SEALED AIR CORP	25,200	15.63	393,876.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO	13,000	131.42	1,708,460.00	
	SIGMA-ALDRICH	17,700	70.70	1,251,390.00	
UNITED STATES STEEL CORP	22,100	19.13	422,773.00		
VULCAN MATERIALS COMPANY	19,300	34.23	660,639.00		
WALTER ENERGY INC	9,000	47.30	425,700.00		
3M COMPANY	96,638	86.00	8,310,868.00		
AGCO CORP	14,000	41.33	578,620.00		
AMETEK INC	23,000	51.87	1,193,010.00		
BOEING COMPANY	103,795	69.94	7,259,422.30		
CATERPILLAR INC	94,800	87.60	8,304,480.00		
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	23,200	69.33	1,608,456.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	CUMMINS INC	26,700	96.80	2,584,560.00	
	DANAHER CORP	85,804	51.51	4,419,764.04	
	DEERE & CO	56,226	74.31	4,178,154.06	
	DOVER CORP	26,700	56.68	1,513,356.00	

EATON CORP	46,600	41.24	1,921,784.00
EMERSON ELECTRIC CO	107,600	46.69	5,023,844.00
FASTENAL CO	41,100	40.27	1,655,097.00
FLOWSERVE CORP	8,000	105.11	840,880.00
FLUOR CORP	24,400	48.53	1,184,132.00
GENERAL DYNAMICS CORPORATION	44,400	64.06	2,844,264.00
GENERAL ELECTRIC	1,549,945	19.20	29,758,944.00
GOODRICH CORP	18,400	126.34	2,324,656.00
GRAINGER (W.W.) INC	8,600	189.98	1,633,828.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	107,900	55.99	6,041,321.00
ILLINOIS TOOL WORKS	63,776	56.01	3,572,093.76
INGERSOLL-RAND PLC	44,868	40.79	1,830,165.72
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	18,500	36.44	674,140.00
JOY GLOBAL INC	15,700	58.12	912,484.00
KBR INC	21,400	25.75	551,050.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	14,400	69.62	1,002,528.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	40,500	83.29	3,373,245.00
MASCO CORP	51,700	13.50	697,950.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	35,700	59.77	2,133,789.00
PACCAR INC	49,675	38.62	1,918,448.50
PALL CORP	16,600	52.98	879,468.00
PARKER HANNIFIN CORP	22,150	81.27	1,800,130.50
PENTAIR INC	14,800	39.81	589,188.00
PRECISION CASTPARTS CORP	21,300	163.98	3,492,774.00
QUANTA SERVICES INC	29,700	22.54	669,438.00
RAYTHEON COMPANY	49,800	51.58	2,568,684.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	20,900	69.87	1,460,283.00
ROCKWELL COLLONS	21,800	50.31	1,096,758.00
ROPER INDUSTRIES INC	14,200	100.16	1,422,272.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,900	30.55	394,095.00
SPX CORP	7,700	70.76	544,852.00
STANLEY BLACK AND DECKER INC	23,637	64.67	1,528,604.79
TEXTRON INC	40,000	24.31	972,400.00
TRANSDIGM GROUP INC	7,000	127.14	889,980.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	67,532	53.49	3,612,286.68
UNITED TECHNOLOGIES CORP	126,700	75.50	9,565,850.00
URS CORP	11,900	36.02	428,638.00
XYLEM INC	27,100	25.92	702,432.00
AVERY DENNISON CORP	15,200	28.32	430,464.00
CINTAS CORP	16,800	36.38	611,184.00
DUN & BRADSTREET CORP	7,000	66.98	468,860.00
EQUIFAX INC	17,400	46.85	815,190.00
IHS INC-CLASS A	6,700	101.63	680,921.00
IRON MOUNTAIN INC	20,800	32.72	680,576.00
MANPOWERGROUP	12,400	35.71	442,804.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	NIELSEN HOLDINGS NV	18,500	27.01	499,685.00	
	PITNEY BOWES INC	29,806	14.28	425,629.68	
	REPUBLIC SERVICES INC	46,070	26.29	1,211,180.30	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	28.28	574,084.00	
	STERICYCLE INC	12,400	87.54	1,085,496.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	20,000	47.59	951,800.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	64,200	32.48	2,085,216.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	23,600	57.92	1,366,912.00	

CSX CORP	154,100	21.08	3,248,428.00	
DELTA AIR LINES INC	33,200	10.38	344,616.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	30,500	39.36	1,200,480.00	
FEDEX CORP	43,795	87.57	3,835,128.15	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	40,900	12.57	514,113.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	14,000	55.39	775,460.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	15,800	67.13	1,060,654.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	48,400	66.44	3,215,696.00	
SOUTHWEST AIRLINES	31,100	9.06	281,766.00	
UNION PACIFIC CORPORATION	70,360	110.64	7,784,630.40	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	13,000	23.49	305,370.00	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	105,820	76.63	8,108,986.60	
AUTOLIV INC	12,900	57.25	738,525.00	
BORGWARNER INC	15,800	68.13	1,076,454.00	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	14,400	28.75	414,000.00	
FORD MOTOR CO	519,070	10.66	5,533,286.20	
GENERAL MOTORS CO	114,700	22.05	2,529,135.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,500	10.49	382,885.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	33,400	48.66	1,625,244.00	
JOHNSON CONTROLS INC	99,742	29.46	2,938,399.32	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	15,200	38.85	590,520.00	
COACH INC	42,000	64.00	2,688,000.00	
DR HORTON INC	40,900	15.97	653,173.00	
FOSSIL INC	7,700	76.15	586,355.00	
GARMIN LTD	17,400	41.77	726,798.00	
HASBRO INC	17,400	34.50	600,300.00	
LEGGETT & PLATT INC	20,000	20.84	416,800.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	14,500	64.77	939,165.00	
MATTEL INC	49,700	31.69	1,574,993.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,800	68.45	602,360.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	43,300	17.99	778,967.00	
NIKE INC. CLASS B	54,000	108.64	5,866,560.00	
PVH CORP	10,100	79.96	807,596.00	
RALPH LAUREN CORP	8,900	145.05	1,290,945.00	
TOLL BROTHERS INC	22,500	25.82	580,950.00	
VF CORP	13,000	139.68	1,815,840.00	
WHIRLPOOL CORP	11,000	60.83	669,130.00	
APOLLO GROUP INC-CL A	17,500	34.98	612,150.00	
CARNIVAL CORP	65,500	33.03	2,163,465.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,600	407.34	1,873,764.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	19,000	50.02	950,380.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	H&R BLOCK INC	44,000	15.45	679,800.00	
	INTL GAME TECHNOLOGY	44,500	13.84	615,880.00	
	LAS VEGAS SANDS CORP	59,100	46.13	2,726,283.00	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,574	37.80	1,458,097.20	
	MC DONALD'S CORPORATION	149,156	87.75	13,088,439.00	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	53,700	11.39	611,643.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,300	24.24	516,312.00	
	STARBUCKS CORP	110,400	53.59	5,916,336.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	28,720	52.09	1,496,024.80	
	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	21,400	50.73	1,085,622.00	
	WYNN RESORTS LTD	11,700	104.21	1,219,257.00	
	YUM BRANDS INC	67,400	64.59	4,353,366.00	

CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	30,300	11.55	349,965.00
CBS CORP-CL B	88,670	32.24	2,858,720.80
CHARTER COMMUNICATION-A	5,900	64.12	378,308.00
COMCAST CORP-CL A	306,923	30.27	9,290,559.21
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	88,050	29.76	2,620,368.00
DIRECTV-CLASS A	99,069	44.10	4,368,942.90
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	20,884	51.02	1,065,501.68
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,784	47.60	798,918.40
DISH NETWORK CORP-A	29,900	27.90	834,210.00
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	68,860	10.84	746,442.40
LIBERTY GLOBAL INC-A	19,953	46.66	931,006.98
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	17,100	45.21	773,091.00
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	15,700	84.20	1,321,940.00
MCGRAW-HILL INC	36,700	43.52	1,597,184.00
NEWS CORP INC CLASS A	247,405	19.44	4,809,553.20
NEWS CORP INC CLASS B	63,165	19.68	1,243,087.20
OMNICOM GROUP	39,700	48.06	1,907,982.00
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	13,100	56.42	739,102.00
SIRIUS XM RADIO INC	538,700	1.86	1,001,982.00
THE WALT DISNEY CO.	249,458	46.24	11,534,937.92
TIME WARNER CABLE	45,841	76.07	3,487,124.87
TIME WARNER INC	143,762	35.23	5,064,735.26
VIACOM INC-CLASS B	71,970	47.64	3,428,650.80
VIRGIN MEDIA INC	41,150	22.83	939,454.50
WASHINGTON POST -CL B	700	364.12	254,884.00
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	12,600	32.16	405,216.00
ADVANCE AUTO PARTS	10,450	74.33	776,748.50
AMAZON.COM INC	53,300	218.48	11,644,984.00
AUTOZONE INC	5,100	385.76	1,967,376.00
BED BATH & BEYOND INC	35,200	70.81	2,492,512.00
BEST BUY CO INC	44,250	19.98	884,115.00
CARMAX INC	32,600	28.15	917,690.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	14,200	47.22	670,524.00
DOLLAR GENERAL CORP	26,700	50.29	1,342,743.00
DOLLAR TREE INC	17,450	106.72	1,862,264.00
EXPEDIA INC	14,425	47.85	690,236.25
FAMILY DOLLAR STORES	14,900	69.58	1,036,742.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	GAMESTOP CORP-CLASS A	20,700	19.03	393,921.00	
	GAP INC/THE	45,600	26.24	1,196,544.00	
	GENUINE PARTS CO	22,400	61.60	1,379,840.00	
	HOME DEPOT INC	225,804	52.35	11,820,839.40	
	J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	23,000	25.18	579,140.00	
	KOHL'S CORP	35,220	45.08	1,587,717.60	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	80,647	16.69	1,345,998.43	
	LIMITED BRANDS	36,430	42.80	1,559,204.00	
	LOWE'S COS INC	181,096	27.92	5,056,200.32	
	MACY'S INC	60,452	37.21	2,249,418.92	
	NETFLIX INC	7,600	65.64	498,864.00	
	NORDSTROM INC	24,200	48.77	1,180,234.00	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18,500	98.09	1,814,665.00	
	PETSMART INC	16,100	66.63	1,072,743.00	
	PRICELINE.COM INC	7,300	644.36	4,703,828.00	
	ROSS STORES INC	33,300	64.50	2,147,850.00	

SEARS HOLDING CORP	6,385	52.28	333,807.80
STAPLES INC	100,450	12.86	1,291,787.00
TARGET CORP	93,120	59.20	5,512,704.00
TIFFANY & CO	18,600	55.28	1,028,208.00
TJX COMPANIES INC	110,500	41.46	4,581,330.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,500	87.70	920,850.00
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	8,800	94.00	827,200.00
URBAN OUTFITTERS INC	17,700	27.64	489,228.00
COSTCO WHOLESALE CORP	63,700	88.74	5,652,738.00
CVS CAREMARK CORP	190,783	44.89	8,564,248.87
KROGER CO	81,500	21.57	1,757,955.00
SAFeway INC	39,300	18.22	716,046.00
SYSCO CORP	84,790	28.80	2,441,952.00
WAL-MART STORES	275,926	68.22	18,823,671.72
WALGREEN CO	127,906	31.16	3,985,550.96
WHOLE FOODS MARKET INC	25,400	90.93	2,309,622.00
ALTRIA GROUP INC	299,675	32.91	9,862,304.25
ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	96,910	31.85	3,086,583.50
BEAM INC	20,700	61.25	1,267,875.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,980	89.20	1,068,616.00
BUNGE LIMITED	21,000	59.31	1,245,510.00
CAMPBELL SOUP	27,600	31.72	875,472.00
COCA-COLA CO/THE	298,334	75.24	22,446,650.16
COCA-COLA ENTERPRISES	44,900	26.94	1,209,606.00
CONAGRA FOODS INC	59,550	25.14	1,497,087.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	26,700	19.15	511,305.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	30,886	42.64	1,316,979.04
GENERAL MILLS INC	94,380	38.20	3,605,316.00
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	18,900	23.13	437,157.00
HEINZ (H.J.) CO	46,900	53.59	2,513,371.00
HERSHEY CO/THE	23,700	67.57	1,601,409.00
HORMEL FOODS CORP	21,000	29.76	624,960.00
JM SMUCKER CO/THE	16,400	75.75	1,242,300.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	KELLOGG CO	36,200	48.63	1,760,406.00	
	KRAFT FOODS INC-A	246,018	38.24	9,407,728.32	
	LORILLARD INC	19,487	123.16	2,400,018.92	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,300	55.80	965,340.00	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	29,800	81.45	2,427,210.00	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	22,700	38.98	884,846.00	
	MONSTER BEVERAGE CORP	21,700	76.10	1,651,370.00	
	PEPSICO INC	230,021	68.31	15,712,734.51	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	252,175	83.97	21,175,134.75	
	RALCORP HOLDINGS INC	8,400	64.42	541,128.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	50,300	41.13	2,068,839.00	
	SARA LEE CORP	86,700	20.13	1,745,271.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	43,100	19.05	821,055.00	
	AVON PRODUCTS, INC	61,940	15.89	984,226.60	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	20,600	53.81	1,108,486.00	
	CLOROX COMPANY	18,100	71.82	1,299,942.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	70,200	100.17	7,031,934.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	10,000	73.39	733,900.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	34,600	55.01	1,903,346.00	
	HERBALIFE LTD	16,800	45.04	756,672.00	

KIMBERLY-CLARK CORP	57,647	81.20	4,680,936.40	
PROCTER & GAMBLE CO	403,415	62.75	25,314,291.25	
AETNA INC	52,100	43.24	2,252,804.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	37,200	37.06	1,378,632.00	
BARD (C.R.) INC	11,700	99.61	1,165,437.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC	82,110	50.62	4,156,408.20	
BECTON DICKINSON & CO	30,900	73.26	2,263,734.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	212,786	5.71	1,215,008.06	
CARDINAL HEALTH INC	50,654	41.90	2,122,402.60	
CAREFUSION CORP	32,277	24.57	793,045.89	
CERNER CORP	21,100	78.95	1,665,845.00	
CIGNA CORP	42,000	44.87	1,884,540.00	
COVENTRY HEALTH CARE INC	21,550	32.45	699,297.50	
COVIDIEN PLC	70,832	52.27	3,702,388.64	
DAVITA INC	13,500	85.60	1,155,600.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	20,400	37.21	759,084.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,800	88.23	1,482,264.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	117,044	53.19	6,225,570.36	
HCA HOLDINGS INC	25,100	25.75	646,325.00	
HENRY SCHEIN INC	13,000	74.32	966,160.00	
HOLOGIC INC	37,844	16.94	641,077.36	
HUMANA INC	24,000	79.41	1,905,840.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,800	536.70	3,112,860.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,300	85.69	1,225,367.00	
MCKESSON CORP	36,000	88.42	3,183,120.00	
MEDTRONIC, INCORPORATED	154,545	37.33	5,769,164.85	
OMNICARE INC	16,500	33.36	550,440.00	
PATTERSON COS INC	14,500	33.19	481,255.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,200	55.43	1,285,976.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ST JUDE MEDICAL INC	46,700	38.97	1,819,899.00	
	STRYKER CORP	44,600	51.31	2,288,426.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	153,168	58.00	8,883,744.00	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,200	59.47	963,414.00	
	WELLPOINT INC	49,998	69.07	3,453,361.86	
	ZIMMER HOLDINGS INC	25,800	60.96	1,572,768.00	
	ABBOTT LABORATORIES	230,353	61.88	14,254,243.64	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	50,900	39.60	2,015,640.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,200	92.43	2,514,096.00	
	ALLERGAN INC	44,600	91.48	4,080,008.00	
	AMGEN INC	115,962	68.87	7,986,302.94	
	BIOGEN IDEC INC	33,157	133.52	4,427,122.64	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	247,275	34.37	8,498,841.75	
	CELGENE CORP	64,300	65.04	4,182,072.00	
	ELI LILLY & CO	152,933	41.53	6,351,307.49	
	FOREST LABORATORIES INC	38,400	35.69	1,370,496.00	
	GILEAD SCIENCES INC	110,900	49.64	5,505,076.00	
	HOSPIRA INC	23,715	32.79	777,614.85	
	ILLUMINA INC	17,500	39.54	691,950.00	
	JOHNSON & JOHNSON	402,070	62.98	25,322,368.60	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	25,600	41.84	1,071,104.00	
	MERCK & CO. INC.	445,919	38.46	17,150,044.74	
MYLAN INC	62,500	21.55	1,346,875.00		
PERRIGO CO	13,000	106.20	1,380,600.00		

PFIZER	1,103,972	22.14	24,441,940.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,800	129.69	1,400,652.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	54,400	50.87	2,767,328.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30,800	56.98	1,754,984.00
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	25,600	19.19	491,264.00
WATERS CORPORATION	12,900	78.78	1,016,262.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,300	70.89	1,297,287.00
BB&T CORPORATION	102,100	29.01	2,961,921.00
CIT GROUP INC	27,400	34.53	946,122.00
COMERICA INC	28,600	29.49	843,414.00
FIFTH THIRD BANCORP	134,743	12.93	1,742,226.99
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,400	31.81	426,254.00
HUDSON CITY BANCORP INC	70,900	6.04	428,236.00
KEYCORP	136,940	7.28	996,923.20
M & T BANK CORP	16,700	79.93	1,334,831.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	62,900	12.15	764,235.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	53,900	11.71	631,169.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	77,288	59.35	4,587,042.80
REGIONS FINANCIAL CORP	206,937	6.15	1,272,662.55
SUNTRUST BANKS INC	78,608	22.18	1,743,525.44
US BANCORP	279,857	30.10	8,423,695.70
WELLS FARGO & COMPANY	733,820	31.43	23,063,962.60
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,600	103.76	788,576.00
AMERICAN EXPRESS COMPANY	153,801	55.86	8,591,323.86
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32,580	48.53	1,581,107.40

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	BANK OF AMERICA CORP	1,572,000	7.56	11,884,320.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	176,492	20.50	3,618,086.00	
	BLACKROCK INC	19,400	173.91	3,373,854.00	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,984	52.59	3,838,228.56	
	CITIGROUP INC	428,976	27.77	11,912,663.52	
	CME GROUP INC	9,200	271.55	2,498,260.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	78,957	32.82	2,591,368.74	
	EATON VANCE CORP	17,900	25.09	449,111.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	22,200	108.10	2,399,820.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	68,900	94.54	6,513,806.00	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,500	127.89	1,342,845.00	
	INVESCO LTD	64,811	22.82	1,478,987.02	
	JPMORGAN CHASE & CO	556,587	33.68	18,745,850.16	
	LEGG MASON INC	19,900	25.60	509,440.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	29,900	20.76	620,724.00	
	MOODY'S CORP	29,400	36.30	1,067,220.00	
	MORGAN STANLEY	217,414	13.71	2,980,745.94	
	NASDAQ OMX GROUP	18,600	22.12	411,432.00	
	NORTHERN TRUST CORP	31,800	43.27	1,375,986.00	
	NYSE GROUP INC	37,700	24.60	927,420.00	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	158,300	12.30	1,947,090.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	22,100	18.28	403,988.00	
	SLM CORP	73,100	14.53	1,062,143.00	
	STATE STREET CORP	71,473	42.16	3,013,301.68	
	T ROWE PRICE GROUP INC	37,178	58.80	2,186,066.40	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	32,800	16.78	550,384.00	
	ACE LTD	49,400	72.85	3,598,790.00	
	AFLAC INC	68,410	40.64	2,780,182.40	

ALLEGHANY CORP	1,900	328.62	624,378.00
ALLSTATE CORP	72,660	34.31	2,492,964.60
AMERICAN INT'L GROUP	88,613	30.48	2,700,924.24
AON PLC	45,200	46.78	2,114,456.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,100	38.42	772,242.00
ASSURANT INC	13,800	33.97	468,786.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	17,900	32.61	583,719.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	133,500	81.36	10,861,560.00
CHUBB CORP	40,018	71.54	2,862,887.72
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,071	36.71	846,936.41
EVEREST RE GROUP LTD	8,100	102.15	827,415.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	29,965	19.52	584,916.80
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	70,600	5.38	379,828.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	60,900	17.17	1,045,653.00
LINCOLN NATIONAL CORP	43,407	20.98	910,678.86
LOEWS CORP	46,490	39.87	1,853,556.30
MARSH & MCLENNAN COS	79,639	31.98	2,546,855.22
METLIFE INC	124,340	29.75	3,699,115.00
PARTNERRE LTD	9,300	72.09	670,437.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43,900	24.81	1,089,159.00
PROGRESSIVE CORP	84,200	21.90	1,843,980.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	68,586	47.97	3,290,070.42	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,900	75.64	597,556.00	
	TORCHMARK CORP	15,300	47.50	726,750.00	
	TRAVELERS COS INC/THE	57,613	62.14	3,580,071.82	
	UNUM GROUP	42,000	19.79	831,180.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	25,500	35.59	907,545.00	
	WR BERKLEY CORP	17,450	38.30	668,335.00	
	XL GROUP PLC	46,100	20.39	939,979.00	
	CBRE GROUP INC	45,600	16.24	740,544.00	
	WEYERHAEUSER CO	78,612	20.45	1,607,615.40	
	ACCENTURE PLC-CL A	94,800	58.53	5,548,644.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	65,800	11.83	778,414.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	72,300	31.65	2,288,295.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	30.12	777,096.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,200	124.80	898,560.00	
	ANSYS INC	13,600	64.59	878,424.00	
	AUTODESK INC	32,600	32.78	1,068,628.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	71,900	53.68	3,859,592.00	
	BMC SOFTWARE INC	24,500	43.70	1,070,650.00	
	CA INC	49,800	25.47	1,268,406.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	27,200	77.12	2,097,664.00	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	44,400	58.85	2,612,940.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	22,300	26.15	583,145.00	
	EBAY INC	169,672	41.05	6,965,035.60	
	ELECTRONIC ARTS INC	47,610	13.47	641,306.70	
	EQUINIX INC	6,800	167.03	1,135,804.00	
	FACEBOOK INC-A	65,200	27.10	1,766,920.00	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	34,423	32.39	1,114,960.97	
	FISERV INC	20,300	69.10	1,402,730.00	
	GOOGLE INC-CLASS A	37,800	580.45	21,941,010.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	161,278	195.14	31,471,788.92	

INTUIT INC	40,600	57.00	2,314,200.00	
LINKEDIN CORP - A	6,200	96.26	596,812.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	16,000	416.55	6,664,800.00	
MICROSOFT CORP	1,106,091	29.65	32,795,598.15	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	36,100	21.24	766,764.00	
ORACLE CORP	588,976	27.16	15,996,588.16	
PAYCHEX INC	47,800	31.01	1,482,278.00	
RACKSPACE HOSTING INC	15,800	45.42	717,636.00	
RED HAT INC	28,300	55.76	1,578,008.00	
SAIC INC	40,800	11.52	470,016.00	
SALESFORCE.COM INC	18,900	136.49	2,579,661.00	
SYMANTEC CORP	105,900	14.57	1,542,963.00	
SYNOPSYS INC	21,400	29.46	630,444.00	
TERADATA CORP	24,500	68.66	1,682,170.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,775	23.45	580,973.75	
VERIFONE SYSTEMS INC	15,600	35.00	546,000.00	
VERISIGN INC	23,400	39.81	931,554.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	76,900	116.58	8,965,002.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	VMWARE INC-CLASS A	12,300	93.80	1,153,740.00	
	WESTERN UNION CO	90,848	16.20	1,471,737.60	
	YAHOO! INC	169,300	15.65	2,649,545.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	23,900	54.86	1,311,154.00	
	APPLE INC	136,600	580.32	79,271,712.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	16,700	34.36	573,812.00	
	AVNET INC	22,200	30.70	681,540.00	
	CISCO SYSTEMS INC	788,913	16.73	13,198,514.49	
	CORNING INC	225,800	13.13	2,964,754.00	
	DELL INC	223,758	12.12	2,711,946.96	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,600	41.80	317,680.00	
	EMC CORP/MASS	300,700	24.64	7,409,248.00	
	F5 NETWORKS INC	11,500	102.40	1,177,600.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	106,500	6.70	713,550.00	
	FLIR SYSTEMS INC	23,300	21.15	492,795.00	
	HARRIS CORP	17,300	40.86	706,878.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	289,500	22.31	6,458,745.00	
	JUNIPER NETWORKS INC	77,100	16.89	1,302,219.00	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	39,771	48.60	1,932,870.60	
	NETAPP INC	52,960	30.33	1,606,276.80	
	QUALCOMM INC	247,738	58.76	14,557,084.88	
	SANDISK CORP	35,500	35.43	1,257,765.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	60,300	23.39	1,410,417.00	
	TE CONNECTIVITY LTD	62,432	32.48	2,027,791.36	
	TRIMBLE NAVIGATION LTD	18,300	47.60	871,080.00	
	WESTERN DIGITAL CORP	34,400	31.23	1,074,312.00	
	XEROX CORP	199,212	7.71	1,535,924.52	
	AT&T INC	868,452	34.55	30,005,016.60	
	CENTURYLINK INC	90,767	37.43	3,397,408.81	
	CROWN CASTLE INTL CORP	41,700	55.89	2,330,613.00	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	150,185	3.45	518,138.25	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,420	21.32	477,994.40	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	45,100	6.15	277,365.00		
NII HOLDINGS INC	26,100	11.30	294,930.00		
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	17,000	52.65	895,050.00		

SPRINT NEXTEL CORP	430,338	2.98	1,282,407.24	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	415,348	42.44	17,627,369.12	
WINDSTREAM CORP	83,800	9.36	784,368.00	
AES CORP	93,700	12.55	1,175,935.00	
ALLIANT ENERGY CORP	16,000	44.92	718,720.00	
AMEREN CORPORATION	34,800	33.25	1,157,100.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	70,800	39.72	2,812,176.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,200	34.32	899,184.00	
CALPINE CORP	45,600	16.78	765,168.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	58,200	20.40	1,187,280.00	
CMS ENERGY CORP	37,700	23.56	888,212.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	42,900	62.24	2,670,096.00	
DOMINION RESOURCES INC	83,500	53.23	4,444,705.00	
DTE ENERGY COMPANY	24,400	57.99	1,414,956.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DUKE ENERGY CORP	195,656	23.15	4,529,436.40	
	EDISON INTERNATIONAL	45,300	46.04	2,085,612.00	
	ENTERGY CORP	25,900	66.28	1,716,652.00	
	EXELON CORP	124,677	37.41	4,664,166.57	
	FIRSTENERGY CORP	61,275	47.86	2,932,621.50	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	11,300	55.48	626,924.00	
	MDU RESOURCES GROUP INC	28,500	22.39	638,115.00	
	NEXTERA ENERGY INC	57,694	66.94	3,862,036.36	
	NISOURCE INC	40,400	25.25	1,020,100.00	
	NORTHEAST UTILITIES	45,848	37.39	1,714,256.72	
	NRG ENERGY INC	34,400	15.93	547,992.00	
	ONEOK INC	29,000	41.28	1,197,120.00	
	P G & E CORP	60,500	45.09	2,727,945.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	32,600	19.33	630,158.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	15,700	51.07	801,799.00	
	PPL CORPORATION	84,800	27.88	2,364,224.00	
	PROGRESS ENERGY INC	43,200	58.13	2,511,216.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	74,100	31.93	2,366,013.00	
	SCANA CORP	17,700	46.99	831,723.00	
	SEMPRA ENERGY	33,400	66.73	2,228,782.00	
	SOUTHERN COMPANY	126,232	47.38	5,980,872.16	
	WISCONSIN ENERGY CORP	33,300	38.60	1,285,380.00	
	XCEL ENERGY INC	71,300	28.43	2,027,059.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	85,092	5.91	502,893.72	
	ALTERA CORPORATION	47,200	33.49	1,580,728.00	
	ANALOG DEVICES	43,600	37.10	1,617,560.00	
	APPLIED MATERIALS INC	189,300	10.76	2,036,868.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	33,900	33.84	1,147,176.00	
	BROADCOM CORP-CL A	72,035	34.06	2,453,512.10	
	CREE INC	16,800	23.86	400,848.00	
	INTEL CORP	731,365	26.41	19,315,349.65	
	KLA-TENCOR CORPORATION	23,961	47.33	1,134,074.13	
	LAM RESEARCH CORP	17,900	37.62	673,398.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	32,725	29.82	975,859.50	
	LSI CORP	84,200	6.60	555,720.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	74,000	12.28	908,720.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	41,900	25.92	1,086,048.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	27,500	32.01	880,275.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	144,700	5.88	850,836.00	

	NVIDIA CORP	87,700	12.12	1,062,924.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	167,727	28.52	4,783,574.04	
	XILINX INC	37,700	32.84	1,238,068.00	
米ドル 小計		44,152,871		1,779,357,351.81 (141,636,845,204)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	41,400	20.26	838,764.00	
	ATHABASCA OIL CORPORATION	46,800	10.46	489,528.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	16,900	44.04	744,276.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	16.29	356,751.00	
	CAMECO CORP	56,700	19.72	1,118,124.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	160,640	28.09	4,512,377.60	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	71,000	19.27	1,368,170.00	
	CENOVUS ENERGY INC	110,440	32.48	3,587,091.20	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	42,700	40.25	1,718,675.00	
	ENBRIDGE INC	108,840	38.98	4,242,583.20	
	ENCANA CORP	107,740	20.84	2,245,301.60	
	ENERPLUS CORP	27,500	13.51	371,525.00	
	HUSKY ENERGY INC	49,500	23.83	1,179,585.00	
	IMPERIAL OIL LTD	43,500	42.92	1,867,020.00	
	MEG ENERGY CORP	18,100	35.16	636,396.00	
	NEXEN INC	75,900	16.39	1,244,001.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	42,800	25.70	1,099,960.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	41,000	27.16	1,113,560.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	53,600	7.43	398,248.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	67,778	13.63	923,814.14	
	PRECISION DRILLING CORP	36,000	7.97	286,920.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	29,000	11.09	321,610.00	
	SUNCOR ENERGY INC	230,632	29.03	6,695,246.96	
	TALISMAN ENERGY INC	151,100	10.82	1,634,902.00	
	TOURMALINE OIL CORP	18,600	24.13	448,818.00	
	TRANSCANADA CORP	103,150	42.32	4,365,308.00	
	VERMILION ENERGY INC	13,700	43.44	595,128.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	24,600	41.30	1,015,980.00	
	AGRIUM INC	23,100	81.49	1,882,419.00	
	BARRICK GOLD CORP	146,500	40.13	5,879,045.00	
	CENTERRA GOLD INC	24,700	11.74	289,978.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	98,700	12.10	1,194,270.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	68,500	18.18	1,245,330.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	20,300	45.60	925,680.00	
	GOLDCORP INC	118,640	40.26	4,776,446.40	
	IAMGOLD CORP	54,000	12.44	671,760.00	
	INMET MINING CORPORATION	7,800	43.41	338,598.00	
	IVANHOE MINES LTD	42,900	10.72	459,888.00	
	KINROSS GOLD CORP	166,620	8.51	1,417,936.20	
	NEW GOLD INC	67,600	10.33	698,308.00	
	OSISKO MINING CORP	56,500	8.06	455,390.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,500	18.82	423,450.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	125,800	39.36	4,951,488.00	
	SILVER WHEATON CORP	51,800	28.24	1,462,832.00	
	SINO-FOREST CORPORATION	34,700	0.00	0.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	84,445	32.10	2,710,684.50		
YAMANA GOLD INC	109,300	16.31	1,782,683.00		
BOMBARDIER INC CL B	206,640	3.74	772,833.60		

CAE INC	37,000	9.75	360,750.00
FINNING INTERNATIONAL INC	24,700	23.76	586,872.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	21,700	38.52	835,884.00
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,000	20.42	285,880.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,800	83.66	5,421,168.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,010	73.54	1,839,235.40

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	MAGNA INTERNATIONAL INC	32,500	40.76	1,324,700.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,300	25.81	446,513.00	
	TIM HORTONS INC	22,803	54.69	1,247,096.07	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	53,840	19.40	1,044,496.00	
	THOMSON REUTERS CORP	54,553	28.99	1,581,491.47	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	11,300	68.21	770,773.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,800	41.69	742,082.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	54.50	228,900.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	16,200	32.32	523,584.00	
	METRO INC	14,500	50.60	733,700.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	30,900	39.99	1,235,691.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,500	58.23	436,725.00	
	SAPUTO INC	20,200	41.57	839,714.00	
	VITERRA INC	46,300	16.11	745,893.00	
	SXC HEALTH SOLUTIONS CORP	9,100	96.49	878,059.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	42,700	49.78	2,125,606.00	
	BANK OF MONTREAL	93,762	54.02	5,065,023.24	
	BANK OF NOVA SCOTIA	161,200	51.85	8,358,220.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,000	70.43	4,155,370.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,600	73.50	1,734,600.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	210,900	50.31	10,610,379.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	132,650	77.92	10,336,088.00	
	CI FINANCIAL CORP	23,500	21.70	509,950.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,100	39.60	597,960.00	
	ONEX CORPORATION	13,300	39.85	530,005.00	
	TMX GROUP INC	10,800	46.10	497,880.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,900	400.12	1,160,348.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	41,000	20.77	851,570.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	22.67	299,244.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	18,700	61.88	1,157,156.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	263,800	10.82	2,854,316.00	
	POWER CO OF CANADA	50,200	22.73	1,141,046.00	
	POWER FINANCIAL CORP	35,600	25.43	905,308.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	86,100	21.59	1,858,899.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	82,125	32.96	2,706,840.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	40,625	16.96	689,000.00	
	CGI GROUP INC	32,700	23.30	761,910.00	
	OPEN TEXT CORP	8,800	47.93	421,784.00	
	RESEARCH IN MOTION	67,800	11.16	756,648.00	
	BCE INC	36,892	41.90	1,545,774.80	
BELL ALIANT INC	11,800	26.03	307,154.00		
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	57,700	35.48	2,047,196.00		
TELUS CORP	7,300	58.65	428,145.00		
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,500	57.16	1,286,100.00		
CANADIAN UTILITIES LTD A	8,400	67.50	567,000.00		
FORTIS INC	27,700	33.75	934,875.00		
TRANSALTA CORP	32,000	17.60	563,200.00		

カナダドル 小計	5,623,125		167,632,485.38 (13,065,275,910)	
----------	-----------	--	------------------------------------	--

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	21,767	18.79	409,110.76	
	ENI SPA	352,013	15.93	5,607,567.09	
	FUGRO NV-CVA	9,936	46.94	466,395.84	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	33,226	9.15	304,084.35	
	NESTE OIL OYJ	18,111	7.94	143,801.34	
	OMV AG	23,501	21.90	514,789.40	
	REPSOL YPF SA	116,238	12.76	1,483,778.07	
	SAIPEM	38,782	31.99	1,240,636.18	
	SBM OFFSHORE NV	24,622	10.56	260,008.32	
	TECHNIP S.A.	14,534	76.14	1,106,618.76	
	TENARIS SA	67,817	12.80	868,057.60	
	TOTAL SA	310,923	34.59	10,756,381.18	
	ACERINOX SA	14,331	8.62	123,662.19	
	AIR LIQUIDE	45,742	86.55	3,958,970.10	
	AKZO NOBEL	34,375	37.87	1,301,781.25	
	ARCELORMITTAL	137,182	11.34	1,556,329.79	
	ARKEMA	9,059	55.34	501,325.06	
	BASF SE	134,535	55.47	7,462,656.45	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	28,479	5.51	156,919.29	
	CRH PLC	105,317	13.76	1,449,161.92	
	HEIDELBERGCEMENT AG	20,196	34.06	687,875.76	
	IMERYS SA	5,070	39.08	198,160.95	
	K+S AG	24,740	30.91	764,837.10	
	KONINKLIJKE DSM NV	22,147	38.43	851,219.94	
	LAFARGE SA	28,878	30.63	884,677.53	
	LANXESS	11,950	50.57	604,311.50	
	LINDE AG	25,056	119.20	2,986,675.20	
	SALZGITTER AG	6,046	35.57	215,086.45	
	SOLVAY SA	8,516	82.92	706,146.72	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	87,783	4.44	390,283.21	
	THYSSENKRUPP AG	55,417	12.03	666,943.59	
	UMICORE	16,373	38.09	623,729.43	
	UPM-KYMMENE OYJ	75,394	8.37	631,424.75	
	VOESTALPINE AG	15,781	21.00	331,479.90	
	WACKER CHEMIE AG	2,460	54.20	133,332.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,336	14.51	295,177.04	
	ALSTOM	29,620	24.62	729,244.40	
	ANDRITZ AG	10,663	41.30	440,381.90	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	25.65	267,016.50	
	BOUYGUES SA	27,132	19.68	533,957.76	
	BRENTAG AG	6,789	90.08	611,553.12	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	58,835	27.52	1,619,139.20	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	60,144	26.88	1,616,670.72	
	FERROVIAL SA	59,093	8.00	472,744.00	
	FIAT INDUSTRIAL	125,354	7.70	965,225.80	
	FINMECCANICA SPA	63,634	2.94	187,211.22	
	GEA GROUP AG	25,078	20.83	522,374.74	
	HOCHTIEF AG	4,512	36.86	166,334.88	
	KONE OYJ-B	22,807	44.98	1,025,858.86	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	LEGRAND SA	34,806	24.97	869,279.85	
	MAN SE	6,195	83.53	517,468.35	
	METSO OYJ	18,354	27.14	498,127.56	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	147,790	14.43	2,132,609.70	
	PRYSMIAN SPA	30,401	11.33	344,443.33	
	REXEL SA	15,749	14.29	225,053.21	
	SAFRAN S.A.	33,597	27.00	907,119.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	76,372	43.32	3,308,816.90	
	SIEMENS AG-REG	120,518	65.26	7,865,004.68	
	THALES SA	15,278	23.89	365,067.81	
	VALLOUREC	16,248	28.65	465,586.44	
	VINCI S.A.	66,411	32.62	2,166,326.82	
	WARTSILA OYJ	24,078	25.76	620,249.28	
	ZARDOYA OTIS SA	22,525	9.23	207,905.75	
	ZODIAC AEROSPACE	4,998	77.83	388,994.34	
	BIC	4,132	80.59	332,997.88	
	BUREAU VERITAS SA	7,847	69.97	549,054.59	
	EDENRED	24,816	21.00	521,136.00	
	RANDSTAD HOLDING NV	17,186	22.59	388,317.67	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	51,149	10.12	517,627.88	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS-RTS	51,149	0.51	26,085.99	
	ADP	5,170	57.75	298,567.50	
	ATLANTIA SPA	49,392	9.51	469,717.92	
	DEUTSCHE POST AG-REG	123,964	13.20	1,636,324.80	
	FRAPORT AG	5,277	41.15	217,174.93	
	GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	81,054	6.28	509,424.39	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	133,230	1.80	240,080.46	
	LUFTHANSA (REGD)	35,142	8.24	289,640.36	
	TNT EXPRESS NV - W/I	50,708	8.99	455,915.62	
	VOPAK (KON)	10,609	47.59	504,882.31	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	48,498	58.82	2,852,652.36	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,791	39.09	304,550.19	
	CONTINENTAL AG	11,490	67.36	773,966.40	
	DAIMLER AG	132,759	35.32	4,689,047.88	
	FIAT SPA	128,208	3.75	481,549.24	
	MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	26,368	48.66	1,283,066.88	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	15,817	29.16	461,223.72	
	PEUGEOT SA	33,785	8.04	271,631.40	
	PIRELLI & CO SPA	34,162	7.96	272,100.33	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	21,991	40.44	889,316.04	
RENAULT SA	27,606	33.55	926,319.33		
VOLKSWAGEN AG	4,404	117.55	517,690.20		
VOLKSWAGEN AG (PREF)	21,184	121.85	2,581,270.40		
ADIDAS-SALOMON AG	30,645	58.19	1,783,232.55		
CHRISTIAN DIOR	7,830	106.35	832,720.50		
HUGO BOSS-PFD	3,036	74.76	226,971.36		
LUXOTTICA GROUP SPA	17,618	25.90	456,306.20		
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	37,191	119.35	4,438,745.85		
ACCOR SA	22,014	24.26	534,169.71		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	AUTOGRILL SPA	16,968	6.88	116,824.68	
	OPAP SA	35,111	3.64	127,804.04	

SODEXO	13,540	59.91	811,181.40	
AXEL SPRINGER AG	5,908	32.89	194,343.66	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	19,712	20.70	408,038.40	
JC DECAUX SA	10,079	16.93	170,687.86	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13,434	45.75	614,672.67	
LAGARDERE S.C.A.	16,950	19.56	331,542.00	
MEDIASET SPA	111,438	1.28	143,086.39	
PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD	12,819	17.29	221,640.51	
PUBLICIS GROUPE	21,397	37.80	808,806.60	
REED ELSEVIER NV	98,786	8.52	842,447.00	
SES	43,040	18.13	780,530.40	
WOLTERS KLUWER	43,323	11.73	508,178.79	
INDITEX	31,956	67.40	2,153,834.40	
PPR	11,146	114.80	1,279,560.80	
CARREFOUR SA	84,580	13.87	1,173,124.60	
CASINO GUICHARD PERRACHON	8,250	64.22	529,815.00	
COLRUYT SA	11,623	31.24	363,160.63	
DELHAIZE GROUP	15,202	27.82	422,995.65	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	86,188	3.52	304,071.26	
JERONIMO MARTINS	31,632	13.93	440,791.92	
KESKO OYJ-B SHS	10,520	19.72	207,454.40	
KONINKLIJKE AHOLD NV	153,191	9.11	1,396,795.53	
METRO AG	19,351	22.64	438,106.64	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	117,625	54.39	6,397,623.75	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	29,529	12.60	372,065.40	
DANONE	84,666	51.25	4,339,132.50	
HEINEKEN HOLDING NV	14,767	32.32	477,269.44	
HEINEKEN NV	33,749	38.02	1,283,305.72	
KERRY GROUP PLC-A	21,855	34.60	756,183.00	
PERNOD-RICARD	31,020	79.05	2,452,131.00	
REMY COINTREAU	3,268	79.82	260,851.76	
SUEDZUCKER AG	10,421	24.33	253,595.03	
UNILEVER NV-CVA	238,608	25.00	5,966,393.04	
BEIERSDORF AG	14,477	52.54	760,621.58	
HENKEL AG & CO KGAA	18,656	43.28	807,431.68	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26,097	51.92	1,354,956.24	
L'OREAL	35,212	91.33	3,215,911.96	
CELESIO AG	12,054	11.61	139,946.94	
ESSILOR INTERNATIONAL	29,784	72.77	2,167,381.68	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	30,728	52.39	1,609,839.92	
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,165	76.83	1,395,616.95	
BAYER AG	121,128	49.46	5,991,596.52	
ELAN CORP PLC	71,914	10.65	765,884.10	
GRIFOLS SA	21,846	18.86	412,015.56	
MERCK KGAA	9,281	74.33	689,856.73	
ORION OYJ	14,834	14.04	208,269.36	
QIAGEN N.V.	33,623	13.21	444,159.83	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	SANOFI	176,771	54.95	9,713,566.45	
	UCB SA	16,115	37.87	610,275.05	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	941,085	0.21	202,615.60	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	693,749	5.15	3,574,194.84	
	BANCO DE SABADELL SA	314,802	1.37	431,278.74	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	294,300	0.51	150,975.90	

BANCO POPOLARE SPA	253,270	0.97	245,925.17
BANCO POPULAR ESPANOL	149,046	1.72	256,955.30
BANCO SANTANDER SA	1,371,186	4.84	6,647,509.72
BANKIA SAU	124,412	1.02	128,019.94
BNP PARIBAS	141,524	28.45	4,027,065.42
CAIXABANK	113,827	2.35	267,493.45
CAIXABANK-RTS	113,827	0.05	6,032.83
COMMERZBANK AG	522,207	1.38	724,823.31
CREDIT AGRICOLE SA	143,501	3.15	452,315.15
ERSTE GROUP BANK AG	31,481	14.43	454,270.83
INTESA SANPAOLO	1,475,866	1.09	1,620,500.86
INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	0.92	123,285.52
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	126,938	0.00	0.00
KBC GROUP	23,136	14.32	331,307.52
NATIXIS	137,179	2.01	276,690.04
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,024	22.92	161,025.20
SOCIETE GENERALE	102,309	17.51	1,791,942.13
UNICREDIT SPA	593,362	2.72	1,616,318.08
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	125,480	2.50	314,201.92
DEUTSCHE BANK AG-REG	136,149	28.54	3,885,692.46
DEUTSCHE BOERSE AG	28,563	38.92	1,111,671.96
EURAZEO	4,516	32.48	146,702.26
EXOR SPA	9,213	17.40	160,306.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,587	52.03	602,871.61
ING GROEP NV-CVA	561,036	4.82	2,706,998.70
MEDIOBANCA SPA	74,203	3.22	239,527.28
POHJOLA BANK PLC	21,721	8.73	189,732.93
WENDEL	4,906	53.32	261,587.92
AEGON NV	246,829	3.30	816,757.16
AGEAS	342,089	1.30	447,794.50
ALLIANZ SE-REG	66,690	72.44	4,831,023.60
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	171,033	9.20	1,574,358.76
AXA	258,954	9.63	2,493,985.97
CNP ASSURANCES	21,876	8.87	194,040.12
DELTA LLOYD NV	15,951	9.95	158,744.35
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	9,001	43.96	395,728.96
MAPFRE SA	118,404	1.60	190,156.82
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,269	101.50	2,666,303.50
SAMPO OYJ-A SHS	61,388	18.83	1,155,936.04
SCOR SE	25,931	18.02	467,276.62
VIENNA INSURANCE GROUP AG	5,519	28.50	157,291.50
IMMOFINANZ AG	142,559	2.28	325,319.63
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	44,996	15.28	687,538.88

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	ATOS	7,956	43.98	349,904.88	
	CAP GEMINI SA	21,253	28.32	601,991.22	
	DASSAULT SYSTEMS SA	8,810	72.62	639,782.20	
	SAP AG	134,775	45.50	6,132,936.37	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,952	13.21	223,935.92	
	ALCATEL-LUCENT	333,225	1.25	416,864.47	
	GEMALTO	11,603	51.22	594,305.66	
	NOKIA OYJ	548,545	2.36	1,296,760.38	
	BELGACOM SA	21,846	21.51	470,016.69	
	DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	411,430	7.83	3,223,142.62	

ELISA CORPORATION-A SHS	21,104	15.63	329,855.52		
FRANCE TELECOM SA	271,598	9.79	2,660,302.41		
ILIAD SA	3,342	106.30	355,254.60		
KONINKLIJKE KPN NV	212,195	7.72	1,639,630.76		
MOBISTAR SA	4,718	26.05	122,903.90		
PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD	96,565	3.27	316,153.81		
TELECOM ITALIA SPA	1,348,798	0.73	985,971.33		
TELECOM ITALIA-RNC	865,439	0.59	514,070.76		
TELEFONICA S.A.	601,664	9.78	5,887,282.24		
TELEKOM AUSTRIA AG	47,716	7.83	373,616.28		
TELENET GROUP HOLDING NV	8,307	32.56	270,517.45		
VIVENDI SA	188,784	13.57	2,561,798.88		
ACCIONA S.A.	3,744	41.39	154,964.16		
E.ON AG	263,788	14.41	3,802,504.02		
ELECTRICITE DE FRANCE	34,519	15.64	539,877.16		
ENAGAS	25,715	13.41	344,966.72		
ENEL GREEN POWER SPA	251,326	1.13	285,255.01		
ENEL SPA	964,155	2.43	2,342,896.65		
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	274,095	1.76	482,407.20		
FORTUM OYJ	63,792	14.25	909,036.00		
GAS NATURAL SDG SA	49,847	9.13	455,452.03		
GDF SUEZ	181,476	16.32	2,961,688.32		
IBERDROLA SA	568,672	3.37	1,921,542.68		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,153	32.45	524,245.61		
RWE AG	71,683	28.66	2,054,793.19		
RWE AG-NON VTG PFD	5,510	26.08	143,728.35		
SNAM SPA	230,794	3.34	772,698.31		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	41,762	8.94	373,644.61		
TERNA SPA	191,370	2.76	528,181.20		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	52,241	9.94	519,327.78		
VERBUND AG	10,707	18.95	202,897.65		
ASML HOLDING NV	61,941	38.34	2,374,817.94		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	156,072	6.20	968,270.68		
STMICROELECTRONICS NV	91,539	4.22	386,935.35		
ユーロ 小計	25,690,009		282,541,241.56 (28,417,998,076)		
英債券	AMEC PLC	47,710	9.64	459,924.40	
	BG GROUP PLC	497,441	12.66	6,300,090.26	
	BP PLC	2,779,929	4.09	11,371,299.57	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英債券	PETROFAC LTD	37,249	15.35	571,772.15	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	537,354	20.35	10,935,153.90	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	389,831	21.20	8,264,417.20	
	TULLOW OIL PLC	132,561	14.43	1,912,855.23	
	ANGLO AMERICAN PLC	194,356	20.74	4,030,943.44	
	ANTOFAGASTA PLC	56,634	10.60	600,320.40	
	BHP BILLITON PLC	309,367	17.67	5,466,514.89	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	19,819	22.79	451,675.01	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	4.23	160,751.57	
	EVRAZ PLC	49,067	2.79	136,995.06	
	FRESNILLO PLC	25,751	14.42	371,329.42	
	GLENCORE INTERNATIONAL-W/I	198,841	3.57	711,453.09	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,831	23.28	717,745.68	
	KAZAKHMYS PLC	30,523	7.05	215,187.15	

LONMIN PLC	23,284	7.47	174,047.90
RANDGOLD RESOURCES LTD	13,163	56.25	740,418.75
REXAM PLC	125,947	4.16	524,317.36
RIO TINTO PLC	197,003	28.69	5,652,016.07
VEDANTA RESOURCES PLC	17,850	9.35	166,986.75
XSTRATA PLC	303,979	9.59	2,915,462.58
BAE SYSTEMS PLC	474,154	2.79	1,325,260.43
BALFOUR BEATTY PLC	102,589	2.82	290,019.10
BUNZL PLC	47,484	10.40	493,833.60
COBHAM PLC	154,900	2.29	354,875.90
IMI PLC	47,029	8.67	407,976.57
INVENSYS PLC	124,280	2.17	270,184.72
MEGGITT PLC	111,766	3.79	424,040.20
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	274,239	8.18	2,244,646.21
SMITHS GROUP PLC	56,376	10.09	568,833.84
WEIR GROUP PLC/THE	30,352	14.58	442,532.16
WOLSELEY PLC	41,752	22.11	923,136.72
AGGREKO PLC	39,128	21.81	853,381.68
BABCOCK INTL GROUP PLC	51,575	8.71	449,476.12
CAPITA PLC	95,767	6.49	622,006.66
EXPERIAN PLC	147,206	9.38	1,380,792.28
G4S PLC	202,593	2.76	559,156.68
INTERTEK GROUP PLC	23,002	26.83	617,143.66
SERCO GROUP PLC	71,357	5.40	385,327.80
GKN PLC	231,821	1.81	421,450.57
BURBERRY GROUP PLC	64,263	13.84	889,399.92
CARNIVAL PLC	25,959	21.23	551,109.57
COMPASS GROUP PLC	277,337	6.40	1,774,956.80
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	41,711	15.04	627,333.44
TUI TRABEL PLC	75,914	1.65	125,941.32
WHITBREAD PLC	25,459	18.86	480,156.74
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	163,509	6.96	1,138,022.64
ITV PLC	530,609	0.72	385,487.43
PEARSON PLC	119,521	11.54	1,379,272.34
REED ELSEVIER PLC	178,301	4.93	879,737.13

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	WPP PLC	184,602	7.62	1,406,667.24	
	KINGFISHER PLC	347,013	2.79	968,166.27	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	234,976	3.35	787,639.55	
	NEXT PLC	24,747	30.36	751,318.92	
	MORRISON <WM.>#194 SUPERMARKETS	348,776	2.81	982,153.21	
	SAINSBURY (J) PLC	175,257	2.89	507,544.27	
	TESCO PLC	1,176,515	3.02	3,562,487.42	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	51,164	11.88	607,828.32	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	288,373	31.21	9,000,121.33	
	DIAGEO PLC	366,589	15.92	5,836,096.88	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	146,584	23.77	3,484,301.68	
	SABMILLER PLC	139,895	24.28	3,397,350.07	
	TATE & LYLE PLC	67,155	6.33	425,426.92	
	UNILEVER PLC	187,996	20.45	3,844,518.20	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	96,604	34.83	3,364,717.32	
	SMITH & NEPHEW PLC	131,231	6.04	793,291.39	
	ASTRAZENECA PLC	187,122	26.70	4,996,157.40	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	739,523	14.44	10,678,712.12	

SHIRE PLC	82,397	18.79	1,548,239.63
BARCLAYS PLC	1,697,898	1.90	3,231,948.84
HSBC HLDGS PLC	2,637,253	5.31	14,014,362.44
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,053,102	0.28	1,695,473.87
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	303,904	2.23	677,705.92
STANDARD CHARTERED PLC	349,208	13.60	4,750,974.84
3I GROUP PLC	139,438	1.83	255,310.97
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	125,759	2.48	312,888.39
ICAP PLC	82,261	3.35	275,738.87
INVESTEC PLC	76,017	3.43	260,814.32
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	21,415	9.77	209,331.62
MAN GROUP PLC	265,344	0.79	211,877.18
SCHRODERS PLC	16,868	12.30	207,476.40
ADMIRAL GROUP PLC	29,167	10.74	313,253.58
AVIVA PLC	425,650	2.71	1,155,639.75
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	860,189	1.16	1,003,840.56
OLD MUTUAL PLC	712,894	1.47	1,048,667.07
PRUDENTIAL PLC	373,239	6.96	2,599,609.63
RESOLUTION LTD	197,641	1.98	392,119.74
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	507,007	1.01	514,105.09
STANDARD LIFE PLC	338,020	2.20	744,996.08
SAGE GROUP PLC	189,008	2.60	491,609.80
BT GROUP PLC	1,139,794	2.06	2,353,674.61
INMARSAT PLC	66,872	4.66	311,690.39
VODAFONE GROUP PLC	7,299,177	1.71	12,518,088.55
CENTRICA PLC	757,823	3.15	2,388,658.09
INTERNATIONAL POWER PLC	223,876	4.16	931,771.91
NATIONAL GRID PLC	522,261	6.62	3,457,367.82
SEVERN TRENT PLC	34,121	17.82	608,036.22
SSE PLC	137,455	13.44	1,847,395.20
UNITED UTILITIES GROUP PLC	97,917	6.80	666,325.18

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	ARM HOLDINGS PLC	201,520	5.04	1,016,668.40	
	英ポンド 小計	40,744,991		201,527,329.53 (24,949,083,395)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	51,329	39.86	2,045,973.94	
	GIVAUDAN-REG	1,194	916.50	1,094,301.00	
	HOLCIM LTD-REG	33,538	51.00	1,710,438.00	
	SIKA AG-BR	315	1,839.00	579,285.00	
	SYNGENTA AG	13,857	307.00	4,254,099.00	
	ABB LTD	322,101	15.51	4,995,786.51	
	GEBERIT AG-REG	5,623	184.80	1,039,130.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,093	107.00	330,951.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,982	106.40	742,884.80	
	SULZER AG-REG	3,580	114.20	408,836.00	
	ADECCO SA-REG	19,027	38.70	736,344.90	
	SGS SA	802	1,767.00	1,417,134.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,756	105.20	815,931.20	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	76,460	53.65	4,102,079.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,517	372.90	1,684,389.30	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,481	65.00	421,265.00	
	ARYZTA AG	12,968	43.90	569,295.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	282	853.00	240,546.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	134	2,826.00	378,684.00	

LINDT & SPRUENGLI AG-REG	17	33,845.00	575,365.00		
NESTLE SA-REGISTERD	483,370	54.75	26,464,507.50		
SONOVA HOLDING AG	7,334	89.90	659,326.60		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,124	154.10	173,208.40		
SYNTHES INC	9,564	158.50	1,515,894.00		
ACTELION LTD-REG	15,915	36.42	579,624.30		
LONZA GROUP AG-REG	7,504	33.71	252,959.84		
NOVARTIS AG-REG SHS	336,933	50.30	16,947,729.90		
ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	102,908	153.80	15,827,250.40		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	441	499.00	220,059.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	170,368	19.35	3,296,620.80		
GAM HOLDING LTD	29,620	10.65	315,453.00		
JULIUS BAER GROUP LTD	29,676	31.60	937,761.60		
PARGESA HOLDING SA-BR	4,249	54.00	229,446.00		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,081	160.50	334,000.50		
UBS AG REG	533,082	11.17	5,954,525.94		
BALOISE HOLDING AG-REG	7,186	60.65	435,830.90		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,377	77.55	339,436.35		
SWISS RE LTD	51,585	55.00	2,837,175.00		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,585	201.50	4,349,377.50		
SWISS PRIME SITE-REG	7,167	78.30	561,176.10		
SWISSCOM AG (REG)	3,348	355.30	1,189,544.40		
スイスフラン 小計	2,399,473		111,563,627.28 (9,343,453,784)		
スウェーデン	LUNDIN PETROLEUM AB	31,960	125.20	4,001,392.00	
クローナ	BOLIDEN AB	39,281	93.75	3,682,593.75	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,461	182.10	1,358,648.10	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
スウェーデン	SSAB AB-A SHARES	23,359	56.20	1,312,775.80	
クローナ	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	83,023	101.80	8,451,741.40	
	ALFA LAVAL AB	48,193	118.00	5,686,774.00	
	ASSA ABLOY AB B	48,574	184.00	8,937,616.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	98,361	143.50	14,114,803.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,042	125.90	7,055,687.80	
	SANDVIK AB	146,990	89.25	13,118,857.50	
	SCANIA AB-B SHS	45,957	120.80	5,551,605.60	
	SKANSKA AB-B SHS	57,436	97.05	5,574,163.80	
	SKF AB-B SHS	56,266	142.10	7,995,398.60	
	VOLVO AB-B SHS	203,848	80.65	16,440,341.20	
	SECURITAS AB-B SHS	46,737	53.00	2,477,061.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	35,907	129.60	4,653,547.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	64,179	32.22	2,067,847.38	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,294	296.60	2,163,400.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	139,070	214.30	29,802,701.00	
	SWEDISH MATCH AB	30,590	270.60	8,277,654.00	
	ELEKTA AB-B SHS	13,424	321.80	4,319,843.20	
	GETINGE AB-B SHS	29,874	176.70	5,278,735.80	
	NORDEA BANK AB	385,338	55.35	21,328,458.30	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	202,571	41.88	8,483,673.48	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	71,789	208.50	14,968,006.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	120,170	107.00	12,858,190.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	87.00	1,446,897.00	
	INVESTOR AB-B SHS	65,415	127.20	8,320,788.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	29,534	127.50	3,765,585.00	

	RATOS AB-B SHS	29,254	65.95	1,929,301.30	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	441,126	61.15	26,974,854.90	
	HEXAGON AB-B SHS	37,826	124.80	4,720,684.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	9,193	616.00	5,662,888.00	
	TELE2 AB -B SHS	45,587	104.80	4,777,517.60	
	TELIASONERA AB	317,126	43.85	13,905,975.10	
	スウェーデンクローナ 小計	3,085,386		291,466,009.01 (3,290,651,241)	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	79.00	1,866,454.00	
	SEADRILL LTD	51,550	202.40	10,433,720.00	
	STATOIL ASA	163,471	137.40	22,460,915.40	
	SUBSEA 7 SA	40,419	118.80	4,801,777.20	
	NORSK HYDRO ASA	138,968	26.25	3,647,910.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	26,853	234.70	6,302,399.10	
	ORKLA ASA	110,828	41.50	4,599,362.00	
	DNB ASA	143,148	56.30	8,059,232.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	28,723	67.35	1,934,494.05	
	TELENOR ASA	106,003	91.95	9,746,975.85	
	ノルウェークローネ 小計	833,589		73,853,240.00 (980,032,494)	
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	35,759	159.50	5,703,560.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	79	35,340.00	2,791,860.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	190	37,060.00	7,041,400.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
デンマーク クローネ	DSV A/S	28,360	114.40	3,244,384.00	
	CARLSBERG AS-B	15,363	430.70	6,616,844.10	
	COLOPLAST-B	3,436	1,022.00	3,511,592.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,846	525.50	2,021,073.00	
	NOVO NORDISK AS-B	59,654	783.00	46,709,082.00	
	DANSKE BANK AS	95,534	81.80	7,814,681.20	
	TRYG A/S	3,675	327.50	1,203,562.50	
	TDC A/S	72,506	38.00	2,755,228.00	
	デンマーククローネ 小計	318,402		89,413,267.30 (1,209,761,506)	
オーストラリ アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	13.64	260,128.44	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	159,102	12.67	2,015,822.34	
	SANTOS	138,350	11.85	1,639,447.50	
	WHITEHAVEN COAL LTD	64,057	3.89	249,181.73	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	94,409	32.65	3,082,453.85	
	WORLEYPARSONS LTD	30,113	25.24	760,052.12	
	ALUMINA LTD	374,521	0.94	353,922.34	
	AMCOR LTD	175,546	7.47	1,311,328.62	
	BHP BILLITON LTD	472,309	31.91	15,071,380.19	
	BORAL LIMITED	106,955	3.27	349,742.85	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	205,243	4.59	942,065.37	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	60,132	12.30	739,623.60	
	INCITEC PIVOT LTD	243,103	2.67	649,085.01	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	65,986	7.40	488,296.40	
	LYNAS CORP LTD	261,311	0.96	252,165.11	
	NEWCREST MINING LIMITED	111,976	24.57	2,751,250.32	
	ORICA LIMITED	53,465	23.98	1,282,090.70	
	OZ MINERALS LTD	47,202	8.49	400,744.98	
RIO TINTO LTD	63,828	55.59	3,548,198.52		
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	25,836	9.85	254,484.60		

LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	23,242	16.91	393,022.22	
BRAMBLES LTD	216,844	6.28	1,361,780.32	
BRAMBLES LTD-RIGHTS	10,842	0.44	4,824.69	
CAMPBELL BROTHERS LTD	10,076	53.99	544,003.24	
ASCIANO LTD	140,077	4.32	605,132.64	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	0.97	154,717.91	
QR NATIONAL LTD	245,294	3.40	833,999.60	
TOLL HOLDINGS LIMITED	101,794	4.38	445,857.72	
TRANSURBAN GROUP	192,248	5.73	1,101,581.04	
CROWN LTD	59,796	8.13	486,141.48	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	98,810	4.49	443,656.90	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	107,693	2.92	314,463.56	
TATTS GROUP LTD	202,391	2.60	526,216.60	
FAIRFAX MEDIA LTD	351,320	0.60	210,792.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	1.86	142,359.18	
METCASH LTD	116,059	3.99	463,075.41	
WESFARMERS LTD	147,426	28.99	4,273,879.74	
WOOLWORTHS LIMITED	179,710	26.51	4,764,112.10	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	81,814	13.40	1,096,307.60	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリアドル	COCHLEAR LIMITED	8,173	65.16	532,552.68	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,865	22.09	416,727.85	
	SONIC HEALTHCARE LTD	53,206	12.37	658,158.22	
	CSL LIMITED	76,078	39.24	2,985,300.72	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	392,483	21.56	8,461,933.48	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,379	7.19	405,365.01	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	231,619	50.47	11,689,810.93	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	327,927	22.16	7,266,862.32	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	447,356	20.43	9,139,483.08	
	ASX LTD	25,153	29.54	743,019.62	
	MACQUARIE GROUP LTD	50,057	26.30	1,316,499.10	
	AMP LIMITED	418,141	3.81	1,593,117.21	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	298,580	3.30	985,314.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	169,561	12.40	2,102,556.40	
	SUNCORP GROUP LTD	188,456	7.81	1,471,841.36	
	COMPUTERSHARE LTD	63,842	7.71	492,221.82	
	TELSTRA CORPORATION LTD	637,913	3.64	2,322,003.32	
	AGL ENERGY LTD	66,724	14.87	992,185.88	
	AGL ENERGY LTD-RIGHTS	11,121	3.26	36,254.46	
SP AUSNET	219,745	1.01	223,041.17		
オーストラリアドル 小計		9,055,165		108,401,637.17 (8,615,762,122)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	97,765	6.21	607,120.65	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	145,568	2.50	363,920.00	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.53	308,070.16	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	276,416	2.43	673,072.96	
	CONTACT ENERGY LIMITED	56,144	4.70	263,876.80	
ニュージーランドドル 小計		663,165		2,216,060.57 (136,952,543)	
香港ドル	HOPEWELL HOLDINGS	82,000	20.05	1,644,100.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	312,000	62.50	19,500,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	213,500	11.28	2,408,280.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	186,000	12.16	2,261,760.00	
	MTR CORPORATION	208,000	24.80	5,158,400.00	

ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,500	37.60	1,184,400.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	107,000	24.05	2,573,350.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	214,000	18.46	3,950,440.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	139,200	11.92	1,659,264.00
SANDS CHINA LTD	346,800	25.15	8,722,020.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	230,000	14.92	3,431,600.00
SJM HOLDINGS LTD	283,000	13.90	3,933,700.00
WYNN MACAU LTD	223,600	18.26	4,082,936.00
LI & FUNG LTD	834,400	14.36	11,981,984.00
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	89,500	17.16	1,535,820.00
BANK OF EAST ASIA LIMITED	197,820	25.20	4,985,064.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	542,000	21.65	11,734,300.00
HANG SENG BANK LTD	112,000	99.85	11,183,200.00
WING HANG BANK LIMITED	27,000	75.95	2,050,650.00
FIRST PACIFIC CO	332,000	7.70	2,556,400.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	150,300	106.20	15,961,860.00	
	AIA GROUP LTD	1,499,600	25.55	38,314,780.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	204,000	88.05	17,962,200.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	126,000	45.65	5,751,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	328,000	25.15	8,249,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	136,585	39.90	5,449,741.50	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	99,000	30.50	3,019,500.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	29.90	3,169,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	537,000	8.49	4,559,130.00	
	SINO LAND CO	424,600	10.42	4,424,332.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	230,000	87.10	20,033,000.00	
	SWIRE PACIFIC CL A	104,500	82.50	8,621,250.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	218,000	43.05	9,384,900.00	
	WHEELOCK & CO LTD	137,000	25.35	3,472,950.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	309,000	3.02	933,180.00	
	PCCW LTD	622,000	2.86	1,778,920.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	43.00	3,053,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	264,500	62.85	16,623,825.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	763,370	16.14	12,320,791.80	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	199,500	54.50	10,872,750.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	29,600	93.00	2,752,800.00		
香港ドル 小計		11,270,875		303,247,078.30 (3,111,315,023)	
シンガポール ドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	143,000	0.98	140,855.00	
	FRASER & NEAVE LTD	132,500	6.48	858,600.00	
	KEPPEL CORP LTD	209,500	9.71	2,034,245.00	
	NOBLE GROUP LTD	554,145	1.09	606,788.77	
	SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	142,000	4.93	700,060.00	
	SEBACORP MARINE LTD	125,400	4.33	542,982.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	229,000	2.90	664,100.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	272,000	0.98	266,560.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	296,000	1.46	432,160.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.05	147,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,600	10.10	783,760.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	876,400	1.43	1,257,634.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	236,250	3.78	893,025.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	16,000	42.15	674,400.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	232,800	1.62	378,300.00	

GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,007,720	0.59	599,593.40
WILMAR INTERNATIONAL LTD	276,000	3.46	954,960.00
DBS GROUP HOLDINGS LTD	266,000	13.05	3,471,300.00
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	378,000	8.25	3,118,500.00
UNITED OVERSEAS BANK LTD	186,000	17.32	3,221,520.00
SINGAPORE EXCHANGE LTD	128,000	6.13	784,640.00
CAPITALAND LIMITED	368,000	2.60	956,800.00
CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.41	277,340.00
CITY DEVELOPMENTS LTD	72,000	9.80	705,600.00
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	303,000	2.03	615,090.00
KEPPEL LAND LTD	105,000	2.87	301,350.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
シンガポール ドル	UOL GROUP LTD	67,400	4.38	295,212.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,167,880	3.12	3,643,785.60	
	STARHUB LTD	87,000	3.24	281,880.00	
シンガポールドル 小計		8,290,595		29,608,040.77 (1,849,022,146)	
イスラエル シェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	63,861	40.85	2,608,721.85	
	ISRAEL CORP LTD	327	2,252.00	736,404.00	
	DELEK GROUP LTD	633	650.00	411,450.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,688	133.70	493,085.60	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	138,013	152.30	21,019,379.90	
	BANK HAPOALIM BM	151,941	13.42	2,039,048.22	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	183,464	10.65	1,953,891.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	31.87	620,986.95	
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	148.00	1,338,956.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	269,518	4.88	1,315,247.84	
イスラエルシェケル 小計		839,977		32,537,171.96 (671,241,857)	
合計		152,967,623		237,277,395,301 (237,277,395,301)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	789,000	536,520.00	
		米ドル 小計		789,000	536,520.00 (42,706,992)
	オーストラリア ドル	APA GROUP	94,402	472,010.00	
		LEND LEASE GROUP	78,014	546,878.14	
		SYDNEY AIRPORT	61,192	178,068.72	
オーストラリアドル 小計		233,608	1,196,956.86 (95,134,131)		
投資信託受益証券 合計			1,022,608	137,841,123 (137,841,123)	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	43,900	1,436,847.00	
		AMERICAN TOWER CORP	57,700	3,825,510.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	142,100	2,381,596.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,929	1,973,182.14	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,700	2,282,840.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,700	1,134,168.00	
		DUKE REALTY CORP	37,800	523,908.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	44,000	2,723,600.00	
FED REALTY INVS TRUST	9,200	919,724.00			

	GENERAL GROWTH PROPERTIES	60,497	1,036,313.61	
	HCP INC	60,000	2,502,600.00	
	HEALTH CARE REIT INC	30,800	1,723,568.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	103,681	1,590,466.54	
	KIMCO REALTY CORP	58,500	1,079,325.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,700	592,850.00	
	MACERICH CO	19,000	1,088,130.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考	
投資証券	米ドル	PLUM CREEK TIMBER CO	23,200	866,752.00		
		PROLOGIS INC	67,240	2,142,938.80		
		PUBLIC STORAGE INC	21,300	2,954,523.00		
		RAYONIER INC	17,500	759,150.00		
		REGENCY CENTERS CORP	13,000	581,620.00		
		SIMON PROPERTY GROUP INC	43,565	6,561,324.65		
		SL GREEN REALTY CORP	12,700	960,374.00		
		UDR INC	32,900	856,058.00		
		VENTAS INC	42,300	2,465,667.00		
		VORNADO REALTY TRUST	24,349	2,012,201.36		
	米ドル 小計			1,033,261	46,975,237.10 (3,739,228,873)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,000		286,440.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,000		532,000.00	
	カナダドル 小計			32,000	818,440.00 (63,789,213)	
	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584		0.00	
		CORIO NV	9,339		313,790.40	
		FONCIERE DES REGIONS	4,215		223,268.55	
		GECINA SA	3,446		242,839.62	
		ICADE	3,666		235,173.90	
		KLEPIERRE	14,980		382,963.70	
		UNIBAIL	13,447		1,845,600.75	
	ユーロ 小計			1,654,677	3,243,636.92 (326,245,001)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	125,265		611,794.26	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	85,721		268,135.28	
		HAMMERSON PLC	101,570		422,023.35	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	114,138		818,369.46	
		SEGRO PLC	106,565		230,926.35	
	英ポンド 小計			533,259	2,351,248.70 (291,084,589)	
	オーストラリアドル	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	186,565		371,264.35	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	282,061		533,095.29	
		DEXUS PROPERTY GROUP	694,955		646,308.15	
		GOODMAN GROUP	226,622		777,313.46	
		GPT GROUP	212,033		684,866.59	
MIRVAC GROUP		490,720		608,492.80		
STOCKLAND		333,280		1,076,494.40		
WESTFIELD GROUP		321,300		3,058,776.00		
WESTFIELD RETAIL TRUST	416,692		1,150,069.92			
オーストラリアドル 小計			3,164,228	8,906,680.96 (707,903,002)		
香港ドル	LINK REIT	331,500		10,409,100.00		
香港ドル 小計			331,500	10,409,100.00 (106,797,366)		

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	シンガポール ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	271,000	550,130.00	
		CAPITAMALL TRUST	341,600	614,880.00	
	シンガポールドル 小計		612,600	1,165,010.00 (72,754,874)	
投資証券 合計			7,361,525	5,307,802,918 (5,307,802,918)	
合計				5,445,644,041 (5,445,644,041)	

(注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (注1)	組入投資信託 受益証券 時価比率 (注2)	組入投資証券 時価比率 (注3)	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	606	97.4%	0.0%	2.6%	59.9%
カナダドル	103	99.5%		0.5%	5.4%
ユーロ	247	98.9%		1.1%	11.8%
英ポンド	107	98.8%		1.2%	10.4%
スイスフラン	41	100.0%			3.8%
スウェーデンクローナ	35	100.0%			1.4%
ノルウェークローネ	10	100.0%			0.4%
デンマーククローネ	11	100.0%			0.5%
オーストラリアドル	71	91.5%	1.0%	7.5%	3.9%
ニュージーランドドル	5	100.0%			0.1%
香港ドル	42	96.7%		3.3%	1.3%
シンガポールドル	31	96.2%		3.8%	0.8%
イスラエルシェケル	10	100.0%			0.3%
合計	1,319	97.8%	0.1%	2.2%	100.0%

(注1) 組入株式時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する株式の比率であります。

(注2) 組入投資信託受益証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資信託受益証券の比率であります。

(注3) 組入投資証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資証券の比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	394,401,277
コール・ローン	5,953,475,001
国債証券	389,716,117,446
派生商品評価勘定	84,462,588
未収利息	4,014,331,505
前払費用	126,468,972
差入委託証拠金	230,717,603
流動資産合計	400,519,974,392
資産合計	400,519,974,392
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,525,148
未払解約金	541,469,030
流動負債合計	679,994,178
負債合計	679,994,178
純資産の部	
元本等	
元本	261,445,732,569
剰余金	
剰余金	138,394,247,645
純資産合計	399,839,980,214
負債・純資産合計	400,519,974,392

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1．計算日における受益権総数	261,445,732,569 口
2．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5293 円 (15,293 円)

(金融商品に関する注記)

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在
<p>1．金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、為替変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

(1) 国債証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 元本の変動

平成24年6月11日現在

特定期間の期首元本額	268,151,095,146 円
特定期間中の追加設定元本額	9,053,615,754 円
特定期間中の一部解約元本額	15,758,978,331 円
計算日の元本額	261,445,732,569 円
計算日の元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	5,828,476,675 円
DC外国債券インデックスファンド	1,900,276,458 円
DC外国債券インデックスファンドL	8,926,939,840 円
物価連動債組入世界債券ファンド	93,225,527 円
DCバランスファンド30	110,663,515 円
DCバランスファンド50	166,384,303 円
DCバランスファンド70	33,507,693 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	124,717,666 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	77,303,085 円
新生・4分散ファンド	103,247,620 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	442,303,802 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	29,478,349 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	93,315,215 円
外国債券インデックスe	707,524,845 円
インデックスコレクション(外国債券)	1,038,946,150 円
インデックスコレクション(バランス株式30)	112,746,671 円
インデックスコレクション(バランス株式50)	151,450,238 円
インデックスコレクション(バランス株式70)	46,961,401 円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	413,569,941 円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	17,234,571,704 円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	7,808,742,644 円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	25,247,089,138 円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	86,848,452,948 円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	4,572,176,252 円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	119,668,164 円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	9,210,631,956 円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,390,647,365 円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,080,127,429 円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	19,602,197,137 円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	760,458,018 円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	32,476,558,299 円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,459,198,741 円

VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	508,078,373 円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,643,222,886 円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,626,248,384 円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	388,236,793 円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	156,693,492 円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	3,693,293,083 円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	6,711,958,551 円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	48,060,632 円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	953,846,091 円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	300,566,949 円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	4,143,163,488 円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	59,023,664 円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,781,394 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年6月11日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,949,570,135	
合計	3,949,570,135	

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年2月8日から平成24年6月11日まで)に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,685,482,436		3,676,573,846	8,908,590
	合計	3,685,482,436		3,676,573,846	8,908,590

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成24年6月11日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 買 建				
	米ドル	4,299,046,300		4,305,819,000	6,772,700
	カナダドル	446,209,560		444,201,000	2,008,560
	ユーロ	4,102,651,660		4,083,142,000	19,509,660
	英ポンド	792,677,980		779,877,000	12,800,980
	計	9,640,585,500		9,613,039,000	27,546,500
	売 建				
	米ドル	1,932,665,890		1,934,037,000	1,371,110
	カナダドル	194,302,580		194,825,000	522,420
	ユーロ	1,863,273,770		1,880,659,000	17,385,230
英ポンド	335,904,290		334,233,000	1,671,290	
計	4,326,146,530		4,343,754,000	17,607,470	
合計	13,966,732,030		13,956,793,000	45,153,970	

(注) 時価の算定方法

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

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

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

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A . 株式

該当事項はありません。

B . 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 0.500% 2013/05/31	14,970,000	15,009,764.06	
		US TREASURY N/B 1.125% 2013/06/15	11,410,000	11,513,403.12	
		US TREASURY N/B 0.375% 2013/06/30	1,000,000	1,001,484.38	
		US TREASURY N/B 1.000% 2013/07/15	17,030,000	17,172,360.24	
		US TREASURY N/B 0.375% 2013/07/31	5,000,000	5,007,812.50	
		US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	17,810,000	18,444,481.25	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/08/15	15,000,000	15,090,234.45	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,257,009.37	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/08/31	9,600,000	9,587,250.04	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/08/31	3,210,000	3,322,851.56	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/09/15	15,000,000	15,093,750.00	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/09/30	21,000,000	20,965,546.98	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/10/15	13,700,000	13,742,812.50	
		US TREASURY N/B 0.250% 2013/10/31	10,000,000	9,998,046.90	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/10/31	21,600,000	22,339,125.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/11/15	32,000,000	32,105,000.00	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/11/15	2,140,000	2,261,210.94	
		US TREASURY N/B 0.250% 2013/11/30	12,400,000	12,397,093.81	
		US TREASURY N/B 2.000% 2013/11/30	6,500,000	6,664,531.25	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/12/15	2,000,000	2,014,218.76	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/12/31	1,000,000	997,734.38	
		US TREASURY N/B 1.500% 2013/12/31	40,120,000	40,875,384.57	
		US TREASURY N/B 0.250% 2014/01/31	10,000,000	9,995,703.10	
		US TREASURY N/B 1.750% 2014/01/31	18,900,000	19,353,304.78	
		US TREASURY N/B 1.250% 2014/02/15	25,000,000	25,402,343.75	
		US TREASURY N/B 4.000% 2014/02/15	4,000,000	4,248,125.00	
		US TREASURY N/B 0.250% 2014/02/28	9,000,000	8,995,429.71	
		US TREASURY N/B 1.875% 2014/02/28	2,000,000	2,054,296.88	
		US TREASURY N/B 1.250% 2014/03/15	15,100,000	15,357,171.87	
		US TREASURY N/B 0.250% 2014/03/31	8,000,000	7,996,875.04	
		US TREASURY N/B 1.750% 2014/03/31	13,000,000	13,341,757.78	
		US TREASURY N/B 1.250% 2014/04/15	5,110,000	5,199,824.24	

US TREASURY N/B	0.250%	2014/04/30	17,600,000	17,590,375.08	
US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	6,880,000	7,085,325.00	
US TREASURY N/B	1.000%	2014/05/15	4,900,000	4,966,992.21	
US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	9,300,000	10,096,312.50	
US TREASURY N/B	0.250%	2014/05/31	15,000,000	14,992,968.75	
US TREASURY N/B	2.250%	2014/05/31	7,930,000	8,237,907.07	
US TREASURY N/B	0.750%	2014/06/15	10,000,000	10,091,406.30	
US TREASURY N/B	2.625%	2014/06/30	13,000,000	13,626,640.69	
US TREASURY N/B	0.625%	2014/07/15	2,000,000	2,013,593.76	
US TREASURY N/B	2.625%	2014/07/31	32,650,000	34,262,093.75	
US TREASURY N/B	0.500%	2014/08/15	13,000,000	13,054,843.75	
US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,622,632.81	
US TREASURY N/B	2.375%	2014/08/31	26,000,000	27,184,218.88	
US TREASURY N/B	0.250%	2014/09/15	18,000,000	17,974,687.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 2.375% 2014/09/30	12,150,000	12,727,125.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2014/10/15	5,100,000	5,121,117.21	
		US TREASURY N/B 2.375% 2014/10/31	15,950,000	16,723,824.29	
		US TREASURY N/B 0.375% 2014/11/15	14,000,000	14,013,125.00	
		US TREASURY N/B 4.250% 2014/11/15	9,230,000	10,101,802.38	
		US TREASURY N/B 2.125% 2014/11/30	11,400,000	11,898,750.00	
		US TREASURY N/B 0.250% 2014/12/15	6,100,000	6,087,132.84	
		US TREASURY N/B 2.625% 2014/12/31	3,480,000	3,682,275.00	
		US TREASURY N/B 0.250% 2015/01/15	9,000,000	8,976,796.92	
		US TREASURY N/B 2.250% 2015/01/31	14,900,000	15,645,000.00	
		US TREASURY N/B 0.250% 2015/02/15	15,000,000	14,955,468.75	
		US TREASURY N/B 11.250% 2015/02/15	2,550,000	3,287,308.60	
		US TREASURY N/B 4.000% 2015/02/15	10,020,000	10,986,773.48	
		US TREASURY N/B 2.375% 2015/02/28	15,500,000	16,337,968.75	
		US TREASURY N/B 0.375% 2015/03/15	15,300,000	15,302,390.62	
		US TREASURY N/B 2.500% 2015/03/31	12,820,000	13,578,182.87	
		US TREASURY N/B 0.375% 2015/04/15	23,700,000	23,703,703.12	
		US TREASURY N/B 2.500% 2015/04/30	1,930,000	2,046,403.12	
		US TREASURY N/B 0.250% 2015/05/15	20,090,000	20,017,801.56	
		US TREASURY N/B 4.125% 2015/05/15	1,040,000	1,152,612.50	
US TREASURY N/B 2.125% 2015/05/31	6,950,000	7,304,015.62			
US TREASURY N/B 1.875% 2015/06/30	23,900,000	24,960,562.50			

US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	5,000,000	5,207,031.25	
US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	500,000	560,195.31	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	11,990,000	12,309,421.15	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	22,563,843.75	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	10,264,843.80	
US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	2,160,000	2,454,468.76	
US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	25,771,484.50	
US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	11,629,921.93	
US TREASURY N/B	2.000%	2016/01/31	3,000,000	3,161,718.75	
US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	4,700,000	5,378,562.50	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	12,850,000	13,838,847.72	
US TREASURY N/B	2.250%	2016/03/31	9,150,000	9,741,890.62	
US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	8,443,742.22	
US TREASURY N/B	2.000%	2016/04/30	6,090,000	6,428,756.25	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/04/30	13,580,000	14,656,851.63	
US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	9,000,000	10,587,656.25	
US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,101,851.56	
US TREASURY N/B	1.750%	2016/05/31	10,960,000	11,469,468.80	
US TREASURY N/B	1.500%	2016/06/30	21,960,000	22,766,343.75	
US TREASURY N/B	3.250%	2016/06/30	9,000,000	9,954,843.75	
US TREASURY N/B	1.500%	2016/07/31	9,950,000	10,314,574.26	
US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,941,031.25	
US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	750,000	881,601.56	
US TREASURY N/B	1.000%	2016/08/31	11,000,000	11,176,171.93	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	1,030,000	1,130,827.34	
US TREASURY N/B	1.000%	2016/09/30	10,000,000	10,155,468.80	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,398,437.52	
US TREASURY N/B	1.000%	2016/10/31	9,000,000	9,136,406.25	
US TREASURY N/B	3.125%	2016/10/31	1,400,000	1,548,750.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 4.625% 2016/11/15	2,450,000	2,874,156.25	
		US TREASURY N/B 7.500% 2016/11/15	8,250,000	10,708,242.18	
		US TREASURY N/B 0.875% 2016/11/30	2,000,000	2,019,687.50	
		US TREASURY N/B 2.750% 2016/11/30	15,500,000	16,911,953.12	
		US TREASURY N/B 0.875% 2016/12/31	9,500,000	9,586,835.98	
		US TREASURY N/B 3.250% 2016/12/31	9,800,000	10,924,703.17	
		US TREASURY N/B 3.125% 2017/01/31	5,000,000	5,551,562.50	

US TREASURY N/B	4.625%	2017/02/15	18,500,000	21,845,898.53
US TREASURY N/B	3.000%	2017/02/28	31,550,000	34,884,933.75
US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	17,122,851.63
US TREASURY N/B	0.875%	2017/04/30	7,000,000	7,055,781.25
US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,463,500.00
US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	18,356,945.31
US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	2,700,000	3,750,046.87
US TREASURY N/B	0.625%	2017/05/31	7,000,000	6,968,828.16
US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	10,869,890.62
US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	8,200,000	8,903,406.25
US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	2,000,000	2,159,843.76
US TREASURY N/B	4.750%	2017/08/15	19,000,000	22,843,046.97
US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	2,109,531.26
US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	1,210,000	1,276,171.87
US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	5,166,437.50
US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	5,144,894.55
US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	2,150,625.00
US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	12,131,796.93
US TREASURY N/B	2.625%	2018/01/31	25,250,000	27,688,203.12
US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	6,850,000	7,849,671.87
US TREASURY N/B	2.750%	2018/02/28	290,000	320,223.43
US TREASURY N/B	2.875%	2018/03/31	4,800,000	5,340,000.00
US TREASURY N/B	2.625%	2018/04/30	5,600,000	6,150,375.00
US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	2,040,000	2,391,421.88
US TREASURY N/B	2.375%	2018/05/31	1,100,000	1,191,695.31
US TREASURY N/B	2.375%	2018/06/30	4,960,000	5,378,887.52
US TREASURY N/B	2.250%	2018/07/31	15,000,000	16,154,296.95
US TREASURY N/B	1.500%	2018/08/31	6,500,000	6,709,218.75
US TREASURY N/B	1.375%	2018/09/30	10,520,000	10,768,206.25
US TREASURY N/B	1.750%	2018/10/31	16,630,000	17,410,830.55
US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	5,040,000	5,920,031.27
US TREASURY N/B	1.375%	2018/11/30	9,000,000	9,213,046.92
US TREASURY N/B	1.375%	2018/12/31	3,700,000	3,787,007.83
US TREASURY N/B	1.250%	2019/01/31	30,050,000	30,486,664.06
US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	2,000,000	2,225,156.26
US TREASURY N/B	1.375%	2019/02/28	15,000,000	15,331,640.70
US TREASURY N/B	1.250%	2019/04/30	2,000,000	2,023,281.26
US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	15,520,000	17,690,375.00
US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	1,400,000	1,646,093.75

US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	21,870,000	25,374,325.89
US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	25,030,000	29,529,533.71
US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	26,650,000	31,226,304.68
US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	15,000,000	16,548,046.95
US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	1,800,000	2,847,796.88

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 2.625% 2020/11/15	15,000,000	16,510,546.95	
		US TREASURY N/B 3.625% 2021/02/15	31,230,000	36,912,396.24	
		US TREASURY N/B 3.125% 2021/05/15	9,190,000	10,474,446.13	
		US TREASURY N/B 2.125% 2021/08/15	25,400,000	26,709,687.50	
		US TREASURY N/B 2.000% 2021/11/15	24,320,000	25,233,900.12	
		US TREASURY N/B 8.000% 2021/11/15	6,100,000	9,608,929.71	
		US TREASURY N/B 2.000% 2022/02/15	6,000,000	6,210,000.00	
		US TREASURY N/B 1.750% 2022/05/15	5,000,000	5,050,390.65	
		US TREASURY N/B 7.250% 2022/08/15	1,000,000	1,532,500.00	
		US TREASURY N/B 7.125% 2023/02/15	1,450,000	2,223,710.93	
		US TREASURY N/B 6.250% 2023/08/15	8,080,000	11,768,393.79	
		US TREASURY N/B 7.500% 2024/11/15	4,690,000	7,611,357.05	
		US TREASURY N/B 7.625% 2025/02/15	800,000	1,314,500.00	
		US TREASURY N/B 6.875% 2025/08/15	6,340,000	9,950,828.12	
		US TREASURY N/B 6.000% 2026/02/15	1,040,000	1,532,131.25	
		US TREASURY N/B 6.500% 2026/11/15	2,150,000	3,332,500.00	
		US TREASURY N/B 6.625% 2027/02/15	1,000,000	1,571,796.88	
		US TREASURY N/B 6.375% 2027/08/15	3,940,000	6,106,384.37	
		US TREASURY N/B 6.125% 2027/11/15	2,700,000	4,106,320.32	
		US TREASURY N/B 5.500% 2028/08/15	5,250,000	7,603,476.56	
		US TREASURY N/B 5.250% 2028/11/15	3,350,000	4,747,054.68	
		US TREASURY N/B 5.250% 2029/02/15	1,600,000	2,272,625.00	
		US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15	1,200,000	1,865,812.50	
		US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15	3,520,000	5,589,925.01	
		US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15	5,980,000	8,760,232.84	
		US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15	6,320,000	8,504,843.78	
US TREASURY N/B 4.750% 2037/02/15	3,500,000	4,885,507.83			
US TREASURY N/B 5.000% 2037/05/15	3,400,000	4,914,062.50			
US TREASURY N/B 4.375% 2038/02/15	1,200,000	1,594,406.25			
US TREASURY N/B 4.500% 2038/05/15	1,500,000	2,032,148.44			
US TREASURY N/B 3.500% 2039/02/15	4,770,000	5,520,157.05			

		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	15,510,000	20,264,784.37	
		US TREASURY N/B	4.500%	2039/08/15	7,450,000	10,113,375.00	
		US TREASURY N/B	4.375%	2039/11/15	5,800,000	7,726,234.40	
		US TREASURY N/B	4.625%	2040/02/15	14,700,000	20,341,125.00	
		US TREASURY N/B	4.375%	2040/05/15	11,800,000	15,717,968.75	
		US TREASURY N/B	3.875%	2040/08/15	26,910,000	33,095,095.31	
		US TREASURY N/B	4.250%	2040/11/15	14,820,000	19,377,150.00	
		US TREASURY N/B	4.750%	2041/02/15	7,900,000	11,154,429.72	
		US TREASURY N/B	4.375%	2041/05/15	13,550,000	18,083,957.09	
		US TREASURY N/B	3.750%	2041/08/15	12,440,000	14,984,368.75	
		US TREASURY N/B	3.125%	2041/11/15	17,770,000	19,079,149.30	
		US TREASURY N/B	3.125%	2042/02/15	2,700,000	2,897,648.45	
		US TREASURY N/B	3.000%	2042/05/15	5,080,000	5,318,918.75	
		米ドル 小計			1,923,220,000	2,102,380,173.59 (167,349,461,817)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,651,590.20	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	5,760,000	5,993,971.20	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2013/08/01	4,120,000	4,165,237.60	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	4,020,000	4,091,556.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2013/11/01	2,150,000	2,163,824.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考		
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.000%	2014/02/01	1,390,000	1,389,166.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	3,380,000	3,435,263.00	
		CANADA-GOV'T	0.750%	2014/05/01	1,840,000	1,830,064.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,408,772.00	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	2,790,000	3,004,885.80	
		CANADA-GOV'T	2.250%	2014/08/01	3,800,000	3,897,090.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	8,191,106.10	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2015/02/01	3,850,000	3,841,992.00	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	4,530,000	4,713,193.20	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	3,100,000	3,406,001.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,346,555.90	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2016/06/01	1,200,000	1,235,064.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	6,470,000	7,159,249.10	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2016/09/01	4,910,000	5,209,166.30	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2017/03/01	3,930,000	3,969,300.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	4,950,000	5,586,075.00	

		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	3,150,000	3,659,922.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	8,670,000	9,967,899.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2020/06/01	3,730,000	4,260,480.60	
		CANADA-GOV'T	3.250%	2021/06/01	3,560,000	4,020,236.80	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2022/06/01	3,310,000	3,598,301.00	
		CANADA-GOV'T	9.000%	2025/06/01	860,000	1,546,004.80	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	1,690,000	2,962,384.10	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	4,760,000	7,145,426.40	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	4,970,000	7,782,125.40	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	5,080,000	7,570,774.80	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	6,180,000	8,312,100.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2045/12/01	1,520,000	1,923,484.00	
		カナダドル 小計			130,580,000	149,438,261.80 (11,647,218,124)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	9.000%	2013/06/20	44,110,000	46,051,722.20	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2013/12/19	35,830,000	37,615,408.90	
		MEXICAN BONOS	7.000%	2014/06/19	30,450,000	31,837,302.00	
		MEXICAN BONOS	9.500%	2014/12/18	38,070,000	42,393,990.60	
		MEXICAN BONOS	6.000%	2015/06/18	26,600,000	27,507,326.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2015/12/17	22,840,000	25,141,815.20	
		MEXICAN BONOS	6.250%	2016/06/16	18,860,000	19,770,938.00	
		MEXICAN BONOS	7.250%	2016/12/15	21,990,000	24,026,054.10	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2017/12/14	22,600,000	25,540,486.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2018/12/13	17,750,000	20,990,262.50	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2020/06/11	38,260,000	44,095,797.80	
		MEXICAN BONOS	6.500%	2021/06/10	30,530,000	31,966,131.20	
		MEXICAN BONOS	6.500%	2022/06/09	8,360,000	8,677,847.20	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2023/12/07	10,140,000	11,771,627.40	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2024/12/05	32,410,000	43,387,591.10	
		MEXICAN BONOS	7.500%	2027/06/03	36,430,000	39,702,871.20	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2029/05/31	37,340,000	44,041,783.20	
MEXICAN BONOS	7.750%	2031/05/29	8,000,000	8,702,640.00			
MEXICAN BONOS	10.000%	2036/11/20	27,360,000	36,189,619.20			

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
メキシコ ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	8.500% 2038/11/18	36,630,000	42,173,217.90	
		MEXICAN BONOS	7.750% 2042/11/13	5,010,000	5,304,087.00	

メキシコペソ 小計		549,570,000	616,888,518.70 (3,540,940,097)				
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0326	4.000% 2032/03/28	1,690,000	1,807,286.00		
		BELGIAN 0282	8.000% 2015/03/28	2,160,000	2,561,544.00		
		BELGIAN 0291	5.500% 2028/03/28	5,780,000	7,290,314.00		
		BELGIAN 0300	5.500% 2017/09/28	2,720,000	3,175,600.00		
		BELGIAN 0301	4.250% 2013/09/28	4,420,000	4,624,204.00		
		BELGIAN 0303	4.250% 2014/09/28	4,250,000	4,568,750.00		
		BELGIAN 0304	5.000% 2035/03/28	6,080,000	7,479,008.00		
		BELGIAN 0306	3.750% 2015/09/28	6,920,000	7,446,612.00		
		BELGIAN 0307	3.250% 2016/09/28	4,600,000	4,887,960.00		
		BELGIAN 0308	4.000% 2022/03/28	5,340,000	5,803,512.00		
		BELGIAN 0309	4.000% 2017/03/28	5,110,000	5,590,340.00		
		BELGIAN 0312	4.000% 2018/03/28	6,210,000	6,798,708.00		
		BELGIAN 0314	4.000% 2014/03/28	5,930,000	6,270,382.00		
		BELGIAN 0315	4.000% 2019/03/28	3,420,000	3,745,242.00		
		BELGIAN 0316	3.500% 2015/03/28	1,930,000	2,051,590.00		
		BELGIAN 0318	3.750% 2020/09/28	7,610,000	8,152,593.00		
		BELGIAN 0319	2.750% 2016/03/28	1,740,000	1,817,256.00		
		BELGIAN 0320	4.250% 2041/03/28	3,630,000	4,100,811.00		
		BELGIAN 0321	4.250% 2021/09/28	4,060,000	4,498,074.00		
		BELGIAN 0323	3.500% 2017/06/28	1,750,000	1,869,875.00		
		BELGIAN 0324	4.500% 2026/03/28	1,650,000	1,871,760.00		
		BELGIAN 0325	4.250% 2022/09/28	1,640,000	1,804,984.00		
		BELGIAN 0327	3.000% 2019/09/28	550,000	562,320.00		
		ユーロ	国債証券 (イタリア)	BTPS	2.000% 2013/06/01	7,930,000	7,837,615.50
				BTPS	4.250% 2013/08/01	10,360,000	10,444,019.60
				BTPS	2.250% 2013/11/01	6,530,000	6,415,072.00
				BTPS	3.750% 2013/12/15	8,210,000	8,220,673.00
				BTPS	3.000% 2014/04/01	240,000	236,400.00
BTPS	3.500% 2014/06/01			8,620,000	8,551,040.00		
BTPS	4.250% 2014/07/01			5,490,000	5,516,901.00		
BTPS	4.250% 2014/08/01			4,170,000	4,185,429.00		
BTPS	6.000% 2014/11/15			2,700,000	2,806,110.00		
BTPS	4.250% 2015/02/01			12,230,000	12,226,331.00		
BTPS	2.500% 2015/03/01			2,000,000	1,903,400.00		
BTPS	3.000% 2015/04/15			13,970,000	13,450,316.00		
BTPS	3.000% 2015/06/15			1,880,000	1,804,800.00		
BTPS	3.750% 2015/08/01			12,040,000	11,781,140.00		

	BTPS	3.000%	2015/11/01	8,300,000	7,899,940.00	
	BTPS	3.750%	2016/04/15	5,330,000	5,155,709.00	
	BTPS	3.750%	2016/08/01	8,430,000	8,123,991.00	
	BTPS	4.750%	2016/09/15	8,560,000	8,525,760.00	
	BTPS	4.000%	2017/02/01	9,650,000	9,312,250.00	
	BTPS	4.750%	2017/05/01	3,160,000	3,120,184.00	
	BTPS	5.250%	2017/08/01	11,070,000	11,146,383.00	
	BTPS	4.500%	2018/02/01	6,360,000	6,172,380.00	
	BTPS	4.500%	2018/08/01	5,080,000	4,895,596.00	
	BTPS	4.250%	2019/02/01	9,520,000	9,001,160.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (イタリア)	BTPS	4.500% 2019/03/01	11,620,000	11,073,860.00	
		BTPS	4.250% 2019/09/01	14,580,000	13,661,460.00	
		BTPS	4.500% 2020/02/01	5,620,000	5,321,016.00	
		BTPS	4.250% 2020/03/01	6,310,000	5,873,979.00	
		BTPS	4.000% 2020/09/01	4,250,000	3,871,325.00	
		BTPS	3.750% 2021/03/01	5,240,000	4,661,504.00	
		BTPS	3.750% 2021/08/01	14,100,000	12,427,740.00	
		BTPS	4.750% 2021/09/01	9,980,000	9,464,034.00	
		BTPS	5.000% 2022/03/01	8,340,000	8,006,400.00	
		BTPS	5.500% 2022/09/01	1,200,000	1,183,080.00	
		BTPS	4.750% 2023/08/01	8,530,000	7,905,604.00	
		BTPS	9.000% 2023/11/01	3,920,000	4,867,072.00	
		BTPS	5.000% 2025/03/01	8,470,000	7,826,280.00	
		BTPS	4.500% 2026/03/01	7,000,000	6,099,800.00	
		BTPS	7.250% 2026/11/01	4,000,000	4,437,200.00	
		BTPS	6.500% 2027/11/01	9,310,000	9,566,025.00	
		BTPS	5.250% 2029/11/01	9,580,000	8,850,962.00	
		BTPS	6.000% 2031/05/01	10,920,000	10,783,500.00	
		BTPS	5.750% 2033/02/01	5,250,000	5,025,825.00	
		BTPS	5.000% 2034/08/01	7,820,000	6,826,860.00	
		BTPS	4.000% 2037/02/01	9,000,000	6,882,300.00	
		BTPS	5.000% 2039/08/01	7,650,000	6,578,235.00	
	BTPS	5.000% 2040/09/01	6,140,000	5,263,208.00		
	国債証券 (ドイツ)	BUNDESobl-153	4.000% 2013/10/11	10,060,000	10,590,162.00	
		BUNDESobl-154	2.250% 2014/04/11	10,940,000	11,382,632.40	
		BUNDESobl-155	2.500% 2014/10/10	4,000,000	4,226,000.00	

BUNDESUBL-156	2.500%	2015/02/27	6,970,000	7,423,050.00	
BUNDESUBL-157	2.250%	2015/04/10	9,650,000	10,229,000.00	
BUNDESUBL-158	1.750%	2015/10/09	7,930,000	8,351,479.50	
BUNDESUBL-159	2.000%	2016/02/26	6,180,000	6,591,588.00	
BUNDESUBL-160	2.750%	2016/04/08	540,000	591,948.00	
BUNDESUBL-161	1.250%	2016/10/14	5,620,000	5,845,362.00	
BUNDESUBL-162	0.750%	2017/02/24	6,570,000	6,676,434.00	
BUNDESUBL-163	0.500%	2017/04/07	400,000	401,340.00	
BUNDESSCHATZANW	1.750%	2013/06/14	4,320,000	4,394,952.00	
BUNDESSCHATZANW	0.750%	2013/09/13	1,370,000	1,382,535.50	
BUNDESSCHATZANW	0.250%	2013/12/13	1,310,000	1,314,323.00	
BUNDESSCHATZANW	0.250%	2014/03/14	1,110,000	1,114,162.50	
BUNDESSCHATZANW	0.000%	2014/06/13	100,000	99,910.00	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2013/07/04	10,450,000	10,862,775.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/01/04	13,440,000	14,328,384.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	4,610,000	5,008,304.00	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	11,140,000	12,183,818.00	
DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	7,850,000	8,599,675.00	
DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,786,488.00	
DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,850,000	2,264,122.50	
DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,600,000	8,748,360.00	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	7,400,000	8,536,640.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	7,010,000	8,338,395.00	
DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	5,820,000	6,917,652.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	8,830,000	10,714,322.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (ドイツ)	DEUTSCHLAND REP 3.750% 2019/01/04	9,190,000	10,950,804.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.500% 2019/07/04	10,400,000	12,299,040.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.250% 2020/01/04	8,050,000	9,410,450.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.000% 2020/07/04	6,720,000	7,754,208.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.250% 2020/09/04	13,530,000	14,808,585.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.500% 2021/01/04	5,000,000	5,578,500.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.250% 2021/07/04	4,250,000	5,019,250.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.250% 2021/09/04	3,820,000	4,174,496.00	
		DEUTSCHLAND REP 2.000% 2022/01/04	5,690,000	6,087,162.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.750% 2022/07/04	1,800,000	1,870,200.00	
		DEUTSCHLAND REP 6.250% 2024/01/04	3,930,000	5,913,864.00	

	DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	8,666,048.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	1,910,000	2,878,370.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,140,000	9,960,300.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	3,920,000	6,448,792.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	5,330,000	8,280,688.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	7,980,000	11,990,748.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	11,498,860.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	4,690,000	7,006,860.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2040/07/04	5,770,000	9,331,821.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2042/07/04	5,460,000	7,175,532.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.500%	2044/07/04	1,100,000	1,265,000.00	
国債証券 (フィンランド)	FINNISH GOV'T	5.375%	2013/07/04	1,950,000	2,058,420.00	
	FINNISH GOV'T	3.125%	2014/09/15	2,530,000	2,695,462.00	
	FINNISH GOV'T	4.250%	2015/07/04	2,280,000	2,544,708.00	
	FINNISH GOV'T	1.750%	2016/04/15	2,010,000	2,102,661.00	
	FINNISH GOV'T	1.875%	2017/04/15	1,250,000	1,312,250.00	
	FINNISH GOV'T	3.875%	2017/09/15	2,270,000	2,607,776.00	
	FINNISH GOV'T	4.375%	2019/07/04	1,950,000	2,341,950.00	
	FINNISH GOV'T	3.375%	2020/04/15	2,680,000	3,047,428.00	
	FINNISH GOV'T	3.500%	2021/04/15	1,920,000	2,213,952.00	
	FINNISH GOV'T	4.000%	2025/07/04	2,410,000	2,945,020.00	
	FINNISH GOV'T	2.750%	2028/07/04	940,000	1,010,594.00	
国債証券 (フランス)	BTAN	0.750%	2014/09/25	400,000	402,280.00	
	BTAN	1.750%	2017/02/25	6,210,000	6,313,086.00	
	BTAN-2YR ISSUE	2.000%	2013/09/25	4,190,000	4,283,437.00	
	BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2013/07/12	8,190,000	8,565,921.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2014/01/12	13,190,000	13,639,779.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.000%	2014/07/12	15,830,000	16,664,241.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2015/01/15	5,600,000	5,870,480.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.000%	2015/07/12	9,390,000	9,733,674.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.250%	2016/02/25	7,740,000	8,089,074.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2016/07/25	5,310,000	5,594,616.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/10/25	7,260,000	7,623,000.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/04/25	8,560,000	9,133,520.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/10/25	3,960,000	4,282,344.00	
	FRANCE O.A.T.	3.500%	2015/04/25	11,320,000	12,217,676.00	
	FRANCE O.A.T.	3.000%	2015/10/25	14,790,000	15,811,989.00	
	FRANCE O.A.T.	3.250%	2016/04/25	9,300,000	10,064,460.00	
	FRANCE O.A.T.	5.000%	2016/10/25	10,860,000	12,595,428.00	

		FRANCE O.A.T.	3.750%	2017/04/25	10,840,000	12,015,056.00	
--	--	---------------	--------	------------	------------	---------------	--

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (フランス)	FRANCE O.A.T.	4.250%	2017/10/25	8,230,000	9,365,740.00
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2018/04/25	8,780,000	9,903,840.00
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2018/10/25	8,470,000	9,701,538.00
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2019/04/25	10,400,000	11,925,680.00
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2019/10/25	16,450,000	18,346,685.00
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2019/10/25	4,010,000	5,788,034.00
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2020/04/25	9,960,000	10,921,140.00
		FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	11,690,000	11,895,744.00
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	12,220,000	13,572,754.00
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2021/10/25	2,590,000	2,770,005.00
		FRANCE O.A.T.	3.000%	2022/04/25	6,100,000	6,351,320.00
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	4,090,000	6,368,130.00
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	13,500,000	15,579,000.00
		FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,040,000	6,774,768.00
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	9,050,000	9,594,810.00
		FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,360,000	12,237,264.00
		FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,480,000	11,685,440.00
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,230,000	8,990,505.00
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	9,000,000	10,197,000.00
		FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	7,680,000	9,411,840.00
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	5,360,000	6,202,592.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	3,130,000	3,627,044.00	
	国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	3,870,000	3,733,195.50
		IRISH GOVT	4.500%	2015/02/18	200,000	190,670.00
		IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	3,640,000	3,367,000.00
		IRISH GOVT	4.500%	2018/10/18	3,440,000	2,953,928.00
		IRISH GOVT	4.400%	2019/06/18	3,020,000	2,542,991.00
		IRISH GOVT	5.900%	2019/10/18	2,570,000	2,352,963.50
		IRISH GOVT	4.500%	2020/04/18	4,160,000	3,455,920.00
		IRISH GOVT	5.000%	2020/10/18	2,600,000	2,219,490.00
	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT	4.250%	2013/07/15	5,640,000	5,893,800.00
		NETHERLANDS GOVT	1.000%	2014/01/15	5,690,000	5,762,832.00
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2014/07/15	6,000,000	6,429,600.00
NETHERLANDS GOVT		2.750%	2015/01/15	5,740,000	6,084,400.00	

NETHERLANDS GOVT	0.750%	2015/04/15	1,110,000	1,118,769.00	
NETHERLANDS GOVT	3.250%	2015/07/15	5,040,000	5,457,816.00	
NETHERLANDS GOVT	4.000%	2016/07/15	6,170,000	6,968,398.00	
NETHERLANDS GOVT	2.500%	2017/01/15	4,140,000	4,430,214.00	
NETHERLANDS GOVT	4.500%	2017/07/15	6,180,000	7,229,982.00	
NETHERLANDS GOVT	4.000%	2018/07/15	5,600,000	6,496,000.00	
NETHERLANDS GOVT	4.000%	2019/07/15	8,030,000	9,419,993.00	
NETHERLANDS GOVT	3.500%	2020/07/15	4,450,000	5,094,360.00	
NETHERLANDS GOVT	3.250%	2021/07/15	4,210,000	4,769,088.00	
NETHERLANDS GOVT	2.250%	2022/07/15	1,830,000	1,898,991.00	
NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,940,000	5,844,514.00	
NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,120,000	1,722,224.00	
NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,790,000	6,927,298.00	
NETHERLANDS GOVT	2.500%	2033/01/15	1,430,000	1,492,491.00	
NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,620,000	6,204,660.00	
NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	4,420,000	5,990,426.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (オーストリア)	REP OF AUSTRIA 3.800% 2013/10/20	4,570,000	4,787,989.00		
		REP OF AUSTRIA 4.300% 2014/07/15	3,850,000	4,158,385.00		
		REP OF AUSTRIA 3.400% 2014/10/20	3,950,000	4,219,390.00		
		REP OF AUSTRIA 3.500% 2015/07/15	4,930,000	5,346,092.00		
		REP OF AUSTRIA 4.000% 2016/09/15	4,360,000	4,888,868.00		
		REP OF AUSTRIA 3.200% 2017/02/20	3,170,000	3,450,862.00		
		REP OF AUSTRIA 4.300% 2017/09/15	2,530,000	2,896,091.00		
		REP OF AUSTRIA 4.650% 2018/01/15	3,960,000	4,614,984.00		
		REP OF AUSTRIA 4.350% 2019/03/15	4,260,000	4,945,860.00		
		REP OF AUSTRIA 3.900% 2020/07/15	4,410,000	5,023,431.00		
		REP OF AUSTRIA 3.500% 2021/09/15	5,490,000	6,129,585.00		
		REP OF AUSTRIA 3.650% 2022/04/20	2,300,000	2,593,020.00		
		REP OF AUSTRIA 3.400% 2022/11/22	1,120,000	1,231,664.00		
		REP OF AUSTRIA 4.850% 2026/03/15	3,580,000	4,506,862.00		
		REP OF AUSTRIA 6.250% 2027/07/15	2,440,000	3,506,280.00		
		REP OF AUSTRIA 4.150% 2037/03/15	4,450,000	5,449,025.00		
		国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T 4.200% 2013/07/30	2,450,000	2,459,800.00	
			SPANISH GOV'T 2.500% 2013/10/31	3,990,000	3,914,589.00	
	SPANISH GOV'T 4.250% 2014/01/31		4,840,000	4,844,356.00		
	SPANISH GOV'T 3.400% 2014/04/30		6,980,000	6,872,508.00		

		SPANISH GOV'T	4.750%	2014/07/30	5,220,000	5,257,584.00	
		SPANISH GOV'T	3.300%	2014/10/31	11,170,000	10,870,644.00	
		SPANISH GOV'T	4.400%	2015/01/31	7,420,000	7,385,868.00	
		SPANISH GOV'T	3.000%	2015/04/30	5,360,000	5,104,864.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2015/07/30	6,000,000	5,839,800.00	
		SPANISH GOV'T	3.150%	2016/01/31	9,820,000	9,187,592.00	
		SPANISH GOV'T	3.250%	2016/04/30	4,310,000	4,013,472.00	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2016/10/31	3,380,000	3,227,562.00	
		SPANISH GOV'T	3.800%	2017/01/31	7,790,000	7,252,490.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2017/07/30	7,140,000	7,115,010.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2018/07/30	6,420,000	5,887,782.00	
		SPANISH GOV'T	4.600%	2019/07/30	5,950,000	5,528,740.00	
		SPANISH GOV'T	4.300%	2019/10/31	4,550,000	4,125,485.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2020/04/30	8,910,000	7,854,165.00	
		SPANISH GOV'T	4.850%	2020/10/31	6,910,000	6,374,475.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2021/04/30	8,080,000	7,731,752.00	
		SPANISH GOV'T	5.850%	2022/01/31	760,000	742,064.00	
		SPANISH GOV'T	4.800%	2024/01/31	5,930,000	5,209,505.00	
		SPANISH GOV'T	4.650%	2025/07/30	5,950,000	5,031,320.00	
		SPANISH GOV'T	5.900%	2026/07/30	2,350,000	2,230,620.00	
		SPANISH GOV'T	6.000%	2029/01/31	5,660,000	5,365,114.00	
		SPANISH GOV'T	5.750%	2032/07/30	4,800,000	4,387,680.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2037/01/31	5,890,000	4,279,085.00	
		SPANISH GOV'T	4.900%	2040/07/30	4,880,000	3,865,936.00	
		SPANISH GOV'T	4.700%	2041/07/30	4,070,000	3,146,924.00	
		ユーロ 小計			1,444,910,000	1,543,849,163.50 (155,280,348,864)	
英ポンド	国債証券	TREASURY	2.250%	2014/03/07	8,870,000	9,176,813.30	
		TREASURY	5.000%	2014/09/07	10,490,000	11,597,639.10	
		TREASURY	2.750%	2015/01/22	11,290,000	11,992,576.70	
		TREASURY	4.750%	2015/09/07	9,990,000	11,388,300.30	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
英ポンド	国債証券	TREASURY	8.000%	2015/12/07	2,280,000	2,878,272.00
		TREASURY	2.000%	2016/01/22	6,210,000	6,531,802.20
		TREASURY	4.000%	2016/09/07	5,690,000	6,496,728.20
		TREASURY	1.750%	2017/01/22	9,820,000	10,276,826.40
		TREASURY	8.750%	2017/08/25	1,920,000	2,704,128.00

		TREASURY	1.000%	2017/09/07	2,000,000	2,012,580.00	
		TREASURY	5.000%	2018/03/07	7,020,000	8,622,244.80	
		TREASURY	4.500%	2019/03/07	6,340,000	7,751,474.20	
		TREASURY	3.750%	2019/09/07	8,480,000	9,984,097.60	
		TREASURY	4.750%	2020/03/07	4,620,000	5,799,208.80	
		TREASURY	3.750%	2020/09/07	8,920,000	10,546,205.20	
		TREASURY	8.000%	2021/06/07	5,970,000	9,248,724.00	
		TREASURY	3.750%	2021/09/07	8,140,000	9,662,505.60	
		TREASURY	4.000%	2022/03/07	5,100,000	6,185,535.00	
		TREASURY	5.000%	2025/03/07	5,580,000	7,467,044.40	
		TREASURY	4.250%	2027/12/07	5,500,000	6,909,595.00	
		TREASURY	6.000%	2028/12/07	3,500,000	5,285,140.00	
		TREASURY	4.750%	2030/12/07	5,280,000	7,046,952.00	
		TREASURY	4.250%	2032/06/07	7,370,000	9,242,422.20	
		TREASURY	4.500%	2034/09/07	3,350,000	4,329,305.50	
		TREASURY	4.250%	2036/03/07	8,570,000	10,681,305.20	
		TREASURY	4.750%	2038/12/07	5,360,000	7,209,253.60	
		TREASURY	4.250%	2039/09/07	5,920,000	7,370,459.20	
		TREASURY	4.250%	2040/12/07	6,050,000	7,526,018.50	
		TREASURY	4.500%	2042/12/07	4,870,000	6,342,882.80	
		TREASURY	4.250%	2046/12/07	6,450,000	8,114,293.50	
		TREASURY	4.250%	2049/12/07	7,220,000	9,091,279.60	
		TREASURY	3.750%	2052/07/22	3,090,000	3,539,904.00	
		TREASURY	4.250%	2055/12/07	6,220,000	7,966,638.20	
		TREASURY	4.000%	2060/01/22	2,550,000	3,136,576.50	
		英bond 小計			210,030,000	254,114,731.60 (31,459,403,772)	
スイス フラン	国債証券	SWISS (GOVT)	4.250%	2014/01/06	1,710,000	1,836,027.00	
		SWISS (GOVT)	2.500%	2016/03/12	2,490,000	2,735,514.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2017/06/05	2,250,000	2,729,925.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2018/01/08	2,260,000	2,628,606.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2019/05/12	2,110,000	2,505,836.00	
		SWISS (GOVT)	2.250%	2020/07/06	1,700,000	1,945,990.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2023/02/11	1,610,000	2,170,280.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2028/04/08	2,100,000	3,057,810.00	
		スイスフラン 小計			16,230,000	19,609,988.00 (1,642,336,495)	
スウェーデ ンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT	6.750%	2014/05/05	30,300,000	33,633,000.00	
		SWEDEN GOVT	4.500%	2015/08/12	22,390,000	24,857,378.00	

	SWEDEN GOVT	3.000%	2016/07/12	18,050,000	19,494,000.00	
	SWEDEN GOVT	3.750%	2017/08/12	21,370,000	24,259,224.00	
	SWEDEN GOVT	4.250%	2019/03/12	21,610,000	25,884,458.00	
	SWEDEN GOVT	5.000%	2020/12/01	21,200,000	27,430,680.00	
	SWEDEN GOVT	3.500%	2022/06/01	26,160,000	31,170,163.20	
	SWEDEN GOVT	3.500%	2039/03/30	15,440,000	20,859,440.00	
	スウェーデンクローナ 小計			176,520,000	207,588,343.20 (2,343,672,394)	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T	5.000%	2015/05/15	20,730,000	22,848,606.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	16,770,000	18,884,697.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	12,750,000	15,069,225.00	
		NORWEGIAN GOV'T	3.750%	2021/05/25	11,720,000	13,577,620.00	
	ノルウェークローネ 小計				61,970,000	70,380,148.00 (933,944,563)	
デンマーククローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	32,050,000	34,392,855.00	
		DENMARK - BULLET	2.000%	2014/11/15	12,170,000	12,755,377.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	33,170,000	37,555,074.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	20,930,000	24,822,980.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	34,880,000	42,710,560.00	
		DENMARK - BULLET	3.000%	2021/11/15	21,480,000	24,991,980.00	
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	9,980,000	16,264,206.40	
	DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	41,050,000	65,413,585.50		
デンマーククローネ 小計				205,710,000	258,906,617.90 (3,503,006,540)		
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/07/25	4,560,000	4,329,492.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	8,320,000	8,342,880.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2014/01/25	5,770,000	5,349,367.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,399,911.80	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	10,150,000	10,345,895.00	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	12,440,000	12,994,948.40	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2016/04/25	8,760,000	8,801,610.00	
		POLAND GOVT BOND	4.750%	2016/10/25	5,540,000	5,511,801.40	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	10,570,000	10,717,980.00	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	9,740,000	9,952,819.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	9,060,000	9,081,291.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2021/10/25	5,600,000	5,779,760.00	

		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	9,560,000	9,869,266.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,700,000	2,773,089.00	
		ポーランドズロチ 小計			114,960,000	116,250,110.60	(2,743,502,610)
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	3,060,000	3,200,454.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	5,150,000	5,533,314.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	3,850,000	4,035,647.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	6,190,000	6,854,744.10	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2015/10/21	2,270,000	2,442,565.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	4,250,000	4,631,650.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,920,000	6,845,414.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.250%	2017/07/21	1,480,000	1,600,501.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	3,740,000	4,297,260.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	6,630,000	7,659,904.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	6,760,000	7,544,633.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	5,040,000	6,144,264.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	4,280,000	5,279,808.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2023/04/21	3,060,000	3,721,419.00	
AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2027/04/21	1,350,000	1,565,122.50			
		オーストラリアドル 小計			63,030,000	71,356,701.90	(5,671,430,667)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOV'T	0.250%	2014/02/01	1,020,000	1,021,030.20	
		SINGAPORE GOV'T	2.750%	2042/04/01	680,000	697,387.60	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
シンガポールドル	国債証券	SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	2,360,000	2,410,716.40
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,257,573.40
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	990,000	1,016,195.40
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,510,000	1,627,991.40
		SPR GOV'T	1.125%	2016/04/01	780,000	802,854.00
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	1,660,000	1,891,819.00
		SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	1,510,000	1,641,566.30
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,390,000	1,660,869.30
		SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	990,000	1,084,505.40
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,330,000	1,523,475.10
		SPR GOV'T	2.250%	2021/06/01	1,120,000	1,198,736.00
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,310,000	1,493,662.00
		SPR GOV'T	3.000%	2024/09/01	1,150,000	1,288,264.50

		SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,490,000	1,744,179.10	
		SPR GOV'T	2.875%	2030/09/01	1,060,000	1,157,286.80	
		シンガポールドル 小計			22,460,000	24,518,111.90 (1,531,156,088)	
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.210%	2013/05/31	3,300,000	3,304,488.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	4,610,000	4,631,113.80	
		MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	10,180,000	10,562,869.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.434%	2014/08/15	2,280,000	2,297,784.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.741%	2015/02/27	5,790,000	5,885,361.30	
		MALAYSIAN GOV'T	3.835%	2015/08/12	5,630,000	5,747,385.50	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	8,060,000	8,407,224.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	3,530,000	3,616,732.10	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	9,470,000	9,894,729.50	
		MALAYSIAN GOV'T	3.580%	2018/09/28	4,010,000	4,057,839.30	
		MALAYSIAN GOV'T	4.378%	2019/11/29	9,560,000	10,109,126.40	
		MALAYSIAN GOV'T	4.160%	2021/07/15	4,610,000	4,826,531.70	
		MALAYSIAN GOV'T	3.418%	2022/08/15	920,000	912,998.80	
		MALAYSIAN GOV'T	4.392%	2026/04/15	3,910,000	4,149,761.20	
		MALAYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	1,680,000	1,603,912.80	
MALAYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	1,810,000	2,090,332.80			
		マレーシアリンギット 小計			79,350,000	82,098,191.80 (2,069,695,415)	
		国債証券 合計				389,716,117,446 (389,716,117,446)	
		合計				389,716,117,446 (389,716,117,446)	

(注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(注)	有価証券の合計金額 に対する比率
米ドル	192	100.0%	42.9%
カナダドル	33	100.0%	3.0%
メキシコペソ	21	100.0%	0.9%

ユーロ	245	100.0%	39.8%
英ポンド	34	100.0%	8.1%
スイスフラン	8	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	8	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	4	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	8	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	14	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	15	100.0%	1.5%
シンガポールドル	17	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	16	100.0%	0.5%
合計	615	100.0%	100.0%

（注）組入債券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する債券の比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「Jリートマザーファンド（M）」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	89,894,392
投資証券	13,979,674,620
未収入金	107,933,757
未収配当金	162,282,831
未収利息	177
流動資産合計	14,339,785,777
資産合計	14,339,785,777
負債の部	
流動負債	
未払金	6,085,016
未払解約金	59,185,757
流動負債合計	65,270,773
負債合計	65,270,773
純資産の部	
元本等	
元本	13,664,535,069
剰余金	
剰余金	609,979,935
純資産合計	14,274,515,004
負債・純資産合計	14,339,785,777

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成24年6月11日現在	
1. 計算日における受益権総数	13,664,535,069 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0446 円 (10,446 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、リートの価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。</p> <p>また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

（その他の注記）

1．元本の変動

平成24年6月11日現在

特定期間の期首元本額	16,550,749,788 円
特定期間中の追加設定元本額	2,103,817,270 円
特定期間中の一部解約元本額	4,990,031,989 円
計算日の元本額	13,664,535,069 円
計算日の元本額の内訳	
Ｊリートファンド	8,484,450,459 円
3資産バランスオープン	2,737,632,166 円
3資産バランスオープンアルファ	378,704,435 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	175,482,312 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	113,072,268 円
Ｊリートアクティブファンド（1年決算型）	1,775,193,429 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	823,603,001
合計	823,603,001

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「Ｊリートマザーファンド（Ｍ）」の期首から計算日までの期間（平成23年8月16日から平成24年6月11日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

平成24年6月11日現在

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (口)	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	856	423,720,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,022	317,331,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	578	225,131,000	
	産業ファンド投資法人	808	391,880,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	5,432	810,997,600	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	400	184,000,000	
	日本ビルファンド投資法人	2,827	1,984,554,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,553	1,733,487,000	
	日本リテールファンド投資法人	8,120	968,716,000	
	オリックス不動産投資法人	1,047	342,369,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	3,067	677,807,000	
	プレミア投資法人	875	252,525,000	
	東急リアル・エステート投資法人	717	264,573,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	389	187,692,500	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,223	516,717,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,761	798,449,800	
	森トラスト総合リート投資法人	1,067	670,076,000	
	フロンティア不動産投資法人	955	620,750,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	700	467,600,000	
	福岡リート投資法人	477	252,810,000	
	ケネディクス不動産投資法人	945	230,202,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	663	215,806,500	
	大和証券オフィス投資法人	1,149	217,161,000	
	阪急リート投資法人	272	93,840,000	
	トップリート投資法人	621	264,546,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	801	416,520,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,276	148,939,720		
ジャパンエクセレント投資法人	779	301,473,000		
	合計	55,380	13,979,674,620	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「海外リートマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年6月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	18,625,659
コール・ローン	12,562,178
投資証券	969,745,246
未収入金	424
未収配当金	1,294,970
未収利息	24
流動資産合計	1,002,228,501
資産合計	1,002,228,501
負債の部	
流動負債	
未払解約金	97,725
流動負債合計	97,725
負債合計	97,725
純資産の部	
元本等	
元本	1,779,657,313
剰余金	
欠損金	777,526,537
純資産合計	1,002,130,776
負債・純資産合計	1,002,228,501

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年6月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

3．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4．収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
5．その他	<p>外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成24年6月11日現在	
1．計算日における受益権総数	1,779,657,313 口
2．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	<p style="text-align: center;">元本の欠損</p> <p style="text-align: right;">777,526,537 円</p>
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p style="text-align: right;">0.5631 円</p> <p style="text-align: right;">(5,631 円)</p>

(金融商品に関する注記)

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年6月11日現在	
<p>1．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	

2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、リートの価格変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

3．金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年6月11日現在

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2．時価の算定方法

(1) 投資証券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年6月11日現在

該当事項はありません。

（その他の注記）

1．元本の変動

平成24年 6月11日現在	
特定期間の期首元本額	2,169,566,255 円
特定期間中の追加設定元本額	- 円
特定期間中の一部解約元本額	389,908,942 円
計算日の元本額	1,779,657,313 円
計算日の元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	1,214,367,746 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	348,151,049 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	217,138,518 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年 6月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	103,268,624
合計	103,268,624

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「海外リートマザーファンド」の期首から計算日まで
の期間（平成23年9月13日から平成24年6月11日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

平成24年 6月11日現在
計算日においてデリバティブ取引の残高がないため、該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年6月11日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	900	20,610.00	
		AGREE REALTY CORP	200	4,372.00	
		ALEXANDER'S INC	41	16,599.67	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,200	85,212.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	700	16,506.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,500	66,405.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2,400	65,208.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,400	11,872.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	800	12,520.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,900	269,154.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,100	57,102.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,000	315,600.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	2,800	32,172.00	
		BRE PROPERTIES INC	1,500	74,745.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,600	106,672.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	600	6,720.00	
		CAPLEASE INC	1,300	5,447.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,000	54,000.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,100	5,390.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	300	4,065.00	
		CHESAPEAK LODGING TRUST	600	10,770.00	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	1,800	39,150.00	
		COMMONWEALTH REIT	1,700	30,804.00	
		CORESITE REALTY CORP	400	9,848.00	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,400	31,584.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	2,100	15,456.00	
		CUBESMART	2,400	27,360.00	
		DCT INDUSTRIAL TRUST UNIT	4,900	29,743.00	
		DDR CORP	4,600	65,044.00	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3,300	33,165.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,100	151,704.00	
		DOUGLAS EMMETT INC	2,800	62,048.00	

	DUKE REALTY CORP	5,200	72,072.00	
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1,300	34,086.00	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	600	30,390.00	
	EDUCATION REALTY TRUST INC	1,800	19,998.00	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	900	38,475.00	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	800	54,736.00	
	EQUITY ONE INC	1,200	24,624.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	6,000	371,400.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	700	107,163.00	
	EXCEL TRUST INC	600	6,924.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,900	55,062.00	
	FED REALTY INVS TRUST	1,300	129,961.00	
	FELCOR LODGING TRUST INC	2,600	11,206.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	1,700	20,655.00	
		FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1,000	12,330.00	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,400	14,280.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	11,700	200,421.00	
		GETTY REALTY CORP	500	8,250.00	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	200	3,242.00	
		GLIMCHER REALTY TRUST	2,300	21,712.00	
		GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	700	15,330.00	
		HCP INC	8,200	342,022.00	
		HEALTH CARE REIT INC	4,200	235,032.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,600	35,968.00	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,100	16,430.00	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,400	46,172.00	
		HOME PROPERTIES INC	1,000	60,990.00	
		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	2,500	58,450.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	14,100	216,294.00	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	300	4,899.00	
		INLAND REAL ESTATE CORP	1,500	12,810.00	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,700	12,733.00	
		KILROY REALTY CORP	1,400	65,366.00	
		KIMCO REALTY CORP	8,100	149,445.00	
		KITE REALTY GROUP TRUST	1,300	6,565.00	
		LASALLE HOTEL PROPERTIES	1,700	46,121.00	

LEXINGTON REALTY TRUST	2,700	22,464.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,300	81,650.00	
LTC PROPERTIES INC	600	19,692.00	
MACERICH CO	2,600	148,902.00	
MACK-CALI REALTY CORP	1,700	47,600.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,700	24,786.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	800	53,544.00	
MISSION WEST PROPERTIES	500	4,505.00	
MONMOUTH REIT -CL A	900	9,450.00	
MPG OFFICE TRUST INC	900	1,656.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2,100	56,847.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	600	29,946.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,100	44,940.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	200	3,644.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	400	4,432.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,000	22,150.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,100	14,751.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3,400	56,440.00	
POST PROPERTIES INC	1,100	54,120.00	
PROLOGIS INC	9,100	290,017.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	400	27,072.00	
PUBLIC STORAGE INC	2,800	388,388.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	900	11,241.00	
REALTY INCOME CORP	2,700	107,163.00	
REGENCY CENTERS CORP	1,800	80,532.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	1,000	12,180.00	
RLJ LODGING TRUST	600	10,806.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	ROUSE PROPERTIES INC	400	5,120.00	
		SAUL CENTERS INC	200	8,664.00	
		SENIOR HOUSING PROP TRUST	3,200	66,880.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	6,100	918,721.00	
		SL GREEN REALTY CORP	1,700	128,554.00	
		SOVRAN SELF STORAGE INC	600	30,024.00	
		STAG INDUSTRIAL INC	300	4,170.00	
		STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	3,300	20,724.00	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	500	4,105.00	

	SUN COMMUNITIES INC	500	20,955.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	2,400	24,480.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1,800	56,718.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	1,200	89,400.00	
	TERRENO REALTY CORP	200	2,812.00	
	UDR INC	4,500	117,090.00	
	UMH PROPERTIES INC	400	4,156.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	300	11,904.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	500	9,645.00	
	VENTAS INC	5,800	338,082.00	
	VORNADO REALTY TRUST	3,700	305,768.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,300	36,972.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	2,400	60,912.00	
	WINTHROP REALTY TRUST	600	6,732.00	
	米ドル 小計	242,841	8,200,167.67 (652,733,346)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	500	14,150.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	900	14,319.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	500	29,925.00	
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	300	7,920.00	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	1,000	28,480.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	800	18,936.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	700	27,615.00	
	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	1,400	12,852.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	1,000	23,830.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	400	5,760.00	
	DUNDEE INTERNATIONAL REAL ES	700	6,811.00	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	800	29,232.00	
	EXTENDICARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	800	6,384.00	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1,700	40,579.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	900	4,275.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	600	9,798.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	300	9,855.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	300	3,942.00	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	800	18,248.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,700	71,820.00	
	TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	600	8,484.00	

カナダドル 小計		17,700	393,215.00 (30,647,177)	
ユーロ	AEDIFICA	140	6,920.20	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,210	9,861.50	
		ALTAREA	36	3,672.00	
		ANF IMMOBILIER	227	7,679.41	
		BEFIMMO S.C.A.	294	13,650.42	
		BENI STABILI SPA	16,388	5,916.06	
		BGP HOLDINGS PLC	900,544	0.00	
		COFINIMMO	303	26,012.55	
		CORIO NV	1,865	62,664.00	
		EUROBANK PROPERTIES REAL EST	461	1,290.80	
		EUROCOMMERCIAL-CVA	712	18,654.40	
		FONCIERE DES REGIONS	778	41,210.66	
		GECINA SA	521	36,714.87	
		HAMBORNER REIT AG	680	4,736.20	
		ICADE	456	29,252.40	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,765	1,859.46	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	126	2,411.64	
		KLEPIERRE	1,856	47,448.64	
		MERCIALYS	897	13,194.87	
		NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	1,061	7,119.31	
		SILIC	170	13,566.00	
		STE DE LA TOUR EIFFEL	114	4,161.00	
		UNIBAIL	1,820	249,795.00	
		VASTNED RETAIL NV	369	11,553.39	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	188	7,369.60		
	WERELDHAVE NV	432	21,440.16		
	ユーロ 小計		934,413	648,154.54 (65,191,383)	
	英債券	ユーロ	BIG YELLOW GROUP PLC	2,286	6,512.81
BRITISH LAND CO PLC			17,717	86,529.82	
CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC			11,919	37,282.63	
DERWENT LONDON PLC			1,631	29,015.49	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC			6,232	23,444.78	
HAMMERSON PLC			14,179	58,913.74	

	HANSTEEN HOLDINGS PLC	12,702	9,405.83	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	15,498	111,120.66	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY P	10,878	12,313.89	
	METRIC PROPERTY INVESTMENT P	3,787	3,408.30	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,361	4,276.94	
	SEGRO PLC	14,782	32,032.59	
	SHAFTESBURY PLC	4,993	25,439.33	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,124	4,741.83	
	英bond 小計	120,089	444,438.64 (55,021,503)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	5,805	11,029.50	
	ALE PROPERTY GROUP	3,020	6,553.40	
	ASPEN GROUP	11,812	5,197.28	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1,493	4,120.68	
	AUSTRALAND PROPERTY GROUP	4,682	11,751.82	
	BWP TRUST	7,889	14,910.21	
	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	26,721	53,174.79	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	46,799	88,450.11	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	8,677	4,989.27	
		CHARTER HALL GROUP	4,804	11,049.20	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	4,920	16,482.00	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	48,822	48,333.78	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	17,679	12,375.30	
		DEXUS PROPERTY GROUP	96,445	89,693.85	
		GOODMAN GROUP	27,319	93,704.17	
		GPT GROUP	33,258	107,423.34	
		INVESTA OFFICE FUND	13,241	35,618.29	
		MIRVAC GROUP	68,069	84,405.56	
		STOCKLAND	46,168	149,122.64	
		WESTFIELD GROUP	42,201	401,753.52	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	55,995	154,546.20	
		オーストラリアドル 小計	575,819	1,404,684.91 (111,644,356)	
ニュージーランドドル	DNZ PROPERTY FUND LTD	4,914	7,125.30		
	GOODMAN PROPERTY TRUST	17,726	17,991.89		
	KIWI INCOME PROP	19,384	20,643.96		

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	5,712	6,854.40	
	ニュージーランドドル 小計	47,736	52,615.55 (3,251,640)	
香港ドル	CHAMPION REIT	52,000	161,720.00	
	FORTUNE REIT	23,000	100,510.00	
	LINK REIT	45,000	1,413,000.00	
	PROSPERITY REIT	22,000	36,740.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	34,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	24,000	59,040.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,000	48,720.00	
	香港ドル 小計	200,000	1,853,730.00 (19,019,269)	
シンガポール ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	8,000	9,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	34,000	69,020.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	12,000	12,420.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	11,000	11,330.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	24,000	12,720.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	40,000	47,200.00	
	CAPITAMALL TRUST	55,000	99,000.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	8,000	10,040.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	13,000	23,400.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	10,000	8,700.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	10,000	16,350.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	10,000	9,200.00	
	K-REIT ASIA	14,000	13,580.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	26,000	9,620.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	21,000	19,635.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	20,000	23,100.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	29,000	28,130.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,000	12,635.00	
SAIZEN REIT	25,000	3,450.00		

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	シンガポール ドル	STARHILL GLOBAL REIT	28,000	17,220.00	
		SUNTEC REIT	44,000	56,760.00	
		シンガポールドル 小計	449,000	512,510.00 (32,006,249)	

イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	1,553	11,164.51	
イスラエルシェケル 小計		1,553	11,164.51 (230,323)	
投資証券 合計		2,589,151	969,745,246 (969,745,246)	
合計			969,745,246 (969,745,246)	

(注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	118	100.0%	67.3%
カナダドル	21	100.0%	3.2%
ユーロ	26	100.0%	6.7%
英ポンド	14	100.0%	5.7%
オーストラリアドル	21	100.0%	11.5%
ニュージーランドドル	4	100.0%	0.3%
香港ドル	7	100.0%	2.0%
シンガポールドル	21	100.0%	3.3%
イスラエルシェケル	1	100.0%	0.0%
合計	233	100.0%	100.0%

(注) 組入投資証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資証券の比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年6月29日

資産総額	1,110,295,977 円
負債総額	2,329,328 円
純資産総額（ - ）	1,107,966,649 円
発行済口数	1,844,047,451 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6008 円
1万口当たり純資産額	6,008 円

<参考>

マザーファンドの現況（平成24年6月29日）

純資産額計算書

（日本株式マザーファンド）

資産総額	248,474,443,663 円
負債総額	3,420,685,617 円
純資産総額（ - ）	245,053,758,046 円
発行済口数	346,916,861,591 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7064 円
1万口当たり純資産額	7,064 円

（日本債券マザーファンド）

資産総額	358,371,401,080 円
負債総額	4,296,258,361 円
純資産総額（ - ）	354,075,142,719 円
発行済口数	291,383,343,344 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2152 円
1万口当たり純資産額	12,152 円

（外国株式マザーファンド）

資産総額	252,206,213,894 円
負債総額	317,595,063 円
純資産総額（ - ）	251,888,618,831 円
発行済口数	270,870,300,770 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9299 円
1万口当たり純資産額	9,299 円

（外国債券マザーファンド）

資産総額	393,687,552,819 円
負債総額	321,329,218 円
純資産総額（ - ）	393,366,223,601 円
発行済口数	261,072,645,784 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5067 円
1万口当たり純資産額	15,067 円

（Jリートマザーファンド（M））

資産総額	15,026,057,463 円
負債総額	101,084,640 円
純資産総額(-)	14,924,972,823 円
発行済口数	13,401,352,680 口
1口当たり純資産額(/)	1.1137 円
1万口当たり純資産額	11,137 円

(海外リートマザーファンド)

資産総額	901,159,233 円
負債総額	298,157 円
純資産総額(-)	900,861,076 円
発行済口数	1,587,972,308 口
1口当たり純資産額(/)	0.5673 円
1万口当たり純資産額	5,673 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換等

該当事項はありません。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限

該当事項はありません。

（4）振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

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

受益権の譲渡

- A．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- B．上記A．の申請のある場合には、上記A．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記A．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- C．上記A．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払

い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成24年6月29日現在）

資本金の額　：3億円

発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数　：3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成24年9月11日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年6月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	296	3,576,425
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	635
単位型公社債投資信託	0	0
合計	301	3,577,060

3【委託会社等の経理状況】

- (イ) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(2)【損益計算書】

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
一般管理費合計	1,985,197	1,919,541
営業利益	848,907	585,991
(単位：千円)		
営業外収益		
受取配当金	1,280	2,795
受取利息	1 14,783	13,889
投資有価証券売却益	756	149
その他	1,877	2,125
営業外収益合計	18,697	18,961
営業外費用		
支払手数料	-	800
投資有価証券売却損	480	12
その他	242	74
営業外費用合計	722	887
経常利益	866,883	604,065
特別利益		
投資有価証券売却益	-	1,277,804
特別利益合計	-	1,277,804
特別損失		
資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額	6,776	-
統合関連損失	-	123,726
特別損失合計	6,776	123,726
税引前当期純利益	860,106	1,758,142
法人税、住民税及び事業税	377,534	241,760
法人税等調整額	29,183	368,903
法人税等合計	348,350	610,664
当期純利益	511,755	1,147,477

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

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

(単位：千円)

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

1. 耐用年数の変更

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

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

2. 資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
-------	---------	---------	---------	--------

普通株式（株）	6,000	-	-	6,000
---------	-------	---	---	-------

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数

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

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

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

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

(1) 配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 前事業年度（平成23年3月31日）において保有する非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がな

く、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、

「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

未収委託者報酬	944,716	-	-	-
---------	---------	---	---	---

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

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

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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

			有価証券届出書（内国投資信託受益証券）	
繰延税金資産 合計	130,169	"	159,817	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額			398,925	"
繰延税金負債 合計			398,925	"
繰延税金資産(負債)の純額	130,169	"	239,107	"

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

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

関連情報

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 木村 充男

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅則

印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

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

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

(2) 損益計算書

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

項目	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として10年～15年、器具備品については主として5年～20年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p> <p>(5) 移転関連費用引当金 移転関連費用引当金は、当社グループの東京地区拠点ビルの統廃合に伴うオフィス移転で発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

追加情報

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

1．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

2．役員賞与引当金

役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号 平成17年11月29日）を適用し、当事業年度より役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

1. 貸借対照表関係

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

2. 損益計算書関係

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

3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

4．リース取引関係

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

5．金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

6．有価証券関係

第25期 (平成23年3月31日)				第26期 (平成24年3月31日)			
1．その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの				1．その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949	その他	52,728	50,200	2,528
計	58,149	56,200	1,949	計	52,728	50,200	2,528
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの				貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	986	1,000	13	その他	986	1,000	13
計	986	1,000	13	計	986	1,000	13
2．当事業年度中に売却したその他有価証券				2．当事業年度中に売却したその他有価証券			
区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額	区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344	その他	7,151	153	2
計	128,650	67,194	344	計	7,151	153	2
3．時価評価されていない有価証券				3．時価評価されていない有価証券			
内容	貸借対照表計上額（千円）			内容	貸借対照表計上額（千円）		
その他有価証券 非上場株式	10,000			その他有価証券 非上場株式	10,000		
4．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。				4．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。			

7. デリバティブ関係

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

8. 退職給付関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <table data-bbox="145 685 735 763"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>18,693千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>18,693千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <table data-bbox="145 916 735 994"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	18,693千円	退職給付引当金	18,693千円	勤務費用	7,250千円	退職給付費用	7,250千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成24年3月31日現在）</p> <table data-bbox="796 685 1386 763"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>20,003千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>20,003千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）</p> <table data-bbox="796 916 1386 994"> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	20,003千円	退職給付引当金	20,003千円	勤務費用	7,090千円	退職給付費用	7,090千円
退職給付債務	18,693千円																
退職給付引当金	18,693千円																
勤務費用	7,250千円																
退職給付費用	7,250千円																
退職給付債務	20,003千円																
退職給付引当金	20,003千円																
勤務費用	7,090千円																
退職給付費用	7,090千円																

9. 税効果会計関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																																																																																										
<p>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</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">15,294千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">20,418千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">6,650千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">7,170千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">6,824千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">19,740千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">76,099千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">32,440千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">43,658千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">793千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">806千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">1,600千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">2.9%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.1%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.4%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">36.7%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	<hr/>		繰延税金資産小計	76,099千円	評価性引当額	32,440千円	<hr/>		繰延税金資産合計	43,658千円	その他有価証券評価差額金	793千円	その他	806千円	<hr/>		繰延税金負債合計	1,600千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	評価性引当額の減少	1.6%	住民税均等割	0.1%	その他	0.4%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%	<p>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</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">12,629千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">18,980千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,602千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">6,698千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">7,012千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">28,721千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">81,645千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">19,763千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">61,881千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">5.4%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">3.7%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">44.2%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	12,629千円	賞与引当金繰入超過額	18,980千円	資産除去債務	7,602千円	移転による除却予定資産減損	6,698千円	未払事業税	7,012千円	その他	28,721千円	<hr/>		繰延税金資産小計	81,645千円	評価性引当額	19,763千円	<hr/>		繰延税金資産合計	61,881千円	その他有価証券評価差額金	901千円	<hr/>		繰延税金負債合計	901千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%	評価性引当額の減少	3.7%	住民税均等割	0.2%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%
貸倒引当金繰入超過額	15,294千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	20,418千円																																																																																										
資産除去債務	6,650千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	7,170千円																																																																																										
未払事業税	6,824千円																																																																																										
その他	19,740千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	76,099千円																																																																																										
評価性引当額	32,440千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	43,658千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	793千円																																																																																										
その他	806千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	1,600千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%																																																																																										
評価性引当額の減少	1.6%																																																																																										
住民税均等割	0.1%																																																																																										
その他	0.4%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%																																																																																										
貸倒引当金繰入超過額	12,629千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	18,980千円																																																																																										
資産除去債務	7,602千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	6,698千円																																																																																										
未払事業税	7,012千円																																																																																										
その他	28,721千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	81,645千円																																																																																										
評価性引当額	19,763千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	61,881千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	901千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	901千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%																																																																																										
評価性引当額の減少	3.7%																																																																																										
住民税均等割	0.2%																																																																																										
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%																																																																																										

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

10. 資産除去債務関係

第25期
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	5,776千円
時の経過による調整額	79千円
見積りの変更による増加額	10,489千円
期末残高	<u>16,345千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

第26期
平成24年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	16,345千円
時の経過による調整額	80千円
見積りの変更による増加額	3,574千円
期末残高	<u>20,000千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、平成24年5月にオフィス移転することを決定したことから、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年4月1日から
平成23年3月31日まで)

(セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

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

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

12. 関連当事者との取引関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14. 重要な後発事象

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(企業結合)

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

(1) 企業結合の概要

結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

企業結合日

平成24年4月1日

企業結合の法的形式

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

結合後の企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社は、平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成24年9月11日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年3月末日現在）	事業の内容
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社四国銀行	25,000	
株式会社荘内銀行	7,000	
株式会社千葉興業銀行	57,941	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	
株式会社横浜銀行	215,628	
浜銀TT証券株式会社	3,307	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(参考) 再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成24年3月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から

再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託する
ため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成24年8月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているベスト・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成23年12月13日から平成24年6月11日までの特定期間の財務諸表、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、ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成24年6月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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